

【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】 2023年8月15日

【計算期間】 第22期（自 2022年5月17日 至 2023年5月15日）

【ファンド名】 日立国内株式インデックスファンド

【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】 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」（以下「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、国内株式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、5,000億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。

追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型

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

商品分類表

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

国内：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を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	ファミリー ファンド	あり ()	日経225
	年2回	日本			TOPIX
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 ()
	年6回 (隔月)	欧州			
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	日々	中南米			
	その他 ()	アフリカ			
資産複合 (株式、債券) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)			
		エマージング			

<属性区分表の定義>

その他資産（投資信託証券（株式一般））： 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大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのもの（目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものを、大型株といい、主として中小型株に投資する旨の記載があるものを、中小型株といいます。）を投資対象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。

日本： 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日本の資産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。

TOPIX： 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TOPIXで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。

当ファンドの運用にあたっては、T O P I X（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投資成果を追求します。

T O P I X（東証株価指数）は、株式会社J P X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。以下は、株式会社J P X総研の要請により記述するものです。

1. T O P I Xの指数値及びT O P I Xに係る標章又は商標は、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（以下「J P X」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T O P I Xに関するすべての権利・ノウハウ及びT O P I Xに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。
2. J P Xは、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又はT O P I Xに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
3. J P Xは、T O P I Xの指数値及びT O P I Xに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のT O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
4. J P Xは、T O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、T O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
5. 当ファンドは、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。
6. J P Xは、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
7. J P Xは、日立投資顧問株式会社又は当ファンドの購入者のニーズをT O P I Xの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
8. 以上の項目に限らず、J P Xは当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

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に委託します。
3. マザーファンドの運用にあたっては、主として国内株式に分散投資を行いT O P I X（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投資成果を追求します。

（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。

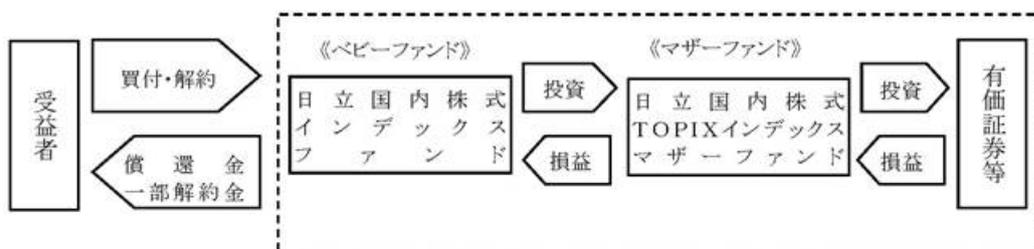
マザーファンド名	設定日
日立国内株式T O P I Xインデックスマザーファンド	2001年 6月22日

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

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



ファンドの関係法人

当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

当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（以下「運用再委託先」といいます。）に委託しております。

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、当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。

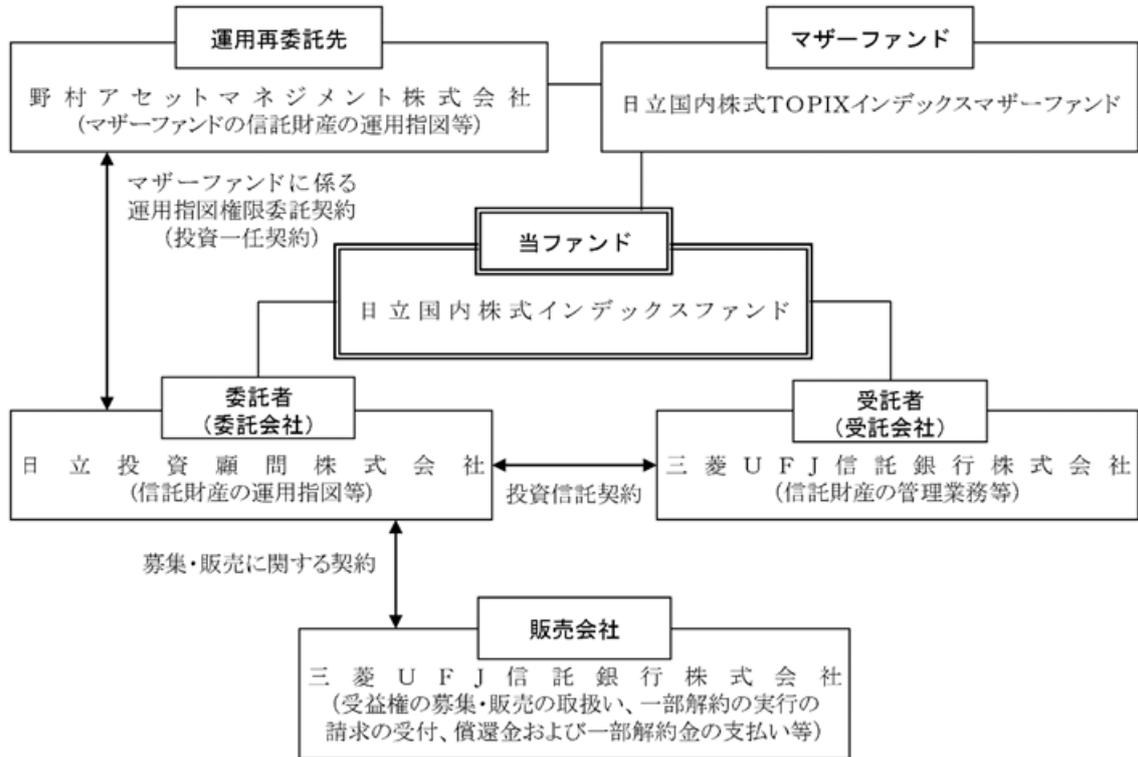
3. 販売会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

委託者との募集・販売に関する契約に基づき、当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

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。

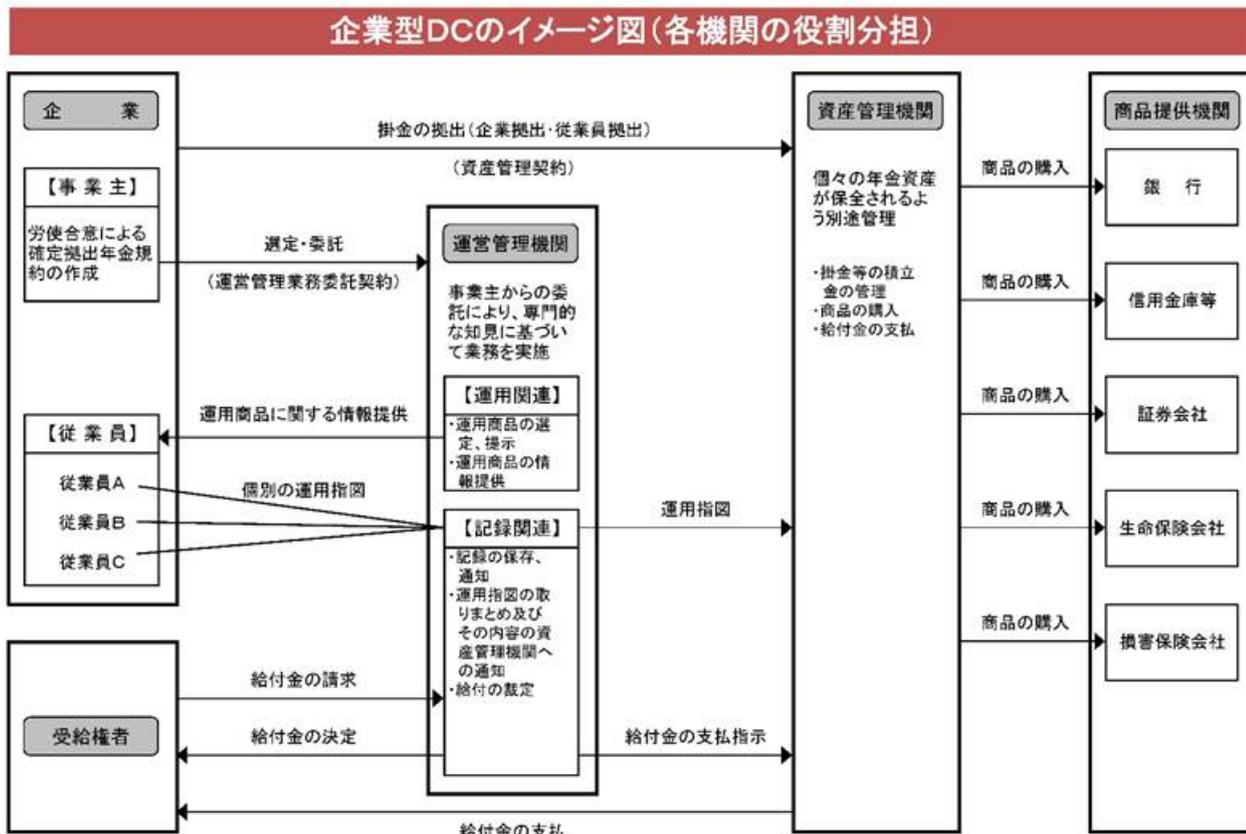
ファンドの関係法人図



（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いがい、資産管理機関が行うこととなります。また、確定拠出年金の加入者等は、確定拠出年金に係る規約等にしたいがい、個別の運用商品の配分の指図を運営管理機関に対して行います。

委託会社の概況（2023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】

次のマザーファンドに主として投資を行うことで、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

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。

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドが投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲

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

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

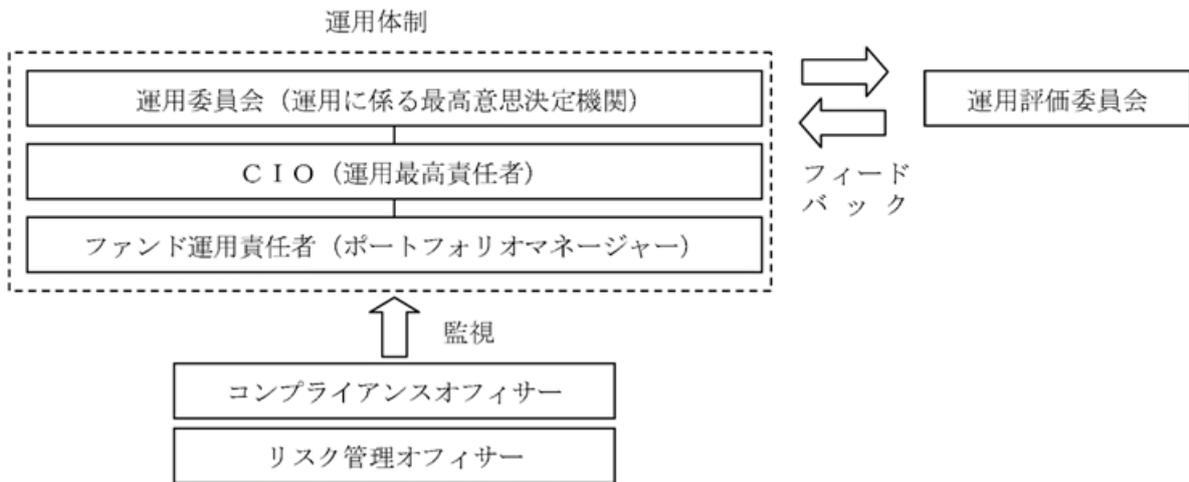
運用委員会は、当社の運用方針策定のための最高意思決定機関で、当ファンドに関する運用方針を策定します。2023年6月末現在10名程度出席。

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。2023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。2023年6月末現在8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。2023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。

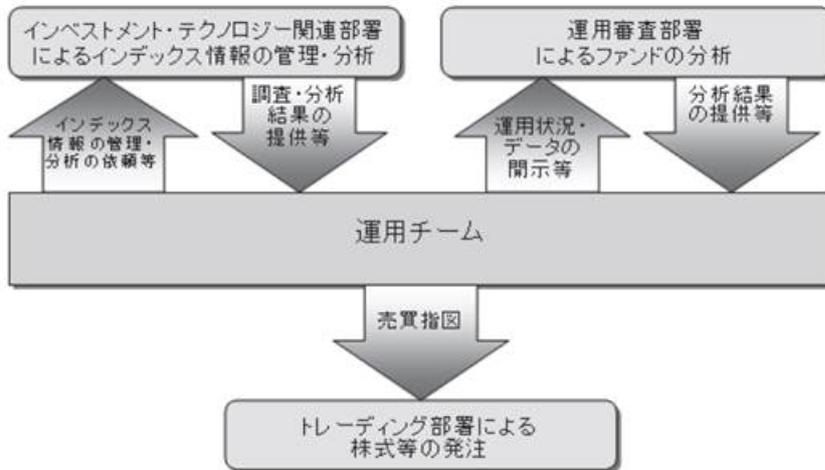
運用体制図



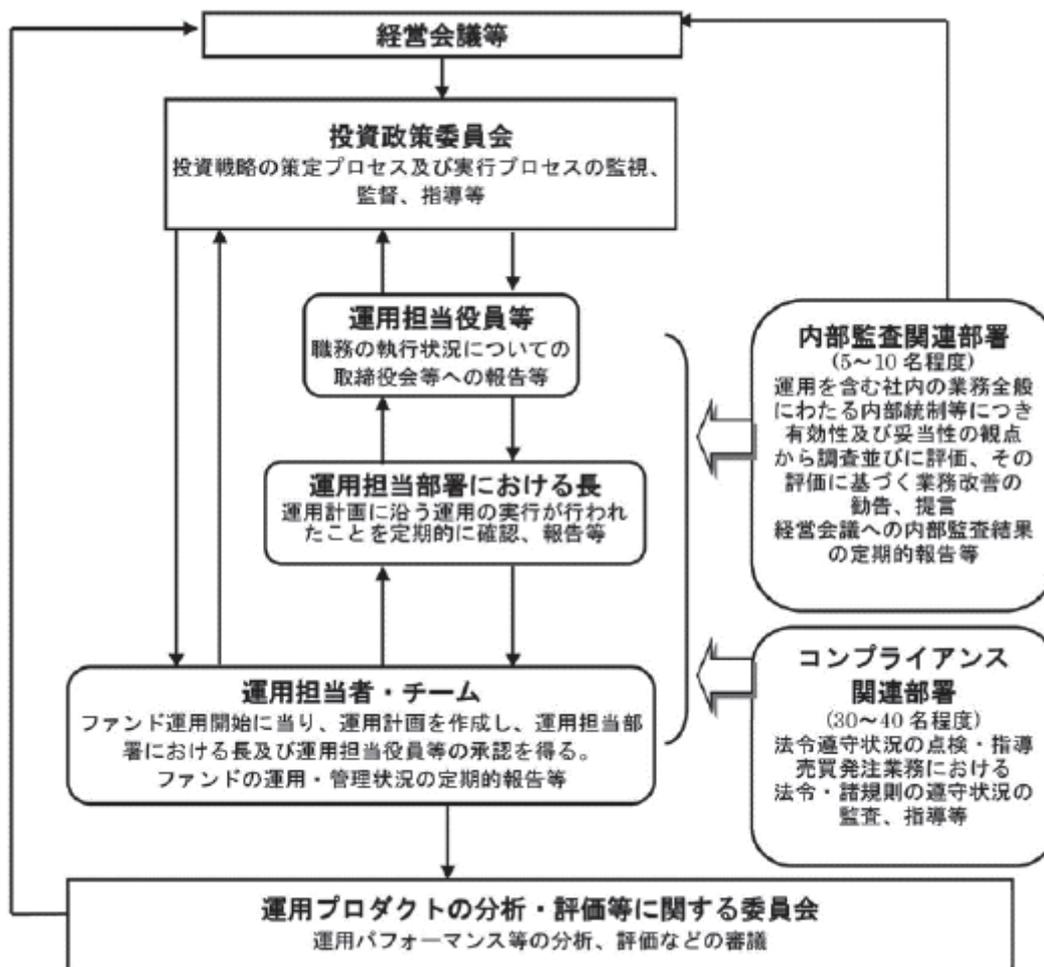
（ご参考）

「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

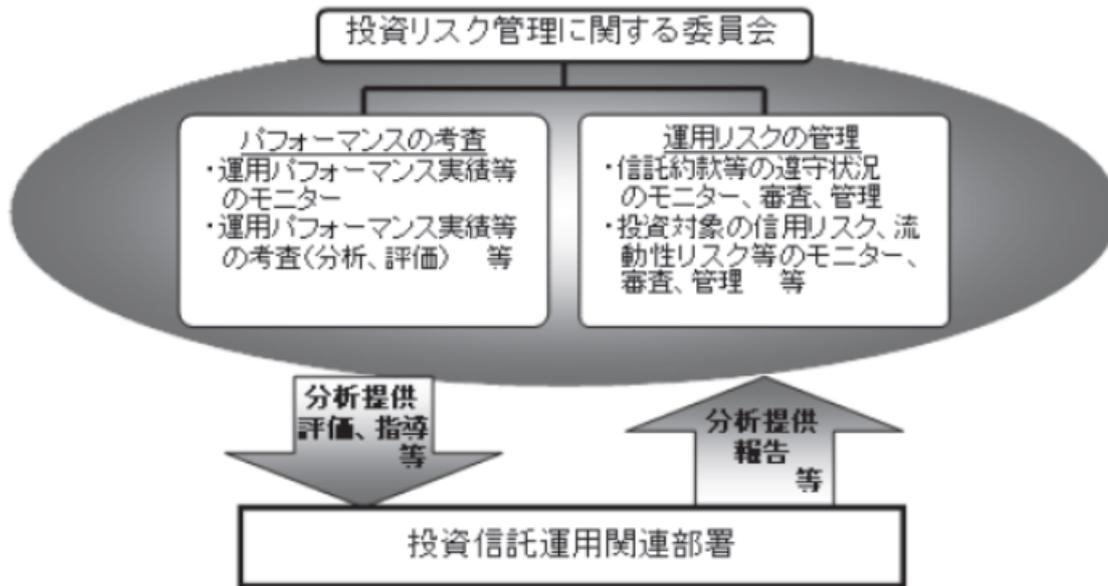
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2023年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



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。

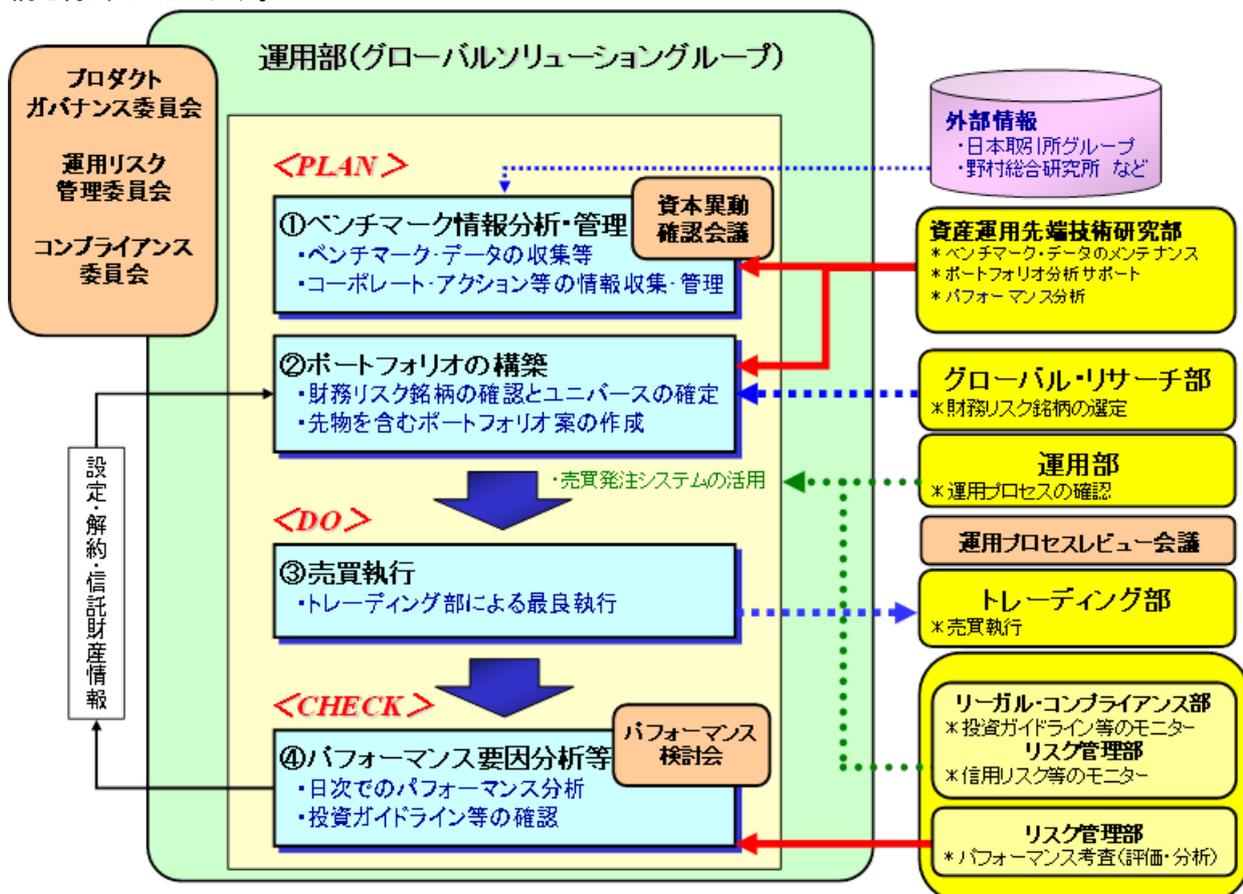


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



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。



（４）【分配方針】

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

（５）【投資制限】

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

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

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

委託者は、マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

２．株式への実質投資割合（運用の基本方針 ２．運用方法 (3)投資制限）

委託者は、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下同じ。）への実質投資割合については、制限を設けません。

「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。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 10．外貨建資産への投資制限（投資信託約款第26条）
- イ．委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額に対して100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- 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、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。）

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ベンチマークの動きへの連動を目指します。つまり、ベンチマーク上昇時には同程度の上昇を、ベンチマーク下落時には同程度の下落を目指して運用を行います。したがって、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。

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ファンドの資金動向、市況動向などによっては、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。

2023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）	5,320,339,412
	日立バランスファンド（株式50）	3,105,612,779
	日立バランスファンド（株式30）	704,581,507
	日立国内株式インデックスファンド	10,800,711,255
	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）	4,708,594,316
	合計	24,639,839,269

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。

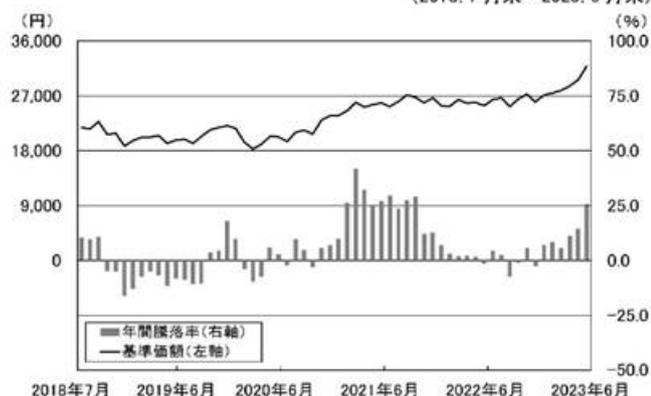
流動性リスクに対する管理体制

- ・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

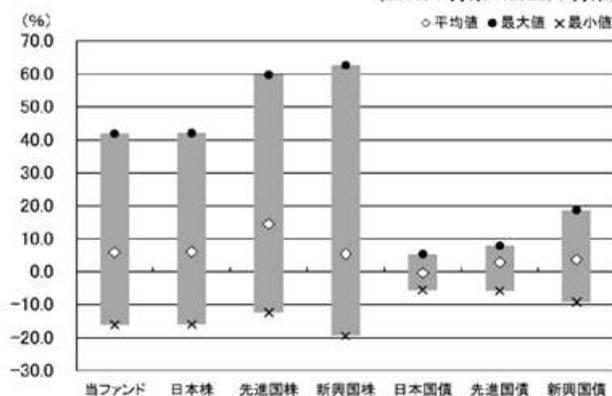
(2018.7月末～2023.6月末)



*年間騰落率は、2018年7月から2023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

(2018.7月末～2023.6月末)



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	5.9	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	3.8
最大値(%)	41.9	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.7
最小値(%)	△ 16.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 5.8	△ 9.1

*2018年7月から2023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:野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、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。

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0.055%	
年率0.154% （税抜0.14%）	委託会社	年率0.055%	委託した資金の運用の対価
	販売会社	年率0.045%	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】

組入る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運用再委託先が運用するマザーファンドの純資産総額に年0.02365%（税抜0.0215%）の率を乗じて得た額とします。

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

運用再委託先に支払う報酬の表示は、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額を含めたものです。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、2023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2023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。

（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	28,756,893,716	99.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		22,555,478	0.07
合計(純資産総額)		28,779,449,194	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	10,800,711,255	2.4592	26,561,109,119	2.6625	28,756,893,716	99.92

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

【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	64,389,174,750	98.14
新株予約権証券	日本	1,081,500	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,213,926,819	1.85
合計(純資産総額)		65,604,183,069	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	1,258,400,000	1.91

（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	1,081,400	1,881.36	2,034,508,669	2,308.50	2,496,411,900	3.80
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	139,300	11,995.69	1,671,000,775	12,965.00	1,806,024,500	2.75
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	19,700	64,477.51	1,270,207,000	67,850.00	1,336,645,000	2.03
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,214,700	848.83	1,031,081,001	1,065.00	1,293,655,500	1.97
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	6,327,300	158.53	1,003,123,405	170.50	1,078,804,650	1.64
6	日本	株式	三菱商事	卸売業	127,000	4,760.18	604,544,112	6,930.00	880,110,000	1.34
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	141,700	5,303.12	751,453,240	6,159.00	872,730,300	1.33
8	日本	株式	日立製作所	電気機器	96,700	7,259.94	702,036,469	8,896.00	860,243,200	1.31
9	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	41,700	16,070.73	670,149,543	20,560.00	857,352,000	1.30
10	日本	株式	任天堂	その他製品	124,300	5,139.71	638,866,932	6,542.00	813,170,600	1.23
11	日本	株式	三井物産	卸売業	147,900	4,122.38	609,700,662	5,411.00	800,286,900	1.21
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	174,800	4,351.76	760,689,330	4,527.00	791,319,600	1.20
13	日本	株式	第一三共	医薬品	172,100	4,820.46	829,602,650	4,550.00	783,055,000	1.19
14	日本	株式	信越化学工業	化学	164,000	4,275.69	701,213,556	4,768.00	781,952,000	1.19
15	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	128,400	4,308.37	553,195,285	5,687.00	730,210,800	1.11
16	日本	株式	HOYA	精密機器	41,700	14,565.86	607,396,362	17,075.00	712,027,500	1.08
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	160,100	3,515.22	562,787,734	4,341.00	694,994,100	1.05
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	23,700	23,674.97	561,096,789	29,265.00	693,580,500	1.05
19	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	149,900	3,655.37	547,940,546	4,563.00	683,993,700	1.04
20	日本	株式	KDDI	情報・通信業	152,600	4,095.38	624,955,918	4,450.00	679,070,000	1.03
21	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	97,400	5,189.17	505,425,216	6,773.00	659,690,200	1.00
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	191,700	2,551.85	489,191,531	3,315.00	635,485,500	0.96
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	280,500	1,879.81	527,287,119	2,199.00	616,819,500	0.94
24	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	107,100	4,533.46	485,534,581	5,601.00	599,867,100	0.91
25	日本	株式	S M C	機械	6,500	69,978.46	454,860,000	79,480.00	516,620,000	0.78
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	59,700	8,039.90	479,982,269	8,236.00	491,689,200	0.74
27	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	317,400	1,528.86	485,260,924	1,540.00	488,796,000	0.74
28	日本	株式	ファナック	電気機器	96,000	4,760.21	456,980,160	5,032.00	483,072,000	0.73
29	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	71,800	5,975.91	429,070,836	6,205.00	445,519,000	0.67
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	205,600	1,581.38	325,133,206	2,027.00	416,751,200	0.63

□.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	0.08
		鉱業	0.28
		建設業	1.96
		食料品	3.32
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.16
		化学	5.93
		医薬品	5.09
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.50
		機械	5.48
		電気機器	17.97
		輸送用機器	7.81
		精密機器	2.52
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.25
		陸運業	2.86
		海運業	0.53
		空運業	0.50
		倉庫・運輸関連業	0.13
		情報・通信業	8.08
		卸売業	6.72
		小売業	4.24
		銀行業	6.00
		証券、商品先物取引業	0.69
		保険業	2.24
その他金融業	1.11		
不動産業	1.76		
サービス業	4.75		
新株予約権証券			0.00
合計			98.14

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	55	日本円	1,201,594,825	1,258,400,000	1.91

（ 3 ）【運用実績】

【純資産の推移】

2023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）
13期 (2014年 5月15日)	12,124,075,712	12,124,075,712	1.3591	1.3591
14期 (2015年 5月15日)	16,716,166,505	16,716,166,505	1.8841	1.8841
15期 (2016年 5月16日)	14,356,061,239	14,356,061,239	1.5785	1.5785
16期 (2017年 5月15日)	16,285,104,177	16,285,104,177	1.9254	1.9254
17期 (2018年 5月15日)	19,621,182,862	19,621,182,862	2.2420	2.2420
18期 (2019年 5月15日)	18,524,843,778	18,524,843,778	1.9603	1.9603
19期 (2020年 5月15日)	17,887,589,700	17,887,589,700	1.8910	1.8910
20期 (2021年 5月17日)	22,079,816,481	22,079,816,481	2.4922	2.4922
21期 (2022年 5月16日)	22,714,168,098	22,714,168,098	2.5268	2.5268
22期 (2023年 5月15日)	26,341,560,638	26,341,560,638	2.9429	2.9429
2022年 6月末日	22,778,788,337		2.5404	
7月末日	23,519,986,548		2.6345	
8月末日	23,664,881,660		2.6660	
9月末日	22,517,335,749		2.5196	
10月末日	23,822,784,912		2.6476	
11月末日	24,311,297,572		2.7254	
12月末日	23,528,105,046		2.6006	
2023年 1月末日	24,658,806,337		2.7152	
2月末日	24,763,077,028		2.7406	
3月末日	25,224,274,538		2.7870	
4月末日	25,606,795,492		2.8619	
5月末日	26,529,487,477		2.9649	
6月末日	28,779,449,194		3.1881	

【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	
18期	
19期	
20期	
21期	
22期	

【収益率の推移】

期	収益率（％）
13期	4.27
14期	38.63
15期	16.22
16期	21.98
17期	16.44
18期	12.56
19期	3.54
20期	31.79
21期	1.39
22期	16.47

（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）
13期	4,594,545,517	3,856,306,837	8,920,787,518
14期	3,571,600,996	3,620,031,834	8,872,356,680
15期	3,772,488,354	3,549,852,243	9,094,992,791
16期	2,297,533,065	2,934,691,699	8,457,834,157
17期	2,715,814,176	2,422,059,323	8,751,589,010
18期	3,024,312,529	2,325,844,264	9,450,057,275
19期	3,402,472,379	3,393,209,501	9,459,320,153
20期	2,888,217,711	3,487,836,509	8,859,701,355
21期	2,874,672,281	2,745,195,449	8,989,178,187
22期	2,373,520,157	2,411,893,063	8,950,805,281

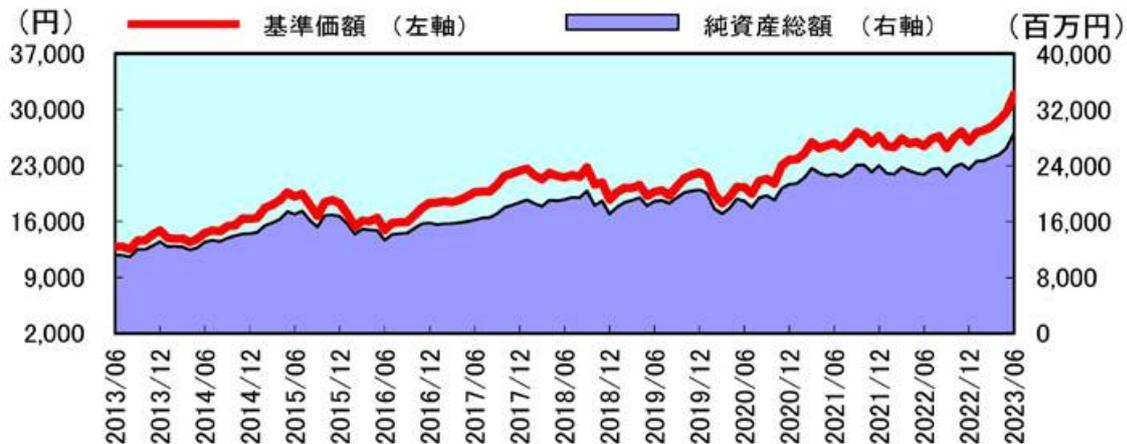
（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

（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（2023年6月末現在）

◆ 基準価額・純資産の推移（2013年6月末～2023年6月末）



◆ 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。

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

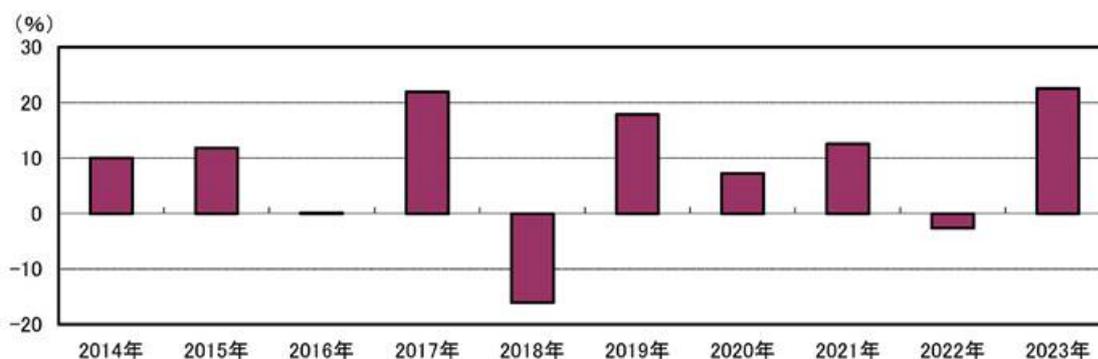
○ 組入上位10銘柄

銘柄名	業種	組入比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.8%
ソニーグループ	電気機器	2.8%
キーエンス	電気機器	2.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.0%
日本電信電話	情報・通信業	1.6%
三菱商事	卸売業	1.3%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.3%
日立製作所	電気機器	1.3%
東京エレクトロン	電気機器	1.3%
任天堂	その他製品	1.2%
合計		18.6%

○ 組入上位10業種

業種	組入比率
電気機器	18.0%
情報・通信業	8.1%
輸送用機器	7.8%
卸売業	6.7%
銀行業	6.0%
化学	5.9%
機械	5.5%
医薬品	5.1%
サービス業	4.8%
小売業	4.2%
合計	72.1%

◆ 年間収益率の推移



※2023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基準価額とします。申込みには申込手数料を要しません。受益権の申込単位は1円の整数倍です。なお、継続募集期間における基準価額は、毎営業日に計算されます。
- (4) 委託者は、信託財産の効率的な運用が妨げられると委託者が合理的に判断する場合、わが国および外国の証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情がある場合は、委託者の判断により、受益権の取得申込みの受付を停止することおよび既に受付けた取得申込みを取消することができます。

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

2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権について委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます（買取請求による換金は行いません。）。解約請求は、原則として毎営業日請求を受付けます。一部解約の受付は午後2時までとし、これらの受付時間を過ぎてからの一部解約の請求は翌営業日の取扱いとします。
- (2) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。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4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ます。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

信託契約の解約

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

信託契約に関する監督官庁の命令

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

委託者の登録取消等に伴う取扱い

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

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

受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

投資信託約款の変更

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

委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告によります。

運用報告書

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

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

(3) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

(4) 反対者の買取請求権

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

（ご参考）確定拠出年金の加入者等の権利

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」といいます。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」といいます。）に基づいて作成しております。
2. 財務諸表に記載している金額については、円単位で表示しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間（2022年5月17日から2023年5月15日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 【財務諸表】

【日立国内株式インデックスファンド】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2022年 5月16日現在	第22期 2023年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	69,612,930	78,611,299
親投資信託受益証券	22,688,561,788	26,312,856,001
流動資産合計	22,758,174,718	26,391,467,300
資産合計	22,758,174,718	26,391,467,300
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,207,413	31,215,684
未払受託者報酬	5,085,449	5,340,243
未払委託者報酬	12,713,568	13,350,514
未払利息	190	221
流動負債合計	44,006,620	49,906,662
負債合計	44,006,620	49,906,662
純資産の部		
元本等		
元本	8,989,178,187	8,950,805,281
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,724,989,911	17,390,755,357
元本等合計	22,714,168,098	26,341,560,638
純資産合計	22,714,168,098	26,341,560,638
負債純資産合計	22,758,174,718	26,391,467,300

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期		第22期	
	自	2021年 5月18日 至 2022年 5月16日	自	2022年 5月17日 至 2023年 5月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		337,039,542		3,822,094,213
営業収益合計		337,039,542		3,822,094,213
営業費用				
支払利息		62,892		53,136
受託者報酬		10,269,108		10,513,176
委託者報酬		25,672,658		26,282,769
その他費用		394		-
営業費用合計		36,005,052		36,849,081
営業利益又は営業損失()		301,034,490		3,785,245,132
経常利益又は経常損失()		301,034,490		3,785,245,132
当期純利益又は当期純損失()		301,034,490		3,785,245,132
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()		295,578,836		337,595,569
期首剰余金又は期首欠損金()		13,220,115,126		13,724,989,911
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,648,314,203		3,926,972,487
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		4,648,314,203		3,926,972,487
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,148,895,072		3,708,856,604
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		4,148,895,072		3,708,856,604
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()		13,724,989,911		17,390,755,357

(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2022年5月17日から2023年5月15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21期 2022年 5月16日現在	第22期 2023年 5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,989,178,187口	8,950,805,281口
1口当たり純資産額	2.5268円	2.9429円
(1万口当たり純資産額)	(25,268円)	(29,429円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日	第22期計算期間 自 2022年 5月17日 至 2023年 5月15日
1.運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に年10,000分の2.15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。	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22期計算期間	
	自 2022年 5月17日 至 2023年 5月15日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
3.金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。	
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価に関する事項

項目	第22期	
	2023年 5月15日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2.時価の算定方法	<p>親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第21期	第22期
	2022年 5月16日現在	2023年 5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	255,277,126	3,669,975,126
合計	255,277,126	3,669,975,126

（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21期計算期間	第22期計算期間
	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日	自 2022年 5月17日 至 2023年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,859,701,355円	8,989,178,187円
期中追加設定元本額	2,874,672,281円	2,373,520,157円
期中一部解約元本額	2,745,195,449円	2,411,893,063円

（４）【附属明細表】

（2023年 5月15日現在）

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	10,708,907,249	26,312,856,001	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：99.9%	10,708,907,249	26,312,856,001 100.0%	
合計				26,312,856,001	

(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」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）

	2022年 5月16日現在	2023年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	243,150,002	414,751,410
株式	53,365,087,440	60,104,347,780
派生商品評価勘定	4,734,060	73,092,965
未収入金	29,352,319	17,682,650
未収配当金	673,417,781	717,065,450
前払金	35,886,800	-
差入委託証拠金	47,250,000	43,725,000
流動資産合計	54,398,878,402	61,370,665,255
資産合計	54,398,878,402	61,370,665,255
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,145,610	-
前受金	-	61,459,200
未払金	18,610,300	26,182,328
未払解約金	-	28,000,000
未払利息	666	1,170
流動負債合計	60,756,576	115,642,698
負債合計	60,756,576	115,642,698
純資産の部		
元本等		
元本	25,798,453,032	24,929,905,972
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	28,539,668,794	36,325,116,585
元本等合計	54,338,121,826	61,255,022,557
純資産合計	54,338,121,826	61,255,022,557
負債純資産合計	54,398,878,402	61,370,665,255

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	2022年 5月16日現在	2023年 5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,798,453,032口	24,929,905,972口
1口当たり純資産額	2.1063円	2.4571円
(1万口当たり純資産額)	(21,063円)	(24,571円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年 5月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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	2023年 5月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2022年 5月16日現在	2023年 5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,314,743,420	3,165,851,055
合計	2,314,743,420	3,165,851,055

（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 2022年 5月17日 至 2023年 5月15日
1.取引の内容	投資信託の利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券先物取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額等の変動によるリスクを回避する目的で行いません。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で利用しております。
4.取引に係るリスクの内容	有価証券先物取引は株式等の相場変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5.取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(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

(2023年 5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,049,950,800	-	1,123,070,000	73,119,200
	東証株価指数先物	1,049,950,800	-	1,123,070,000	73,119,200
合計		1,049,950,800	-	1,123,070,000	73,119,200

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 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日	自 2022年 5月17日 至 2023年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	25,083,862,970円	25,798,453,032円
期中追加設定元本額	2,420,480,186円	1,521,662,936円
期中一部解約元本額	1,705,890,124円	2,390,209,996円
期末元本額	25,798,453,032円	24,929,905,972円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	5,553,243,453円	5,464,330,689円
日立バランスファンド（株式50）	3,480,888,375円	3,272,775,980円
日立バランスファンド（株式30）	809,695,216円	750,220,352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）	5,182,864,231円	4,733,671,702円
日立国内株式インデックスファンド	10,771,761,757円	10,708,907,249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

(2023年 5月15日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	極洋	1,100	3,675.00	4,042,500	
	ニッスイ	27,900	628.00	17,521,200	
	マルハニチロ	4,100	2,623.00	10,754,300	
	雪国まいたけ	2,400	994.00	2,385,600	
	カネコ種苗	900	1,597.00	1,437,300	
	サカタのタネ	3,200	4,060.00	12,992,000	
	ホクト	2,500	1,871.00	4,677,500	
	ホクリヨウ	300	841.00	252,300	
	住石ホールディングス	3,400	334.00	1,135,600	
	日鉄鉱業	1,100	3,715.00	4,086,500	
	三井松島ホールディングス	1,300	3,225.00	4,192,500	
	I N P E X	103,000	1,464.00	150,792,000	
	石油資源開発	3,200	4,360.00	13,952,000	
	K & O エナジーグループ	1,300	2,295.00	2,983,500	
	ショーバンドホールディングス	3,800	5,870.00	22,306,000	
	ミライト・ワン	9,200	1,729.00	15,906,800	
	タマホーム	1,800	3,930.00	7,074,000	
	サンヨーホームズ	300	718.00	215,400	
	日本アクア	900	879.00	791,100	
	ファーストコーポレーション	600	939.00	563,400	
	ベステラ	500	925.00	462,500	
	Robot Home	4,700	211.00	991,700	
	キャンディル	400	569.00	227,600	
	ダイセキ環境ソリューション	400	926.00	370,400	
	第一カッター興業	700	1,233.00	863,100	
	安藤・間	16,100	1,006.00	16,196,600	
	東急建設	7,900	751.00	5,932,900	
コムシスホールディングス	9,400	2,790.00	26,226,000		
ビーアールホールディングス	4,400	393.00	1,729,200		
高松コンストラクショングループ	1,800	2,384.00	4,291,200		
東建コーポレーション	800	7,840.00	6,272,000		
ソネック	200	985.00	197,000		

ヤマウラ	1,400	1,222.00	1,710,800	
オリエンタル白石	10,000	320.00	3,200,000	
大成建設	18,200	4,830.00	87,906,000	
大林組	69,700	1,129.00	78,691,300	
清水建設	58,600	858.00	50,278,800	
飛島建設	2,200	1,160.00	2,552,000	
長谷工コーポレーション	20,100	1,677.00	33,707,700	
松井建設	1,800	723.00	1,301,400	
銭高組	200	3,250.00	650,000	
鹿島建設	43,200	1,886.00	81,475,200	
不動テトラ	1,300	1,829.00	2,377,700	
大末建設	600	1,301.00	780,600	
鉄建建設	1,400	2,043.00	2,860,200	
西松建設	3,300	3,400.00	11,220,000	
三井住友建設	15,700	384.00	6,028,800	
大豊建設	800	3,850.00	3,080,000	
佐田建設	1,000	468.00	468,000	
ナカノフドー建設	1,100	406.00	446,600	
奥村組	3,200	3,730.00	11,936,000	
東鉄工業	2,700	2,720.00	7,344,000	
イチケン	300	1,960.00	588,000	
富士ピー・エス	700	447.00	312,900	
浅沼組	1,600	3,195.00	5,112,000	
戸田建設	24,000	826.00	19,824,000	
熊谷組	3,300	2,925.00	9,652,500	
北野建設	300	2,997.00	899,100	
植木組	400	1,345.00	538,000	
矢作建設工業	2,700	1,054.00	2,845,800	
ピーエス三菱	2,500	694.00	1,735,000	
日本ハウスホールディングス	3,900	394.00	1,536,600	
新日本建設	2,700	1,124.00	3,034,800	
東亜道路工業	800	4,210.00	3,368,000	
日本道路	400	8,130.00	3,252,000	
東亜建設工業	1,700	3,340.00	5,678,000	
日本国土開発	5,800	629.00	3,648,200	
若築建設	900	3,900.00	3,510,000	
東洋建設	6,300	988.00	6,224,400	
五洋建設	27,600	750.00	20,700,000	
世紀東急工業	2,500	1,282.00	3,205,000	

福田組	700	4,835.00	3,384,500
住友林業	15,000	3,065.00	45,975,000
日本基礎技術	900	545.00	490,500
巴コーポレーション	1,700	453.00	770,100
大和ハウス工業	54,500	3,539.00	192,875,500
ライト工業	3,600	2,002.00	7,207,200
積水ハウス	61,100	2,850.50	174,165,550
日特建設	1,900	1,002.00	1,903,800
北陸電気工事	1,300	890.00	1,157,000
ユアテック	4,300	866.00	3,723,800
日本リーテック	1,700	1,356.00	2,305,200
四電工	800	1,980.00	1,584,000
中電工	3,000	2,269.00	6,807,000
関電工	10,700	1,082.00	11,577,400
きんでん	13,700	1,895.00	25,961,500
東京エネシス	1,900	966.00	1,835,400
トーエネック	600	3,660.00	2,196,000
住友電設	1,900	2,984.00	5,669,600
日本電設工業	3,200	1,970.00	6,304,000
エクシオグループ	9,000	2,673.00	24,057,000
新日本空調	1,100	2,169.00	2,385,900
九電工	4,700	3,635.00	17,084,500
三機工業	4,300	1,518.00	6,527,400
日揮ホールディングス	19,300	1,668.00	32,192,400
中外炉工業	600	1,908.00	1,144,800
ヤマト	1,300	958.00	1,245,400
太平電業	1,200	4,245.00	5,094,000
高砂熱学工業	4,700	2,386.00	11,214,200
三晃金属工業	200	3,950.00	790,000
朝日工業社	800	2,393.00	1,914,400
明星工業	3,400	912.00	3,100,800
大気社	2,200	3,815.00	8,393,000
ダイダン	1,300	2,565.00	3,334,500
日比谷総合設備	1,700	2,323.00	3,949,100
フィル・カンパニー	300	880.00	264,000
テスホールディングス	2,100	1,157.00	2,429,700
インフロニア・ホールディングス	20,400	1,257.00	25,642,800
レイズネクスト	2,800	1,467.00	4,107,600
ニッポン	5,300	1,828.00	9,688,400

日清製粉グループ本社	18,100	1,765.00	31,946,500
日東富士製粉	300	4,685.00	1,405,500
昭和産業	1,700	2,646.00	4,498,200
鳥越製粉	1,200	630.00	756,000
中部飼料	2,700	1,092.00	2,948,400
フィード・ワン	2,900	758.00	2,198,200
東洋精糖	300	1,258.00	377,400
日本甜菜製糖	1,100	1,814.00	1,995,400
DM三井製糖ホールディングス	1,900	2,365.00	4,493,500
塩水港精糖	1,800	202.00	363,600
ウェルネオシュガー	1,000	1,961.00	1,961,000
森永製菓	3,600	4,455.00	16,038,000
中村屋	500	3,165.00	1,582,500
江崎グリコ	5,600	3,690.00	20,664,000
名糖産業	800	1,632.00	1,305,600
井村屋グループ	1,100	2,314.00	2,545,400
不二家	1,300	2,519.00	3,274,700
山崎製パン	13,100	1,994.00	26,121,400
第一屋製パン	300	400.00	120,000
モロゾフ	600	3,800.00	2,280,000
亀田製菓	1,200	4,370.00	5,244,000
寿スピリッツ	2,100	10,130.00	21,273,000
カルビー	9,000	2,853.00	25,677,000
森永乳業	3,600	5,330.00	19,188,000
六甲バター	1,400	1,443.00	2,020,200
ヤクルト本社	14,000	9,930.00	139,020,000
明治ホールディングス	24,300	3,315.00	80,554,500
雪印メグミルク	4,700	2,015.00	9,470,500
プリマハム	2,600	2,318.00	6,026,800
日本ハム	7,700	3,900.00	30,030,000
林兼産業	500	501.00	250,500
丸大食品	2,000	1,527.00	3,054,000
S Foods	2,200	3,190.00	7,018,000
柿安本店	800	2,268.00	1,814,400
伊藤ハム米久ホールディングス	14,900	743.00	11,070,700
サッポロホールディングス	6,400	3,955.00	25,312,000
アサヒグループホールディングス	45,200	5,535.00	250,182,000
キリンホールディングス	88,300	2,169.50	191,566,850
宝ホールディングス	13,400	1,065.00	14,271,000

オエノンホールディングス	5,800	326.00	1,890,800	
養命酒製造	600	1,878.00	1,126,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホール デ	15,300	1,551.00	23,730,300	
サントリー食品インターナショナル	13,800	5,320.00	73,416,000	
ダイドーグループホールディングス	1,100	5,140.00	5,654,000	
伊藤園	6,600	4,190.00	27,654,000	
キーコーヒー	2,200	2,104.00	4,628,800	
ユニカフェ	500	911.00	455,500	
ジャパンフーズ	200	1,104.00	220,800	
日清オイリオグループ	2,800	3,500.00	9,800,000	
不二製油グループ本社	4,600	2,080.00	9,568,000	
かどや製油	200	3,520.00	704,000	
J・オイルミルズ	2,000	1,608.00	3,216,000	
キッコーマン	13,000	7,980.00	103,740,000	
味の素	47,200	5,094.00	240,436,800	
ブルドックソース	1,000	2,074.00	2,074,000	
キューピー	10,500	2,357.00	24,748,500	
ハウス食品グループ本社	6,000	3,215.00	19,290,000	
カゴメ	9,100	3,420.00	31,122,000	
焼津水産化学工業	600	845.00	507,000	
アリアケジャパン	1,700	4,985.00	8,474,500	
ピエトロ	200	1,828.00	365,600	
エバラ食品工業	500	3,095.00	1,547,500	
やまみ	100	1,451.00	145,100	
ニチレイ	9,000	3,075.00	27,675,000	
東洋水産	9,900	5,840.00	57,816,000	
イトアンドホールディングス	800	2,268.00	1,814,400	
大冷	200	1,922.00	384,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,200	910.00	1,092,000	
日清食品ホールディングス	6,900	12,410.00	85,629,000	
永谷園ホールディングス	1,000	2,236.00	2,236,000	
一正蒲鉾	700	785.00	549,500	
フジッコ	2,000	1,937.00	3,874,000	
ロック・フィールド	2,200	1,510.00	3,322,000	
日本たばこ産業	128,800	3,032.00	390,521,600	
ケンコーマヨネーズ	1,300	1,260.00	1,638,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,400	2,330.00	3,262,000	
なとり	1,200	1,969.00	2,362,800	

イフジ産業	300	1,080.00	324,000	
ファーマフーズ	2,800	1,818.00	5,090,400	
ユーグレナ	12,600	892.00	11,239,200	
紀文食品	1,500	1,051.00	1,576,500	
ピクルスホールディングス	1,100	1,203.00	1,323,300	
ミヨシ油脂	500	1,000.00	500,000	
理研ビタミン	1,700	2,075.00	3,527,500	
片倉工業	1,800	1,810.00	3,258,000	
グンゼ	1,400	4,595.00	6,433,000	
東洋紡	8,600	1,022.00	8,789,200	
ユニチカ	6,000	210.00	1,260,000	
富士紡ホールディングス	800	3,140.00	2,512,000	
倉敷紡績	1,500	2,361.00	3,541,500	
シキボウ	900	1,003.00	902,700	
日本毛織	5,200	1,036.00	5,387,200	
ダイトウボウ	2,500	91.00	227,500	
トーア紡コーポレーション	600	363.00	217,800	
ダイドーリミテッド	2,200	302.00	664,400	
帝国繊維	2,200	1,723.00	3,790,600	
帝人	19,100	1,442.00	27,542,200	
東レ	133,400	758.60	101,197,240	
住江織物	300	2,360.00	708,000	
日本フェルト	900	419.00	377,100	
イチカワ	200	1,370.00	274,000	
日東製網	200	1,428.00	285,600	
アツギ	900	425.00	382,500	
ダイニック	400	750.00	300,000	
セーレン	3,800	2,286.00	8,686,800	
ソトー	500	810.00	405,000	
東海染工	200	1,217.00	243,400	
小松マテーレ	2,900	687.00	1,992,300	
ワコールホールディングス	3,800	2,941.00	11,175,800	
ホギメディカル	2,700	3,440.00	9,288,000	
クラウディアホールディングス	400	554.00	221,600	
T S Iホールディングス	6,700	715.00	4,790,500	
マツオカコーポレーション	400	1,173.00	469,200	
ワールド	2,600	1,582.00	4,113,200	
三陽商会	600	1,662.00	997,200	
ナイガイ	500	267.00	133,500	

オンワードホールディングス	12,900	398.00	5,134,200	
ルックホールディングス	400	2,437.00	974,800	
ゴールドウイン	3,500	12,630.00	44,205,000	
デサント	3,400	4,275.00	14,535,000	
キング	700	595.00	416,500	
ヤマトインターナショナル	1,200	281.00	337,200	
特種東海製紙	900	2,999.00	2,699,100	
王子ホールディングス	82,900	538.00	44,600,200	
日本製紙	10,400	1,100.00	11,440,000	
三菱製紙	1,900	470.00	893,000	
北越コーポレーション	12,600	905.00	11,403,000	
中越パルプ工業	600	1,118.00	670,800	
巴川製紙所	500	659.00	329,500	
大王製紙	8,800	1,029.00	9,055,200	
阿波製紙	400	551.00	220,400	
レンゴー	18,100	897.00	16,235,700	
トモク	1,100	1,930.00	2,123,000	
ザ・パック	1,500	3,185.00	4,777,500	
北の達人コーポレーション	8,400	291.00	2,444,400	
クラレ	31,600	1,294.00	40,890,400	
旭化成	124,300	961.60	119,526,880	
共和レザー	900	545.00	490,500	
レゾナック・ホールディングス	19,200	2,182.00	41,894,400	
住友化学	147,700	451.00	66,612,700	
住友精化	800	4,110.00	3,288,000	
日産化学	9,400	6,210.00	58,374,000	
ラサ工業	800	2,194.00	1,755,200	
クレハ	1,700	8,600.00	14,620,000	
多木化学	800	4,425.00	3,540,000	
テイカ	1,300	1,244.00	1,617,200	
石原産業	3,600	1,272.00	4,579,200	
片倉コープアグリ	300	1,393.00	417,900	
日本曹達	2,100	4,660.00	9,786,000	
東ソー	26,600	1,685.00	44,821,000	
トクヤマ	6,400	2,163.00	13,843,200	
セントラル硝子	3,200	2,939.00	9,404,800	
東亜合成	10,000	1,246.00	12,460,000	
大阪ソーダ	1,200	3,920.00	4,704,000	
関東電化工業	3,800	1,013.00	3,849,400	

デンカ	7,200	2,674.00	19,252,800
信越化学工業	165,500	3,960.00	655,380,000
日本カーバイド工業	600	1,328.00	796,800
堺化学工業	1,500	1,832.00	2,748,000
第一稀元素化学工業	1,800	904.00	1,627,200
エア・ウォーター	18,800	1,852.00	34,817,600
日本酸素ホールディングス	19,300	2,792.00	53,885,600
日本化学工業	700	1,793.00	1,255,100
東邦アセチレン	300	1,314.00	394,200
日本パーカライズン	9,900	1,075.00	10,642,500
高圧ガス工業	2,900	772.00	2,238,800
チタン工業	200	1,442.00	288,400
四国化成ホールディングス	2,400	1,436.00	3,446,400
戸田工業	500	2,400.00	1,200,000
ステラ ケミファ	1,200	2,772.00	3,326,400
保土谷化学工業	600	3,235.00	1,941,000
日本触媒	3,000	5,240.00	15,720,000
大日精化工業	1,400	1,889.00	2,644,600
カネカ	4,500	3,845.00	17,302,500
三菱瓦斯化学	14,900	1,951.00	29,069,900
三井化学	16,400	3,510.00	57,564,000
J S R	18,600	3,020.00	56,172,000
東京応化工業	3,500	7,110.00	24,885,000
大阪有機化学工業	1,500	2,142.00	3,213,000
三菱ケミカルグループ	134,300	800.00	107,440,000
K Hネオケム	3,300	2,312.00	7,629,600
ダイセル	29,300	1,136.00	33,284,800
住友ベークライト	2,900	5,200.00	15,080,000
積水化学工業	40,700	1,924.00	78,306,800
日本ゼオン	11,900	1,490.00	17,731,000
アイカ工業	5,000	3,025.00	15,125,000
U B E	10,300	2,239.00	23,061,700
積水樹脂	2,900	2,156.00	6,252,400
タキロンシーアイ	4,300	529.00	2,274,700
旭有機材	1,300	3,235.00	4,205,500
ニチバン	1,200	1,946.00	2,335,200
リケンテクノス	4,300	614.00	2,640,200
大倉工業	900	2,100.00	1,890,000
積水化成成品工業	2,800	433.00	1,212,400

群栄化学工業	500	2,664.00	1,332,000
タイガースポリマー	700	527.00	368,900
ミライアル	500	1,484.00	742,000
ダイキアクシス	600	728.00	436,800
ダイキョーニシカワ	4,400	734.00	3,229,600
竹本容器	500	795.00	397,500
森六ホールディングス	1,000	1,943.00	1,943,000
恵和	1,300	1,055.00	1,371,500
日本化薬	15,200	1,264.00	19,212,800
カーリットホールディングス	1,800	706.00	1,270,800
日本精化	1,100	2,508.00	2,758,800
扶桑化学工業	1,800	3,475.00	6,255,000
トリケミカル研究所	2,700	2,214.00	5,977,800
A D E K A	6,900	2,378.00	16,408,200
日油	6,200	6,330.00	39,246,000
新日本理化	2,100	223.00	468,300
ハリマ化成グループ	1,100	858.00	943,800
花王	48,500	5,261.00	255,158,500
第一工業製薬	700	1,902.00	1,331,400
石原ケミカル	900	1,608.00	1,447,200
日華化学	600	844.00	506,400
ニイタカ	300	2,210.00	663,000
三洋化成工業	1,200	4,150.00	4,980,000
有機合成薬品工業	1,100	290.00	319,000
大日本塗料	2,400	914.00	2,193,600
日本ペイントホールディングス	88,100	1,249.00	110,036,900
関西ペイント	18,200	2,127.00	38,711,400
神東塗料	1,300	139.00	180,700
中国塗料	3,300	1,118.00	3,689,400
日本特殊塗料	1,000	1,039.00	1,039,000
藤倉化成	2,700	428.00	1,155,600
太陽ホールディングス	3,000	2,593.00	7,779,000
D I C	7,800	2,487.00	19,398,600
サカタインクス	4,400	1,179.00	5,187,600
東洋インキ S C ホールディングス	3,900	2,156.00	8,408,400
T & K T O K A	1,800	1,183.00	2,129,400
富士フイルムホールディングス	38,200	7,779.00	297,157,800
資生堂	41,600	6,901.00	287,081,600
ライオン	23,900	1,411.00	33,722,900

高砂香料工業	1,300	2,622.00	3,408,600	
マンダム	4,300	1,640.00	7,052,000	
ミルボン	3,000	5,670.00	17,010,000	
ファンケル	8,700	2,351.00	20,453,700	
コーセー	4,100	15,440.00	63,304,000	
コタ	1,800	1,672.00	3,009,600	
シーボン	200	1,607.00	321,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	10,200	2,065.00	21,063,000	
ノエビアホールディングス	1,800	5,400.00	9,720,000	
アジュバンホールディングス	400	925.00	370,000	
新日本製薬	1,100	1,398.00	1,537,800	
アクシージア	1,000	1,206.00	1,206,000	
エステー	1,500	1,596.00	2,394,000	
アグロ カネショウ	800	1,798.00	1,438,400	
コニシ	3,300	2,223.00	7,335,900	
長谷川香料	3,800	3,190.00	12,122,000	
星光PMC	800	555.00	444,000	
小林製薬	5,800	8,310.00	48,198,000	
荒川化学工業	1,700	998.00	1,696,600	
メック	1,600	2,670.00	4,272,000	
日本高純度化学	500	2,511.00	1,255,500	
タカラバイオ	5,400	1,632.00	8,812,800	
JCU	2,200	3,300.00	7,260,000	
新田ゼラチン	1,000	767.00	767,000	
OATアグリオ	600	1,731.00	1,038,600	
デクセリアルズ	5,800	2,618.00	15,184,400	
アース製薬	1,800	5,140.00	9,252,000	
北興化学工業	2,000	896.00	1,792,000	
大成ラミック	600	3,020.00	1,812,000	
クミアイ化学工業	7,900	915.00	7,228,500	
日本農薬	3,700	660.00	2,442,000	
アキレス	1,300	1,452.00	1,887,600	
有沢製作所	3,200	1,090.00	3,488,000	
日東電工	14,500	9,390.00	136,155,000	
レック	2,800	867.00	2,427,600	
三光合成	2,500	533.00	1,332,500	
きもと	2,300	182.00	418,600	
藤森工業	1,600	3,245.00	5,192,000	
前澤化成工業	1,300	1,620.00	2,106,000	

未来工業	700	2,351.00	1,645,700
ウェーブロックホールディングス	500	589.00	294,500
J S P	1,400	1,626.00	2,276,400
エフピコ	3,800	3,115.00	11,837,000
天馬	1,700	2,395.00	4,071,500
信越ポリマー	3,700	1,351.00	4,998,700
東リ	3,500	302.00	1,057,000
ニフコ	7,200	3,875.00	27,900,000
バルカー	1,700	3,470.00	5,899,000
ユニ・チャーム	41,500	5,445.00	225,967,500
ショーエイコーポレーション	400	562.00	224,800
協和キリン	24,100	2,705.00	65,190,500
武田薬品工業	176,400	4,490.00	792,036,000
アステラス製薬	188,300	2,176.00	409,740,800
住友ファーマ	14,800	804.00	11,899,200
塩野義製薬	25,100	6,220.00	156,122,000
わかもと製薬	1,400	249.00	348,600
日本新薬	4,700	6,200.00	29,140,000
中外製薬	62,400	3,613.00	225,451,200
科研製薬	3,400	3,690.00	12,546,000
エーザイ	24,200	8,194.00	198,294,800
ロート製薬	19,300	3,020.00	58,286,000
小野薬品工業	38,400	2,574.00	98,841,600
久光製薬	4,400	3,785.00	16,654,000
持田製薬	2,300	3,590.00	8,257,000
参天製薬	36,300	1,233.00	44,757,900
扶桑薬品工業	600	2,050.00	1,230,000
日本ケミファ	200	1,818.00	363,600
ツムラ	6,300	2,750.00	17,325,000
キッセイ薬品工業	3,100	2,923.00	9,061,300
生化学工業	3,800	795.00	3,021,000
栄研化学	3,200	1,567.00	5,014,400
鳥居薬品	1,100	3,530.00	3,883,000
J C R ファーマ	6,700	1,150.00	7,705,000
東和薬品	3,100	1,905.00	5,905,500
富士製薬工業	1,500	1,163.00	1,744,500
ゼリア新薬工業	2,800	2,525.00	7,070,000
そーせいグループ	6,800	2,820.00	19,176,000
第一三共	173,600	4,676.00	811,753,600

杏林製薬	4,300	1,744.00	7,499,200	
大幸薬品	3,600	390.00	1,404,000	
ダイト	1,400	2,536.00	3,550,400	
大塚ホールディングス	45,600	4,877.00	222,391,200	
大正製薬ホールディングス	4,400	5,570.00	24,508,000	
ペプチドリーム	9,700	1,804.00	17,498,800	
あすか製薬ホールディングス	2,000	1,276.00	2,552,000	
サワイグループホールディングス	4,600	3,705.00	17,043,000	
日本コークス工業	18,000	97.00	1,746,000	
ニチレキ	2,400	1,752.00	4,204,800	
ユシロ化学工業	1,000	1,000.00	1,000,000	
ピーピー・カストロール	600	908.00	544,800	
富士石油	4,100	257.00	1,053,700	
MORESCO	500	1,144.00	572,000	
出光興産	22,100	2,805.00	61,990,500	
ENEOSホールディングス	338,100	485.00	163,978,500	
コスモエネルギーホールディングス	7,900	4,135.00	32,666,500	
横浜ゴム	11,300	2,984.00	33,719,200	
TOYO TIRE	11,500	1,668.00	19,182,000	
ブリヂストン	63,600	5,635.00	358,386,000	
住友ゴム工業	19,500	1,299.00	25,330,500	
藤倉コンポジット	1,100	872.00	959,200	
オカモト	1,100	4,065.00	4,471,500	
フコク	1,000	1,078.00	1,078,000	
ニッタ	2,000	3,030.00	6,060,000	
住友理工	3,900	772.00	3,010,800	
三ツ星ベルト	2,900	4,010.00	11,629,000	
バンドー化学	3,200	1,251.00	4,003,200	
日東紡績	2,200	1,834.00	4,034,800	
AGC	20,300	5,010.00	101,703,000	
日本板硝子	10,200	688.00	7,017,600	
石塚硝子	200	1,561.00	312,200	
日本山村硝子	600	754.00	452,400	
日本電気硝子	8,100	2,508.00	20,314,800	
オハラ	900	1,164.00	1,047,600	
住友大阪セメント	2,800	3,565.00	9,982,000	
太平洋セメント	12,700	2,473.00	31,407,100	
日本ヒューム	1,700	737.00	1,252,900	
日本コンクリート工業	3,900	266.00	1,037,400	

三谷セキサン	800	4,730.00	3,784,000	
アジアパイルホールディングス	3,100	643.00	1,993,300	
東海カーボン	16,700	1,283.00	21,426,100	
日本カーボン	1,100	4,395.00	4,834,500	
東洋炭素	1,200	4,690.00	5,628,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	4,845.00	4,845,000	
TOTO	13,200	4,665.00	61,578,000	
日本碍子	23,200	1,730.00	40,136,000	
日本特殊陶業	15,200	2,561.00	38,927,200	
ダントーホールディングス	1,100	627.00	689,700	
MARUWA	700	17,760.00	12,432,000	
品川リフラクトリーズ	600	5,110.00	3,066,000	
黒崎播磨	400	6,760.00	2,704,000	
ヨータイ	1,300	1,498.00	1,947,400	
東京窯業	1,400	362.00	506,800	
ニッカトー	700	618.00	432,600	
フジインコーポレーテッド	1,600	8,210.00	13,136,000	
クニミネ工業	500	935.00	467,500	
エーアンドエーマテリアル	300	1,054.00	316,200	
ニチアス	5,000	2,819.00	14,095,000	
ニチハ	2,500	2,946.00	7,365,000	
日本製鉄	91,800	2,859.00	262,456,200	
神戸製鋼所	41,200	1,144.00	47,132,800	
中山製鋼所	4,200	831.00	3,490,200	
合同製鐵	1,000	3,130.00	3,130,000	
JFEホールディングス	54,800	1,785.00	97,818,000	
東京製鐵	5,800	1,328.00	7,702,400	
共英製鋼	2,300	1,829.00	4,206,700	
大和工業	3,400	5,550.00	18,870,000	
東京鐵鋼	1,000	2,518.00	2,518,000	
大阪製鐵	900	1,322.00	1,189,800	
淀川製鋼所	2,300	2,930.00	6,739,000	
中部鋼鈹	1,700	2,018.00	3,430,600	
丸一鋼管	6,200	3,180.00	19,716,000	
モリ工業	400	3,245.00	1,298,000	
大同特殊鋼	2,600	5,260.00	13,676,000	
日本高周波鋼業	500	341.00	170,500	
日本冶金工業	1,500	4,285.00	6,427,500	
山陽特殊製鋼	2,000	2,659.00	5,318,000	

愛知製鋼	1,200	2,747.00	3,296,400	
日本金属	300	925.00	277,500	
大平洋金属	1,500	1,660.00	2,490,000	
新日本電工	13,100	300.00	3,930,000	
栗本鐵工所	1,000	2,014.00	2,014,000	
虹技	200	1,178.00	235,600	
日本鑄鉄管	200	1,075.00	215,000	
三菱製鋼	1,300	1,191.00	1,548,300	
日亜鋼業	1,600	311.00	497,600	
日本精線	300	4,470.00	1,341,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,100	569.00	625,900	
シンニッタン	1,700	257.00	436,900	
新家工業	300	2,204.00	661,200	
大紀アルミニウム工業所	2,900	1,356.00	3,932,400	
日本軽金属ホールディングス	5,500	1,427.00	7,848,500	
三井金属鉱業	6,000	3,140.00	18,840,000	
東邦亜鉛	1,200	1,780.00	2,136,000	
三菱マテリアル	13,700	2,390.00	32,743,000	
住友金属鉱山	23,800	4,429.00	105,410,200	
DOWAホールディングス	4,600	4,350.00	20,010,000	
古河機械金属	3,000	1,390.00	4,170,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,000	3,230.00	9,690,000	
東邦チタニウム	3,700	1,811.00	6,700,700	
UACJ	2,900	2,749.00	7,972,100	
CKサンエツ	500	4,185.00	2,092,500	
古河電気工業	6,800	2,501.00	17,006,800	
住友電気工業	70,800	1,691.00	119,722,800	
フジクラ	22,000	949.00	20,878,000	
SWCC	2,300	1,853.00	4,261,900	
タツタ電線	4,200	715.00	3,003,000	
カナレ電気	200	1,347.00	269,400	
平河ヒューテック	1,200	1,359.00	1,630,800	
リョービ	2,200	1,542.00	3,392,400	
アーレスティ	1,800	584.00	1,051,200	
アサヒホールディングス	8,300	2,009.00	16,674,700	
稲葉製作所	1,100	1,493.00	1,642,300	
宮地エンジニアリンググループ	600	3,950.00	2,370,000	
トーカロ	5,600	1,342.00	7,515,200	
アルファC o	600	1,120.00	672,000	

SUMCO	39,000	1,850.00	72,150,000
川田テクノロジーズ	500	4,250.00	2,125,000
RS Technologies	1,400	2,891.00	4,047,400
ジェイテックコーポレーション	200	2,379.00	475,800
信和	900	729.00	656,100
東洋製罐グループホールディングス	13,600	2,158.00	29,348,800
ホッカシホールディングス	1,100	1,417.00	1,558,700
コロナ	1,100	923.00	1,015,300
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,258.00	5,870,800
駒井ハルテック	300	1,769.00	530,700
高田機工	100	2,849.00	284,900
三和ホールディングス	18,900	1,543.00	29,162,700
文化シャッター	5,900	1,154.00	6,808,600
三協立山	2,300	692.00	1,591,600
アルインコ	1,600	993.00	1,588,800
東洋シャッター	400	555.00	222,000
LIXIL	29,900	2,005.00	59,949,500
日本フィルコン	1,000	479.00	479,000
ノーリツ	3,000	1,829.00	5,487,000
長府製作所	2,100	2,435.00	5,113,500
リンナイ	11,200	3,340.00	37,408,000
ダイニチ工業	800	725.00	580,000
日東精工	3,000	607.00	1,821,000
三洋工業	200	1,924.00	384,800
岡部	3,300	791.00	2,610,300
ジーテクト	2,300	1,405.00	3,231,500
東プレ	3,600	1,458.00	5,248,800
高周波熱錬	3,200	876.00	2,803,200
東京製綱	1,200	1,109.00	1,330,800
サンコール	1,400	519.00	726,600
モリテック スチール	1,200	280.00	336,000
パイオラックス	2,800	1,956.00	5,476,800
エイチワン	2,100	687.00	1,442,700
日本発條	18,100	1,000.00	18,100,000
中央発條	1,500	712.00	1,068,000
アドバネクス	200	1,064.00	212,800
立川ブラインド工業	900	1,269.00	1,142,100
三益半導体工業	1,600	2,673.00	4,276,800
日本ドライケミカル	400	1,757.00	702,800

日本製鋼所	5,500	2,465.00	13,557,500	
三浦工業	8,400	4,100.00	34,440,000	
タクマ	6,200	1,421.00	8,810,200	
ツガミ	4,500	1,349.00	6,070,500	
オークマ	2,000	6,190.00	12,380,000	
芝浦機械	2,000	3,170.00	6,340,000	
アマダ	32,000	1,331.00	42,592,000	
アイダエンジニアリング	4,100	895.00	3,669,500	
TAKISAWA	400	1,290.00	516,000	
FUJI	8,700	2,377.00	20,679,900	
牧野フライス製作所	2,200	4,885.00	10,747,000	
オーエスジー	9,600	1,960.00	18,816,000	
ダイジェット工業	200	880.00	176,000	
旭ダイヤモンド工業	5,600	941.00	5,269,600	
DMG森精機	12,200	2,203.00	26,876,600	
ソディック	5,500	731.00	4,020,500	
ディスコ	9,700	17,270.00	167,519,000	
日東工器	1,000	2,101.00	2,101,000	
日進工具	1,700	1,118.00	1,900,600	
パンチ工業	1,400	451.00	631,400	
富士ダイス	700	700.00	490,000	
豊和工業	800	827.00	661,600	
東洋機械金属	1,100	664.00	730,400	
津田駒工業	300	486.00	145,800	
エンシュウ	300	705.00	211,500	
島精機製作所	3,200	1,782.00	5,702,400	
オptron	3,000	2,190.00	6,570,000	
NCホールディングス	300	2,000.00	600,000	
イワキポンプ	1,300	1,307.00	1,699,100	
フリー	2,100	1,098.00	2,305,800	
ヤマシンフィルタ	4,800	338.00	1,622,400	
日阪製作所	1,900	941.00	1,787,900	
やまびこ	3,300	1,413.00	4,662,900	
野村マイクロ・サイエンス	700	4,310.00	3,017,000	
平田機工	1,000	6,220.00	6,220,000	
PEGASUS	2,200	593.00	1,304,600	
マルマエ	900	1,579.00	1,421,100	
タツモ	1,100	1,739.00	1,912,900	
ナブテスコ	12,600	3,175.00	40,005,000	

三井海洋開発	2,500	1,387.00	3,467,500
レオン自動機	2,100	1,299.00	2,727,900
S M C	6,500	71,450.00	464,425,000
ホソカワミクロン	1,400	2,979.00	4,170,600
ユニオンツール	900	3,225.00	2,902,500
オイレス工業	2,800	1,866.00	5,224,800
日精エー・エス・ビー機械	800	4,105.00	3,284,000
サトーホールディングス	2,900	2,323.00	6,736,700
技研製作所	1,900	2,151.00	4,086,900
日本エアージェック	1,000	1,118.00	1,118,000
カワタ	500	968.00	484,000
日精樹脂工業	1,500	978.00	1,467,000
オカダアイオン	500	1,799.00	899,500
ワイエイシイホールディングス	700	2,705.00	1,893,500
小松製作所	94,000	3,300.00	310,200,000
住友重機械工業	11,900	3,060.00	36,414,000
日立建機	8,000	3,265.00	26,120,000
日工	3,000	646.00	1,938,000
巴工業	900	2,485.00	2,236,500
井関農機	1,900	1,210.00	2,299,000
T O W A	2,000	2,073.00	4,146,000
丸山製作所	300	1,746.00	523,800
北川鉄工所	800	1,171.00	936,800
ローツェ	1,000	9,880.00	9,880,000
タカキタ	400	452.00	180,800
クボタ	106,200	1,972.00	209,426,400
荏原実業	1,000	3,000.00	3,000,000
三菱化工機	600	2,401.00	1,440,600
月島ホールディングス	2,700	1,164.00	3,142,800
帝国電機製作所	1,400	2,336.00	3,270,400
東京機械製作所	400	522.00	208,800
新東工業	4,100	1,054.00	4,321,400
澁谷工業	1,900	2,658.00	5,050,200
アイチ コーポレーション	2,800	845.00	2,366,000
小森コーポレーション	4,700	1,074.00	5,047,800
鶴見製作所	1,500	2,362.00	3,543,000
日本ギア工業	500	402.00	201,000
酒井重工業	300	4,500.00	1,350,000
荏原製作所	8,200	6,080.00	49,856,000

石井鐵工所	200	2,445.00	489,000
西島製作所	1,700	1,667.00	2,833,900
北越工業	2,000	1,304.00	2,608,000
ダイキン工業	24,000	26,285.00	630,840,000
オルガノ	2,800	3,385.00	9,478,000
トーヨーカネツ	800	3,095.00	2,476,000
栗田工業	11,200	5,550.00	62,160,000
椿本チエイン	2,800	3,450.00	9,660,000
大同工業	600	746.00	447,600
木村化工機	1,500	720.00	1,080,000
アネスト岩田	3,400	1,060.00	3,604,000
ダイフク	31,000	2,497.00	77,407,000
サムコ	500	5,190.00	2,595,000
加藤製作所	700	1,098.00	768,600
油研工業	200	2,033.00	406,600
タダノ	10,600	1,062.00	11,257,200
フジテック	7,000	3,675.00	25,725,000
C K D	5,600	2,067.00	11,575,200
平和	6,700	2,628.00	17,607,600
理想科学工業	1,800	2,401.00	4,321,800
S A N K Y O	3,900	5,850.00	22,815,000
日本金銭機械	2,200	1,248.00	2,745,600
マースグループホールディングス	1,200	2,968.00	3,561,600
フクシマガリレイ	1,500	5,400.00	8,100,000
オーイズミ	600	516.00	309,600
ダイコク電機	1,100	2,785.00	3,063,500
竹内製作所	3,600	3,670.00	13,212,000
アマノ	5,700	2,881.00	16,421,700
J U K I	3,100	600.00	1,860,000
ジャノメ	2,000	630.00	1,260,000
マックス	2,500	2,310.00	5,775,000
グローリー	4,800	2,777.00	13,329,600
新晃工業	2,000	1,884.00	3,768,000
大和冷機工業	3,100	1,446.00	4,482,600
セガサミーホールディングス	16,100	2,758.00	44,403,800
日本ピストンリング	500	1,398.00	699,000
リケン	800	2,753.00	2,202,400
T P R	2,300	1,441.00	3,314,300
ツバキ・ナカシマ	4,900	933.00	4,571,700

ホシザキ	12,900	5,390.00	69,531,000
大豊工業	1,700	865.00	1,470,500
日本精工	36,900	881.00	32,508,900
NTN	39,600	292.00	11,563,200
ジェイテクト	17,900	1,162.00	20,799,800
不二越	1,500	3,905.00	5,857,500
日本トムソン	4,900	579.00	2,837,100
THK	11,600	3,045.00	35,322,000
ユーシン精機	1,600	725.00	1,160,000
前澤給装工業	1,400	1,216.00	1,702,400
イーグル工業	2,200	1,553.00	3,416,600
前澤工業	900	770.00	693,000
日本ピラー工業	1,900	3,765.00	7,153,500
キッツ	7,400	946.00	7,000,400
マキタ	25,000	3,755.00	93,875,000
三井E & S	9,300	546.00	5,077,800
日立造船	16,400	822.00	13,480,800
三菱重工業	35,100	5,391.00	189,224,100
IHI	12,600	3,350.00	42,210,000
サノヤスホールディングス	2,100	132.00	277,200
スター精密	3,800	1,842.00	6,999,600
日清紡ホールディングス	16,300	1,079.00	17,587,700
イビデン	11,500	6,060.00	69,690,000
コニカミノルタ	44,800	542.00	24,281,600
ブラザー工業	26,800	2,047.00	54,859,600
ミネベアミツミ	34,900	2,511.00	87,633,900
日立製作所	97,600	7,970.00	777,872,000
東芝	38,600	4,437.00	171,268,200
三菱電機	207,400	1,718.00	356,313,200
富士電機	12,200	5,760.00	70,272,000
東洋電機製造	500	1,052.00	526,000
安川電機	23,800	5,710.00	135,898,000
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,592.00	3,502,400
明電舎	3,000	1,857.00	5,571,000
オリジン	300	1,285.00	385,500
山洋電気	900	6,950.00	6,255,000
デンヨー	1,500	1,973.00	2,959,500
PHCホールディングス	2,800	1,378.00	3,858,400
ソシオネクスト	2,800	11,810.00	33,068,000

東芝テック	3,000	3,695.00	11,085,000
芝浦メカトロニクス	400	13,100.00	5,240,000
マブチモーター	5,000	3,925.00	19,625,000
ニデック	48,800	6,953.00	339,306,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,500	519.00	778,500
トレックス・セミコンダクター	900	1,940.00	1,746,000
東光高岳	1,200	2,084.00	2,500,800
ダブル・スコープ	6,600	1,153.00	7,609,800
ダイヘン	1,800	4,815.00	8,667,000
ヤーマン	3,500	1,164.00	4,074,000
JVCケンウッド	18,300	516.00	9,442,800
ミマキエンジニアリング	1,900	647.00	1,229,300
I - P E X	1,100	1,269.00	1,395,900
大崎電気工業	4,800	575.00	2,760,000
オムロン	18,400	8,181.00	150,530,400
日東工業	2,700	2,809.00	7,584,300
I D E C	3,000	3,235.00	9,705,000
正興電機製作所	600	1,015.00	609,000
不二電機工業	300	1,120.00	336,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,600	2,462.00	16,249,200
サクサホールディングス	300	1,991.00	597,300
メルコホールディングス	500	3,290.00	1,645,000
テクノメディカ	500	1,773.00	886,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディング グ	700	916.00	641,200
日本電気	28,400	6,190.00	175,796,000
富士通	20,000	18,225.00	364,500,000
沖電気工業	9,100	764.00	6,952,400
岩崎通信機	700	825.00	577,500
電気興業	800	2,217.00	1,773,600
サンケン電気	1,900	10,590.00	20,121,000
ナカヨ	200	1,142.00	228,400
アイホン	1,200	2,206.00	2,647,200
ルネサスエレクトロニクス	130,900	1,943.50	254,404,150
セイコーエプソン	25,700	2,069.00	53,173,300
ワコム	15,300	717.00	10,970,100
アルバック	4,800	5,200.00	24,960,000
アクセル	600	1,411.00	846,600
E I Z O	1,500	4,730.00	7,095,000

日本信号	4,600	1,070.00	4,922,000
京三製作所	4,200	430.00	1,806,000
能美防災	2,700	1,854.00	5,005,800
ホーチキ	1,500	1,659.00	2,488,500
星和電機	600	492.00	295,200
エレコム	4,800	1,347.00	6,465,600
パナソニック ホールディングス	237,100	1,382.50	327,790,750
シャープ	24,200	876.00	21,199,200
アンリツ	14,100	1,235.00	17,413,500
富士通ゼネラル	5,700	3,450.00	19,665,000
ソニーグループ	140,600	12,875.00	1,810,225,000
T D K	31,800	4,875.00	155,025,000
帝国通信工業	900	1,548.00	1,393,200
タムラ製作所	8,600	703.00	6,045,800
アルプスアルパイン	17,900	1,252.00	22,410,800
池上通信機	500	591.00	295,500
日本電波工業	2,400	1,203.00	2,887,200
鈴木	1,100	1,021.00	1,123,100
メイコー	2,200	2,530.00	5,566,000
日本トリム	500	2,978.00	1,489,000
ローランド ディー・ジー・	1,100	3,455.00	3,800,500
フォスター電機	1,900	1,054.00	2,002,600
S M K	500	2,403.00	1,201,500
ヨコオ	1,600	1,793.00	2,868,800
ティアック	2,400	117.00	280,800
ホシデン	4,700	1,911.00	8,981,700
ヒロセ電機	3,300	18,600.00	61,380,000
日本航空電子工業	4,100	2,501.00	10,254,100
T O A	2,300	873.00	2,007,900
マクセル	4,100	1,497.00	6,137,700
古野電気	2,600	947.00	2,462,200
スミダコーポレーション	1,800	1,643.00	2,957,400
アイコム	800	2,922.00	2,337,600
リオン	800	1,883.00	1,506,400
横河電機	22,000	2,447.00	53,834,000
新電元工業	800	3,495.00	2,796,000
アズビル	13,900	4,405.00	61,229,500
東亜ディーケーケー	700	837.00	585,900
日本光電工業	9,200	3,810.00	35,052,000

チノー	800	2,136.00	1,708,800
共和電業	1,400	358.00	501,200
日本電子材料	1,300	1,393.00	1,810,900
堀場製作所	4,400	7,420.00	32,648,000
アドバンテスト	15,700	12,140.00	190,598,000
小野測器	600	462.00	277,200
エスペック	1,600	2,077.00	3,323,200
キーエンス	19,900	66,220.00	1,317,778,000
日置電機	1,000	9,290.00	9,290,000
シスメックス	17,100	9,314.00	159,269,400
日本マイクロニクス	3,300	1,419.00	4,682,700
メガチップス	1,600	3,135.00	5,016,000
OBARA GROUP	1,100	3,920.00	4,312,000
澤藤電機	200	1,160.00	232,000
原田工業	700	817.00	571,900
コーセル	2,400	1,115.00	2,676,000
イリソ電子工業	1,800	4,315.00	7,767,000
オブテックスグループ	3,600	1,935.00	6,966,000
千代田インテグレ	700	2,265.00	1,585,500
レーザーテック	9,100	18,340.00	166,894,000
スタンレー電気	14,100	2,986.00	42,102,600
岩崎電気	200	4,450.00	890,000
ウシオ電機	10,100	1,892.00	19,109,200
岡谷電機産業	1,200	292.00	350,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	776.00	1,086,400
エノモト	400	1,615.00	646,000
日本セラミック	2,000	2,709.00	5,418,000
遠藤照明	700	1,273.00	891,100
古河電池	1,500	1,110.00	1,665,000
双信電機	600	378.00	226,800
山一電機	1,700	1,892.00	3,216,400
図研	1,700	3,560.00	6,052,000
日本電子	5,000	3,990.00	19,950,000
カシオ計算機	14,800	1,228.00	18,174,400
ファナック	97,500	4,588.00	447,330,000
日本シイエムケイ	4,200	462.00	1,940,400
エンプラス	600	4,320.00	2,592,000
大真空	2,400	648.00	1,555,200
ローム	9,200	10,890.00	100,188,000

浜松ホトニクス	15,900	7,150.00	113,685,000	
三井ハイテック	2,100	8,470.00	17,787,000	
新光電気工業	7,000	4,250.00	29,750,000	
京セラ	30,900	7,398.00	228,598,200	
太陽誘電	9,700	3,980.00	38,606,000	
村田製作所	60,300	7,909.00	476,912,700	
双葉電子工業	3,800	514.00	1,953,200	
北陸電気工業	600	1,200.00	720,000	
ニチコン	4,100	1,346.00	5,518,600	
日本ケミコン	2,000	1,922.00	3,844,000	
K O A	3,000	1,676.00	5,028,000	
市光工業	2,900	548.00	1,589,200	
小糸製作所	23,900	2,693.00	64,362,700	
ミツバ	3,700	703.00	2,601,100	
S C R E E Nホールディングス	3,400	11,790.00	40,086,000	
キャノン電子	2,200	1,890.00	4,158,000	
キャノン	109,000	3,245.00	353,705,000	
リコー	49,800	1,052.00	52,389,600	
象印マホービン	5,900	1,814.00	10,702,600	
M U T O Hホールディングス	200	1,735.00	347,000	
東京エレクトロン	42,100	16,175.00	680,967,500	
イノテック	1,300	1,464.00	1,903,200	
トヨタ紡織	8,400	2,158.00	18,127,200	
芦森工業	300	1,441.00	432,300	
ユニプレス	3,600	1,051.00	3,783,600	
豊田自動織機	14,500	7,990.00	115,855,000	
モリタホールディングス	3,500	1,584.00	5,544,000	
三櫻工業	3,000	714.00	2,142,000	
デンソー	41,000	8,263.00	338,783,000	
東海理化電機製作所	5,600	1,882.00	10,539,200	
川崎重工業	15,000	2,770.00	41,550,000	
名村造船所	4,000	465.00	1,860,000	
日本車輛製造	800	2,064.00	1,651,200	
三菱ロジスネクスト	3,200	1,118.00	3,577,600	
近畿車輛	200	1,476.00	295,200	
日産自動車	282,300	512.80	144,763,440	
いすゞ自動車	57,800	1,651.00	95,427,800	
トヨタ自動車	1,091,100	1,933.00	2,109,096,300	
日野自動車	25,600	552.00	14,131,200	

三菱自動車工業	77,500	469.00	36,347,500
エフテック	1,100	758.00	833,800
レシップホールディングス	600	509.00	305,400
G M B	300	1,670.00	501,000
ファルテック	200	697.00	139,400
武蔵精密工業	4,900	1,785.00	8,746,500
日産車体	3,500	900.00	3,150,000
新明和工業	6,200	1,279.00	7,929,800
極東開発工業	3,300	1,704.00	5,623,200
トピー工業	1,600	2,014.00	3,222,400
ティラド	500	2,515.00	1,257,500
タチエス	3,100	1,263.00	3,915,300
N O K	7,700	1,834.00	14,121,800
フタバ産業	5,300	453.00	2,400,900
K Y B	1,900	4,570.00	8,683,000
大同メタル工業	3,900	498.00	1,942,200
プレス工業	8,900	549.00	4,886,100
ミクニ	1,800	369.00	664,200
太平洋工業	4,600	1,227.00	5,644,200
河西工業	2,100	221.00	464,100
アイシン	15,300	3,935.00	60,205,500
マツダ	65,700	1,208.00	79,365,600
今仙電機製作所	1,000	662.00	662,000
本田技研工業	161,500	3,749.00	605,463,500
スズキ	36,500	4,928.00	179,872,000
S U B A R U	62,900	2,244.50	141,179,050
安永	700	940.00	658,000
ヤマハ発動機	31,200	3,450.00	107,640,000
T B K	1,500	305.00	457,500
エクセディ	3,200	2,128.00	6,809,600
豊田合成	5,800	2,345.00	13,601,000
愛三工業	3,300	979.00	3,230,700
盟和産業	200	971.00	194,200
日本プラスト	1,200	432.00	518,400
ヨロズ	1,900	848.00	1,611,200
エフ・シー・シー	3,500	1,735.00	6,072,500
シマノ	8,100	21,570.00	174,717,000
テイ・エス テック	9,100	1,835.00	16,698,500
ジャムコ	800	1,479.00	1,183,200

テルモ	61,100	4,242.00	259,186,200
クリエートメディック	500	909.00	454,500
日機装	4,600	946.00	4,351,600
日本エム・ディ・エム	1,200	918.00	1,101,600
島津製作所	24,200	4,340.00	105,028,000
J M S	1,800	531.00	955,800
クボテック	400	210.00	84,000
長野計器	1,400	1,618.00	2,265,200
ブイ・テクノロジー	1,000	2,500.00	2,500,000
東京計器	1,500	1,241.00	1,861,500
愛知時計電機	800	1,585.00	1,268,000
インターアクション	900	1,341.00	1,206,900
オーバル	1,400	442.00	618,800
東京精密	4,400	5,250.00	23,100,000
マニー	7,900	1,726.00	13,635,400
ニコン	28,700	1,465.00	42,045,500
トプコン	10,500	1,777.00	18,658,500
オリンパス	122,300	2,273.00	277,987,900
理研計器	1,200	4,795.00	5,754,000
タムロン	1,500	3,505.00	5,257,500
H O Y A	42,400	15,400.00	652,960,000
シード	800	586.00	468,800
ノーリツ鋼機	1,900	2,271.00	4,314,900
A & D ホロンホールディングス	2,900	1,382.00	4,007,800
朝日インテック	22,200	2,574.00	57,142,800
シチズン時計	21,800	797.00	17,374,600
リズム	500	1,992.00	996,000
大研医器	1,200	498.00	597,600
メニコン	6,800	2,792.00	18,985,600
シンシア	100	600.00	60,000
松風	900	2,150.00	1,935,000
セイコーグループ	3,100	2,643.00	8,193,300
ニプロ	16,600	1,003.00	16,649,800
K Y O R I T S U	2,300	143.00	328,900
中本パックス	500	1,578.00	789,000
スノーピーク	3,400	2,125.00	7,225,000
パラマウントベッドホールディングス	4,600	2,514.00	11,564,400
トランザクション	1,300	1,778.00	2,311,400
粧美堂	400	396.00	158,400

ニホンフラッシュ	1,900	1,090.00	2,071,000
前田工織	1,700	3,125.00	5,312,500
永大産業	1,600	219.00	350,400
アートネイチャー	2,000	763.00	1,526,000
パンダイナムコホールディングス	54,400	3,261.00	177,398,400
アイフィスジャパン	400	622.00	248,800
SHOEI	4,500	2,621.00	11,794,500
フランスベッドホールディングス	2,500	1,125.00	2,812,500
パイロットコーポレーション	3,100	4,610.00	14,291,000
萩原工業	1,300	1,285.00	1,670,500
フジシールインターナショナル	4,000	1,574.00	6,296,000
タカラトミー	9,200	1,626.00	14,959,200
広済堂ホールディングス	1,000	2,551.00	2,551,000
エステールホールディングス	400	612.00	244,800
タカノ	600	760.00	456,000
プロネクサス	1,600	1,001.00	1,601,600
ホクシン	1,200	135.00	162,000
ウッドワン	500	1,233.00	616,500
大建工業	1,200	2,265.00	2,718,000
凸版印刷	26,000	2,929.00	76,154,000
大日本印刷	21,700	3,915.00	84,955,500
共同印刷	600	2,800.00	1,680,000
NISSHA	3,800	1,647.00	6,258,600
光村印刷	100	1,181.00	118,100
TAKARA & COMPANY	1,300	2,442.00	3,174,600
アシックス	18,300	3,875.00	70,912,500
ツツミ	300	2,285.00	685,500
ローランド	1,500	4,225.00	6,337,500
小松ウオール工業	700	2,422.00	1,695,400
ヤマハ	12,500	5,390.00	67,375,000
河合楽器製作所	500	3,135.00	1,567,500
クリナップ	2,200	701.00	1,542,200
ピジョン	12,700	2,204.00	27,990,800
キングジム	1,800	930.00	1,674,000
リンテック	4,000	2,238.00	8,952,000
イトーキ	4,100	854.00	3,501,400
任天堂	125,500	5,800.00	727,900,000
三菱鉛筆	2,800	1,830.00	5,124,000
タカラスタンダード	3,700	1,736.00	6,423,200

コクヨ	9,600	2,042.00	19,603,200	
ナカバヤシ	2,100	484.00	1,016,400	
グローブライド	1,600	2,338.00	3,740,800	
オカムラ	6,000	1,735.00	10,410,000	
美津濃	2,000	3,560.00	7,120,000	
東京電力ホールディングス	179,100	510.00	91,341,000	
中部電力	73,200	1,656.00	121,219,200	
関西電力	76,700	1,527.00	117,120,900	
中国電力	31,600	749.00	23,668,400	
北陸電力	18,800	689.00	12,953,200	
東北電力	48,600	752.00	36,547,200	
四国電力	17,000	863.00	14,671,000	
九州電力	45,800	869.00	39,800,200	
北海道電力	19,200	543.00	10,425,600	
沖縄電力	4,700	1,157.00	5,437,900	
電源開発	15,000	2,142.00	32,130,000	
エフオン	1,300	620.00	806,000	
イーレックス	3,500	1,371.00	4,798,500	
レノバ	5,300	1,663.00	8,813,900	
東京瓦斯	42,000	2,971.00	124,782,000	
大阪瓦斯	40,300	2,296.00	92,528,800	
東邦瓦斯	7,800	2,573.00	20,069,400	
北海道瓦斯	1,200	2,063.00	2,475,600	
広島ガス	4,200	379.00	1,591,800	
西部ガスホールディングス	1,900	1,958.00	3,720,200	
静岡ガス	4,500	1,171.00	5,269,500	
メタウォーター	2,500	1,791.00	4,477,500	
S B S ホールディングス	1,800	3,240.00	5,832,000	
東武鉄道	21,800	3,655.00	79,679,000	
相鉄ホールディングス	6,600	2,740.00	18,084,000	
東急	55,700	1,981.00	110,341,700	
京浜急行電鉄	22,500	1,365.00	30,712,500	
小田急電鉄	30,100	2,101.00	63,240,100	
京王電鉄	10,500	5,170.00	54,285,000	
京成電鉄	12,800	5,310.00	67,968,000	
富士急行	2,400	5,560.00	13,344,000	
東日本旅客鉄道	33,700	8,104.00	273,104,800	
西日本旅客鉄道	25,400	6,126.00	155,600,400	
東海旅客鉄道	15,300	17,080.00	261,324,000	

西武ホールディングス	24,000	1,539.00	36,936,000	
鴻池運輸	3,400	1,683.00	5,722,200	
西日本鉄道	5,300	2,530.00	13,409,000	
ハマキョウレックス	1,600	3,535.00	5,656,000	
サカイ引越センター	900	4,835.00	4,351,500	
近鉄グループホールディングス	19,800	4,775.00	94,545,000	
阪急阪神ホールディングス	26,500	4,450.00	117,925,000	
南海電気鉄道	9,500	3,300.00	31,350,000	
京阪ホールディングス	10,900	3,760.00	40,984,000	
神戸電鉄	500	3,220.00	1,610,000	
名古屋鉄道	21,900	2,350.00	51,465,000	
山陽電気鉄道	1,500	2,445.00	3,667,500	
アルプス物流	1,600	1,237.00	1,979,200	
ヤマトホールディングス	25,400	2,485.00	63,119,000	
山九	5,000	5,090.00	25,450,000	
丸運	800	248.00	198,400	
丸全昭和運輸	1,200	3,725.00	4,470,000	
センコーグループホールディングス	10,500	956.00	10,038,000	
トナミホールディングス	400	4,550.00	1,820,000	
ニッコンホールディングス	6,400	2,751.00	17,606,400	
日本石油輸送	200	2,730.00	546,000	
福山通運	1,500	3,690.00	5,535,000	
セイノーホールディングス	12,300	1,514.00	18,622,200	
エスライン	400	809.00	323,600	
神奈川中央交通	600	3,295.00	1,977,000	
A Z - COM丸和ホールディングス	4,800	2,100.00	10,080,000	
C & F ロジホールディングス	1,900	1,315.00	2,498,500	
九州旅客鉄道	14,000	3,160.00	44,240,000	
S Gホールディングス	38,100	2,143.00	81,648,300	
N I P P O N E X P R E S Sホールディング ン	7,400	8,090.00	59,866,000	
日本郵船	53,100	3,112.00	165,247,200	
商船三井	35,000	3,180.00	111,300,000	
川崎汽船	14,900	3,335.00	49,691,500	
N S ユナイテッド海運	1,100	3,525.00	3,877,500	
明治海運	1,500	570.00	855,000	
飯野海運	7,300	796.00	5,810,800	
共栄タンカー	300	899.00	269,700	
乾汽船	2,500	1,472.00	3,680,000	

日本航空	48,700	2,670.00	130,029,000	
A N Aホールディングス	54,000	3,050.00	164,700,000	
パスコ	300	1,635.00	490,500	
トランコム	600	6,880.00	4,128,000	
日新	1,500	2,264.00	3,396,000	
三菱倉庫	4,300	3,480.00	14,964,000	
三井倉庫ホールディングス	1,900	3,560.00	6,764,000	
住友倉庫	5,400	2,256.00	12,182,400	
澁澤倉庫	800	2,351.00	1,880,800	
東陽倉庫	2,000	284.00	568,000	
日本トランスシティ	4,000	650.00	2,600,000	
ケイヒン	300	1,671.00	501,300	
中央倉庫	1,000	1,067.00	1,067,000	
川西倉庫	300	1,022.00	306,600	
安田倉庫	1,400	979.00	1,370,600	
ファイズホールディングス	300	1,265.00	379,500	
東洋埠頭	400	1,426.00	570,400	
上組	9,500	3,135.00	29,782,500	
サンリツ	300	735.00	220,500	
キムラユニティー	700	1,153.00	807,100	
キューソー流通システム	900	1,018.00	916,200	
東海運	900	291.00	261,900	
エーアイテイナー	1,200	1,628.00	1,953,600	
内外トランスライン	700	2,503.00	1,752,100	
日本コンセプト	600	1,590.00	954,000	
N E C ネットズエスアイ	6,700	1,868.00	12,515,600	
クロスキャット	1,100	1,161.00	1,277,100	
システナ	33,500	301.00	10,083,500	
デジタルアーツ	1,300	5,420.00	7,046,000	
日鉄ソリューションズ	3,400	3,980.00	13,532,000	
キューブシステム	1,200	1,197.00	1,436,400	
コア	900	1,713.00	1,541,700	
手間いらず	300	4,490.00	1,347,000	
ラクーンホールディングス	1,700	722.00	1,227,400	
ソリトンシステムズ	1,000	1,083.00	1,083,000	
ソフトクリエイトホールディングス	1,600	1,796.00	2,873,600	
T I S	21,800	3,970.00	86,546,000	
J N S ホールディングス	700	391.00	273,700	
グリー	5,300	695.00	3,683,500	

GMOペパボ	300	1,680.00	504,000	
コーエーテックモホールディングス	12,500	2,475.00	30,937,500	
三菱総合研究所	1,000	5,270.00	5,270,000	
ボルテージ	400	312.00	124,800	
電算	200	1,788.00	357,600	
A G S	600	725.00	435,000	
ファインデックス	1,600	622.00	995,200	
ブレインパッド	1,500	746.00	1,119,000	
K L a b	4,000	381.00	1,524,000	
ポールトゥウィンホールディングス	3,400	969.00	3,294,600	
ネクソン	51,600	3,010.00	155,316,000	
アイスタイル	5,800	583.00	3,381,400	
エムアップホールディングス	2,400	1,224.00	2,937,600	
エイチーム	1,200	699.00	838,800	
エニグモ	2,500	412.00	1,030,000	
テクノスジャパン	1,300	577.00	750,100	
e n i s h	1,200	500.00	600,000	
コロプラ	7,700	668.00	5,143,600	
オルトプラス	1,200	220.00	264,000	
ブロードリーフ	11,600	429.00	4,976,400	
クロス・マーケティンググループ	900	647.00	582,300	
デジタルハーツホールディングス	1,200	1,386.00	1,663,200	
システム情報	1,600	748.00	1,196,800	
メディアドゥ	800	1,357.00	1,085,600	
じげん	5,800	622.00	3,607,600	
ブイキューブ	2,400	477.00	1,144,800	
エンカレッジ・テクノロジー	400	522.00	208,800	
サイバーリンクス	500	887.00	443,500	
ディー・エル・イー	1,100	243.00	267,300	
フィックスターズ	2,200	1,296.00	2,851,200	
C A R T A H O L D I N G S	900	1,429.00	1,286,100	
オブティム	1,600	948.00	1,516,800	
セレス	800	1,135.00	908,000	
S H I F T	1,300	25,370.00	32,981,000	
ティーガイア	2,100	1,672.00	3,511,200	
セック	200	3,100.00	620,000	
テクマトリックス	3,600	1,818.00	6,544,800	
プロシップ	900	1,376.00	1,238,400	

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,800	2,824.00	16,379,200	
GMOペイメントゲートウェイ	4,000	11,310.00	45,240,000	
ザッパラス	400	364.00	145,600	
システムリサーチ	600	2,266.00	1,359,600	
インターネットイニシアティブ	11,100	2,964.00	32,900,400	
さくらインターネット	2,200	677.00	1,489,400	
ヴィンクス	500	1,460.00	730,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	600	3,740.00	2,244,000	
SRAホールディングス	1,000	3,065.00	3,065,000	
システムインテグレータ	500	429.00	214,500	
朝日ネット	2,100	609.00	1,278,900	
eBASE	2,800	721.00	2,018,800	
アバントグループ	2,500	1,387.00	3,467,500	
アドソル日進	800	1,850.00	1,480,000	
ODKソリューションズ	300	594.00	178,200	
フリービット	1,000	1,548.00	1,548,000	
コムチュア	2,600	2,233.00	5,805,800	
サイバーコム	300	1,581.00	474,300	
アステリア	1,600	618.00	988,800	
アイル	900	2,772.00	2,494,800	
マークライnz	1,100	2,354.00	2,589,400	
メディカル・データ・ビジョン	3,000	761.00	2,283,000	
gumi	2,900	734.00	2,128,600	
ショーケース	400	307.00	122,800	
モバイルファクトリー	300	875.00	262,500	
テラスカイ	900	2,516.00	2,264,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,200	1,671.00	2,005,200	
PCIホールディングス	600	1,030.00	618,000	
アイビーシー	200	597.00	119,400	
ネオジャパン	700	927.00	648,900	
PR TIMES	500	1,499.00	749,500	
ラクス	9,400	2,250.00	21,150,000	
ランドコンピュータ	400	1,196.00	478,400	
ダブルスタンダード	800	2,354.00	1,883,200	
オープンドア	1,400	1,481.00	2,073,400	
マイネット	500	332.00	166,000	
アカツキ	900	2,141.00	1,926,900	

ベネフィットジャパン	100	1,177.00	117,700
Ubicomホールディングス	600	2,100.00	1,260,000
カナミックネットワーク	2,100	492.00	1,033,200
ノムラシステムコーポレーション	1,400	116.00	162,400
チェンジホールディングス	4,900	2,361.00	11,568,900
シンクロ・フード	1,000	557.00	557,000
オークネット	1,000	1,781.00	1,781,000
キャピタル・アセット・プランニング	300	709.00	212,700
セグエグループ	400	1,021.00	408,400
エイトレッド	200	1,451.00	290,200
マクロミル	3,900	900.00	3,510,000
ピーグリー	300	1,152.00	345,600
オロ	600	2,280.00	1,368,000
ユーザーローカル	700	2,127.00	1,488,900
テモナ	400	278.00	111,200
ニーズウェル	400	1,323.00	529,200
マネーフォワード	4,800	5,560.00	26,688,000
サインポスト	600	572.00	343,200
Sun Asterisk	1,400	1,259.00	1,762,600
電算システムホールディングス	1,000	3,170.00	3,170,000
Appier Group	7,500	1,569.00	11,767,500
ソルクシーズ	1,300	394.00	512,200
フェイス	400	507.00	202,800
プロトコーポレーション	2,500	1,169.00	2,922,500
ハイマックス	600	1,405.00	843,000
野村総合研究所	39,700	3,535.00	140,339,500
サイバネットシステム	1,700	829.00	1,409,300
CEホールディングス	800	570.00	456,000
日本システム技術	600	1,993.00	1,195,800
インテージホールディングス	2,300	1,655.00	3,806,500
東邦システムサイエンス	400	1,134.00	453,600
ソースネクスト	10,100	223.00	2,252,300
インフォコム	2,600	2,238.00	5,818,800
シンプレクス・ホールディングス	3,400	2,374.00	8,071,600
HEROZ	700	1,279.00	895,300
ラクスル	4,800	1,347.00	6,465,600
メルカリ	12,000	2,663.00	31,956,000
IPS	600	2,419.00	1,451,400
FIG	1,800	285.00	513,000

システムサポート	800	1,924.00	1,539,200
イーソル	1,300	988.00	1,284,400
アルテリア・ネットワークス	1,900	1,962.00	3,727,800
東海ソフト	200	1,039.00	207,800
ウイングアーク1st	2,100	2,311.00	4,853,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングン	500	1,583.00	791,500
サーバーワークス	400	1,956.00	782,400
東名	100	1,911.00	191,100
ヴィッツ	200	1,114.00	222,800
トピラシステムズ	400	960.00	384,000
Sansan	6,500	1,701.00	11,056,500
Link-U	400	1,000.00	400,000
ギフトィ	2,200	2,436.00	5,359,200
メドレー	2,700	3,840.00	10,368,000
ベース	700	5,940.00	4,158,000
JMDC	3,300	5,840.00	19,272,000
フォーカスシステムズ	1,500	1,029.00	1,543,500
クレスコ	1,500	1,908.00	2,862,000
フジ・メディア・ホールディングス	19,100	1,316.00	25,135,600
オービック	6,700	22,570.00	151,219,000
ジャストシステム	2,900	4,300.00	12,470,000
TDCソフト	1,700	1,454.00	2,471,800
Zホールディングス	283,600	359.10	101,840,760
トレンドマイクロ	11,500	6,340.00	72,910,000
IDホールディングス	1,300	1,134.00	1,474,200
日本オラクル	3,800	10,640.00	40,432,000
アルファシステムズ	600	3,780.00	2,268,000
フューチャー	5,000	1,713.00	8,565,000
CAC Holdings	1,200	1,688.00	2,025,600
SBテクノロジー	800	2,448.00	1,958,400
トーセ	400	736.00	294,400
オービックビジネスコンサルタント	3,900	5,210.00	20,319,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,700	3,520.00	37,664,000
アイティフォー	2,600	950.00	2,470,000
東計電算	300	6,130.00	1,839,000
エクスネット	200	1,006.00	201,200
大塚商会	11,300	5,210.00	58,873,000
サイボウズ	2,700	2,591.00	6,995,700

電通国際情報サービス	2,400	5,180.00	12,432,000	
A C C E S S	2,400	875.00	2,100,000	
デジタルガレージ	3,500	4,670.00	16,345,000	
E Mシステムズ	3,300	801.00	2,643,300	
ウェザーニューズ	600	6,860.00	4,116,000	
C I J	3,300	557.00	1,838,100	
ビジネスエンジニアリング	300	3,610.00	1,083,000	
日本エンタープライズ	1,600	142.00	227,200	
WOWOW	1,500	1,281.00	1,921,500	
スカラ	1,800	756.00	1,360,800	
インテリジェント ウェイブ	800	705.00	564,000	
WOW WORLD GROUP	200	1,497.00	299,400	
I M A G I C A GROUP	1,700	616.00	1,047,200	
ネットワンシステムズ	7,400	3,255.00	24,087,000	
システムソフト	6,900	78.00	538,200	
アルゴグラフィックス	1,800	4,080.00	7,344,000	
マーベラス	3,200	675.00	2,160,000	
エイベックス	3,400	1,563.00	5,314,200	
B I P R O G Y	7,300	3,585.00	26,170,500	
都築電気	1,000	1,740.00	1,740,000	
T B S ホールディングス	10,200	2,216.00	22,603,200	
日本テレビホールディングス	17,600	1,247.00	21,947,200	
朝日放送グループホールディングス	1,900	658.00	1,250,200	
テレビ朝日ホールディングス	4,800	1,487.00	7,137,600	
スカパーJSATホールディングス	17,700	557.00	9,858,900	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,645.00	3,703,000	
日本BS放送	600	892.00	535,200	
ビジョン	2,600	1,725.00	4,485,000	
スマートバリュー	400	448.00	179,200	
USEN-NEXT HOLDINGS	2,200	3,050.00	6,710,000	
ワイヤレスゲート	700	232.00	162,400	
日本通信	18,400	289.00	5,317,600	
クロップス	200	1,066.00	213,200	
日本電信電話	255,400	4,199.00	1,072,424,600	
K D D I	154,000	4,503.00	693,462,000	
ソフトバンク	320,200	1,529.00	489,585,800	
光通信	2,300	18,910.00	43,493,000	
エムティーアイ	1,400	590.00	826,000	
GMOインターネットグループ	7,400	2,718.00	20,113,200	

ファイバークート	1,100	1,213.00	1,334,300	
アイドマーケティングコミュニケーション	400	281.00	112,400	
KADOKAWA	10,500	3,150.00	33,075,000	
学研ホールディングス	3,300	879.00	2,900,700	
ゼンリン	3,400	932.00	3,168,800	
昭文社ホールディングス	700	299.00	209,300	
インプレスホールディングス	1,400	220.00	308,000	
アイネット	1,200	1,518.00	1,821,600	
松竹	1,100	12,500.00	13,750,000	
東宝	12,500	5,520.00	69,000,000	
東映	500	18,310.00	9,155,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	62,500	1,920.00	120,000,000	
ピー・シー・エー	1,100	1,175.00	1,292,500	
ビジネスブレイン太田昭和	900	1,883.00	1,694,700	
D T S	4,200	3,340.00	14,028,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,000	6,760.00	67,600,000	
シーイーシー	2,800	1,444.00	4,043,200	
カブコン	19,800	5,230.00	103,554,000	
アイ・エス・ビー	1,000	1,558.00	1,558,000	
ジャステック	1,200	1,240.00	1,488,000	
S C S K	16,300	2,177.00	35,485,100	
N S W	800	2,341.00	1,872,800	
アイネス	1,400	1,424.00	1,993,600	
T K C	3,200	3,695.00	11,824,000	
富士ソフト	2,300	8,570.00	19,711,000	
N S D	7,100	2,687.00	19,077,700	
コナミグループ	8,500	7,180.00	61,030,000	
福井コンピュータホールディングス	1,400	2,729.00	3,820,600	
J B C Cホールディングス	1,500	2,187.00	3,280,500	
ミロク情報サービス	1,800	1,525.00	2,745,000	
ソフトバンクグループ	98,300	4,950.00	486,585,000	
高千穂交易	600	2,489.00	1,493,400	
オルバヘルスケアホールディングス	200	1,817.00	363,400	
伊藤忠食品	500	5,330.00	2,665,000	
エレマテック	1,900	1,827.00	3,471,300	
あらた	1,600	4,525.00	7,240,000	
トーメンデバイス	300	5,460.00	1,638,000	

東京エレクトロン デバイス	800	7,990.00	6,392,000	
円谷フィールズホールディングス	3,600	1,770.00	6,372,000	
双日	22,300	2,846.00	63,465,800	
アルフレッサ ホールディングス	21,100	2,064.00	43,550,400	
横浜冷凍	5,700	1,086.00	6,190,200	
神栄	200	1,101.00	220,200	
ラサ商事	700	1,424.00	996,800	
アルコニックス	2,800	1,359.00	3,805,200	
神戸物産	16,300	4,000.00	65,200,000	
ハイパー	300	458.00	137,400	
あい ホールディングス	3,400	2,410.00	8,194,000	
ディーブイエックス	400	1,025.00	410,000	
ダイワボウホールディングス	8,600	2,729.00	23,469,400	
マクニカホールディングス	5,000	4,395.00	21,975,000	
ラクト・ジャパン	800	2,083.00	1,666,400	
グリムス	900	2,170.00	1,953,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	964.00	2,988,400	
八洲電機	1,700	1,290.00	2,193,000	
メディアスホールディングス	1,300	838.00	1,089,400	
レスターホールディングス	2,000	2,229.00	4,458,000	
ジューテックホールディングス	400	1,167.00	466,800	
大光	700	626.00	438,200	
OCHIホールディングス	400	1,246.00	498,400	
TOKAIホールディングス	10,400	888.00	9,235,200	
黒谷	400	605.00	242,000	
Cominix	300	805.00	241,500	
三洋貿易	2,400	1,264.00	3,033,600	
ビューティガレージ	300	4,030.00	1,209,000	
ウイン・パートナーズ	1,500	1,004.00	1,506,000	
ミタチ産業	400	1,372.00	548,800	
シップヘルスケアホールディングス	7,600	2,535.00	19,266,000	
明治電機工業	800	1,239.00	991,200	
デリカフーズホールディングス	600	610.00	366,000	
スターティアホールディングス	300	1,292.00	387,600	
コメダホールディングス	5,200	2,659.00	13,826,800	
ピーバンドットコム	200	495.00	99,000	
アセンテック	700	565.00	395,500	
富士興産	400	1,183.00	473,200	
協栄産業	100	1,921.00	192,100	

フルサト・マルカホールディングス	2,100	2,797.00	5,873,700	
ヤマエグループホールディングス	1,200	2,271.00	2,725,200	
小野建	2,100	1,546.00	3,246,600	
南陽	300	2,200.00	660,000	
佐鳥電機	1,000	1,677.00	1,677,000	
エコートレーディング	300	781.00	234,300	
伯東	1,200	4,535.00	5,442,000	
コンドーテック	1,600	1,084.00	1,734,400	
中山福	900	348.00	313,200	
ナガイレーベン	2,700	2,182.00	5,891,400	
三菱食品	1,900	3,590.00	6,821,000	
松田産業	1,600	2,173.00	3,476,800	
第一興商	8,100	2,560.00	20,736,000	
メディパルホールディングス	20,100	2,157.00	43,355,700	
S P K	900	1,689.00	1,520,100	
萩原電気ホールディングス	800	3,465.00	2,772,000	
アズワン	3,000	5,640.00	16,920,000	
スズデン	700	2,242.00	1,569,400	
尾家産業	400	1,172.00	468,800	
シモジマ	1,400	1,096.00	1,534,400	
ドウシシャ	2,200	2,116.00	4,655,200	
小津産業	400	1,790.00	716,000	
高速	1,100	2,107.00	2,317,700	
たけびし	800	1,677.00	1,341,600	
リックス	300	2,897.00	869,100	
丸文	1,900	1,089.00	2,069,100	
ハビネット	1,800	1,986.00	3,574,800	
橋本総業ホールディングス	800	1,148.00	918,400	
日本ライフライン	6,200	1,085.00	6,727,000	
タカショー	1,800	733.00	1,319,400	
I D O M	6,400	867.00	5,548,800	
進和	1,300	2,154.00	2,800,200	
エスケイジャパン	400	548.00	219,200	
ダイترون	800	2,668.00	2,134,400	
シークス	3,000	1,445.00	4,335,000	
田中商事	500	658.00	329,000	
オーハシテクニカ	1,000	1,559.00	1,559,000	
白銅	800	2,331.00	1,864,800	
ダイコー通産	200	1,254.00	250,800	

伊藤忠商事	129,600	4,717.00	611,323,200	
丸紅	164,100	1,953.50	320,569,350	
高島	300	3,190.00	957,000	
長瀬産業	9,600	2,363.00	22,684,800	
蝶理	1,100	2,643.00	2,907,300	
豊田通商	18,400	6,000.00	110,400,000	
三共生興	3,000	611.00	1,833,000	
兼松	8,200	1,907.00	15,637,400	
ツカモトコーポレーション	200	1,456.00	291,200	
三井物産	149,200	4,275.00	637,830,000	
日本紙パルプ商事	1,100	5,450.00	5,995,000	
カメイ	2,200	1,521.00	3,346,200	
東都水産	100	6,870.00	687,000	
OUGホールディングス	200	2,469.00	493,800	
スターゼン	1,600	2,394.00	3,830,400	
山善	5,700	1,043.00	5,945,100	
椿本興業	300	4,040.00	1,212,000	
住友商事	130,200	2,592.00	337,478,400	
内田洋行	900	5,480.00	4,932,000	
三菱商事	130,000	5,387.00	700,310,000	
第一実業	700	5,750.00	4,025,000	
キャノンマーケティングジャパン	4,900	3,380.00	16,562,000	
西華産業	800	2,092.00	1,673,600	
佐藤商事	1,500	1,414.00	2,121,000	
菱洋エレクトロ	1,800	2,567.00	4,620,600	
東京産業	1,900	848.00	1,611,200	
ユアサ商事	1,900	4,355.00	8,274,500	
神鋼商事	500	5,640.00	2,820,000	
トルク	900	211.00	189,900	
阪和興業	3,800	4,360.00	16,568,000	
正栄食品工業	1,400	4,005.00	5,607,000	
カナデン	1,400	1,216.00	1,702,400	
RYODEN	1,700	2,056.00	3,495,200	
岩谷産業	4,800	6,760.00	32,448,000	
ナイス	400	1,383.00	553,200	
ニチモウ	200	3,520.00	704,000	
極東貿易	1,300	1,522.00	1,978,600	
アステナホールディングス	3,600	455.00	1,638,000	
三愛オブリ	5,600	1,576.00	8,825,600	

稲畑産業	4,200	2,960.00	12,432,000	
G S I クレオス	1,200	1,904.00	2,284,800	
明和産業	2,800	675.00	1,890,000	
クワザワホールディングス	500	481.00	240,500	
ワキタ	3,900	1,391.00	5,424,900	
東邦ホールディングス	5,200	2,685.00	13,962,000	
サンゲツ	5,300	2,594.00	13,748,200	
ミツウロコグループホールディングス	2,700	1,383.00	3,734,100	
シナネンホールディングス	700	3,785.00	2,649,500	
伊藤忠エネクス	5,200	1,239.00	6,442,800	
サンリオ	6,000	5,930.00	35,580,000	
サンワテクノス	1,100	2,053.00	2,258,300	
リョーサン	2,200	3,410.00	7,502,000	
新光商事	2,800	1,217.00	3,407,600	
トーホー	900	2,384.00	2,145,600	
三信電気	800	2,101.00	1,680,800	
東陽テクニカ	2,100	1,387.00	2,912,700	
モスフードサービス	3,100	3,210.00	9,951,000	
加賀電子	1,700	5,030.00	8,551,000	
ソーダニッカ	1,200	785.00	942,000	
立花エレテック	1,500	2,165.00	3,247,500	
フォーバル	800	1,130.00	904,000	
P A L T A C	3,300	5,040.00	16,632,000	
三谷産業	3,700	317.00	1,172,900	
太平洋興発	600	751.00	450,600	
西本W i s m e t t a cホールディングス	500	4,205.00	2,102,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,224.00	222,400	
コア商事ホールディングス	1,200	733.00	879,600	
K P Pグループホールディングス	4,900	663.00	3,248,700	
ヤマタネ	900	1,644.00	1,479,600	
丸紅建材リース	100	2,168.00	216,800	
日鉄物産	500	9,280.00	4,640,000	
泉州電業	1,100	3,190.00	3,509,000	
トラスコ中山	4,400	2,299.00	10,115,600	
オートバックスセブン	7,300	1,568.00	11,446,400	
モリト	1,500	1,084.00	1,626,000	
加藤産業	2,600	3,870.00	10,062,000	
北恵	400	758.00	303,200	
イエローハット	3,700	1,906.00	7,052,200	

J Kホールディングス	1,600	1,009.00	1,614,400
日伝	1,200	2,154.00	2,584,800
北沢産業	900	437.00	393,300
杉本商事	900	2,060.00	1,854,000
因幡電機産業	5,500	3,145.00	17,297,500
東テク	700	4,125.00	2,887,500
ミスミグループ本社	31,700	3,475.00	110,157,500
アルテック	900	257.00	231,300
タキヒヨー	400	1,080.00	432,000
蔵王産業	300	2,282.00	684,600
スズケン	6,200	3,985.00	24,707,000
ジェコス	1,300	870.00	1,131,000
グローセル	2,000	411.00	822,000
ローソン	5,200	6,330.00	32,916,000
サンエー	1,600	4,800.00	7,680,000
カワチ薬品	1,600	2,239.00	3,582,400
エービーシー・マート	3,100	8,060.00	24,986,000
ハードオフコーポレーション	700	1,415.00	990,500
アスクル	4,300	1,801.00	7,744,300
ゲオホールディングス	2,100	1,752.00	3,679,200
アダストリア	2,500	2,674.00	6,685,000
ジーフット	1,100	277.00	304,700
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	484.00	96,800
くら寿司	2,500	3,205.00	8,012,500
キャンドゥ	700	2,481.00	1,736,700
I Kホールディングス	500	402.00	201,000
パルグループホールディングス	2,100	3,360.00	7,056,000
エディオン	8,300	1,392.00	11,553,600
サーラコーポレーション	4,400	787.00	3,462,800
ワッツ	800	713.00	570,400
ハローズ	1,000	3,260.00	3,260,000
フジオフードグループ本社	2,300	1,451.00	3,337,300
あみやき亭	500	3,695.00	1,847,500
ひらまつ	3,500	274.00	959,000
大黒天物産	600	5,380.00	3,228,000
ハニーズホールディングス	1,700	1,632.00	2,774,400
ファーマライズホールディングス	400	640.00	256,000
アルペン	1,700	2,030.00	3,451,000
ハブ	500	815.00	407,500

クオールホールディングス	2,900	1,193.00	3,459,700
ジンズホールディングス	1,200	3,060.00	3,672,000
ビックカメラ	11,200	1,126.00	12,611,200
D C Mホールディングス	12,800	1,355.00	17,344,000
M o n o t a R O	29,800	1,986.00	59,182,800
東京一番フーズ	400	500.00	200,000
D Dホールディングス	1,100	1,207.00	1,327,700
きちりホールディングス	400	910.00	364,000
アークランドサービスホールディングス	1,700	3,050.00	5,185,000
J . フロント リテイリング	26,100	1,440.00	37,584,000
ドトール・日レスホールディングス	3,700	2,139.00	7,914,300
マツキヨココカラ&カンパニー	12,700	7,320.00	92,964,000
ブロンコビリー	1,100	2,803.00	3,083,300
Z O Z O	13,900	3,080.00	42,812,000
トレジャー・ファクトリー	1,000	1,718.00	1,718,000
物語コーポレーション	3,500	3,075.00	10,762,500
三越伊勢丹ホールディングス	35,400	1,494.00	52,887,600
H a m e e	700	993.00	695,100
マーケットエンタープライズ	200	1,377.00	275,400
ウエルシアホールディングス	10,900	2,947.00	32,122,300
クリエイトS Dホールディングス	3,500	3,435.00	12,022,500
丸善C H Iホールディングス	1,900	362.00	687,800
ミサワ	300	621.00	186,300
ティーライフ	200	1,363.00	272,600
エー・ピーホールディングス	300	789.00	236,700
チムニー	500	1,347.00	673,500
シュッピン	1,600	999.00	1,598,400
オイシックス・ラ・大地	2,800	2,889.00	8,089,200
ネクステージ	4,800	2,358.00	11,318,400
ジョイフル本田	6,200	1,806.00	11,197,200
鳥貴族ホールディングス	800	2,392.00	1,913,600
ホットランド	1,600	1,644.00	2,630,400
すかいらーくホールディングス	28,700	1,892.00	54,300,400
S F Pホールディングス	1,100	2,057.00	2,262,700
綿半ホールディングス	1,600	1,385.00	2,216,000
ヨシックスホールディングス	300	2,182.00	654,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6,800	1,183.00	8,044,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	934.00	934,000

B E E N O S	900	1,964.00	1,767,600	
あさひ	1,800	1,312.00	2,361,600	
日本調剤	1,400	1,126.00	1,576,400	
コスモス薬品	2,100	14,470.00	30,387,000	
トーエル	700	757.00	529,900	
セブン&アイ・ホールディングス	72,500	6,365.00	461,462,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディング グ	15,800	1,026.00	16,210,800	
ツルハホールディングス	4,400	9,030.00	39,732,000	
サンマルクホールディングス	1,700	1,953.00	3,320,100	
フェリシモ	400	1,020.00	408,000	
トリドールホールディングス	5,200	2,881.00	14,981,200	
T O K Y O B A S E	2,200	467.00	1,027,400	
ウイルプラスホールディングス	300	1,133.00	339,900	
J Mホールディングス	1,600	2,059.00	3,294,400	
サツドラホールディングス	700	817.00	571,900	
アレンザホールディングス	1,600	1,001.00	1,601,600	
串カツ田中ホールディングス	600	1,722.00	1,033,200	
バロックジャパンリミテッド	1,400	862.00	1,206,800	
クスリのアオキホールディングス	1,900	6,550.00	12,445,000	
力の源ホールディングス	900	1,645.00	1,480,500	
F O O D & L I F E C O M P A N I E	11,200	3,435.00	38,472,000	
メディカルシステムネットワーク	1,800	397.00	714,600	
一家ホールディングス	400	633.00	253,200	
ジャパクラフトホールディングス	500	571.00	285,500	
はるやまホールディングス	700	536.00	375,200	
ノジマ	6,900	1,509.00	10,412,100	
カッパ・クリエイト	3,300	1,553.00	5,124,900	
ライトオン	1,200	589.00	706,800	
良品計画	23,000	1,438.00	33,074,000	
パリミキホールディングス	2,000	332.00	664,000	
アドヴァングループ	2,000	978.00	1,956,000	
アルビス	700	2,486.00	1,740,200	
コナカ	1,800	365.00	657,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,623.00	324,600	
G - 7 ホールディングス	2,600	1,423.00	3,699,800	
イオン北海道	3,100	833.00	2,582,300	
コジマ	3,500	567.00	1,984,500	

ヒマラヤ	500	956.00	478,000
コーナン商事	2,800	3,725.00	10,430,000
エコス	800	1,891.00	1,512,800
ワタミ	2,500	960.00	2,400,000
マルシェ	500	424.00	212,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホ	42,400	2,609.00	110,621,600
西松屋チェーン	4,700	1,696.00	7,971,200
ゼンショーホールディングス	11,500	5,130.00	58,995,000
幸楽苑ホールディングス	1,400	1,080.00	1,512,000
ハークスレイ	600	732.00	439,200
サイゼリヤ	3,100	3,560.00	11,036,000
V Tホールディングス	8,000	544.00	4,352,000
魚力	700	2,195.00	1,536,500
ボブラ	400	254.00	101,600
フジ・コーポレーション	1,200	1,344.00	1,612,800
ユナイテッドアローズ	2,200	2,387.00	5,251,400
ハイデイ日高	3,100	2,372.00	7,353,200
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	1,000	200.00	200,000
コロワイド	9,700	2,147.00	20,825,900
ピーシーデポコーポレーション	2,300	301.00	692,300
壱番屋	1,700	5,380.00	9,146,000
トップカルチャー	500	196.00	98,000
P L A N T	400	724.00	289,600
スギホールディングス	4,200	5,770.00	24,234,000
薬王堂ホールディングス	1,200	2,467.00	2,960,400
スクロール	3,100	900.00	2,790,000
ヨンドシーホールディングス	1,800	1,807.00	3,252,600
木曽路	3,200	2,468.00	7,897,600
S R S ホールディングス	3,500	1,025.00	3,587,500
千趣会	3,900	425.00	1,657,500
タカキュー	1,100	78.00	85,800
リテールパートナーズ	3,100	1,600.00	4,960,000
ケーヨー	3,400	833.00	2,832,200
上新電機	1,900	1,948.00	3,701,200
日本瓦斯	11,300	2,038.00	23,029,400
ロイヤルホールディングス	4,100	2,868.00	11,758,800
東天紅	100	764.00	76,400

いなげや	2,000	1,478.00	2,956,000
チヨダ	2,000	868.00	1,736,000
ライフコーポレーション	1,800	3,060.00	5,508,000
リンガーハット	2,700	2,450.00	6,615,000
MrMaxHD	2,900	631.00	1,829,900
テンアライド	1,800	263.00	473,400
AOKIホールディングス	3,900	877.00	3,420,300
オークワ	3,400	904.00	3,073,600
コメリ	3,200	3,085.00	9,872,000
青山商事	4,500	1,118.00	5,031,000
しまむら	2,500	12,700.00	31,750,000
はせがわ	800	342.00	273,600
高島屋	15,900	1,991.00	31,656,900
松屋	3,600	1,187.00	4,273,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	10,200	1,569.00	16,003,800
近鉄百貨店	900	2,538.00	2,284,200
丸井グループ	15,500	2,434.00	37,727,000
アクシアル リテイリング	1,400	3,440.00	4,816,000
井筒屋	800	328.00	262,400
イオン	71,300	2,803.00	199,853,900
イズミ	3,200	3,300.00	10,560,000
平和堂	3,500	2,113.00	7,395,500
フジ	3,200	1,792.00	5,734,400
ヤオコー	2,400	7,470.00	17,928,000
ゼビオホールディングス	2,800	1,195.00	3,346,000
ケースホールディングス	14,900	1,295.00	19,295,500
Olympicグループ	600	540.00	324,000
日産東京販売ホールディングス	2,100	344.00	722,400
シルバーライフ	400	1,280.00	512,000
Genky DrugStores	900	4,000.00	3,600,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	968.00	290,400
ブックオフグループホールディングス	1,100	1,345.00	1,479,500
ギフトホールディングス	400	5,120.00	2,048,000
アインホールディングス	2,900	5,640.00	16,356,000
元気寿司	600	3,320.00	1,992,000
ヤマダホールディングス	86,200	438.00	37,755,600
アークランズ	3,100	1,638.00	5,077,800
ニトリホールディングス	8,500	18,880.00	160,480,000
グルメ杵屋	1,700	1,087.00	1,847,900

愛眼	1,200	171.00	205,200	
ケーユーホールディングス	1,200	1,423.00	1,707,600	
吉野家ホールディングス	8,200	2,580.00	21,156,000	
松屋フーズホールディングス	1,000	4,215.00	4,215,000	
サガミホールディングス	3,400	1,342.00	4,562,800	
関西フードマーケット	1,900	1,676.00	3,184,400	
王将フードサービス	1,400	6,290.00	8,806,000	
ミニストップ	1,500	1,456.00	2,184,000	
アークス	3,900	2,551.00	9,948,900	
バローホールディングス	4,000	2,100.00	8,400,000	
ベルク	1,000	6,290.00	6,290,000	
大庄	900	1,152.00	1,036,800	
ファーストリテイリング	9,500	31,950.00	303,525,000	
サンドラッグ	8,000	3,860.00	30,880,000	
サックスパー ホールディングス	2,000	987.00	1,974,000	
ヤマザワ	300	1,300.00	390,000	
やまや	300	2,748.00	824,400	
ベルーナ	5,100	766.00	3,906,600	
いよぎんホールディングス	23,300	783.00	18,243,900	
しずおかフィナンシャルグループ	44,200	1,046.00	46,233,200	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	16,500	904.00	14,916,000	
島根銀行	500	489.00	244,500	
じもとホールディングス	1,300	397.00	516,100	
めぶきフィナンシャルグループ	97,100	348.00	33,790,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,500	2,989.00	7,472,500	
九州フィナンシャルグループ	34,400	510.00	17,544,000	
ゆうちょ銀行	54,800	1,073.00	58,800,400	
富山第一銀行	6,500	630.00	4,095,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	107,900	524.00	56,539,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	12,100	1,106.00	13,382,600	
三十三フィナンシャルグループ	1,800	1,559.00	2,806,200	
第四北越フィナンシャルグループ	3,100	3,065.00	9,501,500	
ひろぎんホールディングス	25,500	734.00	18,717,000	
おきなわフィナンシャルグループ	1,900	2,190.00	4,161,000	
十六フィナンシャルグループ	2,500	3,110.00	7,775,000	
北國フィナンシャルホールディングス	2,200	4,845.00	10,659,000	
プロクレアホールディングス	2,400	2,144.00	5,145,600	
あいちフィナンシャルグループ	2,700	2,208.00	5,961,600	
S B I 新生銀行	4,600	2,806.00	12,907,600	

あおぞら銀行	12,300	2,488.00	30,602,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,225,700	884.90	1,084,621,930
りそなホールディングス	247,400	650.20	160,859,480
三井住友トラスト・ホールディングス	35,600	5,065.00	180,314,000
三井住友フィナンシャルグループ	143,000	5,801.00	829,543,000
千葉銀行	54,500	902.00	49,159,000
群馬銀行	38,000	499.00	18,962,000
武蔵野銀行	2,500	2,260.00	5,650,000
千葉興業銀行	3,600	500.00	1,800,000
筑波銀行	8,600	203.00	1,745,800
七十七銀行	6,300	2,331.00	14,685,300
秋田銀行	1,300	1,707.00	2,219,100
山形銀行	2,200	1,076.00	2,367,200
岩手銀行	1,300	2,117.00	2,752,100
東邦銀行	15,500	226.00	3,503,000
東北銀行	700	999.00	699,300
ふくおかフィナンシャルグループ	15,600	2,585.00	40,326,000
スルガ銀行	17,300	480.00	8,304,000
八十二銀行	40,100	601.00	24,100,100
山梨中央銀行	2,000	1,111.00	2,222,000
大垣共立銀行	3,700	1,864.00	6,896,800
福井銀行	1,700	1,480.00	2,516,000
清水銀行	800	1,454.00	1,163,200
富山銀行	200	1,631.00	326,200
滋賀銀行	3,300	2,759.00	9,104,700
南都銀行	2,900	2,411.00	6,991,900
百五銀行	18,400	399.00	7,341,600
京都銀行	6,200	6,820.00	42,284,000
紀陽銀行	7,000	1,618.00	11,326,000
ほくほくフィナンシャルグループ	12,400	1,071.00	13,280,400
山陰合同銀行	12,200	792.00	9,662,400
鳥取銀行	500	1,174.00	587,000
百十四銀行	1,800	1,827.00	3,288,600
四国銀行	3,100	856.00	2,653,600
阿波銀行	2,700	2,072.00	5,594,400
大分銀行	1,200	2,060.00	2,472,000
宮崎銀行	1,300	2,332.00	3,031,600
佐賀銀行	1,100	1,666.00	1,832,600
琉球銀行	4,500	918.00	4,131,000

セブン銀行	70,100	277.00	19,417,700
みずほフィナンシャルグループ	283,000	2,021.50	572,084,500
高知銀行	500	672.00	336,000
山口フィナンシャルグループ	21,600	908.00	19,612,800
長野銀行	500	1,519.00	759,500
名古屋銀行	1,300	3,440.00	4,472,000
北洋銀行	29,700	290.00	8,613,000
大光銀行	500	1,104.00	552,000
愛媛銀行	2,600	826.00	2,147,600
トマト銀行	500	1,026.00	513,000
京葉銀行	9,000	565.00	5,085,000
栃木銀行	9,000	251.00	2,259,000
北日本銀行	700	2,038.00	1,426,600
東和銀行	3,600	528.00	1,900,800
福島銀行	1,600	224.00	358,400
大東銀行	600	634.00	380,400
トモニホールディングス	15,800	373.00	5,893,400
フィデアホールディングス	2,000	1,311.00	2,622,000
池田泉州ホールディングス	25,100	236.00	5,923,600
F P G	6,600	1,119.00	7,385,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,600	1,119.00	1,790,400
マーキュリアホールディングス	900	688.00	619,200
S B Iホールディングス	28,300	2,714.00	76,806,200
日本アジア投資	1,200	251.00	301,200
ジャフコ グループ	6,500	1,734.00	11,271,000
大和証券グループ本社	139,900	634.00	88,696,600
野村ホールディングス	360,400	497.00	179,118,800
岡三証券グループ	17,200	428.00	7,361,600
丸三証券	6,500	413.00	2,684,500
東洋証券	6,500	338.00	2,197,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,300	361.00	7,689,300
光世証券	300	410.00	123,000
水戸証券	5,300	295.00	1,563,500
いちよし証券	3,600	589.00	2,120,400
松井証券	11,600	775.00	8,990,000
マネックスグループ	21,100	499.00	10,528,900
極東証券	2,400	615.00	1,476,000
岩井コスモホールディングス	2,200	1,329.00	2,923,800

アイザワ証券グループ	2,800	740.00	2,072,000
マネーパートナーズグループ	1,600	259.00	414,400
スパークス・グループ	2,200	1,409.00	3,099,800
小林洋行	700	240.00	168,000
かんぽ生命保険	23,800	2,290.00	54,502,000
S O M P Oホールディングス	33,600	5,848.00	196,492,800
アニコム ホールディングス	6,600	538.00	3,550,800
M S & A Dインシュアランスグループホール	39,800	4,625.00	184,075,000
第一生命ホールディングス	95,600	2,628.00	251,236,800
東京海上ホールディングス	193,400	2,815.00	544,421,000
T & Dホールディングス	52,500	1,793.00	94,132,500
アドバンスクリエイト	1,100	1,113.00	1,224,300
全国保証	5,100	5,120.00	26,112,000
あんしん保証	700	332.00	232,400
ジェイリース	500	2,149.00	1,074,500
イントラスト	600	1,036.00	621,600
日本モーゲージサービス	800	586.00	468,800
C a s a	600	862.00	517,200
アルヒ	2,400	1,012.00	2,428,800
プレミアグループ	3,300	1,611.00	5,316,300
ネットプロテクションズホールディングス	6,500	537.00	3,490,500
クレディセゾン	12,400	1,942.00	24,080,800
芙蓉総合リース	1,800	10,040.00	18,072,000
みずほリース	2,900	4,240.00	12,296,000
東京センチュリー	3,700	5,010.00	18,537,000
日本証券金融	7,800	1,059.00	8,260,200
アイフル	32,400	359.00	11,631,600
リコーリース	1,900	4,055.00	7,704,500
イオンフィナンシャルサービス	11,200	1,225.00	13,720,000
アコム	34,900	328.00	11,447,200
ジャックス	2,100	4,650.00	9,765,000
オリエントコーポレーション	5,100	1,130.00	5,763,000
オリックス	128,500	2,379.50	305,765,750
三菱H C キャピタル	76,300	735.00	56,080,500
九州リースサービス	700	802.00	561,400
日本取引所グループ	55,000	2,235.00	122,925,000
イー・ギャランティ	3,200	2,082.00	6,662,400
アサックス	700	641.00	448,700

NECキャピタルソリューション	1,000	2,864.00	2,864,000	
大東建託	7,200	13,400.00	96,480,000	
いちご	22,500	248.00	5,580,000	
日本駐車場開発	20,700	245.00	5,071,500	
スター・マイカ・ホールディングス	1,800	648.00	1,166,400	
SREホールディングス	1,000	3,900.00	3,900,000	
ADワークスグループ	3,800	190.00	722,000	
ヒューリック	45,700	1,191.00	54,428,700	
三栄建築設計	900	1,490.00	1,341,000	
野村不動産ホールディングス	12,200	3,390.00	41,358,000	
三重交通グループホールディングス	4,200	569.00	2,389,800	
サムティ	3,100	2,205.00	6,835,500	
ディア・ライフ	3,300	728.00	2,402,400	
コーセーアールイー	500	778.00	389,000	
地主	1,500	1,937.00	2,905,500	
プレサンスコーポレーション	3,100	2,047.00	6,345,700	
ハウスコム	200	1,050.00	210,000	
JPMC	1,000	1,145.00	1,145,000	
サンセイランディック	400	902.00	360,800	
エストラスト	200	633.00	126,600	
フージャースホールディングス	3,000	908.00	2,724,000	
オープンハウスグループ	7,200	5,720.00	41,184,000	
東急不動産ホールディングス	58,800	754.00	44,335,200	
飯田グループホールディングス	17,100	2,473.00	42,288,300	
イーランド	200	1,479.00	295,800	
ムゲンエステート	1,000	668.00	668,000	
ビーロッド	1,000	617.00	617,000	
ファーストブラザーズ	300	908.00	272,400	
And Doホールディングス	1,200	1,065.00	1,278,000	
シーアールイー	1,100	1,298.00	1,427,800	
プロパティエージェント	200	1,041.00	208,200	
ケイアイスター不動産	900	4,640.00	4,176,000	
アグレ都市デザイン	300	1,559.00	467,700	
グッドコムアセット	1,800	803.00	1,445,400	
ジェイ・エス・ビー	500	4,325.00	2,162,500	
ロードスターキャピタル	1,100	1,412.00	1,553,200	
テンボイノベーション	500	1,117.00	558,500	
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,147.00	344,100	
フェイスネットワーク	400	812.00	324,800	

パーク24	15,300	2,174.00	33,262,200
パラカ	700	1,972.00	1,380,400
三井不動産	84,600	2,669.50	225,839,700
三菱地所	118,100	1,643.00	194,038,300
平和不動産	3,200	3,925.00	12,560,000
東京建物	18,700	1,751.00	32,743,700
京阪神ビルディング	3,300	1,141.00	3,765,300
住友不動産	35,400	3,241.00	114,731,400
テーオーシー	3,500	643.00	2,250,500
東京楽天地	300	4,280.00	1,284,000
レオパレス21	22,000	332.00	7,304,000
スターツコーポレーション	2,800	2,691.00	7,534,800
フジ住宅	2,700	708.00	1,911,600
空港施設	2,400	562.00	1,348,800
明和地所	700	888.00	621,600
ゴールドクレスト	1,900	1,730.00	3,287,000
エスリード	900	2,318.00	2,086,200
日神グループホールディングス	3,100	463.00	1,435,300
日本エスコン	4,400	867.00	3,814,800
MIRARTHホールディングス	9,900	386.00	3,821,400
AVANTIA	900	847.00	762,300
イオンモール	10,100	1,858.00	18,765,800
毎日コムネット	600	822.00	493,200
ファースト住建	600	1,103.00	661,800
カチタス	5,300	2,696.00	14,288,800
トーセイ	3,300	1,613.00	5,322,900
穴吹興産	300	2,371.00	711,300
サンフロンティア不動産	3,300	1,299.00	4,286,700
FJネクストホールディングス	2,100	1,020.00	2,142,000
インテリックス	400	569.00	227,600
ランドビジネス	600	286.00	171,600
サンネクスタグループ	400	1,016.00	406,400
グランディハウス	1,300	563.00	731,900
日本空港ビルデング	6,900	6,830.00	47,127,000
明豊ファシリティワークス	800	756.00	604,800
日本工営	1,200	3,800.00	4,560,000
LIFULL	7,000	237.00	1,659,000
MIXI	4,700	2,931.00	13,775,700
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	2,518.00	4,532,400

日本M & Aセンターホールディングス	35,100	1,014.00	35,591,400	
メンバーズ	600	1,423.00	853,800	
中広	200	398.00	79,600	
UTグループ	3,000	2,706.00	8,118,000	
アイティメディア	800	1,297.00	1,037,600	
E・Jホールディングス	1,200	1,580.00	1,896,000	
オープンアップグループ	6,100	1,925.00	11,742,500	
コシダカホールディングス	6,100	1,133.00	6,911,300	
アルトナー	400	1,441.00	576,400	
パソナグループ	2,500	1,860.00	4,650,000	
CDS	400	1,821.00	728,400	
リンクアンドモチベーション	5,900	452.00	2,666,800	
エス・エム・エス	7,800	3,075.00	23,985,000	
サニーサイドアップグループ	500	727.00	363,500	
パーソルホールディングス	22,900	2,872.00	65,768,800	
リニカル	900	709.00	638,100	
クックパッド	5,600	185.00	1,036,000	
エスクリ	600	401.00	240,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	658.00	526,400	
学情	900	1,652.00	1,486,800	
スタジオアリス	1,000	2,186.00	2,186,000	
シミックホールディングス	1,000	2,050.00	2,050,000	
エプロ	300	745.00	223,500	
NJS	400	2,336.00	934,400	
総合警備保障	7,600	3,950.00	30,020,000	
カカクコム	15,000	2,042.00	30,630,000	
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	587.00	176,100	
ルネサンス	1,400	932.00	1,304,800	
ディップ	3,600	3,415.00	12,294,000	
デジタルホールディングス	1,600	1,066.00	1,705,600	
新日本科学	2,200	2,320.00	5,104,000	
キャリアデザインセンター	300	1,641.00	492,300	
ベネフィット・ワン	9,500	1,717.00	16,311,500	
エムスリー	40,400	3,080.00	124,432,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	420.00	420,000	
プラス	200	1,120.00	224,000	
アウトソーシング	12,200	1,409.00	17,189,800	
ウェルネット	1,200	627.00	752,400	

ワールドホールディングス	900	2,955.00	2,659,500	
ディー・エヌ・エー	8,200	2,026.00	16,613,200	
博報堂D Yホールディングス	26,100	1,561.00	40,742,100	
ぐるなび	3,800	374.00	1,421,200	
タカミヤ	2,800	490.00	1,372,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	782.00	782,000	
ファンコミュニケーションズ	4,000	415.00	1,660,000	
ライク	800	1,846.00	1,476,800	
ビジネス・ブレークスルー	600	430.00	258,000	
エスプール	5,900	624.00	3,681,600	
WDBホールディングス	1,000	2,106.00	2,106,000	
ティア	900	439.00	395,100	
CDG	200	1,345.00	269,000	
アドウェイズ	2,800	694.00	1,943,200	
バリューコマース	1,500	1,404.00	2,106,000	
インフォマート	21,200	300.00	6,360,000	
J Pホールディングス	5,900	325.00	1,917,500	
CLホールディングス	600	885.00	531,000	
プレステージ・インターナショナル	8,600	597.00	5,134,200	
アミューズ	1,100	1,868.00	2,054,800	
ドリームインキュベータ	600	2,467.00	1,480,200	
クイック	1,600	2,043.00	3,268,800	
TAC	800	204.00	163,200	
電通グループ	20,100	4,960.00	99,696,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,092.00	546,000	
ぴあ	700	3,465.00	2,425,500	
イオンファンタジー	900	3,560.00	3,204,000	
シーティーエス	2,300	740.00	1,702,000	
ネクシィーズグループ	500	669.00	334,500	
H . U . グループホールディングス	6,000	2,730.00	16,380,000	
アルプス技研	1,800	2,699.00	4,858,200	
日本空調サービス	2,200	748.00	1,645,600	
オリエンタルランド	108,100	5,125.00	554,012,500	
ダスキン	4,500	3,445.00	15,502,500	
明光ネットワークジャパン	2,500	655.00	1,637,500	
ファルコホールディングス	900	2,023.00	1,820,700	
秀英予備校	300	409.00	122,700	
ラウンドワン	17,100	623.00	10,653,300	
リゾートトラスト	8,100	2,274.00	18,419,400	

ビー・エム・エル	2,500	3,105.00	7,762,500	
りらいあコミュニケーションズ	3,400	1,461.00	4,967,400	
リソー教育	9,300	284.00	2,641,200	
早稲田アカデミー	1,100	1,477.00	1,624,700	
ユー・エス・エス	21,000	2,370.00	49,770,000	
東京個別指導学院	2,400	541.00	1,298,400	
サイバーエージェント	45,100	1,160.00	52,316,000	
楽天グループ	94,700	643.00	60,892,100	
クリーク・アンド・リバー社	1,200	2,099.00	2,518,800	
SBIグローバルアセットマネジメント	3,300	503.00	1,659,900	
テー・オー・ダブリュー	4,000	336.00	1,344,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,743.00	1,743,000	
セントラルスポーツ	800	2,583.00	2,066,400	
フルキャストホールディングス	1,900	2,440.00	4,636,000	
エン・ジャパン	3,700	2,425.00	8,972,500	
リソルホールディングス	100	4,845.00	484,500	
テクノプロ・ホールディングス	12,100	3,260.00	39,446,000	
アトラグループ	400	183.00	73,200	
インターワークス	400	360.00	144,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	1,883.00	2,071,300	
Keepers 技研	1,300	5,920.00	7,696,000	
ファーストロジック	200	871.00	174,200	
三機サービス	200	1,152.00	230,400	
Gunosy	1,600	581.00	929,600	
デザインワン・ジャパン	400	177.00	70,800	
イー・ガーディアン	800	2,151.00	1,720,800	
リブセンス	700	294.00	205,800	
ジャパンマテリアル	6,300	1,829.00	11,522,700	
ベクトル	3,200	1,314.00	4,204,800	
ウチヤマホールディングス	700	296.00	207,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,700	1,116.00	1,897,200	
キャリアリンク	700	2,632.00	1,842,400	
IBJ	1,200	701.00	841,200	
アサンテ	1,000	1,653.00	1,653,000	
バリューHR	1,800	1,506.00	2,710,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	3,280.00	5,576,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,100.00	770,000	
ERIホールディングス	400	1,381.00	552,400	
アビスト	200	3,085.00	617,000	

シグマックス・ホールディングス	3,100	1,233.00	3,822,300
ウィルグループ	1,700	1,034.00	1,757,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,700	146.00	248,200
メドピア	1,800	1,163.00	2,093,400
レアジョブ	300	1,213.00	363,900
リクルートホールディングス	151,200	3,876.00	586,051,200
エラン	2,700	1,017.00	2,745,900
土木管理総合試験所	700	345.00	241,500
日本郵政	267,700	1,139.00	304,910,300
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,393.00	3,761,100
鎌倉新書	2,300	907.00	2,086,100
S MN	400	469.00	187,600
一蔵	200	534.00	106,800
グローバルキッズCOMPANY	300	666.00	199,800
エアトリ	1,500	2,687.00	4,030,500
アトラエ	1,200	850.00	1,020,000
ストライク	900	3,635.00	3,271,500
ソラスト	5,600	639.00	3,578,400
セラク	600	1,616.00	969,600
インソース	4,400	1,317.00	5,794,800
ベイカレント・コンサルティング	16,200	5,330.00	86,346,000
Orchestra Holdings	400	1,563.00	625,200
アイモバイル	900	1,324.00	1,191,600
キャリアインデックス	500	328.00	164,000
MS - Japan	500	1,042.00	521,000
船場	300	729.00	218,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングン	7,300	2,023.00	14,767,900
フルテック	200	1,120.00	224,000
グリーンズ	500	1,425.00	712,500
ツナググループ・ホールディングス	400	715.00	286,000
GameWith	500	357.00	178,500
MS&Consulting	200	608.00	121,600
ウェルビー	1,500	706.00	1,059,000
エル・ティー・エス	300	2,803.00	840,900
ミダックホールディングス	1,200	2,103.00	2,523,600
日総工産	1,500	830.00	1,245,000
キュービーネットホールディングス	1,000	1,444.00	1,444,000
RPAホールディングス	2,800	371.00	1,038,800

スプリックス	500	926.00	463,000
マネジメントソリューションズ	1,100	3,230.00	3,553,000
プロレド・パートナーズ	500	505.00	252,500
and factory	500	378.00	189,000
テノ・ホールディングス	200	704.00	140,800
フロンティア・マネジメント	700	1,066.00	746,200
ピアラ	300	531.00	159,300
コプロ・ホールディングス	300	1,430.00	429,000
ギークス	200	942.00	188,400
アンビスホールディングス	2,200	2,864.00	6,300,800
カーブスホールディングス	5,600	790.00	4,424,000
フォーラムエンジニアリング	1,200	1,004.00	1,204,800
Fast Fitness Japan	700	1,801.00	1,260,700
ダイレクトマーケティングミックス	2,400	1,362.00	3,268,800
ポピンズ	300	1,743.00	522,900
LITALICO	1,600	2,679.00	4,286,400
アドバンテッジリスクマネジメント	700	522.00	365,400
リログループ	11,400	2,021.00	23,039,400
東祥	1,400	1,242.00	1,738,800
ビーウィズ	500	2,011.00	1,005,500
TREホールディングス	4,300	1,200.00	5,160,000
人・夢・技術グループ	800	1,495.00	1,196,000
大栄環境	5,200	2,031.00	10,561,200
日本管財ホールディングス	2,100	2,722.00	5,716,200
エイチ・アイ・エス	5,300	1,994.00	10,568,200
ラックランド	800	3,195.00	2,556,000
共立メンテナンス	3,500	5,370.00	18,795,000
イチネンホールディングス	2,200	1,341.00	2,950,200
建設技術研究所	1,100	3,530.00	3,883,000
スペース	1,500	1,052.00	1,578,000
燦ホールディングス	900	2,233.00	2,009,700
スバル興業	100	9,620.00	962,000
東京テアトル	600	1,147.00	688,200
タナベコンサルティンググループ	600	888.00	532,800
ナガワ	500	6,590.00	3,295,000
東京都競馬	1,700	4,235.00	7,199,500
常磐興産	500	1,277.00	638,500
カナモト	3,700	2,226.00	8,236,200
ニシオホールディングス	1,900	3,225.00	6,127,500

	トランス・コスモス	2,500	3,320.00	8,300,000	
	乃村工藝社	8,900	941.00	8,374,900	
	藤田観光	900	3,745.00	3,370,500	
	KNT-CTホールディングス	1,200	1,513.00	1,815,600	
	トーカイ	1,800	1,995.00	3,591,000	
	白洋舎	200	2,376.00	475,200	
	セコム	20,800	9,234.00	192,067,200	
	セントラル警備保障	1,100	2,788.00	3,066,800	
	丹青社	4,000	809.00	3,236,000	
	メイテック	8,000	2,295.00	18,360,000	
	応用地質	1,900	2,022.00	3,841,800	
	船井総研ホールディングス	4,300	2,533.00	10,891,900	
	進学会ホールディングス	500	295.00	147,500	
	オオバ	1,000	776.00	776,000	
	いであ	400	1,628.00	651,200	
	学究社	800	2,257.00	1,805,600	
	ベネッセホールディングス	7,600	1,933.00	14,690,800	
	イオンディライト	2,300	3,055.00	7,026,500	
	ナック	900	967.00	870,300	
	ダイセキ	4,200	4,080.00	17,136,000	
	ステップ	700	1,831.00	1,281,700	
小計	銘柄数：2,142 組入時価比率：98.1%			60,104,347,780 100.0%	
合計				60,104,347,780	

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

（2023年6月末現在）

日立国内株式インデックスファンド

資産総額	28,858,322,502 円
負債総額	78,873,308 円
純資産総額（ - ）	28,779,449,194 円
発行済口数	9,027,155,614 口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1881 円
（1万口当たり純資産額）	（31,881 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	65,766,189,700 円
負債総額	162,006,631 円
純資産総額（ - ）	65,604,183,069 円
発行済口数	24,639,839,269 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6625 円
（1万口当たり純資産額）	（26,625 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（2023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。

2023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、18本であり、その純資産総額の合計は798,332百万円です。（なお、親投資信託16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	198,965
	私募	11	599,367
合計		18	798,332

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（2022年4月1日から2023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23期 (2022年3月31日現在)		第24期 (2023年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		1,029		998
未収委託者報酬		305,266		297,681
未収運用受託報酬		40		40
関係会社預け金	2	1,410,735	2	1,552,333
前払費用		32,649		34,850
その他		257		715
流動資産合計		1,749,979		1,886,620
固定資産				
有形固定資産				
建物		-	1	29,516
工具器具備品		-	1	2,207
有形固定資産合計		-		31,724
無形固定資産				
ソフトウェア		570		394
無形固定資産合計		570		394
投資その他の資産				
敷金		16,545		-
繰延税金資産		52,415		61,919
投資その他の資産合計		68,960		61,919
固定資産合計		69,530		94,038
資産合計		1,819,509		1,980,658

（単位：千円）

	第23期 （2022年3月31日現在）		第24期 （2023年3月31日現在）			
負債の部						
流動負債						
未払金	2	4	62,192	2	4	66,693
未払費用	2		424,210	2		453,526
未払法人税等	3		2,518	3		27,030
預り金			4,464			4,763
賞与引当金			28,857			29,132
流動負債合計			522,244			581,145
固定負債						
退職給付引当金			124,570			131,929
資産除去債務			-			15,439
固定負債合計			124,570			147,368
負債合計			646,814			728,514
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			797,695			877,144
利益剰余金合計			872,695			952,144
株主資本合計			1,172,695			1,252,144
純資産合計			1,172,695			1,252,144
負債純資産合計			1,819,509			1,980,658

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第23期 （ 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日 ）	第24期 （ 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日 ）
営業収益		
委託者報酬	1,064,526	1,222,061
運用受託報酬	445,247	434,930
営業収益計	1,509,773	1,656,991
営業費用		
支払手数料	717,337	808,196
委託計算費	52,644	68,497
調査費	245,818	263,958
営業雑経費		
通信費	2,034	1,808
印刷費	2,194	2,239
諸会費	3,409	3,536
営業雑経費計	7,639	7,585
営業費用計	1,023,440	1,148,237
一般管理費		
給料		
役員報酬	20,300	20,080
給料・手当	218,081	214,839
賞与	2,575	1,945
給料計	240,957	236,865
交際費	275	864
旅費交通費	57	177
租税公課	71	139
不動産賃借料	34,278	44,286
賞与引当金繰入額	57,714	58,264
退職給付費用	7,306	7,359
その他の人件費	41,745	41,816
その他の不動産関係費	11,531	5,232
減価償却費	175	2,301
諸雑費	7,103	8,462
一般管理費計	1 401,216	1 405,770
営業利益	85,116	102,983
営業外収益		
受取利息	835	772
為替差益	6	-
その他	44	297
営業外収益計	1 886	1 1,069
営業外費用		
為替差損	-	325
営業外費用合計	-	325
経常利益	86,002	103,727
特別利益		
移転補償金	-	3 13,281
特別損失		
事務過誤損失補填	3,272	-
税引前当期純利益	82,730	117,008

法人税等	2	26,176	2	47,063
法人税等調整額		1,581		9,503
法人税等合計		27,757		37,560
当期純利益		54,972		79,448

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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 準備金	利益剰余金			
		その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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 準備金	利益剰余金			
		その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		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	797,695	872,695	1,172,695	1,172,695
当 期 変 動 額								
当期純利益					79,448	79,448	79,448	79,448
当期変動額合計	-	-	-	-	79,448	79,448	79,448	79,448
当 期 末 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	877,144	952,144	1,252,144	1,252,144

重要な会計方針

1. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産 定額法を採用しております。 建物 15年、8年 工具器具備品 15年、10年</p> <p>(2)無形固定資産 定額法を採用しております。 自社利用ソフトウェア 5年</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第23期 (2022年3月31日現在)	第24期 (2023年3月31日現在)
-	1. 有形固定資産に係る減価償却累計額は、次のとおりであります。 建物 1,911千円 工具器具備品 214千円 減価償却累計額 2,125千円
2. 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. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 1,552,333千円 未払金 14,945千円
3. 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. 未払法人税等の内訳 未払法人税 16,563千円 未払事業税 7,531千円 未払住民税 1,985千円 未払事業所税 950千円
4. 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。	4. 消費税等の取扱い 同左

(損益計算書関係)

第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第24期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
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	1. 関係会社との取引高 一般管理費 63,785千円 営業外収益 772千円 特別利益 13,281千円
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
	3. 移転補償金 特別利益は、当社における本社事務所移転に伴う補償金であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
1. 発行済株式に関する事項 (1) 株式の種類 普通株式 (2) 当事業年度期首株式数 6,000株 (3) 当事業年度増加株式数 - (4) 当事業年度減少株式数 - (5) 当事業年度末株式数 6,000株 2. 自己株式に関する事項 - 3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項 - 4. 配当に関する事項 (1) 当事業年度中に行った剰余金の配当 - (2) 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 -	1. 発行済株式に関する事項 (1) 株式の種類 普通株式 (2) 当事業年度期首株式数 6,000株 (3) 当事業年度増加株式数 - (4) 当事業年度減少株式数 - (5) 当事業年度末株式数 6,000株 2. 自己株式に関する事項 - 3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項 - 4. 配当に関する事項 (1) 当事業年度中に行った剰余金の配当 - (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23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
1年内	1,425千円	- 千円
1年超	- 千円	- 千円
合計	1,425千円	- 千円

（金融商品関係）

前事業年度（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行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023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23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023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 124,570千円（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 131,929千円（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 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	(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 124,570 千円 退職給付費用 7,359 退職給付の支払額 - 退職給付債務の期末残高 131,929
(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	(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 131,929 千円 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 131,929 退職給付引当金 131,929 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 131,929
(3)退職給付費用 退職給付費用 7,306 千円	(3)退職給付費用 退職給付費用 7,359 千円

（税効果会計関係）

第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第24期 (自 2022年4月 1日 至 2023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;">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>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">313</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">277</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>	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		未払事業税	313		その他	277		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		<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;">11,255</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;">45,634</td> <td></td> </tr> <tr> <td>資産除去債務</td> <td style="text-align: right;">5,340</td> <td></td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">1,768</td> <td></td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">2,605</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">417</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;">67,020</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;">1,750</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;">1,750</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;">65,269</td> <td></td> </tr> <tr> <td>(繰延税金負債)</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>資産除去債務に対応する除去費用</td> <td style="text-align: right;">3,350</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,350</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;">61,919</td> <td></td> </tr> </table>	賞与引当金	11,255	千円	退職給付引当金	45,634		資産除去債務	5,340		未払社会保険料	1,768		未払事業税	2,605		その他	417		繰延税金資産小計	67,020		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	1,750		評価性引当額小計	1,750		繰延税金資産合計	65,269		(繰延税金負債)			資産除去債務に対応する除去費用	3,350		繰延税金負債合計	3,350		繰延税金資産合計	61,919	
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																																																																														
未払事業税	313																																																																														
その他	277																																																																														
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																																																																														
賞与引当金	11,255	千円																																																																													
退職給付引当金	45,634																																																																														
資産除去債務	5,340																																																																														
未払社会保険料	1,768																																																																														
未払事業税	2,605																																																																														
その他	417																																																																														
繰延税金資産小計	67,020																																																																														
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	1,750																																																																														
評価性引当額小計	1,750																																																																														
繰延税金資産合計	65,269																																																																														
(繰延税金負債)																																																																															
資産除去債務に対応する除去費用	3,350																																																																														
繰延税金負債合計	3,350																																																																														
繰延税金資産合計	61,919																																																																														
<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 style="width: 80%;"></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;">33.6</td> </tr> </table>		(%)	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	<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 style="width: 80%;"></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;">2.0</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">4.5</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">32.1</td> </tr> </table>		(%)	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	2.0	その他	4.5	税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.1																																																						
	(%)																																																																														
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																																																																														
	(%)																																																																														
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	2.0																																																																														
その他	4.5																																																																														
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.1																																																																														
	<p>3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理</p> <p>当社は、当事業年度よりグループ通算制度を適用しております。また「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。</p>																																																																														

（ストックオプション等関係）

第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023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23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023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23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第24期 (自 2022年4月 1日 至 2023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>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>なお、従来は、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を採用していましたが、本店移転に伴い敷金が発生していないため、資産除去債務を負債計上し、これに対応する除去費用を資産計上しています。</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いましたが、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>2. 当該資産除去債務の金額算定方法</p> <p>資産資産除去債務の金額の算定方法</p> <p>資産除去債務の金額は不動産賃貸借業者からの原状回復見積を鑑み、使用見込期間を15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: 70%;">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	<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: 70%;">期首残高</td> <td style="text-align: right;">9,420千円</td> </tr> <tr> <td>当会計期間の負担に属する 償却額</td> <td style="text-align: right;">1,989千円</td> </tr> <tr> <td>時の経過による調整額</td> <td style="text-align: right;">84千円</td> </tr> <tr> <td>資産除去債務の履行による 減少額</td> <td style="text-align: right;">11,410千円</td> </tr> <tr> <td>有形固定資産の取得に伴う 増加額</td> <td style="text-align: right;">15,354千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td style="text-align: right;">15,439千円</td> </tr> </table>	期首残高	9,420千円	当会計期間の負担に属する 償却額	1,989千円	時の経過による調整額	84千円	資産除去債務の履行による 減少額	11,410千円	有形固定資産の取得に伴う 増加額	15,354千円	期末残高	15,439千円
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																				
期首残高	9,420千円																				
当会計期間の負担に属する 償却額	1,989千円																				
時の経過による調整額	84千円																				
資産除去債務の履行による 減少額	11,410千円																				
有形固定資産の取得に伴う 増加額	15,354千円																				
期末残高	15,439千円																				

（収益認識に関する注記）

第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第24期 (自 2022年4月 1日 至 2023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。	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	セグメント																				
投資運用業	投資運用業																				
<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">主要な財又はサービスのライン</td> <td style="width: 20%; text-align: right;">100,000千円</td> </tr> <tr> <td>投資助言業務収益</td> <td></td> </tr> <tr> <td>投資一任業務収益</td> <td style="text-align: right;">345,247千円</td> </tr> <tr> <td>投信委託者報酬</td> <td style="text-align: right;">1,064,526千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">1,509,773千円</td> </tr> </table>	主要な財又はサービスのライン	100,000千円	投資助言業務収益		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	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">主要な財又はサービスのライン</td> <td style="width: 20%; text-align: right;">100,000千円</td> </tr> <tr> <td>投資助言業務収益</td> <td></td> </tr> <tr> <td>投資一任業務収益</td> <td style="text-align: right;">334,930千円</td> </tr> <tr> <td>投信委託者報酬</td> <td style="text-align: right;">1,222,061千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">1,656,991千円</td> </tr> </table>	主要な財又はサービスのライン	100,000千円	投資助言業務収益		投資一任業務収益	334,930千円	投信委託者報酬	1,222,061千円	合計	1,656,991千円
主要な財又はサービスのライン	100,000千円																				
投資助言業務収益																					
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																				
主要な財又はサービスのライン	100,000千円																				
投資助言業務収益																					
投資一任業務収益	334,930千円																				
投信委託者報酬	1,222,061千円																				
合計	1,656,991千円																				
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 <div style="text-align: right;">1,509,773千円</div>	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 <div style="text-align: right;">1,656,991千円</div>																				
合計	合計																				
1,509,773千円	1,656,991千円																				
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。	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。

(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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(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）	251,630
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	248,048

（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 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	(株)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）

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	(株)日立製作所	東京都千代田区	462,817 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、事務所賃借契約等	グループ通算制度の未払金	12,861	未払金	12,861
								預け金の利息	772	未収入金	-
								賃借料等の支払い	32,860		
								親会社に対する預け金の増加	1,853,884	関係会社預け金	1,552,333
								親会社に対する預け金の減少	1,712,286		
								移転補償金の受取り	13,281		

(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。

賃借料の支払：近隣の取引実勢に基づいて、交渉の上決定しております。

移転補償金：移転前の事務所の原状回復費用の一般的な取引条件に基づいた実際発生額を元に決定しております。

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（東証プライム市場、名証プレミアム市場に上場）

（1株当たり情報）

第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
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株当たり純資産額 208,690円72銭 1株当たり当期純利益 13,241円45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 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	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 79,448千円 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 79,448千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

（重要な後発事象）

第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第24期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
該当事項はありません。	同左

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（2023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。

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
す。）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	2022年 8月15日
有価証券報告書	2022年 8月15日
有価証券届出書の訂正届出書	2023年 2月10日
半期報告書	2023年 2月10日

独立監査人の監査報告書

2023年5月26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

大関 康広

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、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第24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2023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、継続企業的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。継続企業的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）XBRL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

2023年7月26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国内株式インデックスファンドの2022年5月17日から2023年5月15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、日立国内株式インデックスファンドの2023年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。