

【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】	2026年8月14日提出
【計算期間】	第25期(自 2025年5月16日至 2026年5月15日)
【ファンド名】	日立バランスファンド（株式70） 日立バランスファンド（株式50） 日立バランスファンド（株式30）
【発行者名】	日立投資顧問株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 宮崎 倫明
【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 小林 実貴男
【連絡場所】	東京都台東区東上野二丁目16番1号
【電話番号】	080-7784-4540
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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】

- ① ファンドの目的
内外株式および内外債券を実質的な主要投資対象として中長期的に信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。
- ② ファンドの基本的性格
- 1) 商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券)、資産配分固定型)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(資産複合)とが異なります。

<商品分類の定義>

1. 単位型投信・追加型投信の区分

- (1) 単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンドをいう。
- (2) 追加型投信：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なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

- (1) 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う。
- (2) 債券：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債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)：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不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産：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上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 独立した区分

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)：「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)：「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

<補足として使用する商品分類>

- (1) 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う。
- (2) 特殊型：目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

<属性区分の定義>

1. 投資対象資産による属性区分

(1) 株式

- ① 一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ② 大型株：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いう。
- ③ 中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- ① 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ② 公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③ 社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ④ その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ⑤ 格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信

これ以上の詳細な分類は行なわないものとする。

(4) その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- ① 資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ② 資産配分変型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2. 決算頻度による属性区分

- ① 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う。
- ② 年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- ③ 年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- ④ 年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- ⑤ 年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- ⑥ 日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- ⑦ その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

- ① グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

- ②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う。
- ③北米：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北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ④欧州：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欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑤アジア：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を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑥オセアニア：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オセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑦中南米：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中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑧アフリカ：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アフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑨中近東(中東)：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中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑩エマージング：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エマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
4. 投資形態による属性区分
- ①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う。
- ②ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
5. 為替ヘッジによる属性区分
- ①為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいう。
- ②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいう。
6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
- ①日経225
- ②TOPIX
- ③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。
7. 特殊型
- ①ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- ②条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- ③ロング・ショート型／絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- ④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

※上記は、一般社団法人資産運用業協会が定める分類方法に基づき記載しています。また、商品分類および属性区分の定義は一般社団法人資産運用業協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。なお、一般社団法人資産運用業協会のホームページ (<https://www.imaj.or.jp/>) でもご覧頂けます。

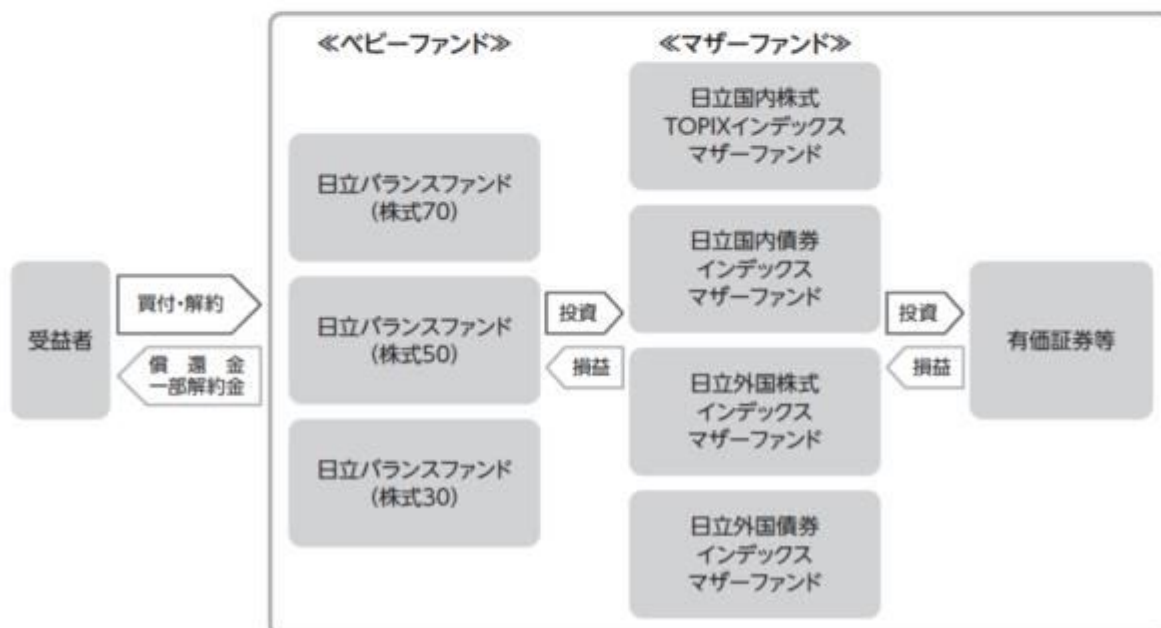
③ ファンドの特色

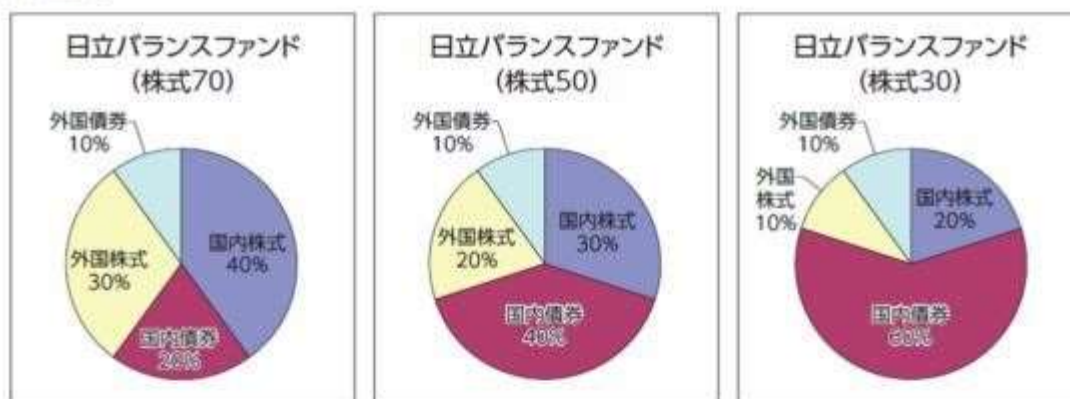
○ 確定拠出年金向けのファンドです。

各事業主が定める確定拠出年金に係る規約等に従い、加入者等は運用商品の配分の指定を運営管理機関に対して行います。その為、確定拠出年金に係る規約等に定めが無い場合は、当ファンドを購入することができません。

○ 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。



☐ 基本資産配分


基本資産配分に±5%の範囲で上限と下限を設け、その範囲内に制御します。

☐ ベンチマーク

当ファンドの運用にあたっては、以下のベンチマークを基に、各ファンドに定められた基本資産配分にしたがって委託者が計算する合成指数をベンチマークとします。

主な投資対象	マザーファンド名	ベンチマーク
国内株式	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)
国内債券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合 (ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合)
外国株式	日立外国株式 インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)
外国債券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

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

☐ 主な投資制限

投資制限の内容	上限		
	日立バランスファンド (株式70)	日立バランスファンド (株式50)	日立バランスファンド (株式30)
株式への実質投資割合	80%	60%	40%
外貨建資産への実質投資割合	50%	40%	30%

☐ 配分方針

収 益 分 配	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。
---------	--------------------------------

○ 日立国内株式TOPIXインデックス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。

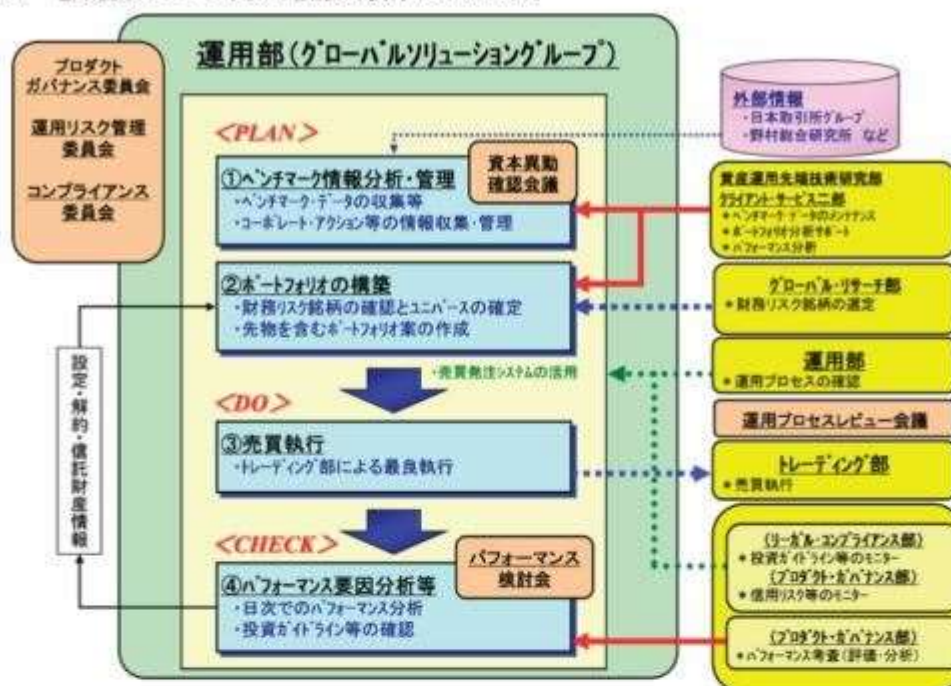
野村アセットマネジメント株式会社の概要

設立年月日：1959年12月1日

資本金：17,180百万円(2026年6月末現在)

事業内容：投資助言・代理業及び投資運用業に係る業務

運用のプロセスは、以下のとおりです。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。



○ 日立国内債券インデックス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。

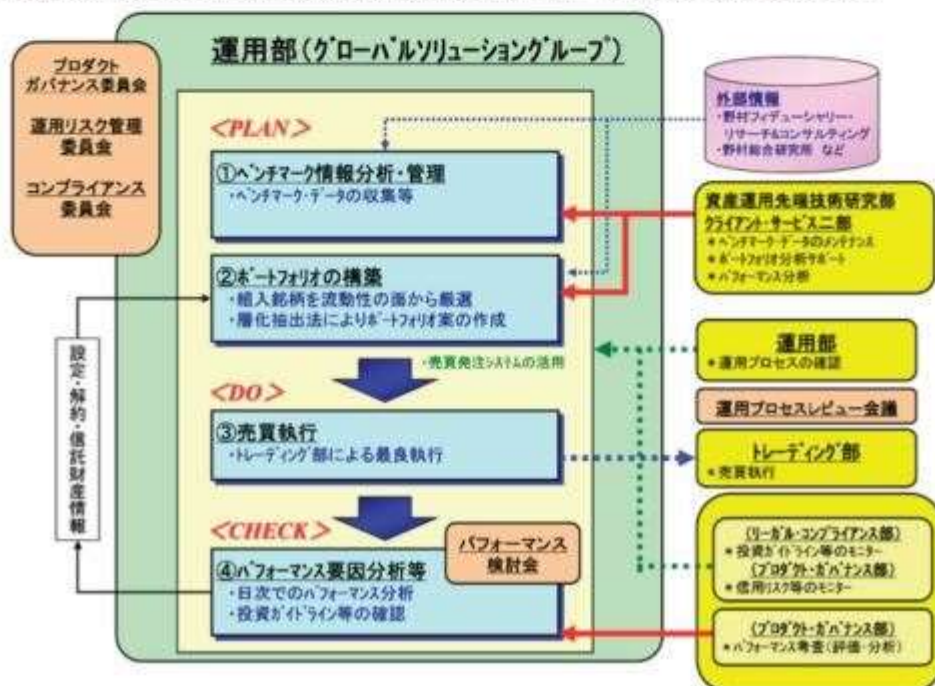
野村アセットマネジメント株式会社の概要

設立年月日：1959年12月1日

資本金：17,180百万円(2026年6月末現在)

事業内容：投資助言・代理業及び投資運用業に係る業務

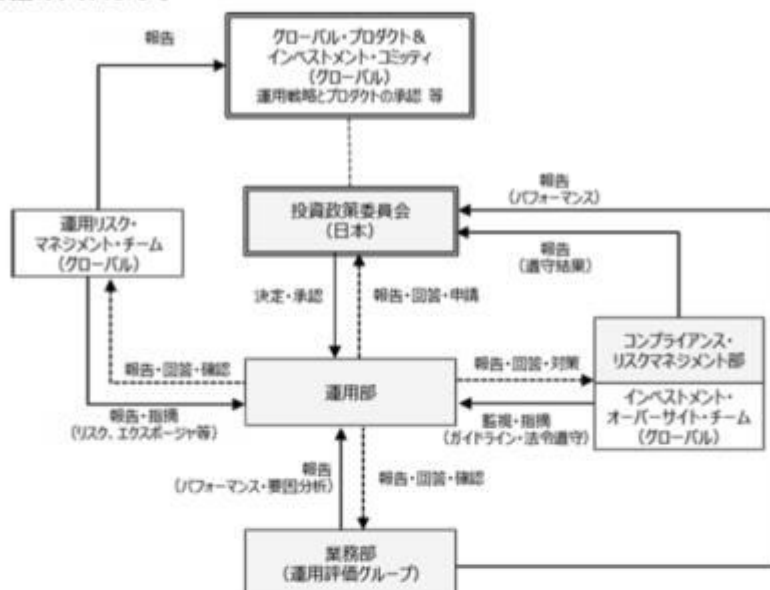
運用のプロセスは、以下のとおりです。ベンチマーク・データ、信託財産情報、追加設定・解約等の資金流入データ等を入手した後、層化抽出法の考え方に基いてポートフォリオを構築します。



- 日立外国株式インデックスマザーファンドの運用は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に委託します。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の概要	設立年月日：1998年2月25日 資本金：310百万円(2026年5月末現在) 事業内容：投資助言・代理業及び投資運用業に係る業務
---------------------------------	---

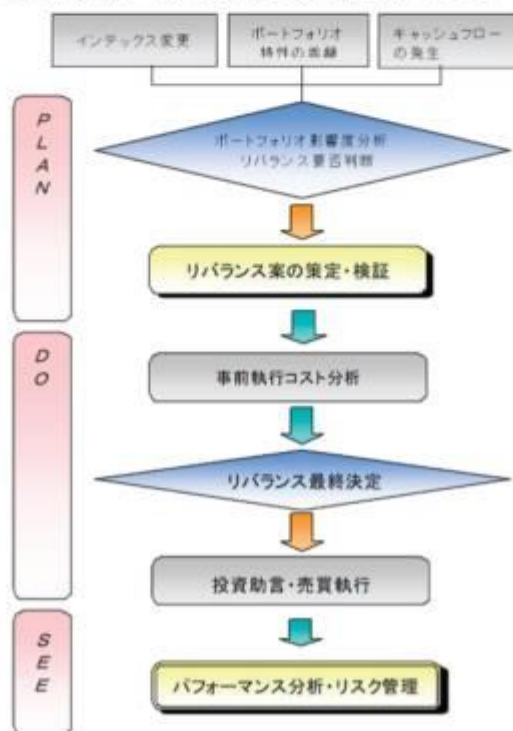
運用のプロセスは、以下のとおりです。基本的には、インデックスに採用されている銘柄全てを、その時価総額割合に基づき組み入れます。



- 日立外国債券インデックスマザーファンドの運用は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社に委託します。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社の概要	設立年月日：1985年8月1日 資本金：2,000百万円(2026年5月末現在) 事業内容：投資助言・代理業及び投資運用業に係る業務
------------------------	--

運用のプロセスは、以下のとおりです。層化抽出法における銘柄選択を行い、インデックスを構成する国別に、ポートフォリオとインデックスの特性が一致するよう最適化を行います。



④ 信託金限度額

- 各ファンド、5,000億円（合計15,000億円）を限度として信託金を追加することができます。
- 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

2001年12月5日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み

ファンドの関係法人

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

1) 委託者（委託会社）：日立投資顧問株式会社

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

当社はマザーファンドの委託者でもあります。マザーファンドの信託財産の運用の指図に関する権限を野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社および三菱UFJアセットマネジメント株式会社（以下、総称してまたはそれぞれを「運用再委託先」といいます。）に委託しております。

マザーファンド名	運用再委託先
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社
日立国内債券インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社
日立外国株式インデックスマザーファンド	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
日立外国債券インデックスマザーファンド	三菱UFJアセットマネジメント株式会社

2) 受託者（受託会社）：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

3) 販売会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

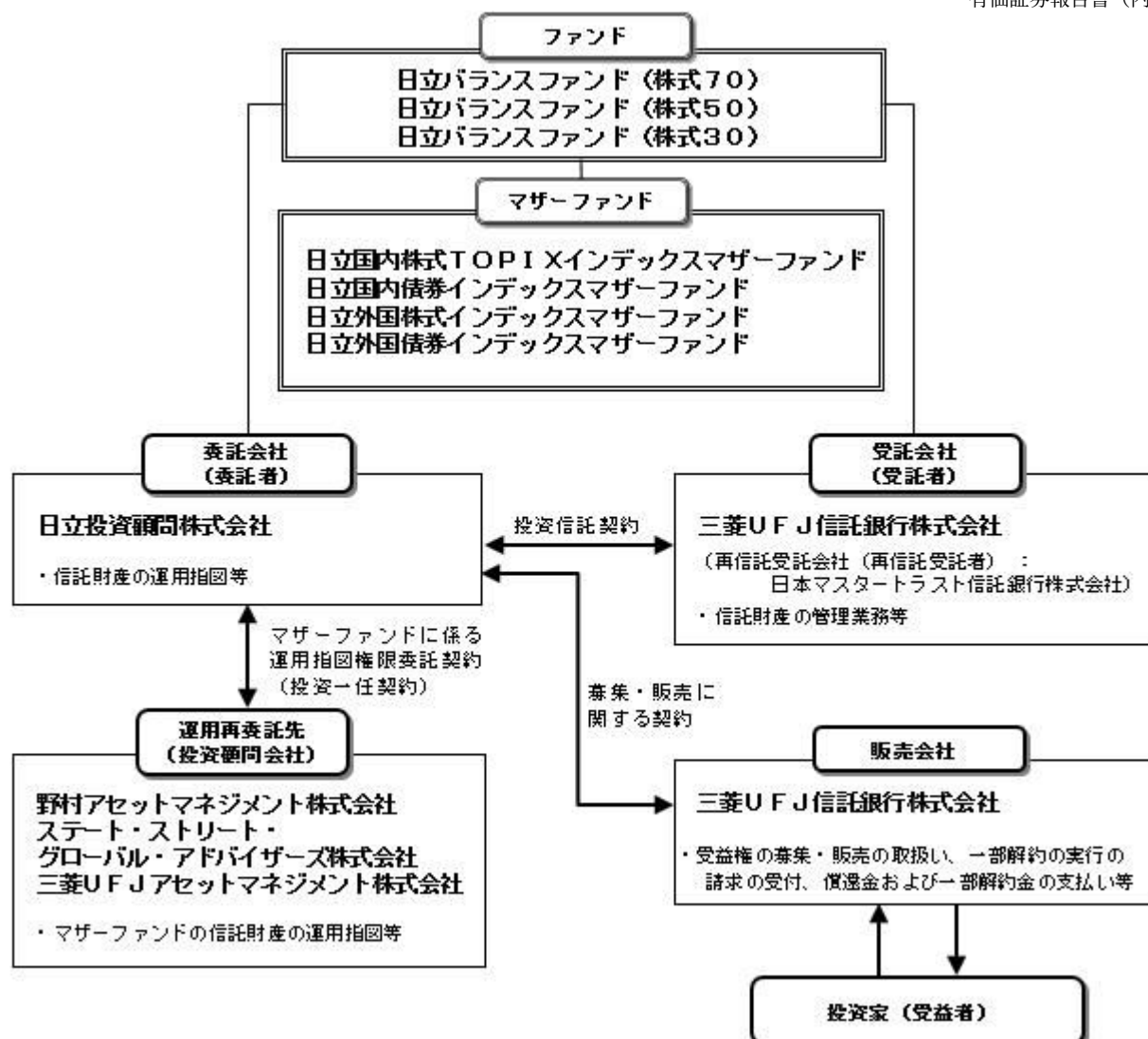
委託者との募集・販売に関する契約に基づき、各ファンドの販売会社として、受益権の募集・販売の取扱い（確定拠出年金による取得申込みに限ります。）、一部解約の実行の請求の受付、償還金の支払い等を行います。

4) 運用再委託先（投資顧問会社）：

野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社、三菱UFJ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

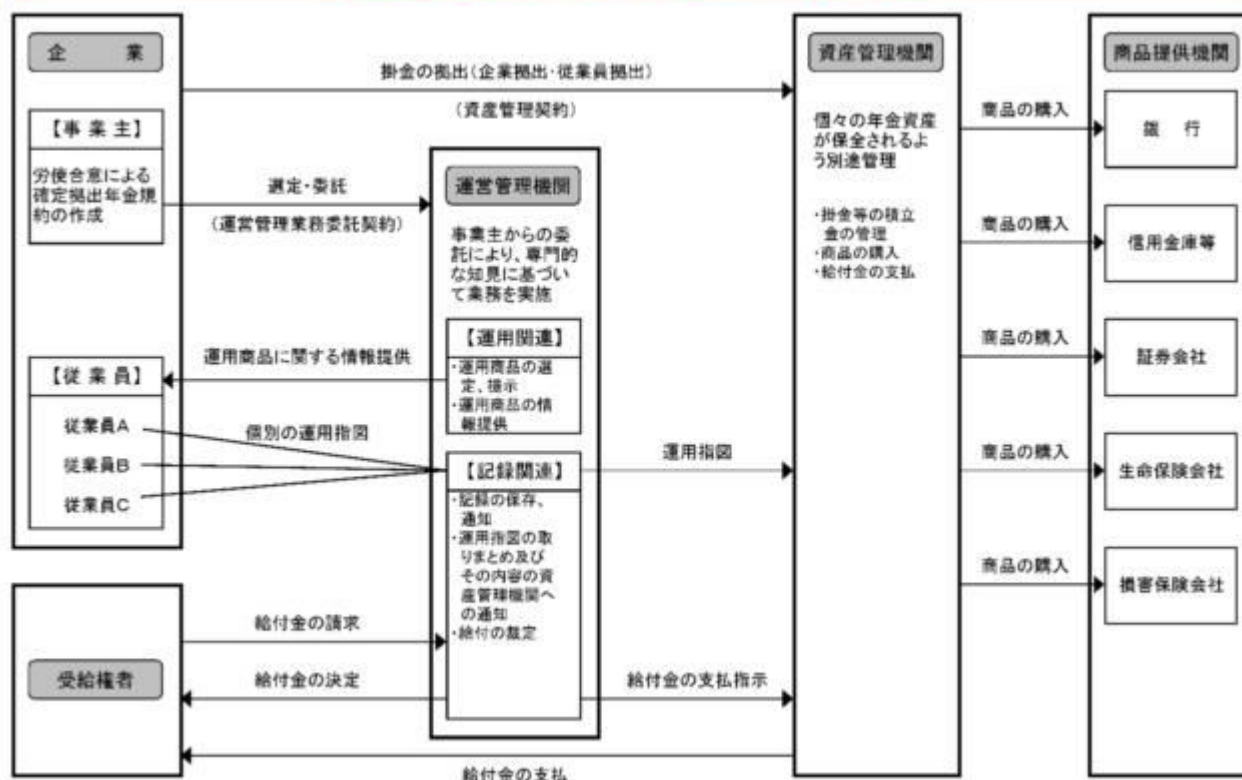


（ご参考）

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。

企業型DCのイメージ図（各機関の役割分担）



（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、資産管理機関が行うことになります。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、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。

② 委託会社の概況（2026年5月末現在）

1）資本金の額

1億円

2）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	住所	所有株数	所有割合
株式会社 日立製作所	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号	6,000株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

- ① TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとして、主として国内株式に分散投資を行う国内株式マザーファンドの受益証券、NOMURA-BPI総合（ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）をベンチマークとして、主として国内債券に分散投資を行う国内債券マザーファンドの受益証券、MSCIコクサイ指数（除く日本、円ベース）をベンチマークとして、主として外国株式に分散投資を行う外国株式マザーファンドの受益証券、ならびにFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとして、主として外国債券に分散投資を行う外国債券マザーファンドの受益証券に主として投資を行うことにより、②に記載の複合ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求します。

- ② それぞれのマザーファンドの受益証券への信託財産の基本資産配分は、次のとおりとし、①に記載のそれぞれのマザーファンドのベンチマークを、この基本資産配分割合で加重平均したものを複合ベンチマークと呼びます。

＜基本資産配分割合＞

ファンド名

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

- ③ それぞれのマザーファンドの受益証券への実際の資産配分は、マザーファンド毎の基本資産配分に±5%の範囲で上限と下限を設け、その範囲内となるようにします。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 資金動向、市況動向等によっては、上記の運用が困難となり、上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。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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。
- ⑩ 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。
- ⑪ 複合ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、実質組入有価証券の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。

(2) 【投資対象】

<日立バランスファンド（株式70）>

<日立バランスファンド（株式50）>

<日立バランスファンド（株式30）>

次の親投資信託（以下、総称してまたはそれぞれを「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

- ・日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド（以下「国内株式マザーファンド」といいます。）
- ・日立国内債券インデックスマザーファンド（以下「国内債券マザーファンド」といいます。）
- ・日立外国株式インデックスマザーファンド（以下「外国株式マザーファンド」といいます。）
- ・日立外国債券インデックスマザーファンド（以下「外国債券マザーファンド」といいます。）

① 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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
- ハ) 金銭債権

ニ) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

② 有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として日立投資顧問株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の親投資信託（以下、総称してまたはそれぞれを「マザーファンド」といいます。）の受益証券に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。

「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」

「日立国内債券インデックスマザーファンド」

「日立外国株式インデックスマザーファンド」

「日立外国債券インデックスマザーファンド」

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) の証券または証書の性質を有するもの
 - 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 - 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 - 21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 22) 外国の者に対する権利で21) の有価証券の性質を有するもの
- なお、1) の証券または証書、12) ならびに17) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券および12) ならびに17) の証券または証書のうち2) から6) までの証券の性質を有するものおよび14) の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13) の証券および14) の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 金融商品の指図範囲
委託者は、信託金を、上記②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
- ④ 上記②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、信託金を上記③の1) から6) 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。

<日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド>

わが国の証券取引所上場株式（以下「国内株式」といいます。）を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類
この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
- イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限ります。)
 - ハ) 金銭債権
 - ニ) 約束手形
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ) 為替手形
- ② 有価証券の指図範囲
委託者（投資顧問会社を含みます。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
- 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 - 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 - 9) 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証書（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。以下同じ。）及び新株

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) の証券または証書の性質を有するもの
 - 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 17) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 - 21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 22) 外国の者に対する権利で21) の有価証券の性質を有するもの
- なお、1) の証券または証書12) ならびに17) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券および12) ならびに17) の証券または証書のうち2) から6) までの証券の性質を有するものおよび14) の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13) の証券および14) の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

③ 金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記②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

④ 上記②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、信託金を上記③の1) から6) 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。

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債（以下「国内債券」といいます。）を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 金銭債権
 - ニ) 約束手形
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

② 有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証書（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。以下同じ。）及び新株予約権証券
- 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) 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します。）
 - 17) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 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します。）
 - 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 - 21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 22) 外国の者に対する権利で21)の有価証券の性質を有するもの
- なお、1)の証券または証書12)ならびに17)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものおよび14)の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13)の証券および14)の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 金融商品の指図範囲
委託者は、信託金を、上記②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
- ④ 上記②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、信託金を上記③の1)から6)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。

<日立外国株式インデックスマザーファンド>

わが国を除く世界主要国・地域の株式（以下「外国株式」といいます。）を主要投資対象とします。

- ① 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します。）
 - ハ) 金銭債権
 - ニ) 約束手形
 - 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形
- ② 有価証券の指図範囲
委託者（投資顧問会社を含みます。）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書（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。以下同じ。）及び新株予約権証券
 - 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)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します。）
 - 17) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 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します。）

- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22) 外国の者に対する権利で21)の有価証券の性質を有するもの
 なお、1)の証券または証書12)ならびに17)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものおよび14)の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13)の証券および14)の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 金融商品の指図範囲
 委託者は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
- ④ 上記②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、信託金を上記③の1)から6)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。

<日立外国債券インデックスマザーファンド>

国際機関債およびわが国を除く世界主要国の公社債（以下「外国債券」といいます。）を主要投資対象とします。

- ① 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。）
 - 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
- ② 有価証券の指図範囲
 委託者（投資顧問会社を含みます。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
- 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - 9) 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証書（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。以下同じ。）及び新株予約権証券
 - 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)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号の2で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。）
 - 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。）
 - 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」といいます。

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。

③ 金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記②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

④ 上記②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、信託金を上記③の1)から6)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。

◆投資対象とするマザーファンドの概要

<日立国内株式T O P I Xインデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、投資態度②に掲げるベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、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方針とします。
主な投資対象	わが国の証券取引所上場株式（以下「国内株式」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	① 運用にあたっては、投資一任契約に基づき、野村アセットマネジメント株式会社に運用の指図に関する権限を委託します。 ② 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収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。 ③ 国内株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。 ④ ベンチマーク採用銘柄の入れ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、上記の運用が困難となり、上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。 ⑤ 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。 ⑥ 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。 ⑦ 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。 ⑧ 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。 ⑨ 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。
主な投資制限	① 国内株式への投資割合については、制限を設けません。 ② 株式への投資割合については、制限を設けません。 ③ 外貨建資産への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日立投資顧問株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、投資態度②に掲げるベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、中長期的に信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを基本方針とします。
主な投資対象	わが国の公社債（以下「国内債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	① 運用にあたっては、投資一任契約に基づき、野村アセットマネジメント株式会社に運用の指図に関する権限を委託します。 ② 主として国内債券に分散投資を行い、NOMURA-BPI総合（ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）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。 ③ 国内債券の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。 ④ 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、上記の運用が困難となり、上記と異なる運用を行う場合があり、また、目的が達成されない場合があります。 ⑤ 公社債の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。 ⑥ 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。 ⑦ 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。 ⑧ 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。 ⑨ ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入国内債券の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。
主な投資制限	① 国内債券への投資割合については、制限を設けません。 ② 株式への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ③ 外貨建資産への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日立投資顧問株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

<日立外国株式インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、投資態度②に掲げるベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、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方針とします。
主な投資対象	わが国を除く世界主要国・地域の株式（以下「外国株式」といいます。）を主要投資対象とします。

投資態度	① 運用にあたっては、投資一任契約に基づき、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に運用の指図に関する権限を委託します。 ② 主として外国株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ指数（除く日本、円ベース）をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。 ③ 外国株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。 ④ 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。 ⑤ 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、上記の運用が困難となり、上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。 ⑥ 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。 ⑦ 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。 ⑧ 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。 ⑨ 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。 ⑩ ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入外国株式の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。
主な投資制限	① 外国株式への投資割合については、制限を設けません。 ② 株式への投資割合については、制限を設けません。 ③ 外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日立投資顧問株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

＜日立外国債券インデックスマザーファンド＞

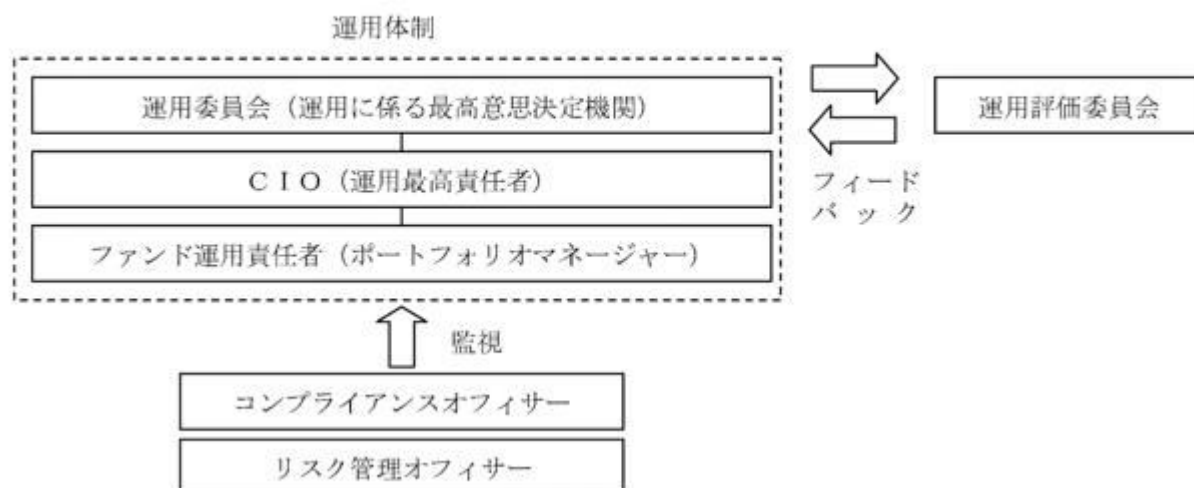
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、投資態度②に掲げるベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、中長期的に信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本方針とします。
主な投資対象	国際機関債およびわが国を除く世界主要国の公社債（以下「外国債券」といいます。）を主要投資対象とします。

投資態度	① 運用にあたっては、投資一任契約に基づき、三菱UFJアセットマネジメント株式会社に運用の指図に関する権限を委託します。 ② 主として外国債券に分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。 ③ 外国債券の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。 ④ 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。 ⑤ 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、上記の運用が困難となり、上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。 ⑥ 公社債の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。 ⑦ 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。 ⑧ 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。 ⑨ 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。 ⑩ ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入外国債券の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。
主な投資制限	① 外国債券への投資割合については、制限を設けません。 ② 株式への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ③ 外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日立投資顧問株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

（３）【運用体制】

- ① 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。（7名程度出席。）
- ② 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。（8名程度出席。）
- ③ 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。（8名在籍。）
- ④ 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。（コンプライアンスグループは1名在籍。）

運用体制図

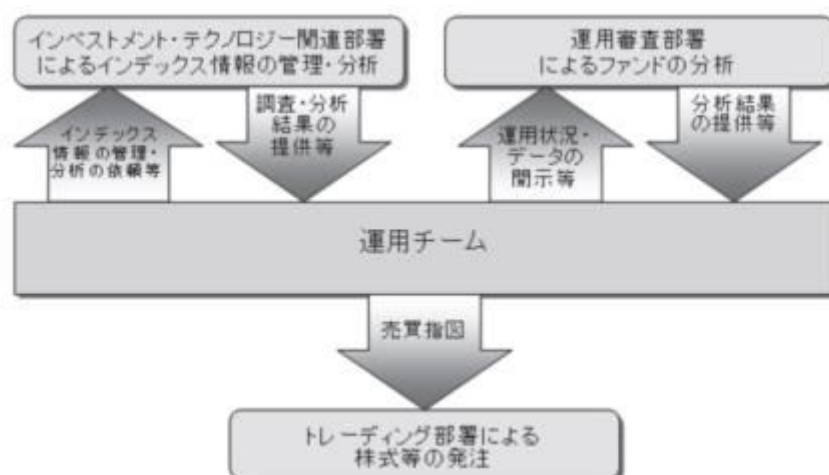


※上記体制は2026年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

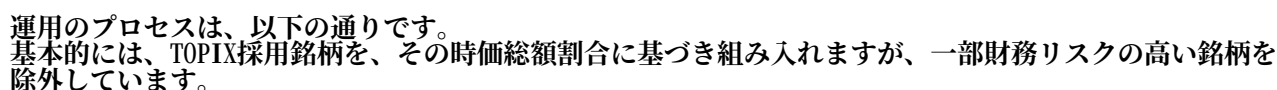
（ご参考）

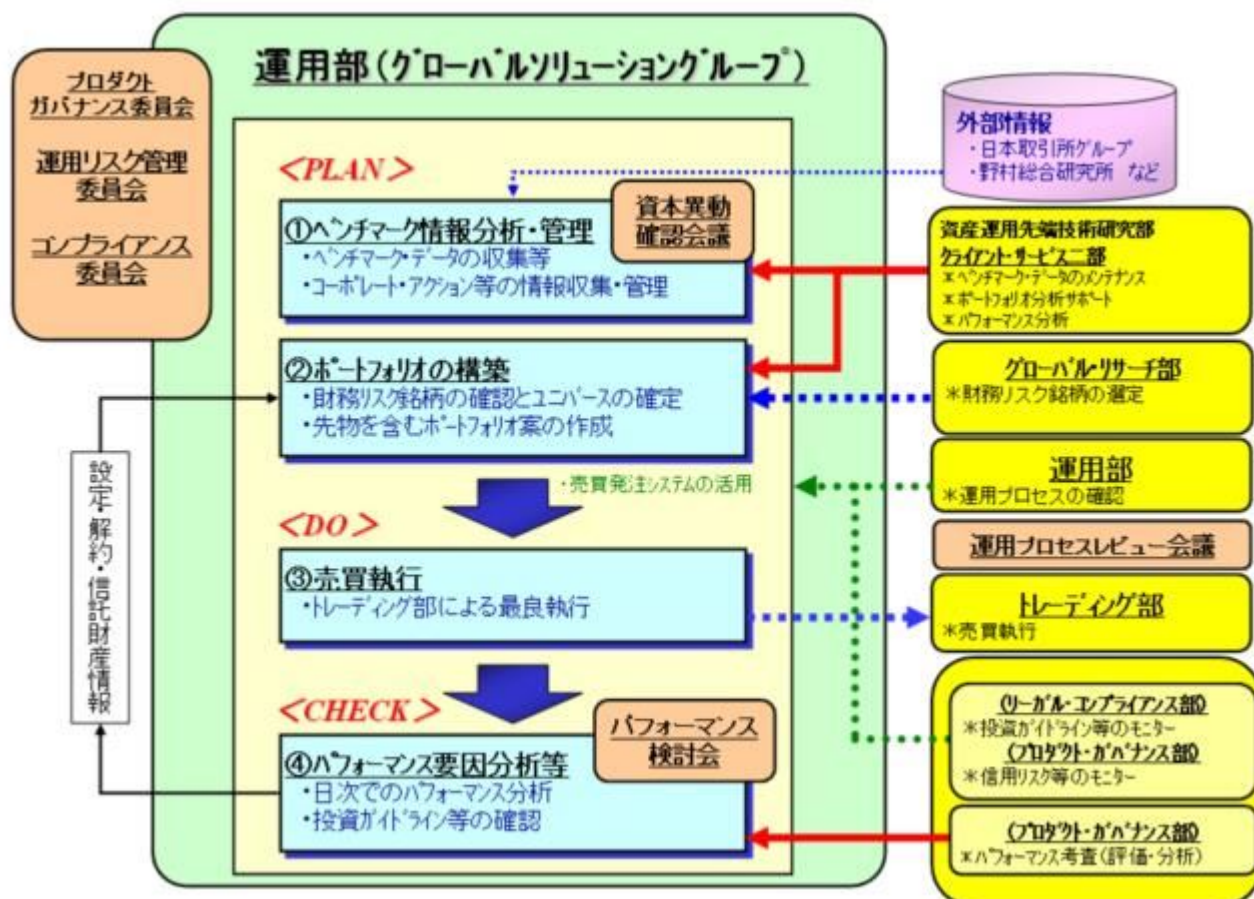
「日立国内株式T O P I Xインデックスマザーファンド」の運用体制

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。



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。



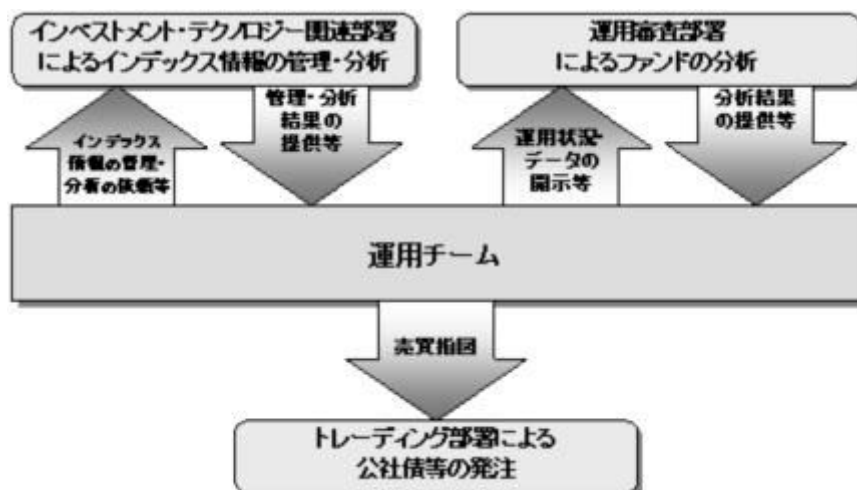


※上記体制は2026年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

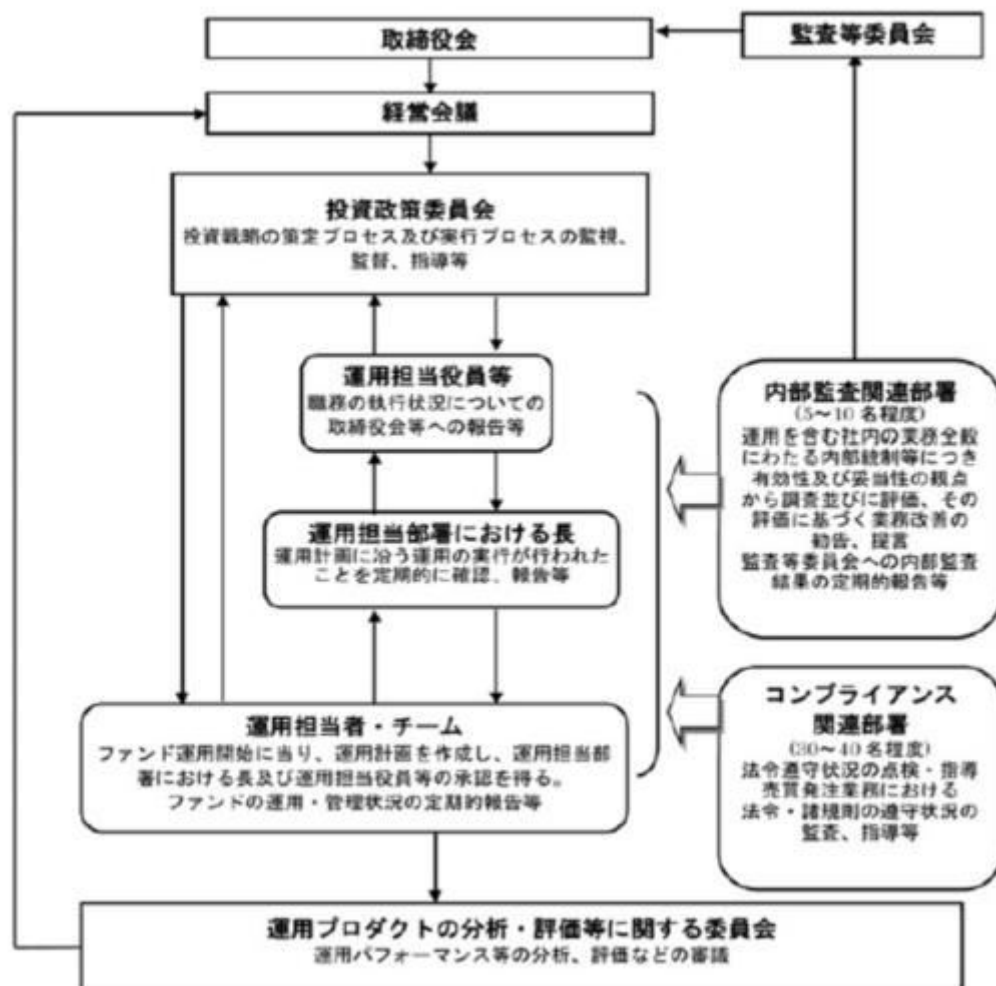
（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の運用体制

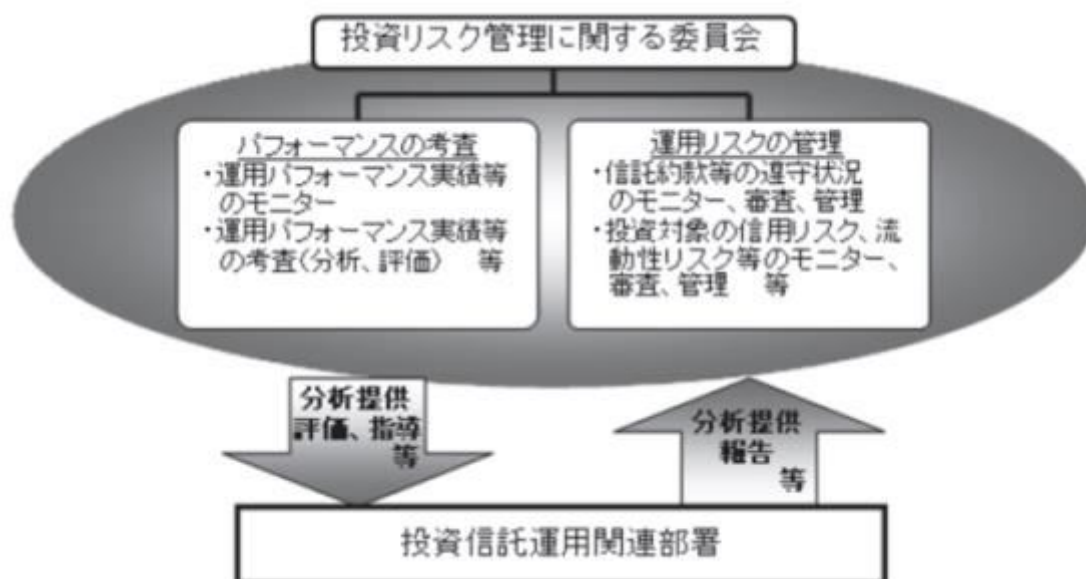
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。



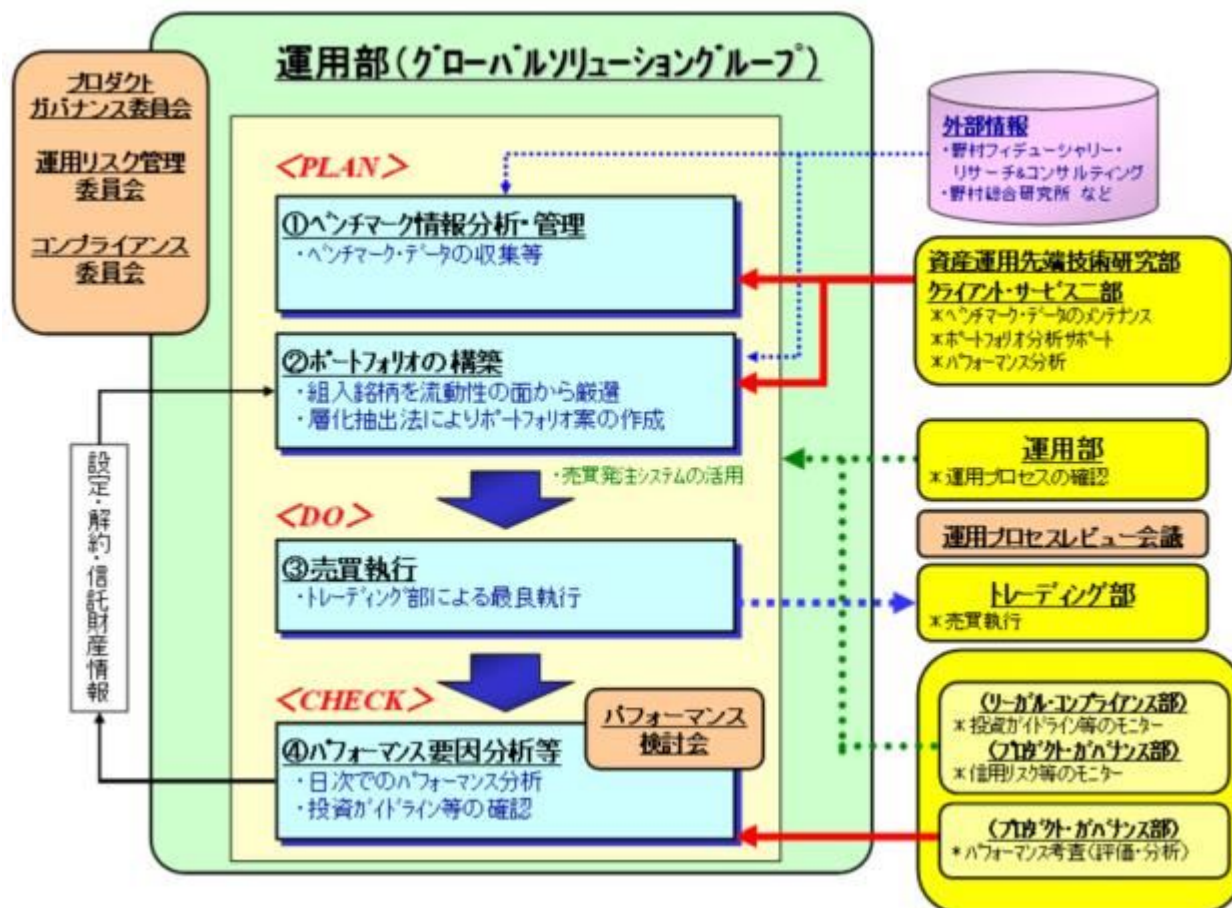
内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。
ベンチマーク・データ、信託財産情報、追加設定・解約等の資金流入出データ等を入手した後、
層化抽出法の考え方に基いてポートフォリオを構築します。



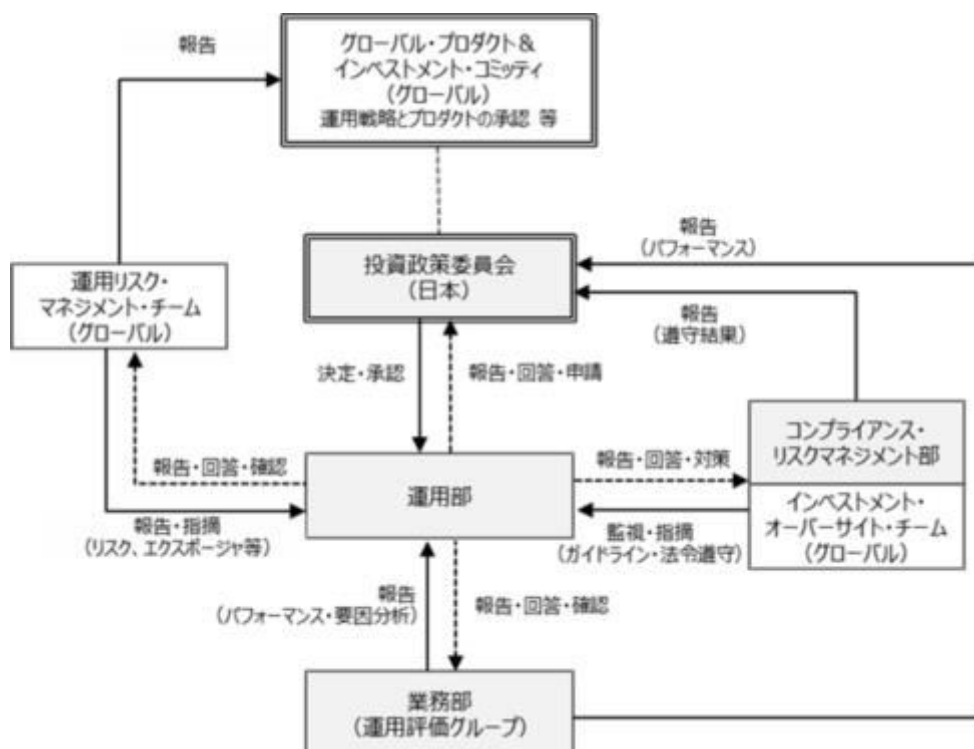
※上記体制は2026年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（ご参考）

「日立外国株式インデックスマザーファンド」の運用体制

当マザーファンドの運用は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。

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



運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル／プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該ストラテジーに関わる運用担当者との意見・情報交換を

行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務部責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。運用担当者は、投資戦略別に毎月の投資行動を報告した上で、ガイドラインからの乖離やパフォーマンスの格差、発注取引先の集中等が生じている場合には、その理由及び顧客への説明状況について報告します。

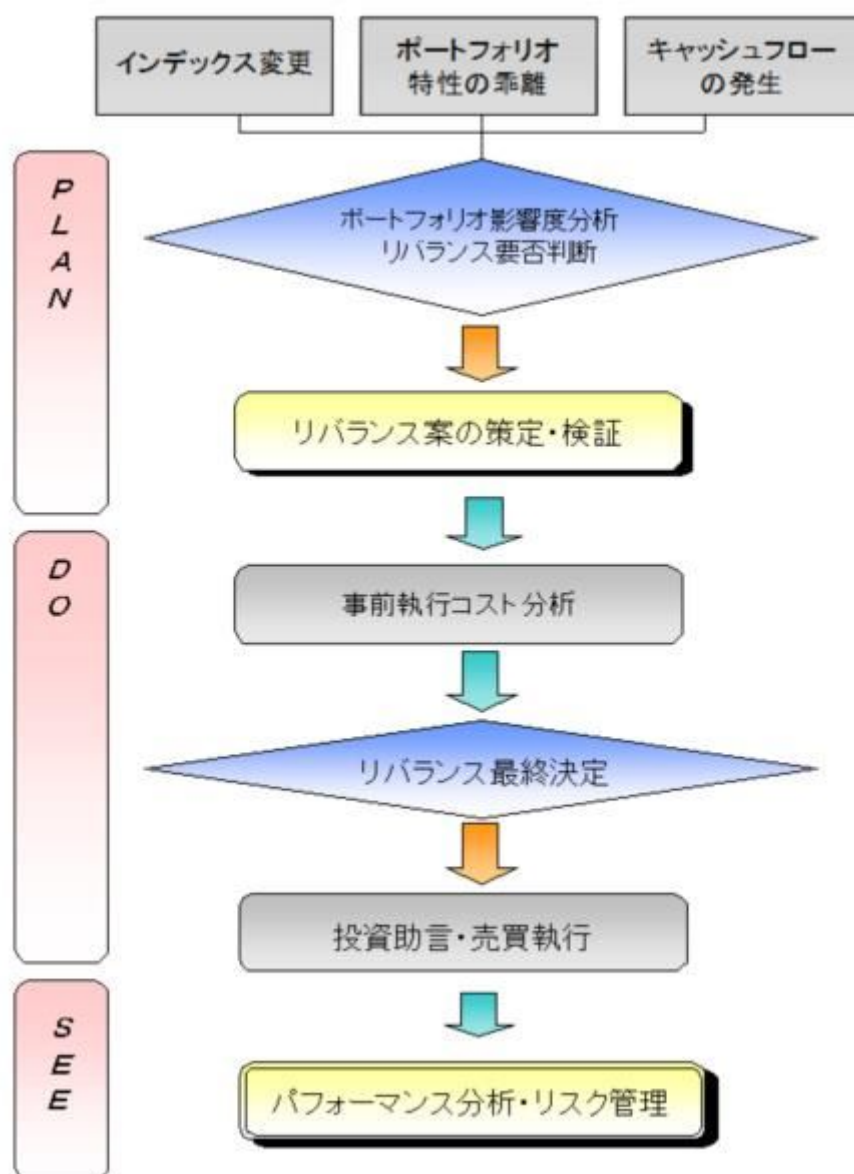
※上記体制は2026年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（ご参考）

「日立外国債券インデックスマザーファンド」の運用体制

当マザーファンドの運用は、三菱UFJ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。

債券運用第一部が、三菱UFJ信託銀行資産運用部債券インデックス運用課の策定した投資助言案を確認し、トレーディング部が発注を行います。層化抽出法における銘柄選択を行い、インデックスを構成する国別に、ポートフォリオとインデックスの特性が一致するよう最適化を行います。



A. コンプライアンス体制

当マザーファンドのコンプライアンスチェックについては、法務・コンプライアンス部が行っています。法令等の違反またはそのおそれのある事象を発見した場合には調査の上、違反の有無によらずコンプライアンス担当役員（CCO）宛てに報告されます。法令等に違反している場合には、コンプライアンス担当役員はこれを社長に報告し、経営会議や取締役会へも報告を行うほか、必要とCCOが判断した場合にはコンプライアンス委員会に報告が行われます。

当該法令等違反の場合の対応は、必要に応じ、トラブル対応本部運営規程や危機管理規則に基づき行われ、トラブル対応本部や危機対策本部が設置されて、対応にあたります。

B. リスク管理における補完体制

当マザーファンドのリスク管理については、バリューマネジメント統括部において、推定トラッキングエラーやファンド属性値のモニタリングが行われています。
投資助言を行う三菱UFJ信託銀行の資産運用部債券インデックス運用課においては、日次で推定トラッキングエラー、デュレーション、残存年限別・国別・通貨別構成等をモニタリングしております。
受託監理部においては、月次でガイドライン遵守状況のチェックおよびリスク管理・パフォーマンス測定を実施するほか、月次で開催される運用会議では、インデックスからの乖離やリバランス状況等が確認され、パフォーマンスの分析結果が定期的、継続的に評価・検討されています。
また、乖離の要因については、評価単価差異、各種コスト、キャッシュ、現物トラッキングエラー等に分けて把握されています。

※上記体制は2026年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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】

① 約款に定める投資制限

<日立バランスファンド（株式70）>

<日立バランスファンド（株式50）>

<日立バランスファンド（株式30）>

1) 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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合については、信託財産の純資産総額に対して次の割合を上限とします。

ファンド名	日立 バランスファンド (株式70)	日立 バランスファンド (株式50)	日立 バランスファンド (株式30)
実質投資割合	80%	60%	40%

3) 外貨建資産への実質投資割合については、信託財産の純資産総額に対して次の割合を上限とします。

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

4) 有価証券先物取引等は、約款第20条の範囲内で行います。

5) スワップ取引は、約款第21条の範囲内で行います。

6) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第22条の範囲内で行います。

7) 信用取引の運用指図

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

8) 有価証券の貸付の指図

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

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

9) 公社債の空売りの指図範囲

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。

10) 公社債の借入れの指図範囲

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

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

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

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

11) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

- 12) 外国為替予約の指図
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。
- 13) 資金の借入れ
イ) 委託者は、信託財産の効率的な運用および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。
- 14) 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、一般社団法人資産運用業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、
- 15) 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

<日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド>

- 1) 国内株式への投資割合については、制限を設けません。
- 2) 株式への投資割合については、制限を設けません。
- 3) 外貨建資産への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- 4) 有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲内で行います。
- 5) スワップ取引は、約款第20条の範囲内で行います。
- 6) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第21条の範囲内で行います。
- 7) 信用取引の運用指図
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ことの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、
- 8) 有価証券の貸付の指図
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ことの指図をすることができます。
ロ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 9) 公社債の空売りの指図範囲
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ことの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、
- 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。
- 10) 公社債の借入れの指図範囲
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。
ロ) イ)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
ニ) イ)の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 11) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 12) 外国為替予約の指図
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。
- 13) 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、一般社団法人資産運用業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、
- 14) 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

- 1) 国内債券への投資割合については、制限を設けません。

- 2) 株式への投資割合については、制限を設けません。
- 3) 外貨建資産への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- 4) 有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲内で行います。
- 5) スワップ取引は、約款第20条の範囲内で行います。
- 6) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲内で行います。
- 7) 信用取引の運用指図
委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 8) 有価証券の貸付の指図
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
ロ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 9) 公社債の空売りの指図範囲
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。
- 10) 公社債の借入れの指図範囲
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。
ロ) イ)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
ニ) イ)の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 11) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 12) 外国為替予約の指図
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。
- 13) 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、一般社団法人資産運用業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ます。
- 14) 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

<日立外国株式インデックスマザーファンド>

- 1) 外国株式への投資割合については、制限を設けません。
- 2) 株式への投資割合については、制限を設けません。
- 3) 外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。
- 4) 有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲内で行います。
- 5) スワップ取引は、約款第20条の範囲内で行います。
- 6) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲内で行います。
- 7) 信用取引の運用指図
委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 8) 有価証券の貸付の指図
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
ロ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 9) 公社債の空売りの指図範囲
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。
- 10) 公社債の借入れの指図範囲
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担

保の提供の指図をするものとします。

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

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

- 11) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 12) 外国為替予約の指図
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。
- 13) 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、一般社団法人資産運用業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ます。
- 14) 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

<日立外国債券インデックスマザーファンド>

- 1) 外国債券への投資割合については、制限を設けません。
 - 2) 株式への投資割合については、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
 - 3) 外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。
 - 4) 有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲内で行います。
 - 5) スワップ取引は、約款第20条の範囲内で行います。
 - 6) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第21条の範囲内で行います。
 - 7) 信用取引の運用指図
委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 - 8) 有価証券の貸付の指図
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
ロ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
 - 9) 公社債の空売りの指図範囲
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。
 - 10) 公社債の借入れの指図範囲
イ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。
ロ) イ)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
ニ) イ)の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
 - 11) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
 - 12) 外国為替予約の指図
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。
 - 13) 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、一般社団法人資産運用業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ます。
 - 14) 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。
- ② 法令による投資制限
同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）
同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

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。

① 有価証券に投資することによるリスク

有価証券には、次のリスクが単独でまたは同時にあるいは複合して存在するため、個々の有価証券の価格は、日常の企業活動、マクロ経済の状況、市場の需給、その他の予測出来ない要因により、日々刻々変化します。有価証券の価格変動により、当ファンドの基準価額は変動します。当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的に個々の有価証券に投資を行うため、個々の有価証券の性質に応じて以下のリスクが単独であるいは複合して基準価額等に影響を及ぼすことが想定されます。

1. 株式の価格変動リスク

株式の価格変動リスクとは、株式市場が国内外の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、個々の株式が発行会社の日常の企業活動の影響を受け、株価が変動するリスクをいいます。株式の価格が下落した場合には、その影響を受けファンドの基準価額が下落する要因となります。また、投資する株式の発行企業が、業績悪化、経営不振あるいは倒産等に陥った場合には、その企業の株式の価値が大きく減少すること、もしくは無くなることもあり、ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

2. 債券の価格変動リスク

債券の価格変動リスクは、金利変動リスクと信用リスクに大別されます。金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。信用リスクとは、債券の発行者（債務者）が元本償還金や利息の支払い（債務）を不履行あるいは遅延するリスクをいいます。この場合には、当該債券の価格は下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

3. 為替変動リスク

為替変動リスクとは、外国為替相場の変動により外国通貨建資産の円貨換算の価格が変動するリスクをいいます。外国為替相場が対円で下落した（円高になった）場合には、ファンドの基準価額が下落する要因となります。したがって、外国通貨建証券が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該証券の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動に影響を与える要因となります。当ファンドでは、為替変動リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの基準価額に影響します。

4. 政治・カントリーリスク

特定の国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて有価証券の価格が変動する可能性もあります。特に政治情勢によっては、当該国・地域の評価が変わったり市場の仕組みが変わることもあり、有価証券の価値が減少するか消滅したり、市場の閉鎖により売買が出来なくなったり、保管中の有価証券が凍結され売買機会を逸することもあります。

5. 決済リスク

世界の市場では有価証券の決済のために様々なシステムや機関が相互に関連しあっており、天災、人災またはシステムダウンなどにより、そのどれかに支障が生じた場合に連鎖的な被害を受けることがあります。

6. 流動性リスク

有価証券によってまたは市場によっては、流動性の低いものがあり、それらの有価証券は概して価格の変動率も大きく、期待する価格での取引ができなかったり、取引に時間が掛かることもあります。

② 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。

③ インデックス運用に係る留意点

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて複合ベンチマークの動きへの連動を目指します。つまり、複合ベンチマーク上昇時には同程度の上昇を、複合ベンチマーク下落時には同程度の下落を目指して運用を行います。したがって、複合ベンチマークを相対的に上回る投資成果を目指す運用を行うものではありません。

各ベンチマーク採用銘柄の入替えおよび各ベンチマークの算出方法の変更ならびにファンドの資金動向、市況動向などによっては、複合ベンチマークの動きへの連動が困難となり、目的が達成されない場合があります。

④ 運用の再委託に係る留意点

委託者は、マザーファンドの運用の指図に関する権限を野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社および三菱UFJ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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 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。

⑨ 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。

⑩ 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がある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①から⑩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）を直接保有していません。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いません。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

① 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

② 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。

③ 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。

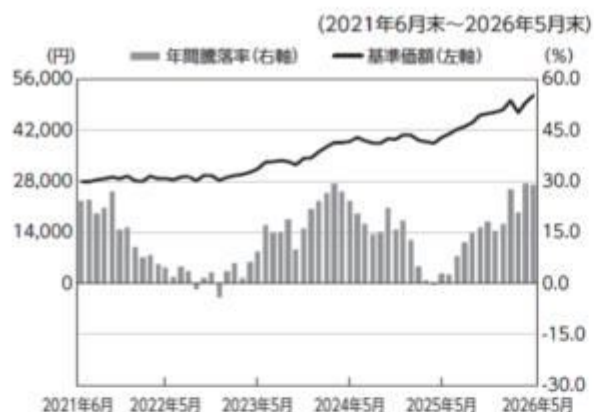
※ 流動性リスクに対する管理体制

- ・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。

※上記体制は2026年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

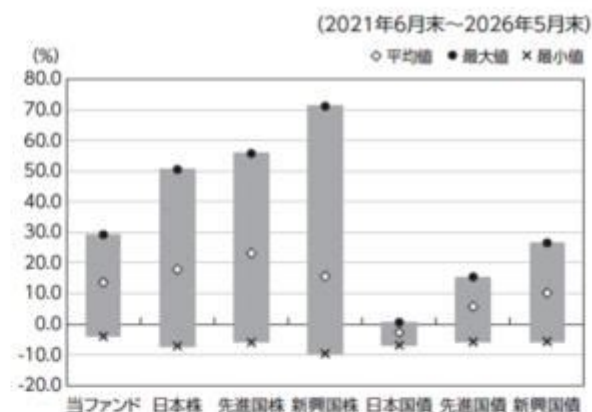
○ ファンドの年間騰落率及び基準価額の推移

日立バランスファンド(株式70)



*年間騰落率は、2021年6月から2026年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

○ 代表的な資産クラスと騰落率の比較



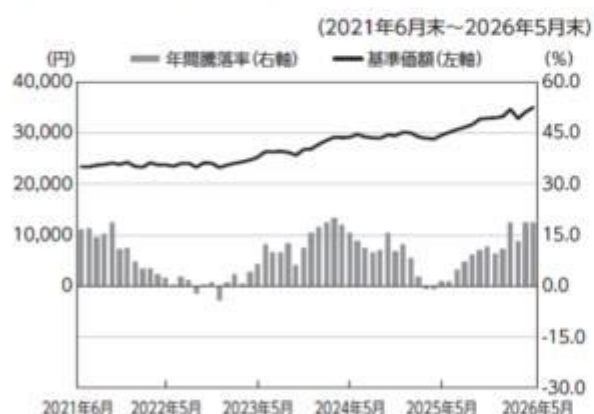
(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	13.6	17.9	23.1	15.6	△ 2.8	5.7	10.2
最大値	29.3	50.5	55.7	71.2	0.6	15.4	26.5
最小値	△ 4.0	△ 7.1	△ 6.0	△ 9.7	△ 6.9	△ 5.8	△ 5.7

*2021年6月から2026年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

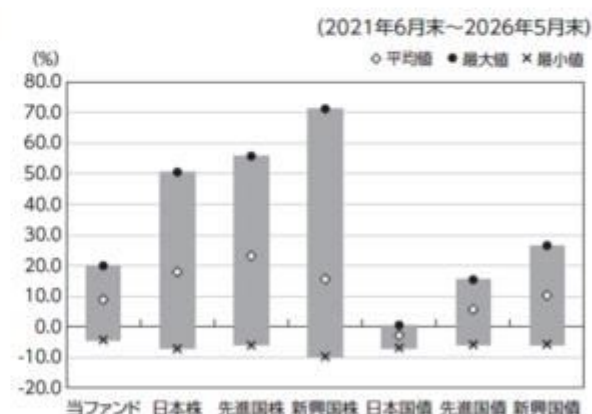
*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

日立バランスファンド(株式50)



*年間騰落率は、2021年6月から2026年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。



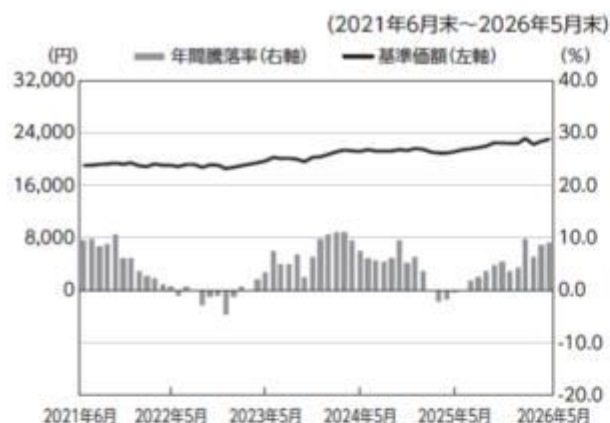
(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	8.9	17.9	23.1	15.6	△ 2.8	5.7	10.2
最大値	19.9	50.5	55.7	71.2	0.6	15.4	26.5
最小値	△ 4.2	△ 7.1	△ 6.0	△ 9.7	△ 6.9	△ 5.8	△ 5.7

*2021年6月から2026年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

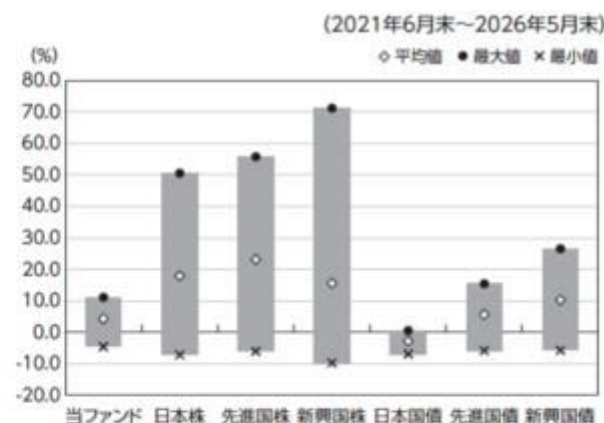
*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

日立バランスファンド(株式30)



*年間騰落率は、2021年6月から2026年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。



(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	4.3	17.9	23.1	15.6	△ 2.8	5.7	10.2
最大値	11.1	50.5	55.7	71.2	0.6	15.4	26.5
最小値	△ 4.5	△ 7.1	△ 6.0	△ 9.7	△ 6.9	△ 5.8	△ 5.7

*2021年6月から2026年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日 本 株・・・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、各ファンドの日々の純資産総額に対して、以下の表に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は日々計上され、各ファンドの基準価額に反映されます。

日立 バランスファンド (株式70)	日立 バランスファンド (株式50)	日立 バランスファンド (株式30)
年率0.154% (税抜0.140%)	年率0.154% (税抜0.140%)	年率0.154% (税抜0.140%)

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

支払先	信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率		
	日立 バランスファンド (株式70)	日立 バランスファンド (株式50)	日立 バランスファンド (株式30)
委託会社	年率0.0671% (税抜0.0610%)	年率0.0671% (税抜0.0610%)	年率0.0682% (税抜0.0620%)
販売会社	年率0.0429% (税抜0.0390%)	年率0.0429% (税抜0.0390%)	年率0.0418% (税抜0.0380%)
受託会社	年率0.044% (税抜0.040%)	年率0.044% (税抜0.040%)	年率0.044% (税抜0.040%)

役務の内容	
委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	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	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。

③ 支払時期

信託報酬(信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。)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。

(4) 【その他の手数料等】

- ① 組入の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。
- ② 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。
- ③ 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①、②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

- ① マザーファンドについては信託報酬を収受しません。
- ② 運用再委託先に支払う報酬は、委託者の負担とします。報酬額は、毎日、この投資信託が保有するそれぞれの運用再委託先が運用するマザーファンドの純資産総額に下表の率を乗じて得た額とします。

マザーファンド	運用再委託先	報酬
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社	年0.02365% (税抜0.0215%)
日立国内債券 インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社	年0.0275% (税抜0.025%)
日立外国株式 インデックスマザーファンド	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社	年0.0451% (税抜0.041%)
日立外国債券 インデックスマザーファンド	三菱UFJアセットマネジメント株式会社	年0.0396% (税抜0.036%)

- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 組入の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。
- ⑥ 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⑤、⑥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。

《確定拠出年金の場合》

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

《確定拠出年金でない場合》

① 個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

*解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りま。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りま。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

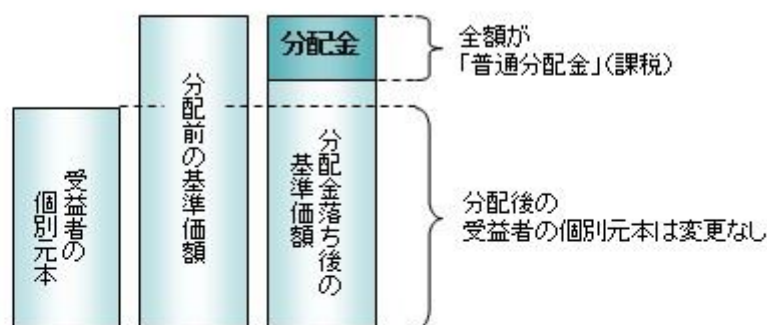
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

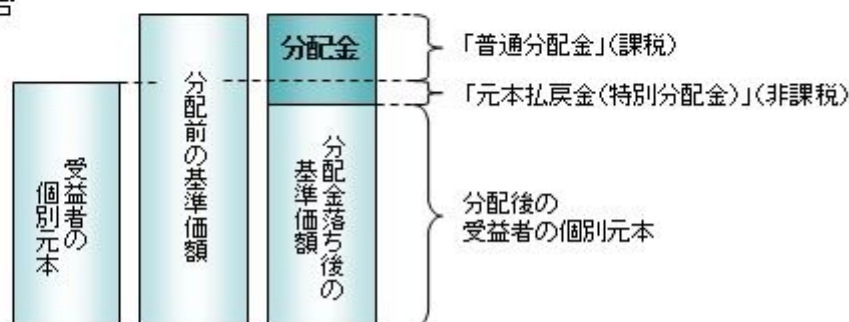
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は2026年5月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
日立バランスファンド (株式70)	0.16%	0.15%	0.01%
日立バランスファンド (株式50)	0.16%	0.15%	0.01%
日立バランスファンド (株式30)	0.16%	0.15%	0.01%

※対象期間は2025年5月16日から2026年5月15日までです。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【日立バランスファンド(株式70)】

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。

・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	50,776,490,751	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	482,605,085	0.94
合計(純資産総額)		51,259,095,836	100.00

（２）【投資資産】

①【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T O P I Xインデッ クスマザーファンド	4,185,094,083	4.8169	20,159,179,689	4.9341	20,649,672,714	40.28
2	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式インデックスマザー ファンド	1,652,391,532	9.3172	15,395,662,382	9.4634	15,637,242,023	30.50
3	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券インデックスマザー ファンド	8,177,478,708	1.1865	9,703,285,349	1.1934	9,759,003,090	19.03
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券インデックスマザー ファンド	1,440,754,378	3.2494	4,681,587,275	3.2834	4,730,572,924	9.22

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

2026年5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）
16期	(2017年 5月15日)	19,493,670,645	19,493,670,645	2.0454	2.0454
17期	(2018年 5月15日)	21,985,000,610	21,985,000,610	2.2493	2.2493
18期	(2019年 5月15日)	22,796,928,479	22,796,928,479	2.1572	2.1572
19期	(2020年 5月15日)	22,157,711,620	22,157,711,620	2.1213	2.1213
20期	(2021年 5月17日)	27,634,476,168	27,634,476,168	2.7157	2.7157
21期	(2022年 5月16日)	29,416,034,623	29,416,034,623	2.8202	2.8202
22期	(2023年 5月15日)	33,178,298,207	33,178,298,207	3.0913	3.0913
23期	(2024年 5月15日)	42,279,209,015	42,279,209,015	3.8767	3.8767
24期	(2025年 5月15日)	40,271,351,018	40,271,351,018	3.9712	3.9712
25期	(2026年 5月15日)	50,506,233,639	50,506,233,639	5.0678	5.0678
2025年 5月末日		40,348,926,020	—	3.9966	—
6月末日		41,201,610,804	—	4.0978	—
7月末日		42,259,939,843	—	4.2161	—
8月末日		43,056,109,685	—	4.2983	—
9月末日		44,113,090,195	—	4.4033	—
10月末日		46,082,328,828	—	4.6064	—

11月末日	46,424,701,523	—	4.6533	—
12月末日	46,856,996,619	—	4.6912	—
2026年 1月末日	47,522,723,779	—	4.7609	—
2月末日	49,966,905,734	—	5.0062	—
3月末日	46,644,725,275	—	4.6830	—
4月末日	49,350,179,776	—	4.9613	—
5月末日	51,259,095,836	—	5.1517	—

②【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
16期	—
17期	—
18期	—
19期	—
20期	—
21期	—
22期	—
23期	—
24期	—
25期	—

③【収益率の推移】

期	収益率（％）
16期	15.18
17期	9.97
18期	△4.09
19期	△1.66
20期	28.02
21期	3.85
22期	9.61
23期	25.41
24期	2.44
25期	27.61

(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）
16期	1,117,467,696	1,355,884,843
17期	1,571,044,252	1,327,710,546
18期	2,096,243,112	1,302,302,033
19期	1,874,137,360	1,996,671,300
20期	1,588,252,403	1,858,065,744

21期	1,490,771,030	1,236,066,675
22期	1,424,230,338	1,121,687,214
23期	1,439,175,113	1,266,023,617
24期	1,126,870,948	1,892,135,980
25期	922,665,164	1,097,304,285

【日立バランスファンド（株式５０）】

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。

・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	31,349,247,151	99.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	283,128,594	0.89
合計（純資産総額）		31,632,375,745	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.上位銘柄明細

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券インデックスマザー ファンド	10,353,084,048	1.1865	12,284,954,739	1.1934	12,355,370,502	39.05
2	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式T O P I Xインデッ クスマザーファンド	1,936,895,776	4.8169	9,329,833,264	4.9341	9,556,837,448	30.21
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式インデックスマザー ファンド	678,099,220	9.3172	6,317,986,053	9.4634	6,417,124,158	20.28
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券インデックスマザー ファンド	919,752,404	3.2494	2,988,643,461	3.2834	3,019,915,043	9.54

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.10
合計	99.10

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

2026年5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）
16期	（2017年 5月15日）	20,776,203,481	20,776,203,481	1.8533	1.8533
17期	（2018年 5月15日）	22,260,170,947	22,260,170,947	1.9892	1.9892

18期	(2019年 5月15日)	22,249,586,762	22,249,586,762	1.9380	1.9380
19期	(2020年 5月15日)	21,568,431,191	21,568,431,191	1.9238	1.9238
20期	(2021年 5月17日)	24,324,503,291	24,324,503,291	2.2926	2.2926
21期	(2022年 5月16日)	24,720,346,144	24,720,346,144	2.3415	2.3415
22期	(2023年 5月15日)	26,319,483,520	26,319,483,520	2.4964	2.4964
23期	(2024年 5月15日)	30,162,751,371	30,162,751,371	2.9122	2.9122
24期	(2025年 5月15日)	27,571,256,477	27,571,256,477	2.9387	2.9387
25期	(2026年 5月15日)	31,284,576,188	31,284,576,188	3.4537	3.4537
	2025年 5月末日	27,574,582,131	—	2.9528	—
	6月末日	27,946,030,559	—	3.0110	—
	7月末日	28,408,479,763	—	3.0657	—
	8月末日	28,743,212,668	—	3.1073	—
	9月末日	29,227,995,648	—	3.1618	—
	10月末日	30,140,799,466	—	3.2706	—
	11月末日	30,133,214,295	—	3.2865	—
	12月末日	30,121,243,005	—	3.2949	—
	2026年 1月末日	30,321,865,033	—	3.3203	—
	2月末日	31,523,811,996	—	3.4595	—
	3月末日	29,774,109,722	—	3.2804	—
	4月末日	30,922,196,613	—	3.4120	—
	5月末日	31,632,375,745	—	3.5010	—

②【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
16期	—
17期	—
18期	—
19期	—
20期	—
21期	—
22期	—
23期	—
24期	—
25期	—

③【収益率の推移】

期	収益率（％）
16期	10.15
17期	7.33
18期	△2.57
19期	△0.73
20期	19.17
21期	2.13

22期	6.62
23期	16.66
24期	0.91
25期	17.52

(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）
16期	909,333,996	1,281,826,035
17期	1,126,087,244	1,145,889,203
18期	1,383,433,415	1,092,924,153
19期	1,147,563,792	1,416,825,942
20期	889,595,823	1,491,239,831
21期	777,252,687	829,651,463
22期	837,323,138	851,688,104
23期	693,139,937	878,780,632
24期	593,735,746	1,569,090,411
25期	497,203,462	821,016,531

【日立バランスファンド（株式３０）】

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。
・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	8,776,596,498	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	85,582,173	0.96
合計(純資産総額)		8,862,178,671	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.上位銘柄明細

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券インデックスマザー ファンド	4,389,791,731	1.1865	5,208,920,511	1.1934	5,238,777,451	59.11
2	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式T O P I Xインデッ クスマザーファンド	360,490,776	4.8169	1,736,448,019	4.9341	1,778,697,537	20.07
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式インデックスマザー ファンド	94,138,902	9.3172	877,110,978	9.4634	890,874,085	10.05
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券インデックスマザー ファンド	264,435,471	3.2494	859,256,619	3.2834	868,247,425	9.79

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.03

合計	99.03
----	-------

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

2026年5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）
16期 (2017年 5月15日)	7,612,669,650	7,612,669,650	1.6414	1.6414
17期 (2018年 5月15日)	8,093,462,907	8,093,462,907	1.7187	1.7187
18期 (2019年 5月15日)	8,624,969,214	8,624,969,214	1.6988	1.6988
19期 (2020年 5月15日)	8,526,779,741	8,526,779,741	1.6987	1.6987
20期 (2021年 5月17日)	8,822,900,421	8,822,900,421	1.8816	1.8816
21期 (2022年 5月16日)	8,711,572,471	8,711,572,471	1.8894	1.8894
22期 (2023年 5月15日)	9,121,784,637	9,121,784,637	1.9585	1.9585
23期 (2024年 5月15日)	9,612,873,272	9,612,873,272	2.1229	2.1229
24期 (2025年 5月15日)	8,537,504,454	8,537,504,454	2.1060	2.1060
25期 (2026年 5月15日)	8,801,495,310	8,801,495,310	2.2789	2.2789
2025年 5月末日	8,504,020,206	—	2.1129	—
6月末日	8,578,827,027	—	2.1425	—
7月末日	8,629,125,049	—	2.1582	—
8月末日	8,675,795,228	—	2.1747	—
9月末日	8,730,153,399	—	2.1979	—
10月末日	8,832,881,251	—	2.2476	—
11月末日	8,800,250,907	—	2.2465	—
12月末日	8,705,505,453	—	2.2398	—
2026年 1月末日	8,677,969,893	—	2.2411	—
2月末日	8,959,916,147	—	2.3144	—
3月末日	8,618,410,007	—	2.2249	—
4月末日	8,806,144,020	—	2.2720	—
5月末日	8,862,178,671	—	2.3035	—

②【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
16期	—
17期	—
18期	—
19期	—

20期	—
21期	—
22期	—
23期	—
24期	—
25期	—

③【収益率の推移】

期	収益率（％）
16期	5.24
17期	4.71
18期	△1.16
19期	△0.01
20期	10.77
21期	0.41
22期	3.66
23期	8.39
24期	△0.80
25期	8.21

(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）
16期	626,093,297	615,672,733
17期	801,659,364	730,398,178
18期	1,043,886,482	675,987,808
19期	806,345,793	863,678,546
20期	557,465,780	888,078,611
21期	479,576,773	558,002,197
22期	581,341,836	534,355,492
23期	459,141,674	588,640,924
24期	415,248,819	889,572,294
25期	409,848,939	601,460,078

（参考）

日立国内株式TOP I Xインデックスマザーファンド

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。
・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。

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	97,298,723,390	98.35

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,631,504,818	1.64
合計(純資産総額)		98,930,228,208	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	1,624,420,000	1.64

(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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,092,300	2,602.65	2,842,881,858	2,999.00	3,275,807,700	3.31
2	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	934,500	3,161.32	2,954,253,540	3,042.00	2,842,749,000	2.87
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	338,000	3,574.92	1,208,324,936	7,491.00	2,531,958,000	2.55
4	日本	株式	日立製作所	電気機器	447,300	4,467.42	1,998,279,422	5,166.00	2,310,751,800	2.33
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	377,400	5,012.34	1,891,660,798	5,819.00	2,196,090,600	2.21
6	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	606,400	3,210.14	1,946,628,896	3,444.00	2,088,441,600	2.11
7	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	36,900	37,312.75	1,376,840,475	52,420.00	1,934,298,000	1.95
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	240,900	6,092.79	1,467,753,111	7,195.00	1,733,275,500	1.75
9	日本	株式	三菱商事	卸売業	341,500	5,315.58	1,815,270,570	5,065.00	1,729,697,500	1.74
10	日本	株式	村田製作所	電気機器	167,800	3,435.45	576,469,608	9,625.00	1,615,075,000	1.63
11	日本	株式	キーエンス	電気機器	17,600	55,099.15	969,745,106	80,110.00	1,409,936,000	1.42
12	日本	株式	三井物産	卸売業	263,700	5,957.68	1,571,041,314	5,290.00	1,394,973,000	1.41
13	日本	株式	アドバンテスト	電気機器	52,900	20,376.72	1,077,928,704	26,170.00	1,384,393,000	1.39
14	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	125,800	6,537.55	822,423,952	10,570.00	1,329,706,000	1.34
15	日本	株式	三菱電機	電気機器	194,500	4,998.25	972,160,588	6,558.00	1,275,531,000	1.28
16	日本	株式	三菱重工業	機械	332,700	4,225.13	1,405,702,993	3,806.00	1,266,256,200	1.27
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	178,000	7,307.56	1,300,746,784	7,111.00	1,265,758,000	1.27
18	日本	株式	信越化学工業	化学	156,600	6,266.83	981,385,922	7,758.00	1,214,902,800	1.22
19	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	625,200	1,974.43	1,234,414,360	1,935.50	1,210,074,600	1.22
20	日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	12,600	61,763.06	778,214,571	82,330.00	1,037,358,000	1.04
21	日本	株式	HOYA	精密機器	33,400	26,570.39	887,451,234	27,080.00	904,472,000	0.91
22	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	156,900	5,660.92	888,199,242	5,118.00	803,014,200	0.81
23	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	62,600	8,398.25	525,730,739	12,585.00	787,821,000	0.79
24	日本	株式	任天堂	その他製品	110,000	8,767.89	964,468,046	7,148.00	786,280,000	0.79
25	日本	株式	住友商事	卸売業	110,000	5,784.03	636,243,300	7,099.00	780,890,000	0.78
26	日本	株式	パナソニック ホールディングス	電気機器	209,800	2,591.67	543,733,775	3,700.00	776,260,000	0.78
27	日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	172,200	2,161.94	372,286,754	4,500.00	774,900,000	0.78
28	日本	株式	丸紅	卸売業	141,900	5,619.10	797,351,016	5,196.00	737,312,400	0.74
29	日本	株式	N T T	情報・通信業	4,841,200	157.07	760,407,284	149.50	723,759,400	0.73

30	日本	株式	キオクシアホールディングス	電気機器	10,800	19,470.85	210,285,228	65,850.00	711,180,000	0.71
----	----	----	---------------	------	--------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.06
		鉱業	0.34
		建設業	2.11
		食料品	2.56
		繊維製品	0.30
		パルプ・紙	0.12
		化学	4.81
		医薬品	3.23
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.52
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.63
		非鉄金属	2.79
		金属製品	0.48
		機械	5.99
		電気機器	21.39
		輸送用機器	5.21
		精密機器	1.86
		その他製品	1.82
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	1.76
		海運業	0.49
		空運業	0.25
		倉庫・運輸関連業	0.12
		情報・通信業	6.75
		卸売業	7.60
		小売業	3.81
		銀行業	10.66
		証券、商品先物取引業	0.84
		保険業	3.16
		その他金融業	1.19
		不動産業	1.63
		サービス業	3.20
合計			98.35

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	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	41	日本円	1,436,640,000	1,624,420,000	1.64

日立国内債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。
・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。

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	50,643,669,880	84.02
地方債証券	日本	3,164,884,000	5.25
特殊債券	日本	2,827,572,159	4.69
社債券	日本	3,153,979,000	5.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	481,977,798	0.79
合計(純資産総額)		60,272,082,837	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第484回利付 国債（2年）	760,000,000	100.07	760,547,200	100.06	760,494,000	1.4	2028/5/1	1.26
2	日本	国債証券	第371回利付 国債（10年）	720,000,000	89.03	641,059,200	88.12	634,485,600	0.4	2033/6/20	1.05
3	日本	国債証券	第372回利付 国債（10年）	680,000,000	91.22	620,302,800	90.16	613,142,400	0.8	2033/9/20	1.01
4	日本	国債証券	第185回利付 国債（5年）	580,000,000	100.43	582,504,800	100.50	582,934,800	2	2031/3/20	0.96
5	日本	国債証券	第373回利付 国債（10年）	640,000,000	89.32	571,660,800	88.23	564,710,400	0.6	2033/12/20	0.93
6	日本	国債証券	第177回利付 国債（5年）	570,000,000	98.07	559,010,400	98.10	559,192,800	1.1	2029/12/20	0.92
7	日本	国債証券	第360回利付 国債（10年）	590,000,000	92.96	548,493,500	93.00	548,723,600	0.1	2030/9/20	0.91
8	日本	国債証券	第170回利付 国債（5年）	550,000,000	97.05	533,813,500	97.18	534,539,500	0.6	2029/6/20	0.88
9	日本	国債証券	第378回利付 国債（10年）	580,000,000	92.86	538,641,800	91.43	530,340,400	1.4	2035/3/20	0.87
10	日本	国債証券	第179回利付 国債（5年）	540,000,000	97.06	524,148,600	97.03	523,978,200	1	2030/6/20	0.86
11	日本	国債証券	第163回利付 国債（5年）	520,000,000	97.51	507,093,600	97.69	507,993,200	0.4	2028/9/20	0.84
12	日本	国債証券	第367回利付 国債（10年）	560,000,000	89.84	503,132,000	89.36	500,444,000	0.2	2032/6/20	0.83
13	日本	国債証券	第368回利付 国債（10年）	560,000,000	89.30	500,084,000	88.73	496,888,000	0.2	2032/9/20	0.82
14	日本	国債証券	第374回利付 国債（10年）	540,000,000	90.26	487,425,600	89.04	480,864,600	0.8	2034/3/20	0.79
15	日本	国債証券	第375回利付 国債（10年）	530,000,000	92.02	487,721,900	90.64	480,423,800	1.1	2034/6/20	0.79
16	日本	国債証券	第178回利付 国債（5年）	490,000,000	97.43	477,426,600	97.41	477,328,600	1	2030/3/20	0.79

17	日本	国債証券	第157回利付 国債（5年）	480,000,000	97.77	469,329,600	97.99	470,380,800	0.2	2028/3/20	0.78
18	日本	国債証券	第377回利付 国債（10年）	520,000,000	91.90	477,926,800	90.36	469,877,200	1.2	2034/12/20	0.77
19	日本	国債証券	第174回利付 国債（5年）	470,000,000	96.99	455,862,400	97.11	456,435,800	0.7	2029/9/20	0.75
20	日本	国債証券	第182回利付 国債（5年）	460,000,000	98.52	453,228,800	98.34	452,377,800	1.4	2030/9/20	0.75
21	日本	国債証券	第181回利付 国債（5年）	460,000,000	98.08	451,211,300	97.92	450,450,400	1.3	2030/9/20	0.74
22	日本	国債証券	第158回利付 国債（5年）	460,000,000	97.58	448,895,600	97.82	449,972,000	0.1	2028/3/20	0.74
23	日本	国債証券	第168回利付 国債（5年）	460,000,000	97.40	448,044,600	97.52	448,633,400	0.6	2029/3/20	0.74
24	日本	国債証券	第354回利付 国債（10年）	460,000,000	95.95	441,388,400	96.19	442,515,400	0.1	2029/3/20	0.73
25	日本	国債証券	第166回利付 国債（20年）	570,000,000	79.09	450,813,000	76.94	438,580,800	0.7	2038/9/20	0.72
26	日本	国債証券	第168回利付 国債（20年）	600,000,000	74.64	447,865,200	72.50	435,000,000	0.4	2039/3/20	0.72
27	日本	国債証券	第369回利付 国債（10年）	480,000,000	90.65	435,153,600	89.92	431,654,400	0.5	2032/12/20	0.71
28	日本	国債証券	第167回利付 国債（5年）	430,000,000	96.82	416,326,000	96.97	417,005,400	0.4	2029/3/20	0.69
29	日本	国債証券	第376回利付 国債（10年）	470,000,000	90.04	423,197,400	88.63	416,565,700	0.9	2034/9/20	0.69
30	日本	国債証券	第356回利付 国債（10年）	430,000,000	94.97	408,383,900	95.21	409,433,100	0.1	2029/9/20	0.67

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	84.02
地方債証券	5.25
特殊債券	4.69
社債券	5.23
合計	99.20

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日立外国株式インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。
・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。

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	128,001,676,745	76.27
	カナダ	5,903,485,503	3.51
	ユーロ(ドイツ)	3,836,631,947	2.28
	ユーロ(イタリア)	1,261,014,793	0.75
	ユーロ(フランス)	3,779,838,308	2.25
	ユーロ(オランダ)	2,824,264,503	1.68

国債	ユーロ(スペイン)	1,564,542,816	0.93
	ユーロ(ベルギー)	384,105,353	0.22
	ユーロ(オーストリア)	138,974,649	0.08
	ユーロ(ルクセンブルク)	101,800,286	0.06
	ユーロ(フィンランド)	444,188,645	0.26
	ユーロ(アイルランド)	187,306,550	0.11
	ユーロ(ポルトガル)	76,046,523	0.04
	ユーロ(イギリス)	6,950,386	0.00
	ユーロ(スイス)	27,987,317	0.01
	ユーロ(バミューダ)	21,546,740	0.01
	ユーロ(ジャージー)	7,097,708	0.00
	イギリス	6,160,469,124	3.67
	スイス	3,994,629,666	2.38
	スウェーデン	1,479,548,025	0.88
	ノルウェー	284,522,754	0.16
	デンマーク	715,006,934	0.42
	オーストラリア	2,732,222,022	1.62
	ニュージーランド	76,549,009	0.04
	香港	760,791,611	0.45
	シンガポール	613,049,915	0.36
	イスラエル	387,329,836	0.23
	小計	165,771,577,668	98.77
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,055,191,053
合計(純資産総額)		167,826,768,721	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,450,146,152	0.86
	買建	カナダ	92,970,144	0.05
	買建	ドイツ	223,679,719	0.13
	買建	イギリス	89,581,685	0.05
	買建	オーストラリア	49,202,838	0.02

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	—	70,005,041	△0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	295,700	26,326.44	7,784,730,171	34,149.30	10,097,950,228	6.01
2	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	178,860	39,310.35	7,031,050,220	49,810.96	8,909,189,897	5.30
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	85,936	57,214.63	4,916,796,822	68,057.93	5,848,626,797	3.48
4	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	117,080	32,029.42	3,750,004,552	43,672.86	5,113,218,449	3.04
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	70,830	43,593.16	3,087,703,877	62,182.82	4,404,409,190	2.62
6	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半 導体製造装 置	54,810	46,766.61	2,563,278,437	67,992.58	3,726,673,650	2.22
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	59,220	43,535.78	2,578,189,164	61,543.66	3,644,615,948	2.17
8	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-A	メディア・ 娯楽	26,510	85,493.60	2,266,435,554	101,258.87	2,684,372,726	1.59
9	アメリカ	株式	TESLA, INC.	自動車・自 動車部品	34,400	56,628.07	1,948,005,925	70,466.31	2,424,041,374	1.44
10	アメリカ	株式	MICRON TECHNOLOGY	半導体・半 導体製造装 置	13,697	51,291.70	702,542,442	147,199.85	2,016,196,384	1.20
11	アメリカ	株式	ELI LILLY AND COMPANY	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	9,778	141,319.95	1,381,826,527	179,600.65	1,756,135,175	1.04
12	アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半 導体製造装 置	19,819	31,246.81	619,280,638	82,578.36	1,636,620,618	0.97
13	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	33,128	45,230.10	1,498,382,763	47,295.79	1,566,815,087	0.93
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービ ス	16,750	75,656.05	1,267,238,961	76,095.97	1,274,607,561	0.75
15	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	4,723	206,453.91	975,081,864	258,253.05	1,219,729,202	0.72
16	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	51,303	27,330.60	1,402,141,942	23,423.95	1,201,719,133	0.71
17	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	29,269	38,650.48	1,131,260,931	36,787.21	1,076,724,908	0.64
18	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービ ス	20,510	47,743.68	979,222,889	51,793.78	1,062,290,438	0.63
19	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	54,857	6,565.27	360,151,242	19,268.65	1,057,020,723	0.62
20	アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品 流通・小売 り	53,286	19,684.66	1,048,917,059	18,951.47	1,009,848,084	0.60
21	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	48,039	12,279.40	589,890,366	18,910.02	908,418,912	0.54
22	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品 流通・小売 り	5,399	158,844.88	857,603,540	158,624.92	856,415,986	0.51
23	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービ ス	10,300	78,738.66	811,008,198	78,698.81	810,597,769	0.48
24	アメリカ	株式	CATERPILLAR INC	資本財	5,690	106,381.66	605,311,689	141,485.72	805,053,754	0.47

25	アメリカ	株式	LAM RESEARCH CORP	半導体・半導体製造装置	15,300	31,866.84	487,562,693	50,686.02	775,496,106	0.46
26	アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	21,510	33,969.19	730,677,423	34,847.43	749,568,342	0.44
27	アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	51,628	14,818.48	765,048,914	13,764.92	710,655,310	0.42
28	アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS INC	半導体・半導体製造装置	9,652	51,502.09	497,098,239	71,674.49	691,802,228	0.41
29	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	20,976	22,123.33	464,059,012	32,467.74	681,043,377	0.40
30	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	23,295	33,585.06	782,364,134	29,173.15	679,588,569	0.40

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	不動産管理・開発	0.21
		エネルギー	3.94
		素材	3.33
		資本財	8.01
		商業・専門サービス	0.92
		運輸	1.37
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	0.77
		消費者サービス	1.45
		メディア・娯楽	7.64
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.71
		生活必需品流通・小売り	1.65
		食品・飲料・タバコ	2.43
		家庭用品・パーソナル用品	0.98
		ヘルスケア機器・サービス	2.47
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.20
		銀行	6.48
		金融サービス	5.96
		保険	2.52
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	1.47
		ソフトウェア・サービス	7.57
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.07
		電気通信サービス	1.16
		公益事業	2.55
		半導体・半導体製造装置	14.90
合計			98.77

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（先物）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	24	ドル	8,116,612.5	1,293,706,865	9,098,100	1,450,146,152	0.86
	カナダ	モントリオール取引所	S&PTSE602606	買建	2	カナダドル	767,980	88,778,488	804,240	92,970,144	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SMI 2606	買建	2	スイスフラン	253,600	51,556,880	269,980	54,886,934	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURX50 2606	買建	15	ユーロ	857,960	159,288,854	909,150	168,792,785	0.10
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 2606	買建	2	オーストラリアドル	424,450	48,438,234	431,150	49,202,838	0.02
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2606	買建	4	ポンド	413,695	88,654,838	418,020	89,581,685	0.05

（為替予約）

資産の種類	通貨	買建／ 売建	数量	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
為替予約取引	ドル	売建	288,727.09	46,000,000	46,004,186	△0.02
	ユーロ	売建	86,206.90	16,000,000	16,002,388	△0.00
	スウェーデンクローナ	売建	464,522.12	8,000,000	7,998,467	△0.00

日立外国債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2026年 5月29日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	24,440,449,982	44.24
	カナダ	1,156,417,244	2.09
	メキシコ	477,493,517	0.86
	ユーロ（ドイツ）	3,050,910,489	5.52
	ユーロ（イタリア）	3,562,637,726	6.44
	ユーロ（フランス）	3,942,315,025	7.13
	ユーロ（オランダ）	662,340,935	1.19
	ユーロ（スペイン）	2,343,636,309	4.24
	ユーロ（ベルギー）	814,586,034	1.47
	ユーロ（オーストリア）	562,571,150	1.01
	ユーロ（フィンランド）	287,322,033	0.52
	ユーロ（アイルランド）	226,153,744	0.40
	ユーロ（ポルトガル）	313,612,546	0.56
	イギリス	3,082,769,361	5.58
	スウェーデン	94,305,175	0.17

	ノルウェー	93,822,877	0.16
	デンマーク	108,916,767	0.19
	ポーランド	396,454,937	0.71
	オーストラリア	713,024,025	1.29
	ニュージーランド	158,001,290	0.28
	シンガポール	195,602,112	0.35
	マレーシア	287,315,842	0.52
	韓国	254,886,210	0.46
	イスラエル	250,487,785	0.45
	中国	6,938,297,713	12.56
	小計	54,414,330,828	98.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	824,446,153	1.49
合計(純資産総額)		55,238,776,981	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	3.625% US TREASURY N/B	1,680,000	15,722.32	264,135,129	15,615.23	262,336,016	3.625	2030/9/30	0.47
2	アメリカ	国債証券	4.625% US TREASURY N/B	1,490,000	16,333.73	243,372,715	16,196.76	241,331,777	4.625	2035/2/15	0.43
3	アメリカ	国債証券	4.250% US TREASURY N/B	1,530,000	15,876.73	242,914,094	15,745.98	240,913,627	4.25	2035/5/15	0.43
4	アメリカ	国債証券	3.750% US TREASURY N/B	1,460,000	15,922.81	232,473,055	15,910.35	232,291,250	3.75	2027/6/30	0.42
5	アメリカ	国債証券	1.000% US TREASURY N/B	1,500,000	14,932.85	223,992,760	14,940.32	224,104,830	1	2028/7/31	0.40
6	アメリカ	国債証券	4.000% US TREASURY N/B	1,410,000	15,697.42	221,333,684	15,582.86	219,718,367	4	2034/2/15	0.39
7	アメリカ	国債証券	4.250% US TREASURY N/B	1,370,000	15,860.55	217,289,538	15,729.80	215,498,269	4.25	2035/8/15	0.39
8	アメリカ	国債証券	4.375% US TREASURY N/B	1,340,000	16,087.23	215,568,918	15,958.92	213,849,578	4.375	2034/5/15	0.38
9	アメリカ	国債証券	0.625% US TREASURY N/B	1,550,000	13,825.83	214,300,478	13,794.70	213,817,949	0.625	2030/8/15	0.38
10	アメリカ	国債証券	4.250% US TREASURY N/B	1,350,000	15,911.60	214,806,664	15,782.10	213,058,355	4.25	2034/11/15	0.38
11	中国	国債証券	1.910% CHINA GOV'T	8,900,000	2,388.63	212,588,177	2,393.02	212,979,356	1.91	2029/7/15	0.38
12	中国	国債証券	1.400% CHINA GOV'T	9,000,000	2,357.00	212,130,746	2,360.74	212,467,270	1.4	2028/11/25	0.38
13	アメリカ	国債証券	3.875% US TREASURY N/B	1,370,000	15,511.88	212,512,819	15,394.83	210,909,207	3.875	2034/8/15	0.38
14	アメリカ	国債証券	1.375% US TREASURY N/B	1,520,000	13,799.68	209,755,248	13,773.53	209,357,769	1.375	2031/11/15	0.37
15	アメリカ	国債証券	1.125% US TREASURY N/B	1,380,000	15,143.29	208,977,473	15,164.46	209,269,605	1.125	2028/2/29	0.37
16	アメリカ	国債証券	3.500% US TREASURY N/B	1,300,000	15,792.36	205,300,696	15,722.32	204,390,279	3.5	2028/12/15	0.37
17	アメリカ	国債証券	1.250% US TREASURY N/B	1,340,000	15,149.52	203,003,586	15,160.72	203,153,762	1.25	2028/3/31	0.36
18	アメリカ	国債証券	1.25% US TREASURY N/B	1,340,000	15,118.39	202,586,434	15,124.61	202,669,863	1.25	2028/4/30	0.36

19	アメリカ	国債証券	4.625% US TREASURY N/B	1,240,000	16,285.17	201,936,172	16,174.34	200,561,932	4.625	2029/4/30	0.36
20	アメリカ	国債証券	2.875% US TREASURY N/B	1,320,000	14,884.28	196,472,583	14,797.12	195,321,986	2.875	2032/5/15	0.35
21	アメリカ	国債証券	0.625% US TREASURY N/B	1,400,000	13,944.13	195,217,883	13,922.96	194,921,518	0.625	2030/5/15	0.35
22	アメリカ	国債証券	1.250% US TREASURY N/B	1,410,000	13,811.14	194,737,124	13,766.06	194,101,532	1.25	2031/8/15	0.35
23	アメリカ	国債証券	4.500% US TREASURY N/B	1,200,000	16,245.02	194,940,346	16,113.33	193,359,994	4.5	2033/11/15	0.35
24	アメリカ	国債証券	1.625% US TREASURY N/B	1,350,000	14,194.42	191,624,760	14,134.65	190,817,848	1.625	2031/5/15	0.34
25	アメリカ	国債証券	4.125% US TREASURY N/B	1,200,000	15,919.07	191,028,915	15,809.49	189,713,947	4.125	2032/11/15	0.34
26	アメリカ	国債証券	3.875% US TREASURY N/B	1,220,000	15,617.72	190,536,300	15,509.39	189,214,609	3.875	2033/8/15	0.34
27	中国	国債証券	1.610% CHINA GOV'T	8,100,000	2,319.76	187,900,765	2,333.08	188,980,055	1.61	2035/2/15	0.34
28	アメリカ	国債証券	1.875% US TREASURY N/B	1,340,000	14,112.24	189,104,032	14,048.73	188,253,038	1.875	2032/2/15	0.34
29	アメリカ	国債証券	3.750% US TREASURY N/B	1,200,000	15,782.10	189,385,206	15,668.78	188,025,410	3.75	2031/1/31	0.34
30	アメリカ	国債証券	0.375% US TREASURY N/B	1,230,000	15,133.33	186,140,000	15,200.57	186,967,086	0.375	2027/9/30	0.33

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.50
合計	98.50

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。

《参考情報》

運用実績

2026年5月末現在

◆ 基準価額・純資産の推移(2016年5月末～2026年5月末)

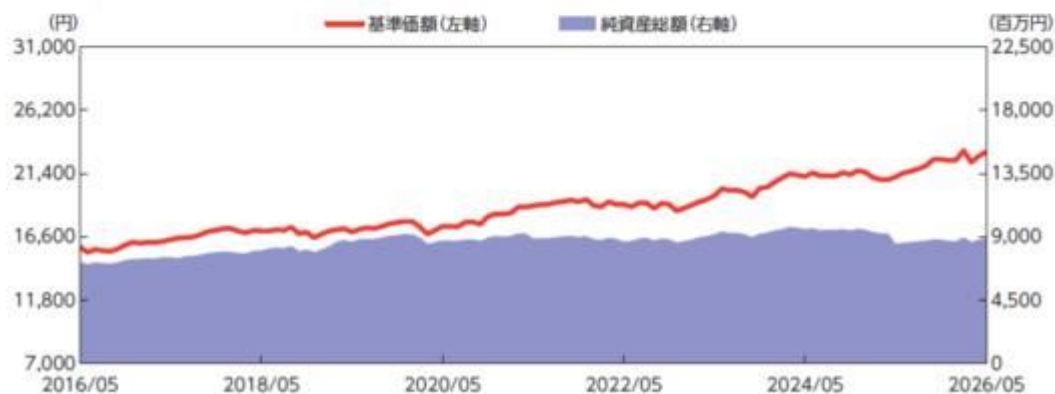
日立バランスファンド(株式70)



日立バランスファンド(株式50)



日立バランスファンド(株式30)



◆ 分配の推移

期中には分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保します。
そのため、これまでに分配金を支払ったことはありません。

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

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

国内株式(日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド)

○ 組入上位10銘柄

銘柄名	業種	組入比率
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.3%
トヨタ自動車	輸送用機器	2.9%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.6%
日立製作所	電気機器	2.3%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.2%
ソニーグループ	電気機器	2.1%
東京エレクトロン	電気機器	2.0%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.8%
三菱商事	卸売業	1.7%
村田製作所	電気機器	1.6%
合計		22.5%

○ 組入上位10業種

業種	組入比率
電気機器	21.4%
銀行業	10.7%
卸売業	7.6%
情報・通信業	6.8%
機械	6.0%
輸送用機器	5.2%
化学	4.8%
小売業	3.8%
医薬品	3.2%
サービス業	3.2%
合計	72.7%

外国株式(日立外国株式インデックスマザーファンド)

○ 組入上位10銘柄

銘柄名	国/地域	組入比率
NVIDIA CORP	アメリカ	6.0%
APPLE INC	アメリカ	5.3%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.5%
AMAZON COM INC	アメリカ	3.0%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	2.6%
BROADCOM INC	アメリカ	2.2%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	2.2%
META PLATFORMS INC-A	アメリカ	1.6%
TESLA,INC.	アメリカ	1.4%
MICRON TECHNOLOGY	アメリカ	1.2%
合計		29.0%

○ 組入上位10ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	76.3%
イギリス	3.7%
カナダ	3.5%
スイス	2.4%
ドイツ	2.3%
フランス	2.3%
オランダ	1.7%
オーストラリア	1.6%
スペイン	0.9%
スウェーデン	0.9%
合計	95.6%

国内債券(日立国内債券インデックスマザーファンド)

○ 組入上位10銘柄

銘柄名	償還期限	組入比率
第484回利付国債(2年)	2028/5/1	1.3%
第371回利付国債(10年)	2033/6/20	1.1%
第372回利付国債(10年)	2033/9/20	1.0%
第185回利付国債(5年)	2031/3/20	1.0%
第373回利付国債(10年)	2033/12/20	0.9%
第177回利付国債(5年)	2029/12/20	0.9%
第360回利付国債(10年)	2030/9/20	0.9%
第170回利付国債(5年)	2029/6/20	0.9%
第378回利付国債(10年)	2035/3/20	0.9%
第179回利付国債(5年)	2030/6/20	0.9%
合計		9.8%

○ 債券種別構成比

債券種別	組入比率
国債証券	84.0%
地方債証券	5.3%
社債券	5.2%
特殊債券	4.7%
合計	99.2%

外国債券(日立外国債券インデックスマザーファンド)

○ 組入上位10銘柄

銘柄名	償還期限	組入比率
米国債 3.625%	2030/9/30	0.5%
米国債 4.625%	2035/2/15	0.4%
米国債 4.250%	2035/5/15	0.4%
米国債 3.750%	2027/6/30	0.4%
米国債 1.000%	2028/7/31	0.4%
米国債 4.000%	2034/2/15	0.4%
米国債 4.250%	2035/8/15	0.4%
米国債 4.375%	2034/5/15	0.4%
米国債 0.625%	2030/8/15	0.4%
米国債 4.250%	2034/11/15	0.4%
合計		4.1%

○ 組入上位5ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	44.2%
中国	12.6%
フランス	7.1%
イタリア	6.4%
イギリス	5.6%
合計	75.9%

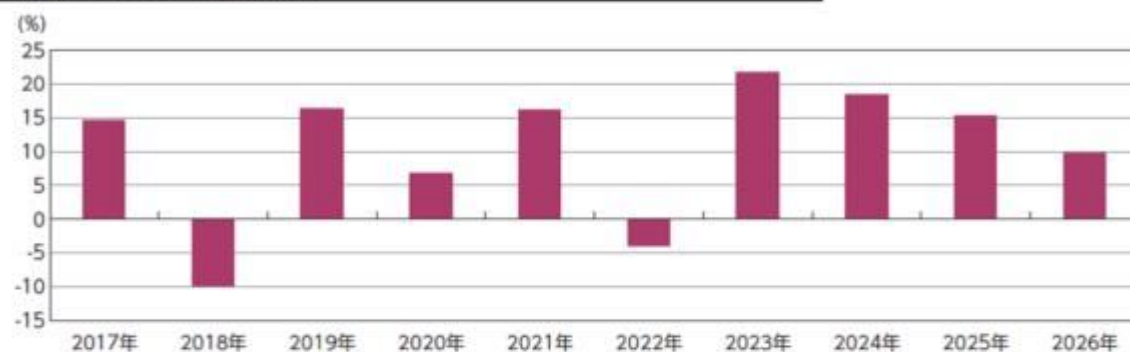
ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

◆ 資産の構成（資産別マザーファンドの保有時価比率を表示しています。）

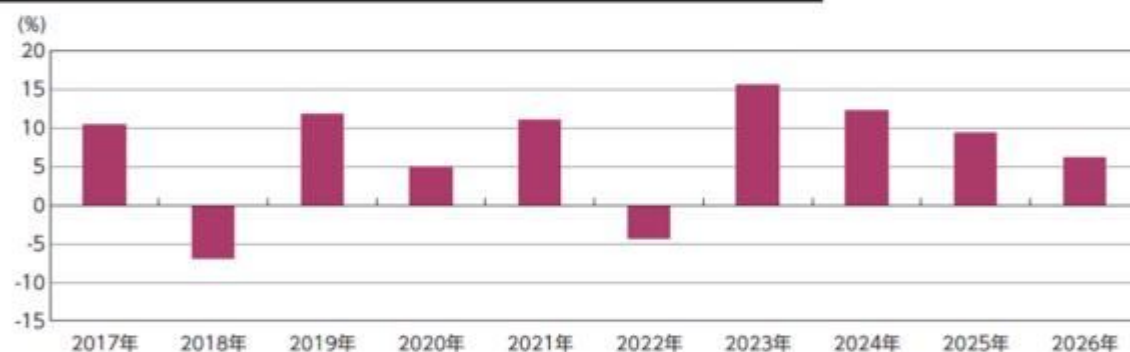
ファンド名	区分	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期資産
日立バランスファンド(株式70)	基本資産配分	40.0%	30.0%	20.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	40.3%	30.5%	19.0%	9.2%	1.0%
日立バランスファンド(株式50)	基本資産配分	30.0%	20.0%	40.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	30.2%	20.3%	39.1%	9.5%	0.9%
日立バランスファンド(株式30)	基本資産配分	20.0%	10.0%	60.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	20.1%	10.1%	59.1%	9.8%	0.9%

◆ 年間収益率の推移

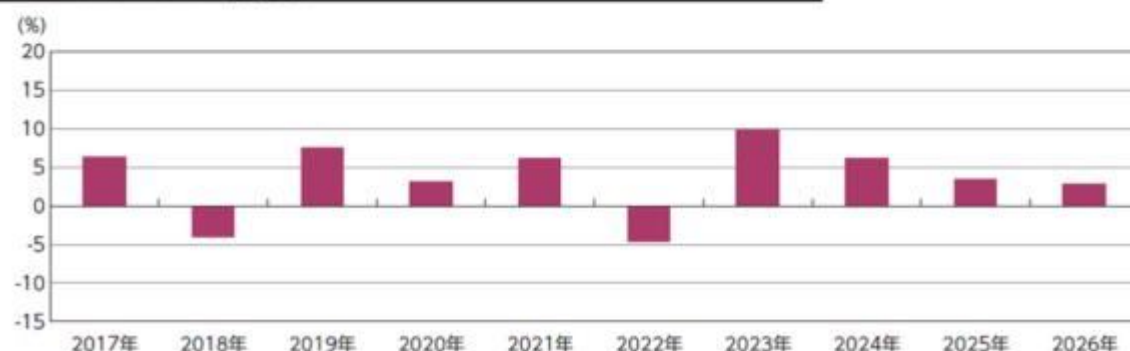
日立バランスファンド(株式70)



日立バランスファンド(株式50)



日立バランスファンド(株式30)



※2026年は、1月から5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) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。

- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会等に限るものとします。
- (2) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (3) 取扱時間
原則として、午後2時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
※販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (5) 申込単位
1円以上1円単位
- (6) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所[※]等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ときは、取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。
※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後2時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
※販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約制限
ありません。
- (4) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日立投資顧問株式会社

<電話番号>03-5539-2578（代表）

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

- (5) 手取額
1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。
※上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合を記載しています。
※税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。
- (6) 解約単位
1口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (7) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品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、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた解約請求の受付を取消することができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約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解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

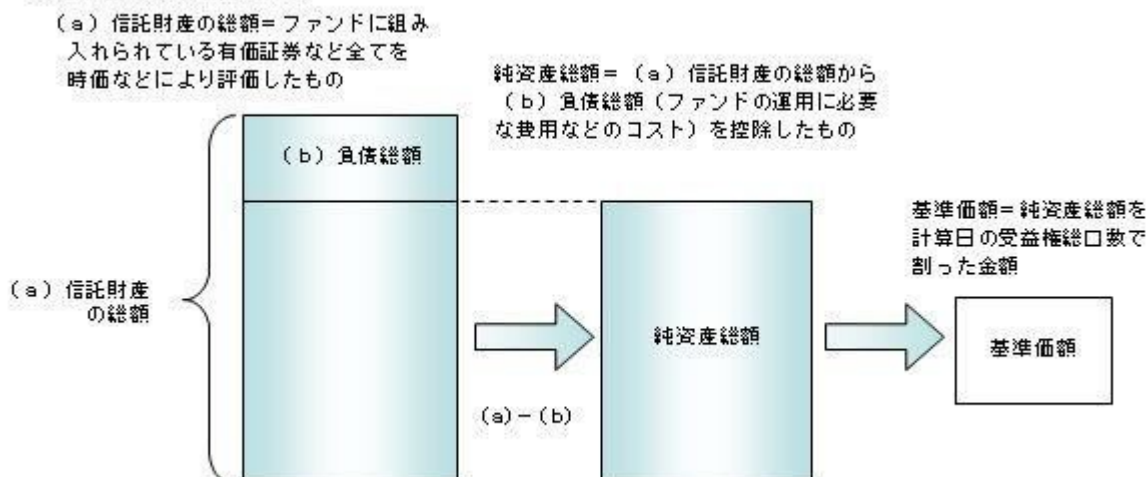
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・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。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人資産運用業協会規則に従って時価評価します。

<主な資産の評価方法>

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

◇外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

- ・価格情報会社の提供する価額

※残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

※外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、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相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日立投資顧問株式会社

<電話番号>03-5539-2578（代表）

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

（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】

無期限とします（2001年12月5日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年5月16日から翌年5月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

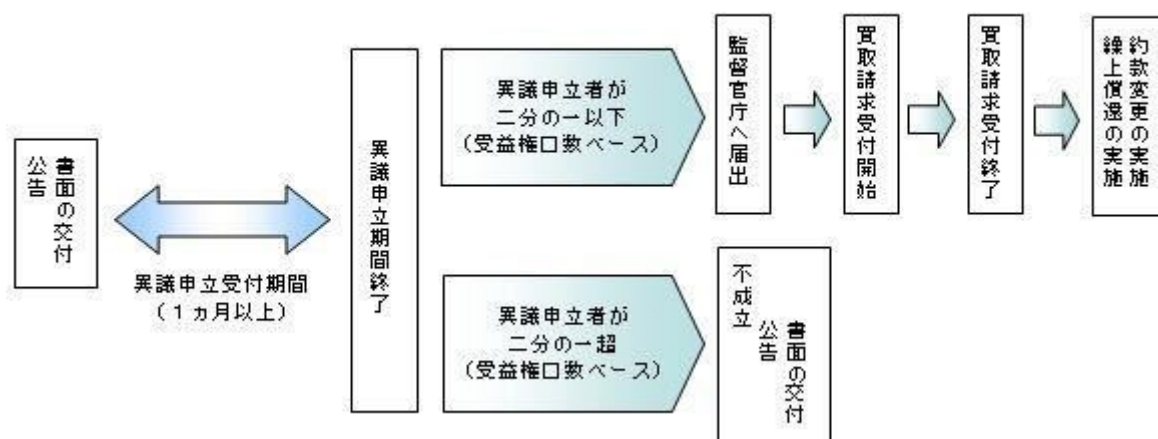
(5) 【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

- イ) 信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき
ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
イ) 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、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ハ) 委託会社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（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- ② 償還金について
・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
- ③ 信託約款の変更
1) 委託会社は、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、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。
- ④ 異議の申立て
1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



- ⑤ 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。
- ⑥ 運用報告書の作成
・ 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。
- ⑦ 関係法人との契約について
・ 販売会社との募集・販売に関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
・ 投資顧問会社とのマザーファンドに係る運用指図権限委託契約は、当該ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

4 【受益者の権利等】

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

(1) 一部解約（換金）請求権

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

(2) 償還金請求権

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

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

(3) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

(4) 反対者の買取請求権

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

(ご参考) 確定拠出年金の加入者等の権利

確定拠出年金の加入者等は、当ファンドの受益者ではないため、前記の権利を直接有しておりません。

ただし、加入者等は、運営管理機関に対して行う配分の指図（一部解約の指図）を通じて解約でき、また、ファンドの償還金は資産管理機関または連合会に支払われます。なお、これらは各事業主または連合会により定められた確定拠出年金に係る規約等にしながら行われるため、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）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）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25期計算期間（2025年5月16日から2026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】

【日立バランスファンド（株式７０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	371,416,391	486,247,167
親投資信託受益証券	39,860,959,288	50,041,056,664
未収入金	2,817,900,000	55,500,000
未収利息	3,561	7,993
流動資産合計	43,050,279,240	50,582,811,824
資産合計	43,050,279,240	50,582,811,824
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,746,230,914	39,943,634
未払受託者報酬	9,342,104	10,467,030
未払委託者報酬	23,355,204	26,167,521
流動負債合計	2,778,928,222	76,578,185
負債合計	2,778,928,222	76,578,185
純資産の部		
元本等		
元本	10,140,778,134	9,966,139,013
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,130,572,884	40,540,094,626
元本等合計	40,271,351,018	50,506,233,639
純資産合計	40,271,351,018	50,506,233,639
負債純資産合計	43,050,279,240	50,582,811,824

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期 自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
営業収益		
受取利息	589,665	1,994,894
有価証券売買等損益	1,097,292,176	11,050,297,376
営業収益合計	1,097,881,841	11,052,292,270
営業費用		
受託者報酬	18,747,217	19,949,524
委託者報酬	46,867,924	49,873,693
営業費用合計	65,615,141	69,823,217
営業利益又は営業損失（△）	1,032,266,700	10,982,469,053
経常利益又は経常損失（△）	1,032,266,700	10,982,469,053
当期純利益又は当期純損失（△）	1,032,266,700	10,982,469,053
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	107,310,770	559,910,102
期首剰余金又は期首欠損金（△）	31,373,165,849	30,130,572,884
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,279,812,724	3,264,548,315
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	3,279,812,724	3,264,548,315
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,447,361,619	3,277,585,524
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,447,361,619	3,277,585,524
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（△）	30,130,572,884	40,540,094,626

(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 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、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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026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	10,140,778,134口	9,966,139,013口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.9712円 (39,712円)	5.0678円 (50,678円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第24期計算期間 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026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	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式T O P I Xインデックス マザーファンド 年10,000分の2.15 日立国内債券インデックス マザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックス マザーファンド 年10,000分の4.1 日立外国債券インデックス マザーファンド 年10,000分の3.6	同左
2. 分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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25期 2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026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	880,132,891	10,303,247,152
合計	880,132,891	10,303,247,152

（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24期計算期間 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,906,043,166円	10,140,778,134円
期中追加設定元本額	1,126,870,948円	922,665,164円
期中一部解約元本額	1,892,135,980円	1,097,304,285円

（4）【附属明細表】
 （2026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	日立国内債券インデックスマザー ファンド	8,020,466,332	9,517,085,349	
		日立国内株式TOPIXインデック スマザーファンド	4,199,756,541	20,229,807,282	
		日立外国債券インデックスマザー ファンド	1,440,754,378	4,681,587,275	
		日立外国株式インデックスマザー ファンド	1,675,672,601	15,612,576,758	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.1%	15,336,649,852	50,041,056,664 100.0%	
合計				50,041,056,664	

(注1)組入時価比率(列項目：銘柄)は、組入時価の純資産に対する比率であります。
 (注2)組入時価比率(列項目：評価額)は、各評価額小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表
該当事項はありません。

【日立バランスファンド（株式５０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	245,415,545	248,059,302
親投資信託受益証券	27,285,036,872	31,006,010,540
未収入金	2,197,800,000	108,100,000
未収利息	2,353	4,077
流動資産合計	29,728,254,770	31,362,173,919
資産合計	29,728,254,770	31,362,173,919
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,134,177,037	54,269,126
未払受託者報酬	6,520,374	6,665,333
未払委託者報酬	16,300,882	16,663,272
流動負債合計	2,156,998,293	77,597,731
負債合計	2,156,998,293	77,597,731
純資産の部		
元本等		
元本	9,382,186,392	9,058,373,323
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,189,070,085	22,226,202,865
元本等合計	27,571,256,477	31,284,576,188
純資産合計	27,571,256,477	31,284,576,188
負債純資産合計	29,728,254,770	31,362,173,919

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期 自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
営業収益		
受取利息	418,416	1,246,885
有価証券売買等損益	327,461,962	4,788,493,668
営業収益合計	327,880,378	4,789,740,553
営業費用		
受託者報酬	13,175,696	13,013,860
委託者報酬	32,939,121	32,534,521
営業費用合計	46,114,817	45,548,381
営業利益又は営業損失（△）	281,765,561	4,744,192,172
経常利益又は経常損失（△）	281,765,561	4,744,192,172
当期純利益又は当期純損失（△）	281,765,561	4,744,192,172
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	41,463,940	211,975,755
期首剰余金又は期首欠損金（△）	19,805,210,314	18,189,070,085
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,144,967,896	1,100,457,690
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,144,967,896	1,100,457,690
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,001,409,746	1,595,541,327
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,001,409,746	1,595,541,327
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（△）	18,189,070,085	22,226,202,865

(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 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、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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026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	9,382,186,392口	9,058,373,323口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9387円 (29,387円)	3.4537円 (34,537円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第24期計算期間 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026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	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式T O P I Xインデックス マザーファンド 年10,000分の2.15 日立国内債券インデックス マザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックス マザーファンド 年10,000分の4.1 日立外国債券インデックス マザーファンド 年10,000分の3.6	同左
2. 分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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25期 2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026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	186,444,816	4,217,564,301
合計	186,444,816	4,217,564,301

（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24期計算期間 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,357,541,057円	9,382,186,392円
期中追加設定元本額	593,735,746円	497,203,462円
期中一部解約元本額	1,569,090,411円	821,016,531円

（4）【附属明細表】
 （2026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	日立国内債券インデックスマザー ファンド	10,221,097,876	12,128,354,739	
		日立国内株式T O P I Xインデック スマザーファンド	1,960,897,374	9,445,446,560	
		日立外国債券インデックスマザー ファンド	919,752,404	2,988,643,461	
		日立外国株式インデックスマザー ファンド	691,577,489	6,443,565,780	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.1%	13,793,325,143	31,006,010,540 100.0%	
合計				31,006,010,540	

(注1)組入時価比率(列項目：銘柄)は、組入時価の純資産に対する比率であります。
 (注2)組入時価比率(列項目：評価額)は、各評価額小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表
該当事項はありません。

【日立バランスファンド（株式３０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	83,526,148	90,397,212
親投資信託受益証券	8,446,643,940	8,722,518,361
未収入金	766,500,000	20,800,000
未収利息	800	1,485
流動資産合計	9,296,670,888	8,833,717,058
資産合計	9,296,670,888	8,833,717,058
負債の部		
流動負債		
未払解約金	752,003,107	25,517,991
未払受託者報酬	2,046,680	1,915,378
未払委託者報酬	5,116,647	4,788,379
流動負債合計	759,166,434	32,221,748
負債合計	759,166,434	32,221,748
純資産の部		
元本等		
元本	4,053,828,512	3,862,217,373
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,483,675,942	4,939,277,937
元本等合計	8,537,504,454	8,801,495,310
純資産合計	8,537,504,454	8,801,495,310
負債純資産合計	9,296,670,888	8,833,717,058

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期 自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
営業収益		
受取利息	137,529	386,913
有価証券売買等損益	△55,475,850	698,174,421
営業収益合計	△55,338,321	698,561,334
営業費用		
受託者報酬	4,159,466	3,834,032
委託者報酬	10,398,546	9,584,966
営業費用合計	14,558,012	13,418,998
営業利益又は営業損失（△）	△69,896,333	685,142,336
経常利益又は経常損失（△）	△69,896,333	685,142,336
当期純利益又は当期純損失（△）	△69,896,333	685,142,336
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（△）	△2,902,970	61,011,635
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,084,721,285	4,483,675,942
剰余金増加額又は欠損金減少額	464,727,246	498,859,062
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	464,727,246	498,859,062
剰余金減少額又は欠損金増加額	998,779,226	667,387,768
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	998,779,226	667,387,768
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,483,675,942	4,939,277,937

（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 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、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。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026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	4,053,828,512口	3,862,217,373口
１口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1060円 (21,060円)	2.2789円 (22,789円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第24期計算期間 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026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	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式T O P I Xインデックス マザーファンド 年10,000分の2.15 日立国内債券インデックス マザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックス マザーファンド 年10,000分の4.1 日立外国債券インデックス マザーファンド 年10,000分の3.6	同左
２．分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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25期 2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第24期 2025年 5月15日現在	第25期 2026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	△81,158,864	545,992,322
合計	△81,158,864	545,992,322

（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24期計算期間 自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	第25期計算期間 自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,528,151,987円	4,053,828,512円
期中追加設定元本額	415,248,819円	409,848,939円
期中一部解約元本額	889,572,294円	601,460,078円

（4）【附属明細表】
（2026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	日立国内債券インデックスマザー ファンド	4,363,745,585	5,178,020,511	
		日立国内株式T O P I Xインデック スマザーファンド	368,713,420	1,776,055,672	
		日立外国債券インデックスマザー ファンド	264,435,471	859,256,619	
		日立外国株式インデックスマザー ファンド	97,581,415	909,185,559	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.1%	5,094,475,891	8,722,518,361 100.0%	
合計				8,722,518,361	

（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。

（参考）

当ファンドは「日立国内株式T O P I Xインデックスマザーファンド」、「日立国内債券インデックスマザーファンド」、「日立外国株式インデックスマザーファンド」、「日立外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は、次のとおりです。
以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

日立国内株式T O P I Xインデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)		
	2025年 5月15日現在	2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,549,712,850	589,796,690
株式	72,067,620,340	95,404,471,010
派生商品評価勘定	10,798,615	106,062,005
未収入金	2,397,207,223	279,871,760
未収配当金	907,897,605	946,470,768
未収利息	24,449	9,695
差入委託証拠金	101,702,013	98,641,023
流動資産合計	78,034,963,095	97,425,322,951
資産合計	78,034,963,095	97,425,322,951
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,425,540	-
前受金	9,035,300	106,697,300
未払金	-	28,404,400
未払解約金	4,397,300,000	180,800,000
流動負債合計	4,423,760,840	315,901,700
負債合計	4,423,760,840	315,901,700
純資産の部		
元本等		
元本	22,061,472,950	20,160,301,490
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	51,549,729,305	76,949,119,761
元本等合計	73,611,202,255	97,109,421,251
純資産合計	73,611,202,255	97,109,421,251
負債純資産合計	78,034,963,095	97,425,322,951

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	2025年 5月15日現在	2026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	22,061,472,950口	20,160,301,490口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3366円 (33,366円)	4.8169円 (48,169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 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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	2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	2025年 5月15日現在	2026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	2,249,715,426	9,019,870,715
合計	2,249,715,426	9,019,870,715

(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 2025年 5月16日 至 2026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ないません。
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、資産運用業協会の諸規則、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)

(2025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	1,509,749,700	—	1,503,150,000	△6,599,700
	東証株価指数先物	1,509,749,700	—	1,503,150,000	△6,599,700
合計		1,509,749,700	—	1,503,150,000	△6,599,700

(2026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	1,485,332,700	—	1,591,415,000	106,082,300
	東証株価指数先物	1,485,332,700	—	1,591,415,000	106,082,300
合計		1,485,332,700	—	1,591,415,000	106,082,300

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 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	23,546,892,390円	22,061,472,950円
期中追加設定元本額	2,079,793,505円	1,133,188,800円
期中一部解約元本額	3,565,212,945円	3,034,360,260円
期末元本額	22,061,472,950円	20,160,301,490円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式70）	4,737,642,086円	4,199,756,541円
日立バランスファンド（株式50）	2,428,873,007円	1,960,897,374円
日立バランスファンド（株式30）	499,570,446円	368,713,420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）	3,945,696,773円	3,249,813,288円
日立国内株式インデックスファンド	10,449,690,638円	10,381,120,867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

(2026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	1,000	4,535.00	4,535,000	
	ニッスイ	22,600	1,315.50	29,730,300	

U m i o s	12,000	1,255.00	15,060,000	
ユキグニファクトリー	2,100	1,068.00	2,242,800	
カネコ種苗	700	1,412.00	988,400	
サカタのタネ	3,000	4,100.00	12,300,000	
ホクト	2,200	1,896.00	4,171,200	
住石ホールディングス	2,200	704.00	1,548,800	
日鉄鉱業	4,700	2,608.00	12,257,600	
I N P E X	82,900	3,921.00	325,050,900	
石油資源開発	15,200	1,965.00	29,868,000	
K&Oエナジーグループ	1,100	4,605.00	5,065,500	
ショーボンドホールディングス	14,400	1,319.50	19,000,800	
ミライト・ワン	8,400	4,041.00	33,944,400	
タマホーム	1,600	3,635.00	5,816,000	
第一カッター興業	600	1,401.00	840,600	
安藤・間	13,100	1,896.00	24,837,600	
東急建設	7,700	1,255.00	9,663,500	
コムシスホールディングス	7,800	5,681.00	44,311,800	
ビーアールホールディングス	1,200	526.00	631,200	
高松コンストラクショングループ	1,800	3,755.00	6,759,000	
東建コーポレーション	500	13,080.00	6,540,000	
ヤマウラ	1,400	1,442.00	2,018,800	
オリエンタル白石	9,100	333.00	3,030,300	
大成建設	12,900	14,695.00	189,565,500	
大林組	54,600	3,558.00	194,266,800	
清水建設	47,200	2,782.00	131,310,400	
長谷工コーポレーション	15,400	2,684.00	41,333,600	
松井建設	1,400	1,427.00	1,997,800	
鹿島建設	38,300	5,843.00	223,786,900	
不動テトラ	1,000	2,888.00	2,888,000	
鉄建建設	1,100	4,810.00	5,291,000	
西松建設	2,800	5,584.00	15,635,200	
大豊建設	2,400	746.00	1,790,400	
奥村組	2,800	5,950.00	16,660,000	
東鉄工業	1,900	4,750.00	9,025,000	
浅沼組	6,900	854.00	5,892,600	
戸田建設	20,900	1,491.50	31,172,350	
熊谷組	10,300	1,425.00	14,677,500	
矢作建設工業	3,200	1,888.00	6,041,600	
ピーエス・コンストラクション	1,600	2,450.00	3,920,000	
日本ハウスホールディングス	3,700	304.00	1,124,800	
新日本建設	2,400	2,256.00	5,414,400	
東亜道路工業	2,700	1,558.00	4,206,600	
東亜建設工業	6,400	2,597.00	16,620,800	

日本国土開発	5,300	582.00	3,084,600	
若築建設	500	3,695.00	1,847,500	
五洋建設	24,500	1,943.00	47,603,500	
世紀東急工業	2,700	1,471.00	3,971,700	
福田組	600	8,180.00	4,908,000	
住友林業	44,800	1,295.50	58,038,400	
大和ハウス工業	47,800	4,538.00	216,916,400	
ライト工業	3,100	4,095.00	12,694,500	
積水ハウス	52,400	3,396.00	177,950,400	
日特建設	1,700	1,174.00	1,995,800	
北陸電気工事	1,000	1,667.00	1,667,000	
ユアテック	3,600	2,476.00	8,913,600	
日本リーテック	1,300	2,921.00	3,797,300	
四電工	2,200	2,014.00	4,430,800	
中電工	2,300	4,825.00	11,097,500	
関電工	9,500	6,845.00	65,027,500	
きんでん	11,800	7,458.00	88,004,400	
東京エネシス	1,500	2,308.00	3,462,000	
トーエネック	3,300	2,324.00	7,669,200	
日本電設工業	3,200	4,625.00	14,800,000	
エクシオグループ	16,200	2,917.00	47,255,400	
新日本空調	2,200	3,530.00	7,766,000	
クラフティア	3,700	9,336.00	34,543,200	
三機工業	10,600	2,575.00	27,295,000	
日揮ホールディングス	17,700	2,710.50	47,975,850	
中外炉工業	500	4,555.00	2,277,500	
太平電業	3,400	2,717.00	9,237,800	
高砂熱学工業	9,200	4,520.00	41,584,000	
朝日工業社	1,800	4,145.00	7,461,000	
明星工業	2,900	1,780.00	5,162,000	
大気社	4,200	3,735.00	15,687,000	
ダイダン	10,000	2,660.00	26,600,000	
日比谷総合設備	2,300	3,185.00	7,325,500	
飛島ホールディングス	1,800	2,015.00	3,627,000	
フィル・カンパニー	300	735.00	220,500	
テスホールディングス	4,700	797.00	3,745,900	
インフロニア・ホールディングス	18,100	2,487.00	45,014,700	
レイズネクスト	2,500	2,310.00	5,775,000	
ニッポン	6,100	2,713.00	16,549,300	
日清製粉グループ本社	16,700	1,941.50	32,423,050	
日東富士製粉	1,200	1,799.00	2,158,800	
昭和産業	1,500	3,160.00	4,740,000	
中部飼料	2,200	1,804.00	3,968,800	

フィード・ワン	2,300	1,253.00	2,881,900	
日本甜菜製糖	800	4,240.00	3,392,000	
DM三井製糖	1,400	3,290.00	4,606,000	
ウェルネオシュガー	1,000	2,703.00	2,703,000	
森永製菓	6,800	2,501.00	17,006,800	
中村屋	400	3,140.00	1,256,000	
江崎グリコ	5,000	5,517.00	27,585,000	
me i t o	700	3,090.00	2,163,000	
井村屋グループ	900	2,238.00	2,014,200	
不二家	1,200	2,389.00	2,866,800	
山崎製パン	11,600	3,111.00	36,087,600	
モロゾフ	1,600	1,515.00	2,424,000	
亀田製菓	3,300	1,305.00	4,306,500	
寿スピリッツ	9,200	2,121.50	19,517,800	
カルビー	7,900	2,904.50	22,945,550	
森永乳業	6,200	4,522.00	28,036,400	
六甲バター	1,400	1,099.00	1,538,600	
ヤクルト本社	22,300	2,761.50	61,581,450	
明治ホールディングス	24,200	3,701.00	89,564,200	
雪印メグミルク	4,200	3,420.00	14,364,000	
プリマハム	2,300	2,507.00	5,766,100	
日本ハム	6,500	6,108.00	39,702,000	
丸大食品	1,700	2,293.00	3,898,100	
S F o o d s	1,900	2,841.00	5,397,900	
柿安本店	700	2,583.00	1,808,100	
伊藤ハム米久ホールディングス	3,000	4,965.00	14,895,000	
サッポロホールディングス	25,900	1,591.50	41,219,850	
アサヒグループホールディングス	130,200	1,536.00	199,987,200	
キリンホールディングス	64,500	2,623.00	169,183,500	
シマダヤ	800	1,630.00	1,304,000	
宝ホールディングス	14,300	1,823.00	26,068,900	
オエノンホールディングス	5,200	490.00	2,548,000	
養命酒製造	200	4,030.00	806,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホール デ	11,300	3,404.00	38,465,200	
ライフドリンク カンパニー	3,100	1,253.00	3,884,300	
サントリービバレッジ&フード	12,200	4,196.00	51,191,200	
ダイドーグループホールディングス	2,000	2,624.00	5,248,000	
伊藤園	5,600	2,928.00	16,396,800	
キーコーヒー	1,900	1,929.00	3,665,100	
日清オイリオグループ	7,300	1,805.00	13,176,500	
不二製油	3,500	3,525.00	12,337,500	
Jーオイルミルズ	2,000	1,993.00	3,986,000	
キッコーマン	57,400	1,408.00	80,819,200	

味の素	83,700	5,269.00	441,015,300	
ブルドックソース	900	1,809.00	1,628,100	
キューピー	9,300	4,064.00	37,795,200	
ハウス食品グループ本社	6,500	3,368.00	21,892,000	
カゴメ	9,000	2,569.00	23,121,000	
アリアケジャパン	1,900	5,530.00	10,507,000	
エバラ食品工業	400	2,519.00	1,007,600	
ニチレイ	15,200	1,858.00	28,241,600	
東洋水産	8,000	10,800.00	86,400,000	
イトアンドホールディングス	800	2,004.00	1,603,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,300	649.00	843,700	
日清食品ホールディングス	19,600	2,684.00	52,606,400	
フジッコ	2,000	1,493.00	2,986,000	
ロック・フィールド	1,900	1,311.00	2,490,900	
日本たばこ産業	105,300	6,301.00	663,495,300	
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,965.00	2,161,500	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	2,721.00	3,265,200	
なとり	1,100	1,900.00	2,090,000	
ファーマフーズ	2,100	650.00	1,365,000	
ユーグレナ	11,900	377.00	4,486,300	
紀文食品	1,500	1,040.00	1,560,000	
ピックスホールディングス	1,000	1,103.00	1,103,000	
オリオンビール	3,900	1,174.00	4,578,600	
理研ビタミン	1,500	2,825.00	4,237,500	
片倉工業	1,900	2,658.00	5,050,200	
グンゼ	2,500	3,735.00	9,337,500	
ユニチカ	6,100	1,415.00	8,631,500	
富士紡ホールディングス	2,500	4,370.00	10,925,000	
倉敷紡績	1,200	11,550.00	13,860,000	
シキボウ	1,200	1,046.00	1,255,200	
日本毛織	4,400	1,826.00	8,034,400	
帝国繊維	1,800	3,200.00	5,760,000	
帝人	15,600	1,681.50	26,231,400	
東レ	118,800	1,150.00	136,620,000	
セーレン	3,800	3,275.00	12,445,000	
小松マテーレ	2,300	707.00	1,626,100	
ワコールホールディングス	3,500	4,380.00	15,330,000	
T S I ホールディングス	4,600	1,189.00	5,469,400	
ワールド	5,800	1,513.00	8,775,400	
三陽商会	800	3,825.00	3,060,000	
オンワードホールディングス	10,300	739.00	7,611,700	
ルックホールディングス	600	2,584.00	1,550,400	
ゴールドウイン	10,300	2,198.00	22,639,400	

特種東海製紙	3,100	1,714.00	5,313,400	
王子ホールディングス	66,800	857.00	57,247,600	
日本製紙	9,900	1,450.00	14,355,000	
北越コーポレーション	8,600	892.00	7,671,200	
大王製紙	8,900	969.00	8,624,100	
レンゴー	17,800	1,404.00	24,991,200	
トーモク	1,000	3,945.00	3,945,000	
ザ・バック	3,500	1,324.00	4,634,000	
北の達人コーポレーション	7,400	129.00	954,600	
東洋紡	7,600	1,642.00	12,479,200	
クラレ	22,300	1,631.00	36,371,300	
旭化成	116,900	1,728.00	202,003,200	
レゾナック・ホールディングス	17,000	17,200.00	292,400,000	
住友化学	141,900	623.60	88,488,840	
住友精化	3,700	1,260.00	4,662,000	
日産化学	8,900	7,234.00	64,382,600	
ラサ工業	2,900	2,048.00	5,939,200	
クレハ	2,600	3,835.00	9,971,000	
多木化学	700	5,450.00	3,815,000	
テイカ	1,300	2,047.00	2,661,100	
石原産業	2,900	2,778.00	8,056,200	
日本曹達	3,600	3,460.00	12,456,000	
東ソー	25,700	2,627.00	67,513,900	
トクヤマ	6,200	4,645.00	28,799,000	
セントラル硝子	2,200	3,945.00	8,679,000	
東亜合成	7,100	1,748.50	12,414,350	
大阪ソーダ	6,200	1,831.00	11,352,200	
関東電化工業	3,400	2,050.00	6,970,000	
デンカ	7,000	3,876.00	27,132,000	
信越化学工業	156,800	7,105.00	1,114,064,000	
日本カーバイド工業	900	2,957.00	2,661,300	
堺化学工業	1,400	3,430.00	4,802,000	
第一稀元素化学工業	1,800	2,188.00	3,938,400	
日本酸素ホールディングス	20,000	6,116.00	122,320,000	
日本化学工業	700	3,735.00	2,614,500	
日本パーカライジング	8,700	1,531.00	13,319,700	
高圧ガス工業	2,600	1,120.00	2,912,000	
四国化成ホールディングス	2,000	5,880.00	11,760,000	
戸田工業	400	1,538.00	615,200	
ステラ ケミファ	900	6,000.00	5,400,000	
保土谷化学工業	1,100	2,554.00	2,809,400	
日本触媒	10,900	2,097.00	22,857,300	
大日精化工業	4,800	1,104.00	5,299,200	

カネカ	4,100	5,355.00	21,955,500	
三菱瓦斯化学	12,500	4,641.00	58,012,500	
三井化学	31,700	2,149.50	68,139,150	
東京応化工業	8,400	10,760.00	90,384,000	
大阪有機化学工業	1,500	5,120.00	7,680,000	
三菱ケミカルグループ	123,400	1,016.50	125,436,100	
KHネオケム	2,900	2,693.00	7,809,700	
ダイセル	19,300	1,186.50	22,899,450	
住友ベークライト	5,800	6,572.00	38,117,600	
積水化学工業	36,800	2,334.50	85,909,600	
日本ゼオン	12,400	2,245.00	27,838,000	
アイカ工業	4,400	3,482.00	15,320,800	
UBE	9,100	2,384.00	21,694,400	
積水樹脂	2,100	2,161.00	4,538,100	
旭有機材	1,200	5,970.00	7,164,000	
ニチバン	1,100	1,902.00	2,092,200	
リケンテクノス	3,000	1,681.00	5,043,000	
大倉工業	900	4,980.00	4,482,000	
積水化成品工業	2,800	532.00	1,489,600	
群栄化学工業	400	4,945.00	1,978,000	
ダイキョーニシカワ	3,700	1,069.00	3,955,300	
森六	900	2,517.00	2,265,300	
恵和	1,100	1,255.00	1,380,500	
日本化薬	12,600	2,058.00	25,930,800	
カーリット	1,500	2,740.00	4,110,000	
日本精化	1,100	2,495.00	2,744,500	
扶桑化学工業	5,600	4,045.00	22,652,000	
トリケミカル研究所	2,100	3,430.00	7,203,000	
ADEKA	6,800	4,125.00	28,050,000	
日油	20,200	2,847.00	57,509,400	
ハリマ化成グループ	1,400	947.00	1,325,800	
花王	41,800	5,883.00	245,909,400	
第一工業製薬	700	8,780.00	6,146,000	
石原ケミカル	700	2,551.00	1,785,700	
三洋化成工業	1,100	5,440.00	5,984,000	
大日本塗料	2,000	1,206.00	2,412,000	
日本ペイントホールディングス	93,600	998.60	93,468,960	
関西ペイント	14,100	2,300.00	32,430,000	
中国塗料	3,600	3,020.00	10,872,000	
藤倉化成	2,000	1,065.00	2,130,000	
太陽ホールディングス	8,500	4,900.00	41,650,000	
DIC	6,300	4,199.00	26,453,700	
サカタインクス	3,900	2,304.00	8,985,600	

artience	3,300	4,120.00	13,596,000	
富士フイルムホールディングス	106,400	3,110.00	330,904,000	
資生堂	34,200	2,948.50	100,838,700	
ライオン	20,300	1,545.00	31,363,500	
高砂香料工業	6,600	1,202.00	7,933,200	
ミルボン	2,800	2,541.00	7,114,800	
コーセーホールディングス	4,000	5,208.00	20,832,000	
コタ	1,900	1,163.00	2,209,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,100	1,274.50	11,597,950	
ノエビアホールディングス	1,600	4,280.00	6,848,000	
新日本製薬	1,000	1,932.00	1,932,000	
I-ne	500	1,146.00	573,000	
アクシージア	1,000	333.00	333,000	
エステー	1,700	1,457.00	2,476,900	
コニシ	5,600	1,468.00	8,220,800	
長谷川香料	3,400	3,070.00	10,438,000	
小林製薬	4,600	5,821.00	26,776,600	
荒川化学工業	1,500	1,369.00	2,053,500	
メック	1,300	10,470.00	13,611,000	
日本高純度化学	400	5,420.00	2,168,000	
タカラバイオ	2,400	1,143.00	2,743,200	
JCU	1,900	7,450.00	14,155,000	
OATアグリオ	700	2,847.00	1,992,900	
デクセリアルズ	15,000	3,849.00	57,735,000	
アース製薬	1,600	4,610.00	7,376,000	
北興化学工業	1,300	1,760.00	2,288,000	
大成ラミックグループ	500	2,315.00	1,157,500	
クミアイ化学工業	7,900	770.00	6,083,000	
日本農薬	2,700	986.00	2,662,200	
アキレス	1,000	1,246.00	1,246,000	
有沢製作所	3,100	2,357.00	7,306,700	
日東電工	53,600	2,958.50	158,575,600	
レック	1,800	1,035.00	1,863,000	
三光合成	2,200	840.00	1,848,000	
ZACROS	5,600	1,278.00	7,156,800	
前澤化成工業	1,100	1,832.00	2,015,200	
未来工業	800	3,070.00	2,456,000	
JSP	1,000	2,585.00	2,585,000	
エフピコ	3,300	2,341.00	7,725,300	
信越ポリマー	3,800	2,298.00	8,732,400	
ニフコ	6,600	4,537.00	29,944,200	
バルカー	1,500	6,190.00	9,285,000	
ユニ・チャーム	110,300	936.00	103,240,800	

協和キリン	20,800	2,370.00	49,296,000	
武田薬品工業	157,100	5,277.00	829,016,700	
アステラス製薬	154,900	2,324.50	360,065,050	
住友ファーマ	17,700	1,709.00	30,249,300	
塩野義製薬	64,400	3,080.00	198,352,000	
日本新薬	4,600	4,237.00	19,490,200	
中外製薬	55,300	7,938.00	438,971,400	
科研製薬	2,600	4,150.00	10,790,000	
エーザイ	23,000	4,723.00	108,629,000	
ロート製薬	18,700	2,438.50	45,599,950	
小野薬品工業	39,400	2,533.50	99,819,900	
持田製薬	2,200	3,415.00	7,513,000	
参天製薬	29,700	1,861.00	55,271,700	
扶桑薬品工業	700	2,080.00	1,456,000	
ツムラ	6,100	3,778.00	23,045,800	
キッセイ薬品工業	2,800	4,305.00	12,054,000	
生化学工業	3,000	748.00	2,244,000	
栄研化学	2,500	2,844.00	7,110,000	
J C Rファーマ	7,700	522.00	4,019,400	
東和薬品	2,400	3,780.00	9,072,000	
富士製薬工業	1,400	2,038.00	2,853,200	
ゼリア新薬工業	2,300	2,350.00	5,405,000	
ネクスラファーマ	7,700	1,172.00	9,024,400	
第一三共	162,100	2,574.00	417,245,400	
杏林製薬	3,600	1,420.00	5,112,000	
大幸薬品	3,700	271.00	1,002,700	
ダイト	2,200	1,245.00	2,739,000	
大塚ホールディングス	39,300	11,235.00	441,535,500	
ペプチドリーム	8,600	1,127.00	9,692,200	
セルソース	1,000	363.00	363,000	
あすか製薬ホールディングス	1,700	2,808.00	4,773,600	
サワイグループホールディングス	9,100	2,032.50	18,495,750	
日本コークス工業	17,900	99.00	1,772,100	
ニチレキグループ	1,900	2,005.00	3,809,500	
ユシロ	900	3,315.00	2,983,500	
出光興産	76,400	1,428.00	109,099,200	
ENEOSホールディングス	249,500	1,386.00	345,807,000	
コスモエネルギーホールディングス	9,800	3,832.00	37,553,600	
横浜ゴム	9,900	6,600.00	65,340,000	
TOYO TIRE	11,200	3,814.00	42,716,800	
ブリヂストン	96,600	3,387.00	327,184,200	
住友ゴム工業	19,000	2,048.00	38,912,000	
藤倉コンポジット	1,500	2,545.00	3,817,500	

オカモト	900	5,400.00	4,860,000	
フコク	800	1,779.00	1,423,200	
ニッタ	1,700	5,600.00	9,520,000	
三ツ星ベルト	2,300	4,095.00	9,418,500	
バンドー化学	2,600	2,209.00	5,743,400	
日東紡績	2,200	23,900.00	52,580,000	
A G C	17,200	5,999.00	103,182,800	
日本板硝子	10,300	481.00	4,954,300	
日本電気硝子	5,900	7,004.00	41,323,600	
オハラ	700	1,385.00	969,500	
住友大阪セメント	3,000	4,898.00	14,694,000	
太平洋セメント	10,900	3,967.00	43,240,300	
日本ヒューム	3,100	1,138.00	3,527,800	
日本コンクリート工業	3,400	329.00	1,118,600	
三谷セキサン	2,900	1,643.00	4,764,700	
アジアパイルホールディングス	2,800	1,690.00	4,732,000	
東海カーボン	17,800	1,530.00	27,234,000	
日本カーボン	1,000	4,920.00	4,920,000	
東洋炭素	1,500	6,680.00	10,020,000	
ノリタケ	3,700	3,475.00	12,857,500	
TOTO	11,000	7,127.00	78,397,000	
NGK	19,200	5,696.00	109,363,200	
日本特殊陶業	14,400	9,679.00	139,377,600	
MARUWA	700	73,330.00	51,331,000	
品川リフラ	2,200	1,911.00	4,204,200	
ヨータイ	1,000	1,718.00	1,718,000	
フジミインコーポレーテッド	5,300	3,290.00	17,437,000	
ニチアス	13,800	3,487.00	48,120,600	
ニチハ	2,000	2,982.00	5,964,000	
日本製鉄	495,200	559.90	277,262,480	
神戸製鋼所	36,500	1,962.50	71,631,250	
中山製鋼所	3,700	670.00	2,479,000	
合同製鐵	1,000	2,839.00	2,839,000	
J F Eホールディングス	58,900	1,678.00	98,834,200	
東京製鐵	5,100	1,825.00	9,307,500	
共英製鋼	2,100	1,865.00	3,916,500	
大和工業	3,300	11,975.00	39,517,500	
東京鐵鋼	2,000	1,865.00	3,730,000	
大阪製鐵	800	2,375.00	1,900,000	
ヨドコウ	10,300	1,229.00	12,658,700	
中部鋼鈑	1,700	2,051.00	3,486,700	
丸一鋼管	18,200	1,922.50	34,989,500	
モリ工業	2,000	949.00	1,898,000	

大同特殊鋼	12,900	1,891.00	24,393,900	
日本冶金工業	1,200	4,500.00	5,400,000	
愛知製鋼	3,400	2,954.00	10,043,600	
大平洋金属	1,500	2,404.00	3,606,000	
新日本電工	9,900	498.00	4,930,200	
栗本鐵工所	4,200	1,376.00	5,779,200	
三菱製鋼	1,200	2,169.00	2,602,800	
日本精線	1,400	1,359.00	1,902,600	
エンビプロ・ホールディングス	1,600	962.00	1,539,200	
J X 金属	67,200	4,175.00	280,560,000	
大紀アルミニウム工業所	2,600	1,848.00	4,804,800	
日本軽金属ホールディングス	5,300	3,120.00	16,536,000	
三井金属	4,500	46,640.00	209,880,000	
三菱マテリアル	12,100	5,428.00	65,678,800	
住友金属鉱山	24,900	10,275.00	255,847,500	
DOWAホールディングス	4,900	11,640.00	57,036,000	
古河機械金属	1,900	4,195.00	7,970,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,100	2,502.00	7,756,200	
東邦チタニウム	3,300	2,961.00	9,771,300	
U A C J	11,000	3,115.00	34,265,000	
C K サンエツ	400	4,595.00	1,838,000	
古河電気工業	6,000	54,480.00	326,880,000	
住友電気工業	62,700	10,980.00	688,446,000	
フジクラ	140,200	5,819.00	815,823,800	
SWC C	2,600	15,590.00	40,534,000	
平河ヒューテック	1,100	3,710.00	4,081,000	
リョービ	2,100	2,590.00	5,439,000	
A R E ホールディングス	8,000	3,925.00	31,400,000	
稲葉製作所	900	1,686.00	1,517,400	
宮地エンジニアリンググループ	2,400	1,544.00	3,705,600	
トーカロ	5,200	3,315.00	17,238,000	
SUMCO	34,600	3,090.00	106,914,000	
川田テクノロジーズ	4,100	1,319.00	5,407,900	
R S T e c h n o l o g i e s	1,200	6,640.00	7,968,000	
東洋製罐グループホールディングス	9,100	3,706.00	33,724,600	
ホッカンホールディングス	1,000	2,234.00	2,234,000	
コロナ	1,000	938.00	938,000	
横河ブリッジホールディングス	3,100	2,926.00	9,070,600	
三和ホールディングス	17,500	3,455.00	60,462,500	
文化シャッター	5,700	1,820.00	10,374,000	
三協立山	2,300	647.00	1,488,100	
アルインコ	1,400	1,021.00	1,429,400	
L I X I L	28,400	1,672.50	47,499,000	

ノーリツ	3,200	2,456.00	7,859,200	
長府製作所	1,800	2,005.00	3,609,000	
リンナイ	9,300	3,462.00	32,196,600	
日東精工	2,400	778.00	1,867,200	
岡部	3,100	904.00	2,802,400	
ジーテクト	2,300	1,903.00	4,376,900	
東プレ	3,200	2,639.00	8,444,800	
高周波熱錬	2,600	1,270.00	3,302,000	
東京製綱	1,100	1,705.00	1,875,500	
サンコール	1,800	1,619.00	2,914,200	
パイオラックス	2,000	1,579.00	3,158,000	
エイチワン	1,900	1,586.00	3,013,400	
日本発條	13,700	3,541.00	48,511,700	
中央発條	1,200	4,000.00	4,800,000	
立川ブラインド工業	900	2,535.00	2,281,500	
GMSグループ	2,300	380.00	874,000	
日本製鋼所	5,400	7,863.00	42,460,200	
三浦工業	8,200	3,381.00	27,724,200	
タクマ	5,000	3,255.00	16,275,000	
ツガミ	3,800	5,960.00	22,648,000	
オークマ	3,100	4,795.00	14,864,500	
芝浦機械	2,100	4,915.00	10,321,500	
アマダ	25,100	2,813.00	70,606,300	
アイダエンジニアリング	3,100	1,324.00	4,104,400	
F U J I	7,100	7,993.00	56,750,300	
牧野フライス製作所	1,800	13,620.00	24,516,000	
オーエスジー	6,300	3,530.00	22,239,000	
旭ダイヤモンド工業	4,100	1,336.00	5,477,600	
DMG森精機	12,200	3,569.00	43,541,800	
ソディック	4,300	1,664.00	7,155,200	
ディスコ	8,600	64,900.00	558,140,000	
日東工器	600	1,620.00	972,000	
日進工具	1,500	849.00	1,273,500	
富士ダイス	1,300	1,009.00	1,311,700	
リケンNPR	2,000	4,035.00	8,070,000	
島精機製作所	2,700	930.00	2,511,000	
オプトラン	2,900	3,980.00	11,542,000	
イワキポンプ	1,200	2,939.00	3,526,800	
フリュー	1,900	1,178.00	2,238,200	
ヤマシンフィルタ	3,700	576.00	2,131,200	
日阪製作所	2,100	1,461.00	3,068,100	
やまびこ	2,900	3,815.00	11,063,500	
野村マイクロ・サイエンス	3,200	4,950.00	15,840,000	

平田機工	2,500	3,050.00	7,625,000	
P E G A S U S	2,000	783.00	1,566,000	
マルマエ	1,700	2,404.00	4,086,800	
タツモ	1,200	3,195.00	3,834,000	
ナブテスコ	10,100	5,657.00	57,135,700	
三井海洋開発	4,500	12,235.00	55,057,500	
レオン自動機	2,100	1,566.00	3,288,600	
SMC	5,000	67,880.00	339,400,000	
ホソカワミクロン	1,300	5,700.00	7,410,000	
ユニオンツール	800	20,160.00	16,128,000	
瑞光	1,500	911.00	1,366,500	
オイレス工業	2,200	2,654.00	5,838,800	
日精エー・エス・ビー機械	700	9,370.00	6,559,000	
サトー	2,400	2,160.00	5,184,000	
技研製作所	1,600	1,865.00	2,984,000	
日本エアーテック	800	1,308.00	1,046,400	
ワイエイシイホールディングス	1,500	1,401.00	2,101,500	
小松製作所	85,700	6,483.00	555,593,100	
住友重機械工業	10,500	5,416.00	56,868,000	
日立建機	7,100	5,226.00	37,104,600	
日工	3,400	842.00	2,862,800	
巴工業	2,000	1,788.00	3,576,000	
井関農機	1,700	1,783.00	3,031,100	
TOWA	6,400	2,579.00	16,505,600	
北川鉄工所	700	1,646.00	1,152,200	
ローツェ	10,500	3,739.00	39,259,500	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	4,800	7,100.00	34,080,000	
クボタ	90,000	2,928.50	263,565,000	
荏原実業	1,900	2,512.00	4,772,800	
三菱化工機	1,900	3,660.00	6,954,000	
月島ホールディングス	2,400	2,902.00	6,964,800	
T E I K O K U	1,100	2,791.00	3,070,100	
新東工業	3,600	1,201.00	4,323,600	
澁谷工業	1,700	3,740.00	6,358,000	
アイチ コーポレーション	2,600	1,406.00	3,655,600	
小森コーポレーション	4,200	1,502.00	6,308,400	
鶴見製作所	2,500	2,021.00	5,052,500	
酒井重工業	700	2,116.00	1,481,200	
荏原製作所	36,100	5,533.00	199,741,300	
西島製作所	1,300	2,841.00	3,693,300	
A I R M A N	1,800	1,662.00	2,991,600	
ダイキン工業	23,200	25,370.00	588,584,000	
オルガノ	2,400	18,240.00	43,776,000	

トヨーカnetz	1,500	2,695.00	4,042,500	
栗田工業	10,700	9,000.00	96,300,000	
椿本チエイン	7,700	2,750.00	21,175,000	
木村化工機	1,400	1,268.00	1,775,200	
アネスト岩田	3,300	1,674.00	5,524,200	
ダイフク	30,000	7,197.00	215,910,000	
サムコ	500	12,030.00	6,015,000	
タダノ	9,400	1,387.00	13,037,800	
CKD	5,400	6,790.00	36,666,000	
平和	5,300	1,900.00	10,070,000	
理想科学工業	2,800	994.00	2,783,200	
SANKYO	16,700	1,765.50	29,483,850	
日本金銭機械	2,100	902.00	1,894,200	
マースグループホールディングス	1,500	2,999.00	4,498,500	
ガリレイ	2,600	3,500.00	9,100,000	
ダイコク電機	900	2,327.00	2,094,300	
竹内製作所	3,200	7,120.00	22,784,000	
アマノ	4,700	3,671.00	17,253,700	
JUKI	2,800	619.00	1,733,200	
ジャノメ	1,300	1,265.00	1,644,500	
マックス	9,800	1,772.00	17,365,600	
グローリー	4,700	4,408.00	20,717,600	
新晃工業	4,800	1,283.00	6,158,400	
大和冷機工業	2,700	1,894.00	5,113,800	
セガサミーホールディングス	14,600	2,227.00	32,514,200	
TPR	3,900	1,319.00	5,144,100	
ツバキ・ナカシマ	4,100	340.00	1,394,000	
ホシザキ	11,400	5,138.00	58,573,200	
大豊工業	1,300	1,191.00	1,548,300	
日本精工	32,900	1,211.00	39,841,900	
NTN	47,200	410.80	19,389,760	
ジェイテクト	16,800	2,027.00	34,053,600	
不二越	1,300	5,850.00	7,605,000	
日本トムソン	4,800	1,800.00	8,640,000	
THK	9,400	7,572.00	71,176,800	
YUSHIN	1,400	734.00	1,027,600	
前澤給装工業	1,300	1,497.00	1,946,100	
イーグル工業	2,000	2,879.00	5,758,000	
PILLAR	1,600	10,070.00	16,112,000	
キッツ	6,300	2,198.00	13,847,400	
マキタ	22,100	5,650.00	124,865,000	
三井E&S	8,800	4,720.00	41,536,000	
カナデビア	14,600	1,402.00	20,469,200	

三菱重工業	333,100	4,080.00	1,359,048,000
I H I	92,700	2,685.00	248,899,500
キオクシアホールディングス	10,800	44,450.00	480,060,000
日清紡ホールディングス	13,400	2,232.50	29,915,500
イビデン	22,300	15,660.00	349,218,000
コニカミノルタ	39,700	583.30	23,157,010
ブラザー工業	22,100	3,527.00	77,946,700
ミネベアミツミ	30,900	3,944.00	121,869,600
日立製作所	447,900	4,812.00	2,155,294,800
三菱電機	194,800	6,416.00	1,249,836,800
富士電機	12,800	15,135.00	193,728,000
安川電機	19,300	6,987.00	134,849,100
シンフォニアテクノロジー	2,000	15,210.00	30,420,000
明電舎	3,300	10,940.00	36,102,000
山洋電気	2,000	7,410.00	14,820,000
デンヨー	1,300	3,810.00	4,953,000
PHCホールディングス	3,300	963.00	3,177,900
KOKUSAI ELECTRIC	20,400	6,590.00	134,436,000
ソシオネクスト	15,400	2,426.00	37,360,400
東芝テック	2,300	2,993.00	6,883,900
芝浦メカトロニクス	5,500	5,160.00	28,380,000
マブチモーター	17,200	1,602.00	27,554,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	312.00	343,200
トレックス・セミコンダクター	700	2,390.00	1,673,000
東光高岳	1,000	7,860.00	7,860,000
ダブル・スコープ	6,400	278.00	1,779,200
ダイヘン	1,600	16,900.00	27,040,000
ヤーマン	3,500	700.00	2,450,000
JVCケンウッド	13,800	1,160.50	16,014,900
ミマキエンジニアリング	1,500	1,814.00	2,721,000
大崎電気工業	3,400	1,831.00	6,225,400
オムロン	14,900	5,700.00	84,930,000
日東工業	2,100	4,980.00	10,458,000
I D E C	2,300	3,595.00	8,268,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,300	6,450.00	47,085,000
BUFFALO	900	2,541.00	2,286,900
テクノメディカ	300	2,151.00	645,300
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	900	477.00	429,300
日本電気	116,700	4,004.00	467,266,800
富士通	163,600	3,217.00	526,301,200
沖電気工業	8,600	3,150.00	27,090,000
電気興業	700	3,460.00	2,422,000
サンケン電気	1,800	9,067.00	16,320,600

アイホン	900	2,717.00	2,445,300	
ルネサスエレクトロニクス	172,400	3,647.00	628,742,800	
セイコーエプソン	22,100	2,488.00	54,984,800	
ワコム	10,700	755.00	8,078,500	
アルバック	4,500	9,486.00	42,687,000	
アクセル	800	1,058.00	846,400	
E I Z O	2,500	2,378.00	5,945,000	
日本信号	4,500	1,578.00	7,101,000	
京三製作所	4,100	766.00	3,140,600	
能美防災	2,400	4,665.00	11,196,000	
ホーチキ	4,200	2,137.00	8,975,400	
エレコム	4,200	1,606.00	6,745,200	
パナソニック ホールディングス	210,100	3,293.00	691,859,300	
シャープ	21,400	603.90	12,923,460	
アンリツ	11,600	4,239.00	49,172,400	
ソニーグループ	607,300	3,576.00	2,171,704,800	
TDK	153,600	2,993.00	459,724,800	
帝国通信工業	800	2,898.00	2,318,400	
タムラ製作所	7,100	929.00	6,595,900	
アルプスアルパイン	13,700	2,206.00	30,222,200	
日本電波工業	2,100	2,242.00	4,708,200	
鈴木	1,000	3,095.00	3,095,000	
メイコー	1,600	36,200.00	57,920,000	
日本トリム	400	4,240.00	1,696,000	
フォスター電機	1,600	2,947.00	4,715,200	
SMK	400	3,515.00	1,406,000	
ヨコオ	1,600	5,170.00	8,272,000	
ホシデン	3,500	2,580.00	9,030,000	
ヒロセ電機	2,600	23,915.00	62,179,000	
日本航空電子工業	4,200	2,509.00	10,537,800	
TOA	1,800	1,605.00	2,889,000	
マクセル	3,700	1,914.00	7,081,800	
古野電気	2,300	6,440.00	14,812,000	
スミダコーポレーション	3,100	1,352.00	4,191,200	
アイコム	700	2,980.00	2,086,000	
リオン	700	3,510.00	2,457,000	
横河電機	18,600	5,013.00	93,241,800	
新電元工業	700	3,125.00	2,187,500	
アズビル	42,800	1,510.50	64,649,400	
日本光電工業	14,600	1,477.50	21,571,500	
チノー	1,500	1,546.00	2,319,000	
日本電子材料	1,200	7,220.00	8,664,000	
堀場製作所	3,300	25,525.00	84,232,500	

アドバンテスト	53,000	26,360.00	1,397,080,000	
エスベック	1,700	3,395.00	5,771,500	
キーエンス	17,600	77,180.00	1,358,368,000	
日置電機	900	11,640.00	10,476,000	
シスメックス	45,600	1,335.00	60,876,000	
日本マイクロニクス	2,900	15,300.00	44,370,000	
メガチップス	1,100	12,360.00	13,596,000	
OBARA GROUP	800	6,260.00	5,008,000	
コーセル	2,200	1,332.00	2,930,400	
イリソ電子工業	1,400	3,415.00	4,781,000	
オプテックスグループ	3,000	4,400.00	13,200,000	
千代田インテグレ	400	3,130.00	1,252,000	
レーザーテック	7,400	38,410.00	284,234,000	
スタンレー電気	7,500	3,487.00	26,152,500	
ウシオ電機	6,600	4,239.00	27,977,400	
日本セラミック	1,400	4,200.00	5,880,000	
山一電機	1,700	9,660.00	16,422,000	
図研	1,500	4,565.00	6,847,500	
日本電子	4,100	6,952.00	28,503,200	
カシオ計算機	14,100	1,694.00	23,885,400	
ファナック	84,100	8,228.00	691,974,800	
日本シイエムケイ	5,600	648.00	3,628,800	
エンプラス	500	13,880.00	6,940,000	
大真空	2,500	764.00	1,910,000	
ローム	34,600	4,180.00	144,628,000	
浜松ホトニクス	27,300	2,657.00	72,536,100	
三井ハイテック	9,100	719.00	6,542,900	
京セラ	109,400	2,884.00	315,509,600	
太陽誘電	9,400	6,762.00	63,562,800	
村田製作所	168,000	6,151.00	1,033,368,000	
双葉電子工業	3,600	653.00	2,350,800	
ニチコン	4,600	2,742.00	12,613,200	
日本ケミコン	2,400	2,996.00	7,190,400	
KOA	3,200	2,061.00	6,595,200	
市光工業	3,800	542.00	2,059,600	
小糸製作所	18,200	2,850.00	51,870,000	
ミツバ	3,300	1,156.00	3,814,800	
SCREENホールディングス	12,600	11,335.00	142,821,000	
キヤノン	79,000	4,231.00	334,249,000	
リコー	41,300	1,421.50	58,707,950	
象印マホービン	4,800	1,644.00	7,891,200	
東京エレクトロン	37,300	50,290.00	1,875,817,000	
イノテック	1,200	3,840.00	4,608,000	

トヨタ紡織	8,600	2,285.50	19,655,300	
ARCHION	26,500	365.00	9,672,500	
ユニプレス	3,300	1,277.00	4,214,100	
モリタホールディングス	2,700	2,539.00	6,855,300	
三櫻工業	2,700	773.00	2,087,100	
デンソー	172,500	1,944.00	335,340,000	
東海理化電機製作所	4,700	2,978.00	13,996,600	
川崎重工業	66,300	3,048.00	202,082,400	
名村造船所	5,500	4,375.00	24,062,500	
日本車輛製造	700	3,505.00	2,453,500	
日産自動車	268,900	375.00	100,837,500	
いすゞ自動車	45,300	2,298.50	104,122,050	
トヨタ自動車	935,800	3,085.00	2,886,943,000	
三菱自動車工業	67,300	347.00	23,353,100	
武蔵精密工業	3,900	5,440.00	21,216,000	
日産車体	2,700	1,019.00	2,751,300	
新明和工業	5,100	2,328.00	11,872,800	
極東開発工業	2,900	2,363.00	6,852,700	
トピー工業	1,300	2,760.00	3,588,000	
ティラド	300	14,370.00	4,311,000	
タチエス	3,200	2,172.00	6,950,400	
NOK	6,400	2,924.50	18,716,800	
フタバ産業	4,700	1,042.00	4,897,400	
カヤバ	3,000	4,115.00	12,345,000	
大同メタル工業	3,400	982.00	3,338,800	
プレス工業	7,100	792.00	5,623,200	
アイシン	45,000	2,480.50	111,622,500	
マツダ	58,200	1,092.50	63,583,500	
本田技研工業	328,200	1,430.00	469,326,000	
スズキ	129,300	1,843.50	238,364,550	
SUBARU	51,900	2,567.50	133,253,250	
ヤマハ発動機	87,100	1,325.50	115,451,050	
エクセディ	2,900	6,120.00	17,748,000	
豊田合成	5,400	4,771.00	25,763,400	
愛三工業	2,900	1,787.00	5,182,300	
ヨロズ	1,600	881.00	1,409,600	
エフ・シー・シー	3,400	3,435.00	11,679,000	
シマノ	7,400	17,025.00	125,985,000	
テイ・エス テック	6,500	1,810.50	11,768,250	
リガク・ホールディングス	10,400	2,856.00	29,702,400	
北里コーポレーション	1,800	1,206.00	2,170,800	
テルモ	117,000	1,922.00	224,874,000	
日機装	4,100	2,911.00	11,935,100	

日本エム・ディ・エム	1,400	630.00	882,000	
島津製作所	23,400	3,506.00	82,040,400	
JMS	1,600	430.00	688,000	
長野計器	1,100	3,075.00	3,382,500	
ブイ・テクノロジー	900	5,270.00	4,743,000	
東京計器	1,500	6,830.00	10,245,000	
愛知時計電機	800	3,050.00	2,440,000	
インターアクション	900	1,974.00	1,776,600	
東京精密	3,300	16,515.00	54,499,500	
マニー	7,700	1,665.00	12,820,500	
ニコン	22,000	2,265.50	49,841,000	
オリンパス	95,400	1,720.00	164,088,000	
理研計器	2,500	3,720.00	9,300,000	
タムロン	9,000	1,072.00	9,648,000	
HOYA	33,400	28,005.00	935,367,000	
ノーリツ銅機	5,000	2,042.00	10,210,000	
A & Dホロンホールディングス	2,400	2,545.00	6,108,000	
朝日インテック	21,000	3,394.00	71,274,000	
シチズン時計	14,600	2,256.00	32,937,600	
メニコン	6,600	1,560.00	10,296,000	
松風	2,100	1,723.00	3,618,300	
セイコーグループ	4,900	6,500.00	31,850,000	
ニプロ	14,700	1,621.50	23,836,050	
三井松島ホールディングス	3,000	1,405.00	4,215,000	
テクセンドフォトマスク	6,500	4,220.00	27,430,000	
トランザクション	3,000	1,143.00	3,429,000	
ニホンフラッシュ	1,600	765.00	1,224,000	
前田工繊	3,600	1,807.00	6,505,200	
アートネイチャー	1,600	812.00	1,299,200	
フルヤ金属	1,700	10,080.00	17,136,000	
バンダイナムコホールディングス	47,100	3,709.00	174,693,900	
SHOEI	4,200	1,794.00	7,534,800	
フランスベッドホールディングス	2,500	1,286.00	3,215,000	
パイロットコーポレーション	2,500	4,664.00	11,660,000	
萩原工業	1,200	1,717.00	2,060,400	
フジシールインターナショナル	3,600	2,666.00	9,597,600	
タカラトミー	8,600	2,789.50	23,989,700	
広済堂ホールディングス	6,500	633.00	4,114,500	
プロネクス	1,800	1,096.00	1,972,800	
TOPPANホールディングス	21,300	4,480.00	95,424,000	
大日本印刷	38,000	2,910.00	110,580,000	
共同印刷	1,800	1,502.00	2,703,600	
NISSHA	3,200	1,555.00	4,976,000	

TAKARA & COMPANY	1,000	3,335.00	3,335,000	
アシックス	67,700	4,506.00	305,056,200	
ツツミ	400	2,855.00	1,142,000	
ローランド	1,400	4,630.00	6,482,000	
小松ウオール工業	1,300	2,503.00	3,253,900	
ヤマハ	27,400	1,135.00	31,099,000	
河合楽器製作所	500	3,120.00	1,560,000	
クリナップ	1,900	889.00	1,689,100	
ビジョン	10,400	1,855.00	19,292,000	
キングジム	1,600	794.00	1,270,400	
リンテック	3,800	5,380.00	20,444,000	
イトーキ	3,900	2,715.00	10,588,500	
任天堂	110,200	7,151.00	788,040,200	
三菱鉛筆	2,400	2,559.00	6,141,600	
タカラスタンダード	3,800	2,990.00	11,362,000	
コクヨ	34,800	803.80	27,972,240	
ナカバヤシ	1,900	562.00	1,067,800	
グローブライド	1,700	2,481.00	4,217,700	
オカムラ	5,300	2,320.00	12,296,000	
美津濃	4,700	3,400.00	15,980,000	
グリムス	600	2,924.00	1,754,400	
東京電力ホールディングス	158,700	592.70	94,061,490	
中部電力	64,900	2,715.50	176,235,950	
関西電力	95,400	2,333.50	222,615,900	
中国電力	30,600	910.30	27,855,180	
北陸電力	18,000	907.20	16,329,600	
東北電力	46,300	1,051.50	48,684,450	
四国電力	16,400	1,541.50	25,280,600	
九州電力	40,600	1,785.00	72,471,000	
北海道電力	19,800	980.90	19,421,820	
沖縄電力	4,500	947.00	4,261,500	
電源開発	13,300	4,266.00	56,737,800	
エフオン	1,300	420.00	546,000	
イーレックス	3,600	967.00	3,481,200	
レノバ	4,800	1,346.00	6,460,800	
東京瓦斯	31,800	6,722.00	213,759,600	
大阪瓦斯	31,400	5,732.00	179,984,800	
東邦瓦斯	24,100	1,285.50	30,980,550	
北海道瓦斯	5,300	784.00	4,155,200	
広島ガス	3,700	414.00	1,531,800	
西部ガスホールディングス	2,000	2,261.00	4,522,000	
静岡ガス	4,000	1,351.00	5,404,000	
メタウォーター	2,300	3,515.00	8,084,500	

SBSホールディングス	1,600	4,485.00	7,176,000	
東武鉄道	18,200	2,828.50	51,478,700	
相鉄ホールディングス	6,800	2,725.00	18,530,000	
東急	45,200	1,657.00	74,896,400	
京浜急行電鉄	20,000	1,578.00	31,560,000	
小田急電鉄	26,700	1,704.00	45,496,800	
京王電鉄	39,400	775.50	30,554,700	
京成電鉄	30,600	1,085.00	33,201,000	
富士急行	2,200	2,084.00	4,584,800	
東日本旅客鉄道	97,100	3,766.00	365,678,600	
西日本旅客鉄道	42,000	2,731.00	114,702,000	
東海旅客鉄道	72,500	3,634.00	263,465,000	
東京地下鉄	28,000	1,543.00	43,204,000	
西武ホールディングス	18,100	3,414.00	61,793,400	
鴻池運輸	3,000	2,762.00	8,286,000	
西日本鉄道	5,100	2,763.00	14,091,300	
ハマキョウレックス	5,500	1,855.00	10,202,500	
サカイ引越センター	2,200	2,805.00	6,171,000	
近鉄グループホールディングス	18,800	3,622.00	68,093,600	
阪急阪神ホールディングス	23,200	4,787.00	111,058,400	
NANKAI	8,000	2,944.50	23,556,000	
京阪ホールディングス	9,100	3,064.00	27,882,400	
神戸電鉄	500	2,424.00	1,212,000	
名古屋鉄道	19,400	1,817.50	35,259,500	
山陽電気鉄道	1,300	1,983.00	2,577,900	
ヤマトホールディングス	21,400	1,732.50	37,075,500	
山九	3,800	9,081.00	34,507,800	
丸全昭和運輸	1,100	7,980.00	8,778,000	
センコーグループホールディングス	12,700	2,031.50	25,800,050	
ニッコンホールディングス	7,500	5,311.00	39,832,500	
福山通運	1,900	5,870.00	11,153,000	
セイノーホールディングス	8,600	2,547.00	21,904,200	
神奈川中央交通	500	3,255.00	1,627,500	
AZ-COM丸和ホールディングス	5,500	847.00	4,658,500	
九州旅客鉄道	13,200	3,674.00	48,496,800	
SGホールディングス	29,500	1,444.00	42,598,000	
NIPPON EXPRESSホールディ ン	17,600	4,710.00	82,896,000	
日本郵船	35,000	5,498.00	192,430,000	
商船三井	33,500	5,863.00	196,410,500	
川崎汽船	37,900	2,522.50	95,602,750	
NSユニテッド海運	1,100	7,940.00	8,734,000	
飯野海運	6,500	1,531.00	9,951,500	
乾汽船	2,200	1,614.00	3,550,800	

日本航空	40,300	2,550.00	102,765,000
ANAホールディングス	47,800	2,745.00	131,211,000
三菱倉庫	19,100	1,425.00	27,217,500
三井倉庫ホールディングス	5,400	3,980.00	21,492,000
住友倉庫	5,000	3,965.00	19,825,000
澁澤倉庫	2,800	1,422.00	3,981,600
日本トランスシティ	4,400	1,212.00	5,332,800
中央倉庫	900	1,977.00	1,779,300
安田倉庫	1,200	2,287.00	2,744,400
上組	7,700	5,000.00	38,500,000
キューソー流通システム	1,000	2,836.00	2,836,000
エーアイティー	1,100	2,260.00	2,486,000
M I X I	3,300	2,662.00	8,784,600
クロスキャット	1,000	925.00	925,000
システナ	25,200	412.00	10,382,400
デジタルアーツ	900	4,240.00	3,816,000
日鉄ソリューションズ	4,800	3,476.00	16,684,800
キューブシステム	1,000	1,020.00	1,020,000
コア	800	2,053.00	1,642,400
ディー・エヌ・エー	7,200	2,715.50	19,551,600
手間いらず	200	2,394.00	478,800
ラクーンホールディングス	1,400	647.00	905,800
ソリトンシステムズ	900	2,050.00	1,845,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,500	1,616.00	2,424,000
T I S	18,000	3,453.00	62,154,000
グリーホールディングス	5,900	405.00	2,389,500
GMOペパボ	200	1,829.00	365,800
コーエーテクモホールディングス	11,100	1,518.00	16,849,800
三菱総合研究所	1,000	4,580.00	4,580,000
ファインデックス	1,200	774.00	928,800
K L a b	5,200	275.00	1,430,000
ボールトゥウィンホールディングス	2,500	293.00	732,500
ネクソン	41,700	2,243.00	93,533,100
アイスタイル	6,800	392.00	2,665,600
エムアップホールディングス	4,300	713.00	3,065,900
エイチームホールディングス	1,200	998.00	1,197,600
セルシス	2,300	1,444.00	3,321,200
エニグモ	2,000	370.00	740,000
コロプラ	6,000	381.00	2,286,000
ブロードリーフ	6,400	950.00	6,080,000
デジタルハーツホールディングス	1,100	759.00	834,900
メディアドゥ	600	1,209.00	725,400
じげん	5,100	406.00	2,070,600

フィックスターズ	2,400	1,554.00	3,729,600	
オプティム	1,800	443.00	797,400	
セレス	800	1,914.00	1,531,200	
SHIFT	17,600	628.80	11,066,880	
セック	500	3,730.00	1,865,000	
テクマトリックス	3,500	1,793.00	6,275,500	
プロシップ	1,400	1,630.00	2,282,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,486.00	10,192,600	
GMOペイメントゲートウェイ	4,000	7,274.00	29,096,000	
システムリサーチ	1,300	1,734.00	2,254,200	
インターネットイニシアティブ	9,700	3,035.00	29,439,500	
さくらインターネット	2,500	3,060.00	7,650,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	1,906.00	953,000	
SRAホールディングス	1,000	4,740.00	4,740,000	
朝日ネット	1,900	612.00	1,162,800	
eBASE	2,200	424.00	932,800	
アバントグループ	1,900	1,172.00	2,226,800	
アドソル日進	1,400	1,517.00	2,123,800	
フリービット	900	1,414.00	1,272,600	
コムチュア	2,300	1,304.00	2,999,200	
アステリア	1,400	1,524.00	2,133,600	
アイル	1,200	2,344.00	2,812,800	
マークライنز	1,000	1,453.00	1,453,000	
gumi	3,200	312.00	998,400	
テラスカイ	600	1,921.00	1,152,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,800	892.00	1,605,600	
ネオジャパン	500	1,570.00	785,000	
PR TIMES	400	2,252.00	900,800	
ラクス	16,300	810.00	13,203,000	
ダブルスタンダード	600	1,204.00	722,400	
オープンドア	1,000	286.00	286,000	
アカツキ	900	2,994.00	2,694,600	
Ubicomホールディングス	600	1,025.00	615,000	
カナミックネットワーク	2,200	515.00	1,133,000	
チェンジホールディングス	3,400	926.00	3,148,400	
オークネット	3,200	1,473.00	4,713,600	
オロ	700	1,950.00	1,365,000	
ユーザーローカル	700	1,702.00	1,191,400	
PKSHA Technology	1,900	2,902.00	5,513,800	
マネーフォワード	4,000	4,415.00	17,660,000	
GMOフィナンシャルゲート	300	5,570.00	1,671,000	
Sun Asterisk	1,600	445.00	712,000	

プラスアルファ・コンサルティング	2,500	2,296.00	5,740,000	
電算システムホールディングス	800	2,819.00	2,255,200	
Appier Group	6,800	967.00	6,575,600	
ビジョナル	2,400	7,445.00	17,868,000	
ハイマックス	500	1,128.00	564,000	
野村総合研究所	34,400	4,332.00	149,020,800	
日本システム技術	1,600	1,760.00	2,816,000	
インテージホールディングス	1,300	1,750.00	2,275,000	
ソースネクスト	9,200	129.00	1,186,800	
シンプレクス・ホールディングス	14,000	951.00	13,314,000	
HEROZ	700	764.00	534,800	
メルカリ	7,600	4,173.00	31,714,800	
I P S	500	3,585.00	1,792,500	
システムサポートホールディングス	1,500	1,033.00	1,549,500	
ボードルア	1,300	2,002.00	2,602,600	
NE	1,700	279.00	474,300	
イーソル	1,200	618.00	741,600	
ウイングアーク1st	1,800	2,522.00	4,539,600	
サーバーワークス	400	2,024.00	809,600	
Sansan	5,800	1,308.00	7,586,400	
ギフトィ	1,400	1,068.00	1,495,200	
メドレー	2,200	2,169.00	4,771,800	
ベース	700	3,135.00	2,194,500	
JMDC	2,600	2,688.00	6,988,800	
フォーカスシステムズ	1,200	1,513.00	1,815,600	
クレスコ	3,000	1,538.00	4,614,000	
フジ・メディア・ホールディングス	13,900	3,814.00	53,014,600	
オービック	32,800	4,032.00	132,249,600	
ジャストシステム	2,500	3,735.00	9,337,500	
TDCソフト	3,300	957.00	3,158,100	
LINEヤフー	271,900	417.30	113,463,870	
トレンドマイクロ	10,200	5,537.00	56,477,400	
IDホールディングス	2,300	1,031.00	2,371,300	
日本オラクル	3,400	8,671.00	29,481,400	
アルファシステムズ	600	3,235.00	1,941,000	
フューチャー	3,800	1,557.00	5,916,600	
CAC Holdings	1,100	1,820.00	2,002,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,000	6,047.00	18,141,000	
アイティフォー	1,800	1,644.00	2,959,200	
東計電算	500	4,025.00	2,012,500	
大塚商会	20,000	2,903.00	58,060,000	
サイボウズ	2,400	2,392.00	5,740,800	
電通総研	6,400	2,118.00	13,555,200	

デジタルガレージ	2,500	2,332.00	5,830,000	
EMシステムズ	2,300	544.00	1,251,200	
ウェザーニューズ	2,500	2,090.00	5,225,000	
C I J	4,300	490.00	2,107,000	
ビジネスエンジニアリング	2,100	1,150.00	2,415,000	
WOWOW	1,300	1,171.00	1,522,300	
スカラ	1,600	332.00	531,200	
ANYCOLOR	2,800	2,743.00	7,680,400	
日本ビジネスシステムズ	1,900	1,734.00	3,294,600	
トランヴィア	1,000	907.00	907,000	
セラク	500	1,199.00	599,500	
システムソフト	7,300	53.00	386,900	
アルゴグラフィックス	6,300	1,373.00	8,649,900	
マーベラス	3,300	445.00	1,468,500	
エイベックス	3,000	1,178.00	3,534,000	
B I P R O G Y	5,900	4,584.00	27,045,600	
都築電気	1,100	3,950.00	4,345,000	
T B Sホールディングス	8,700	5,974.00	51,973,800	
日本テレビホールディングス	15,500	2,919.50	45,252,250	
朝日放送グループホールディングス	2,200	779.00	1,713,800	
テレビ朝日ホールディングス	4,300	3,035.00	13,050,500	
スカパー J S A T	11,800	4,180.00	49,324,000	
テレビ東京ホールディングス	1,100	3,900.00	4,290,000	
ビジョン	3,700	1,039.00	3,844,300	
U-NEXT HOLDINGS	5,900	1,551.00	9,150,900	
日本通信	14,300	124.00	1,773,200	
NTT	4,847,700	151.80	735,880,860	
KDDI	248,100	2,724.00	675,824,400	
ソフトバンク	2,842,200	225.00	639,495,000	
光通信	1,700	37,360.00	63,512,000	
エムティーアイ	1,200	590.00	708,000	
GMOインターネットグループ	5,700	3,079.00	17,550,300	
ファイバーゲート	800	698.00	558,400	
KADOKAWA	9,800	3,257.00	31,918,600	
学研ホールディングス	2,900	997.00	2,891,300	
ゼンリン	2,600	876.00	2,277,600	
松竹	1,000	10,510.00	10,510,000	
東宝	46,300	1,317.00	60,977,100	
東映	2,900	5,970.00	17,313,000	
ピー・シー・エー	1,200	1,230.00	1,476,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	968.00	1,839,200	
D T S	14,000	1,025.00	14,350,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,000	2,654.00	76,966,000	

シーイーシー	2,100	1,947.00	4,088,700	
カプコン	35,100	3,065.00	107,581,500	
アイ・エス・ビー	800	2,274.00	1,819,200	
NSW	800	2,508.00	2,006,400	
アイネス	1,400	2,044.00	2,861,600	
TKC	3,000	3,510.00	10,530,000	
NSD	6,200	2,600.00	16,120,000	
コナミグループ	7,600	19,650.00	149,340,000	
福井コンピュータホールディングス	1,000	3,125.00	3,125,000	
JBCCHホールディングス	4,700	1,192.00	5,602,400	
ミロク情報サービス	1,500	1,710.00	2,565,000	
ソフトバンクグループ	338,400	5,745.00	1,944,108,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	3,600	2,664.00	9,590,400	
高千穂交易	1,500	1,964.00	2,946,000	
あらた	2,800	2,670.00	7,476,000	
トーメンデバイス	300	14,600.00	4,380,000	
東京エレクトロン デバイス	1,900	4,145.00	7,875,500	
円谷フィールズホールディングス	3,400	1,463.00	4,974,200	
双日	18,000	5,914.00	106,452,000	
アルフレッサ ホールディングス	17,600	2,378.00	41,852,800	
横浜冷凍	4,300	1,983.00	8,526,900	
ラサ商事	1,000	1,741.00	1,741,000	
アルコニックス	2,900	2,641.00	7,658,900	
神戸物産	16,200	2,798.50	45,335,700	
あい ホールディングス	3,700	2,732.00	10,108,400	
ダイワボウホールディングス	7,000	3,450.00	24,150,000	
マクニカホールディングス	13,000	3,241.00	42,133,000	
ラクト・ジャパン	800	3,210.00	2,568,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,441.00	3,746,600	
八洲電機	1,400	2,842.00	3,978,800	
メディアスホールディングス	1,200	851.00	1,021,200	
レスター	1,600	3,465.00	5,544,000	
TOKAIホールディングス	10,100	1,130.00	11,413,000	
三洋貿易	2,300	1,586.00	3,647,800	
ビューティガレージ	600	1,514.00	908,400	
ウイン・パートナーズ	1,400	1,250.00	1,750,000	
シップヘルスケアホールディングス	6,800	2,144.00	14,579,200	
明治電機工業	900	2,061.00	1,854,900	
コメダホールディングス	4,600	2,952.00	13,579,200	
アセンテック	2,300	477.00	1,097,100	
MIRAINIホールディングス	2,800	1,981.00	5,546,800	
ユニソルホールディングス	1,600	2,074.00	3,318,400	
ヤマエグループホールディングス	1,800	2,910.00	5,238,000	

小野建	2,000	1,366.00	2,732,000	
伯東	1,100	4,570.00	5,027,000	
コンドーテック	1,600	1,497.00	2,395,200	
ナガイレーベン	2,000	1,686.00	3,372,000	
松田産業	1,400	7,770.00	10,878,000	
第一興商	6,200	1,696.50	10,518,300	
メディopalホールディングス	19,900	2,809.50	55,909,050	
S P K	1,500	1,212.00	1,818,000	
アズワン	5,900	2,021.50	11,926,850	
スズデン	1,000	1,988.00	1,988,000	
シモジマ	1,400	1,335.00	1,869,000	
ドウシシャ	2,200	3,055.00	6,721,000	
高速	1,200	2,872.00	3,446,400	
たけびし	700	2,208.00	1,545,600	
リックス	500	3,365.00	1,682,500	
丸文	1,700	1,581.00	2,687,700	
ハピネット	2,500	2,647.00	6,617,500	
橋本総業ホールディングス	600	1,391.00	834,600	
日本ライフライン	4,700	1,281.00	6,020,700	
タカショー	1,500	400.00	600,000	
I D O M	5,600	1,316.00	7,369,600	
進和	1,100	3,040.00	3,344,000	
ダイトロン	1,500	3,825.00	5,737,500	
シークス	3,000	1,366.00	4,098,000	
オーハシテクニカ	1,700	1,065.00	1,810,500	
白銅	500	3,270.00	1,635,000	
伊藤忠商事	626,000	2,059.00	1,288,934,000	
丸紅	142,100	5,856.00	832,137,600	
長瀬産業	31,800	1,159.00	36,856,200	
蝶理	1,000	4,290.00	4,290,000	
豊田通商	55,900	7,387.00	412,933,300	
三共生興	2,400	833.00	1,999,200	
兼松	15,600	2,303.00	35,926,800	
三井物産	264,000	6,106.00	1,611,984,000	
日本紙パルプ商事	9,900	1,219.00	12,068,100	
カメイ	1,700	3,335.00	5,669,500	
スターゼン	4,200	1,148.00	4,821,600	
山善	5,600	1,735.00	9,716,000	
椿本興業	1,300	2,694.00	3,502,200	
住友商事	111,700	7,510.00	838,867,000	
内田洋行	3,800	2,066.00	7,850,800	
三菱商事	371,300	5,849.00	2,171,733,700	
第一実業	1,700	2,955.00	5,023,500	

キヤノンマーケティングジャパン	8,800	3,779.00	33,255,200	
西華産業	2,700	3,360.00	9,072,000	
佐藤商事	1,300	3,120.00	4,056,000	
東京産業	1,900	825.00	1,567,500	
Y U A S A	1,600	5,680.00	9,088,000	
神鋼商事	1,400	2,401.00	3,361,400	
阪和興業	15,300	1,752.00	26,805,600	
正栄食品工業	1,200	4,010.00	4,812,000	
カナデン	1,500	2,646.00	3,969,000	
R Y O D E N	1,400	3,575.00	5,005,000	
岩谷産業	18,500	2,113.00	39,090,500	
極東貿易	1,000	1,890.00	1,890,000	
アステナホールディングス	3,500	480.00	1,680,000	
三愛オブリ	4,100	2,148.00	8,806,800	
稲畑産業	4,200	4,020.00	16,884,000	
G S I クレオス	1,100	2,297.00	2,526,700	
明和産業	2,700	897.00	2,421,900	
ワキタ	3,100	1,805.00	5,595,500	
東邦ホールディングス	5,300	4,164.00	22,069,200	
サンゲツ	4,700	3,005.00	14,123,500	
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,870.00	4,301,000	
シナネンホールディングス	400	7,980.00	3,192,000	
伊藤忠エネクス	4,600	2,049.00	9,425,400	
サンリオ	92,500	855.40	79,124,500	
サンワテクノス	1,100	3,680.00	4,048,000	
新光商事	2,200	1,525.00	3,355,000	
トーヨー	2,200	1,326.00	2,917,200	
三信電気	1,100	2,597.00	2,856,700	
東陽テクニカ	1,500	1,834.00	2,751,000	
モスフードサービス	2,700	3,890.00	10,503,000	
加賀電子	3,500	4,200.00	14,700,000	
ソーダニッカ	1,800	1,074.00	1,933,200	
立花エレテック	1,100	3,085.00	3,393,500	
フォーバル	700	1,043.00	730,100	
P A L T A C	2,900	6,631.00	19,229,900	
三谷産業	3,300	695.00	2,293,500	
コア商事ホールディングス	1,700	825.00	1,402,500	
K P P グループホールディングス	4,900	971.00	4,757,900	
ヤマタネ	1,500	2,030.00	3,045,000	
泉州電業	1,200	6,460.00	7,752,000	
トラスコ中山	3,900	2,249.00	8,771,100	
オートバックスセブン	6,500	1,520.00	9,880,000	
モリト	1,300	1,905.00	2,476,500	

加藤産業	2,300	6,070.00	13,961,000	
イエローハット	4,500	1,637.00	7,366,500	
J Kホールディングス	1,200	1,421.00	1,705,200	
日伝	1,000	2,565.00	2,565,000	
杉本商事	1,500	1,207.00	1,810,500	
因幡電機産業	9,700	2,829.00	27,441,300	
東テク	2,100	4,025.00	8,452,500	
ミスミグループ本社	26,300	3,229.00	84,922,700	
スズケン	6,200	5,311.00	32,928,200	
ジェコス	1,300	1,590.00	2,067,000	
インターメスティック	800	1,904.00	1,523,200	
サンエー	4,200	3,260.00	13,692,000	
カワチ薬品	1,500	3,065.00	4,597,500	
エービーシー・マート	9,800	2,694.00	26,401,200	
ハードオフコーポレーション	700	2,402.00	1,681,400	
アスクル	3,500	1,234.00	4,319,000	
ゲオホールディングス	2,100	2,023.00	4,248,300	
アンドエスティHD	2,600	3,085.00	8,021,000	
くら寿司	4,400	1,565.00	6,886,000	
キャンドゥ	700	3,270.00	2,289,000	
パルグループホールディングス	7,300	1,433.00	10,460,900	
エディオン	8,800	2,249.00	19,791,200	
サーラコーポレーション	3,900	1,010.00	3,939,000	
ハローズ	800	3,950.00	3,160,000	
フジオフードグループ本社	3,000	1,100.00	3,300,000	
あみやき亭	1,400	1,352.00	1,892,800	
大黒天物産	700	4,435.00	3,104,500	
ハニーズホールディングス	1,700	1,457.00	2,476,900	
アルペン	1,800	1,953.00	3,515,400	
クオールホールディングス	2,300	1,930.00	4,439,000	
ジンスホールディングス	1,400	7,110.00	9,954,000	
ビックカメラ	11,100	1,723.50	19,130,850	
DCMホールディングス	9,600	1,541.00	14,793,600	
Monotaro	26,400	1,858.50	49,064,400	
J. フロント リテイリング	21,400	2,390.00	51,146,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,300	2,868.00	9,464,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	32,400	2,291.50	74,244,600	
ブロンコビリー	1,100	4,195.00	4,614,500	
ZOZO	29,400	1,044.00	30,693,600	
トレジャー・ファクトリー	1,300	1,754.00	2,280,200	
物語コーポレーション	3,600	4,790.00	17,244,000	
三越伊勢丹ホールディングス	29,000	3,301.00	95,729,000	
Hamee	900	415.00	373,500	

クリエイトSDホールディングス	2,600	3,240.00	8,424,000	
シュッピン	2,000	1,017.00	2,034,000	
オイシックス・ラ・大地	2,700	1,510.00	4,077,000	
ネクステージ	4,300	3,510.00	15,093,000	
ジョイフル本田	5,500	2,135.00	11,742,500	
エターナルホスピタリティグループ	800	2,844.00	2,275,200	
ホットランドホールディングス	1,700	1,570.00	2,669,000	
すかいらくホールディングス	25,500	2,884.50	73,554,750	
SFPホールディングス	1,100	2,283.00	2,511,300	
綿半ホールディングス	1,400	1,367.00	1,913,800	
ヨシックスホールディングス	500	3,335.00	1,667,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	9,200	835.00	7,682,000	
あさひ	1,600	1,258.00	2,012,800	
コスモス薬品	3,200	6,269.00	20,060,800	
セブン&アイ・ホールディングス	205,700	1,862.50	383,116,250	
クリエイト・レストランツ・ホールディン	28,000	726.00	20,328,000	
グ				
ツルハホールディングス	29,100	2,106.50	61,299,150	
サンマルクホールディングス	1,700	2,625.00	4,462,500	
トリドールホールディングス	5,300	3,758.00	19,917,400	
TOKYO BASE	2,600	332.00	863,200	
JMホールディングス	3,000	1,324.00	3,972,000	
アレンザホールディングス	400	1,455.00	582,000	
ユニシアホールディングス	600	1,811.00	1,086,600	
パロックジャパンリミテッド	2,200	725.00	1,595,000	
クスリのアオキホールディングス	4,400	3,850.00	16,940,000	
力の源ホールディングス	1,400	1,437.00	2,011,800	
FOOD & LIFE COMPAN I	10,700	10,340.00	110,638,000	
E				
ブルーゾーンホールディングス	11,000	1,775.00	19,525,000	
メディカルシステムネットワーク	1,800	485.00	873,000	
J a p a n E y e w e a r H o l d i	800	2,192.00	1,753,600	
n				
ノジマ	18,200	1,325.00	24,115,000	
カッパ・クリエイト	2,900	1,428.00	4,141,200	
良品計画	40,700	3,360.00	136,752,000	
アドヴァングループ	1,100	937.00	1,030,700	
アルビス	600	2,509.00	1,505,400	
G-7ホールディングス	2,000	1,374.00	2,748,000	
イオン北海道	5,500	857.00	4,713,500	
コジマ	3,600	1,213.00	4,366,800	
コーナン商事	2,100	4,090.00	8,589,000	
エコス	700	2,312.00	1,618,400	
ワタミ	2,200	927.00	2,039,400	

パン・パシフィック・インターナショナル ホ	188,200	871.30	163,978,660	
西松屋チェーン	4,100	1,955.00	8,015,500	
ゼンショーホールディングス	9,500	7,750.00	73,625,000	
幸楽苑	1,800	1,088.00	1,958,400	
サイゼリヤ	2,800	5,130.00	14,364,000	
V Tホールディングス	7,300	466.00	3,401,800	
魚力	600	2,264.00	1,358,400	
ユナイテッドアローズ	2,000	2,424.00	4,848,000	
ハイデイ日高	3,000	2,746.00	8,238,000	
コロワイド	10,500	1,865.50	19,587,750	
壺番屋	7,400	874.00	6,467,600	
スギホールディングス	10,000	3,081.00	30,810,000	
薬王堂ホールディングス	1,000	1,800.00	1,800,000	
ダブルエー	800	1,383.00	1,106,400	
スクロール	3,200	1,618.00	5,177,600	
ヨンドシーホールディングス	1,800	1,814.00	3,265,200	
木曽路	2,800	2,328.00	6,518,400	
S R Sホールディングス	3,100	1,190.00	3,689,000	
千趣会	3,800	125.00	475,000	
リテールパートナーズ	2,800	1,330.00	3,724,000	
J o s h i n	2,000	2,975.00	5,950,000	
日本瓦斯	8,900	2,729.00	24,288,100	
ロイヤルホールディングス	7,200	1,317.00	9,482,400	
チヨダ	1,800	939.00	1,690,200	
ライフコーポレーション	3,600	2,537.00	9,133,200	
リンガーハット	2,600	2,152.00	5,595,200	
MrMa xHD	1,600	707.00	1,131,200	
A O K Iホールディングス	4,000	1,648.00	6,592,000	
オークワ	2,500	782.00	1,955,000	
コメリ	2,500	3,505.00	8,762,500	
青山商事	11,900	714.00	8,496,600	
しまむら	13,100	3,212.00	42,077,200	
高島屋	26,100	1,966.00	51,312,600	
松屋	3,500	1,525.00	5,337,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,100	2,517.00	22,904,700	
近鉄百貨店	1,100	1,699.00	1,868,900	
丸井グループ	10,900	3,019.00	32,907,100	
アクシアル リテイリング	5,100	1,049.00	5,349,900	
イオン	219,900	1,497.50	329,300,250	
イズミ	9,900	980.00	9,702,000	
平和堂	3,100	2,653.00	8,224,300	
フジ	2,900	2,095.00	6,075,500	
ゼビオホールディングス	2,200	1,000.00	2,200,000	

ケーズホールディングス	12,200	2,061.50	25,150,300	
シルバーライフ	500	751.00	375,500	
Genky DrugStores	1,600	3,620.00	5,792,000	
ブックオフグループホールディングス	1,400	2,050.00	2,870,000	
ギフトホールディングス	1,100	4,360.00	4,796,000	
アインホールディングス	2,100	5,593.00	11,745,300	
Genki Global Dining	1,100	2,704.00	2,974,400	
ヤマダホールディングス	57,300	572.00	32,775,600	
アークランズ	5,500	1,810.00	9,955,000	
ニトリホールディングス	30,100	2,415.00	72,691,500	
グルメ杵屋	1,500	987.00	1,480,500	
ケーユーホールディングス	1,300	1,155.00	1,501,500	
吉野家ホールディングス	6,900	3,161.00	21,810,900	
松屋フーズホールディングス	900	4,975.00	4,477,500	
サガミホールディングス	3,000	1,754.00	5,262,000	
王将フードサービス	3,800	2,833.00	10,765,400	
ミニストップ	1,400	1,903.00	2,664,200	
アークス	3,100	3,460.00	10,726,000	
パローホールディングス	3,600	3,770.00	13,572,000	
ベルク	800	6,630.00	5,304,000	
大庄	1,100	1,065.00	1,171,500	
ファーストリテイリング	12,600	71,630.00	902,538,000	
サンドラッグ	5,500	3,760.00	20,680,000	
サックスパー ホールディングス	1,600	732.00	1,171,200	
ベルーナ	4,500	930.00	4,185,000	
いよぎんホールディングス	22,700	3,162.00	71,777,400	
しずおかフィナンシャルグループ	38,200	2,915.50	111,372,100	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	14,600	3,033.00	44,281,800	
楽天銀行	9,200	6,000.00	55,200,000	
京都フィナンシャルグループ	23,800	4,413.00	105,029,400	
めぶきフィナンシャルグループ	81,000	1,377.50	111,577,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,200	10,580.00	23,276,000	
九州フィナンシャルグループ	33,600	1,417.50	47,628,000	
ゆうちょ銀行	188,300	2,829.00	532,700,700	
富山第一銀行	5,500	2,695.00	14,822,500	
横浜フィナンシャルグループ	90,400	1,594.00	144,097,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,600	4,050.00	42,930,000	
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,697.00	11,369,900	
第四北越フィナンシャルグループ	16,300	2,030.00	33,089,000	
ひろぎんホールディングス	24,100	2,053.50	49,489,350	
おきなわフィナンシャルグループ	1,500	5,910.00	8,865,000	
十六フィナンシャルグループ	12,200	2,045.00	24,949,000	
CCIグループ	18,100	1,044.00	18,896,400	

プロクレアホールディングス	2,100	3,445.00	7,234,500	
あいちフィナンシャルグループ	17,800	1,522.00	27,091,600	
S B I 新生銀行	29,500	1,648.50	48,630,750	
あおぞら銀行	11,000	2,720.00	29,920,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,093,700	2,929.00	3,203,447,300	
りそなホールディングス	212,600	2,042.00	434,129,200	
三井住友トラストグループ	59,800	5,623.00	336,255,400	
三井住友フィナンシャルグループ	377,900	5,702.00	2,154,785,800	
千葉銀行	51,100	2,280.00	116,508,000	
群馬銀行	31,300	2,232.00	69,861,600	
武蔵野銀行	7,300	2,438.00	17,797,400	
千葉興業銀行	3,300	2,246.00	7,411,800	
筑波銀行	7,600	624.00	4,742,400	
七十七銀行	16,700	3,141.00	52,454,700	
秋田銀行	1,200	5,790.00	6,948,000	
山形銀行	2,200	2,655.00	5,841,000	
岩手銀行	4,400	1,877.00	8,258,800	
東邦銀行	19,900	705.00	14,029,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	6,612.00	91,245,600	
スルガ銀行	11,700	2,336.00	27,331,200	
八十二長野銀行	35,800	2,388.00	85,490,400	
山梨中央銀行	2,100	5,990.00	12,579,000	
大垣共立銀行	3,500	7,410.00	25,935,000	
福井銀行	1,700	4,450.00	7,565,000	
清水銀行	700	2,645.00	1,851,500	
滋賀銀行	11,900	2,056.00	24,466,400	
南都銀行	13,000	1,655.00	21,515,000	
百五銀行	16,300	1,953.00	31,833,900	
紀陽銀行	5,800	4,405.00	25,549,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,500	6,454.00	67,767,000	
山陰合同銀行	10,900	1,969.00	21,462,100	
百十四銀行	6,800	2,467.00	16,775,600	
四国銀行	2,700	2,694.00	7,273,800	
阿波銀行	2,600	6,720.00	17,472,000	
大分銀行	5,400	2,209.00	11,928,600	
宮崎銀行	5,100	1,996.00	10,179,600	
佐賀銀行	1,100	5,220.00	5,742,000	
琉球銀行	3,700	2,577.00	9,534,900	
セブン銀行	54,300	272.10	14,775,030	
みずほフィナンシャルグループ	245,900	6,912.00	1,699,660,800	
山口フィナンシャルグループ	17,000	2,813.00	47,821,000	
名古屋銀行	3,200	6,150.00	19,680,000	
北洋銀行	22,400	995.00	22,288,000	

愛媛銀行	2,500	1,913.00	4,782,500	
京葉銀行	7,500	2,368.00	17,760,000	
栃木銀行	9,400	937.00	8,807,800	
北日本銀行	500	5,240.00	2,620,000	
東和銀行	3,300	1,201.00	3,963,300	
トモニホールディングス	16,600	878.00	14,574,800	
フィデアホールディングス	1,800	1,944.00	3,499,200	
池田泉州ホールディングス	24,000	955.00	22,920,000	
F P G	6,100	1,526.00	9,308,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,800	2,116.00	5,924,800	
S B I ホールディングス	60,900	3,099.00	188,729,100	
ジャフコ グループ	4,600	2,242.50	10,315,500	
大和証券グループ本社	124,000	1,482.50	183,830,000	
野村ホールディングス	284,600	1,273.00	362,295,800	
岡三証券グループ	13,700	930.00	12,741,000	
丸三証券	5,800	1,063.00	6,165,400	
東洋証券	5,300	634.00	3,360,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,500	710.00	14,555,000	
水戸証券	4,800	652.00	3,129,600	
いちよし証券	3,200	1,284.00	4,108,800	
松井証券	11,900	928.00	11,043,200	
マネックスグループ	18,200	666.00	12,121,200	
極東証券	2,400	1,567.00	3,760,800	
岩井コスモホールディングス	1,800	3,640.00	6,552,000	
アイザワ証券グループ	1,800	1,479.00	2,662,200	
スパークス・グループ	1,900	2,137.00	4,060,300	
ライフネット生命保険	3,700	1,846.00	6,830,200	
かんぽ生命保険	58,700	1,648.00	96,737,600	
F P パートナー	800	2,344.00	1,875,200	
SOMPOホールディングス	86,100	6,100.00	525,210,000	
アニコム ホールディングス	5,400	1,340.00	7,236,000	
MS & AD インシュアランスグループホール	108,100	4,391.00	474,667,100	
ソニーフィナンシャルグループ	575,000	147.00	84,525,000	
第一ライフグループ	333,700	1,618.00	539,926,600	
東京海上ホールディングス	178,200	7,568.00	1,348,617,600	
T & Dホールディングス	38,500	3,949.00	152,036,500	
N S グループ	3,100	1,560.00	4,836,000	
ムニノバホールディングス	28,700	458.00	13,144,600	
全国保証	10,000	3,031.00	30,310,000	
ジェイリース	1,300	1,346.00	1,749,800	
S B I アルヒ	1,800	837.00	1,506,600	
プレミアムグループ	2,900	1,923.00	5,576,700	

ネットプロテクションズホールディングス	5,200	437.00	2,272,400	
クレディセゾン	9,800	4,316.00	42,296,800	
芙蓉総合リース	4,800	4,378.00	21,014,400	
みずほリース	13,000	1,360.00	17,680,000	
東京センチュリー	13,000	2,294.00	29,822,000	
日本証券金融	6,000	2,304.00	13,824,000	
リコーリース	1,600	6,300.00	10,080,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,000	1,560.00	15,600,000	
アコム	30,900	464.30	14,346,870	
ジャックス	2,100	3,775.00	7,927,500	
オリエントコーポレーション	6,800	991.00	6,738,800	
オリックス	103,600	5,772.00	597,979,200	
三菱HCキャピタル	86,900	1,426.00	123,919,400	
日本取引所グループ	95,100	1,767.50	168,089,250	
イー・ギャランティ	2,700	1,667.00	4,500,900	
NECキャピタルソリューション	900	3,975.00	3,577,500	
robot home	4,800	181.00	868,800	
大東建託	29,500	3,457.00	101,981,500	
いちご	13,700	489.00	6,699,300	
日本駐車場開発	20,600	252.00	5,191,200	
スター・マイカ・ホールディングス	1,800	1,696.00	3,052,800	
SREホールディングス	900	2,706.00	2,435,400	
ヒューリック	50,600	1,760.50	89,081,300	
野村不動産ホールディングス	48,300	974.30	47,058,690	
三重交通グループホールディングス	4,200	520.00	2,184,000	
ディア・ライフ	3,400	1,016.00	3,454,400	
地主	1,400	3,240.00	4,536,000	
JPMC	900	1,353.00	1,217,700	
フージャースホールディングス	3,000	1,216.00	3,648,000	
オープンハウスグループ	5,400	8,953.00	48,346,200	
東急不動産ホールディングス	47,400	1,314.00	62,283,600	
飯田グループホールディングス	14,800	2,185.50	32,345,400	
And Doホールディングス	900	1,083.00	974,700	
ケイアイスター不動産	1,500	3,500.00	5,250,000	
グッドコムアセット	1,800	1,429.00	2,572,200	
ジェイ・エス・ビー	700	5,270.00	3,689,000	
ロードスターキャピタル	1,000	2,955.00	2,955,000	
アズーム	400	4,245.00	1,698,000	
霞ヶ関キャピタル	1,800	6,020.00	10,836,000	
パーク24	12,400	1,792.00	22,220,800	
パラカ	600	1,979.00	1,187,400	
三井不動産	254,000	1,539.50	391,033,000	
三菱地所	104,200	4,137.00	431,075,400	

平和不動産	3,300	2,413.00	7,962,900
東京建物	16,400	3,298.00	54,087,200
京阪神ビルディング	2,600	2,236.00	5,813,600
住友不動産	49,300	4,232.00	208,637,600
テーオーシー	3,100	1,019.00	3,158,900
レオパレス21	15,400	642.00	9,886,800
スターツコーポレーション	3,200	4,855.00	15,536,000
フジ住宅	2,200	735.00	1,617,000
空港施設	2,400	913.00	2,191,200
明和地所	1,400	839.00	1,174,600
ゴールドクレスト	900	3,650.00	3,285,000
エスリード	800	5,170.00	4,136,000
日神グループホールディングス	2,800	662.00	1,853,600
エスコン	3,900	1,125.00	4,387,500
MIRARTHホールディングス	11,100	394.00	4,373,400
カチタス	4,700	3,580.00	16,826,000
トーセイ	5,100	1,583.00	8,073,300
サンフロンティア不動産	2,700	2,467.00	6,660,900
FJネクストホールディングス	1,600	1,703.00	2,724,800
グランディハウス	1,600	534.00	854,400
日本空港ビルデング	6,100	5,037.00	30,725,700
LIFULL	6,200	186.00	1,153,200
ジェイエイシーリクルートメント	6,500	832.00	5,408,000
日本M&Aセンターホールディングス	28,800	638.30	18,383,040
フィットイージー	500	2,397.00	1,198,500
メンバーズ	600	1,169.00	701,400
UTグループ	35,600	182.00	6,479,200
アイティメディア	1,000	1,223.00	1,223,000
E・Jホールディングス	1,300	1,657.00	2,154,100
オープンアップグループ	5,400	1,861.00	10,049,400
コシダカホールディングス	5,000	1,014.00	5,070,000
パソナグループ	1,900	1,690.00	3,211,000
リンクアンドモチベーション	4,300	532.00	2,287,600
エス・エム・エス	6,900	1,841.00	12,702,900
パーソルホールディングス	165,000	236.30	38,989,500
クックパッド	2,600	125.00	325,000
学情	800	1,583.00	1,266,400
スタジオアリス	900	1,776.00	1,598,400
NJS	500	5,070.00	2,535,000
ALSOK	30,200	1,094.00	33,038,800
カカクコム	11,700	3,528.00	41,277,600
ルネサンス	1,400	1,010.00	1,414,000
ディップ	3,200	1,784.00	5,708,800

新日本科学	1,900	1,220.00	2,318,000	
エムスリー	35,800	1,355.00	48,509,000	
ワールドホールディングス	800	2,406.00	1,924,800	
博報堂DYホールディングス	21,600	1,110.50	23,986,800	
ぐるなび	3,400	126.00	428,400	
タカミヤ	2,500	425.00	1,062,500	
ファンコミュニケーションズ	2,600	433.00	1,125,800	
ライク	900	1,621.00	1,458,900	
エスプール	4,700	230.00	1,081,000	
WDBホールディングス	800	1,704.00	1,363,200	
アドウェイズ	1,900	286.00	543,400	
バリューコマース	1,600	469.00	750,400	
インフォマート	17,100	394.00	6,737,400	
J Pホールディングス	4,600	649.00	2,985,400	
CLホールディングス	500	1,220.00	610,000	
プレステージ・インターナショナル	6,700	666.00	4,462,200	
アミューズ	1,000	1,871.00	1,871,000	
ドリームインキュベータ	600	2,675.00	1,605,000	
クイック	4,500	742.00	3,339,000	
電通グループ	17,500	3,035.00	53,112,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	693.00	623,700	
ぴあ	800	2,828.00	2,262,400	
イオンファンタジー	800	2,578.00	2,062,400	
シーティーエス	2,200	836.00	1,839,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	600	861.00	516,600	
H. U. グループホールディングス	5,700	3,228.00	18,399,600	
アルプス技研	1,500	2,408.00	3,612,000	
日本空調サービス	1,900	1,582.00	3,005,800	
オリエンタルランド	106,700	2,161.00	230,578,700	
ダスキン	4,100	3,975.00	16,297,500	
明光ネットワークジャパン	2,400	688.00	1,651,200	
ファルコホールディングス	700	2,587.00	1,810,900	
ラウンドワン	17,100	826.40	14,131,440	
リゾートトラスト	17,100	1,727.50	29,540,250	
ビー・エム・エル	2,400	3,525.00	8,460,000	
リソー教育グループ	5,700	197.00	1,122,900	
早稲田アカデミー	900	2,172.00	1,954,800	
ユー・エス・エス	34,300	1,760.00	60,368,000	
サイバーエージェント	40,100	1,316.50	52,791,650	
楽天グループ	143,100	778.30	111,374,730	
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,296.00	1,425,600	
SBIグローバルアセットマネジメント	3,400	604.00	2,053,600	
テー・オー・ダブリュー	3,500	368.00	1,288,000	

GMOインターネット	500	629.00	314,500	
山田コンサルティンググループ	800	1,648.00	1,318,400	
セントラルスポーツ	800	2,348.00	1,878,400	
フルキャストホールディングス	1,400	1,531.00	2,143,400	
エン	2,900	1,177.00	3,413,300	
弁護士ドットコム	900	2,710.00	2,439,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	792.00	712,800	
K e e P e r 技研	1,100	2,725.00	2,997,500	
G u n o s y	1,400	520.00	728,000	
イー・ガーディアン	500	1,688.00	844,000	
ジャパンマテリアル	5,500	1,992.00	10,956,000	
ベクトル	2,500	1,259.00	3,147,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,253.00	1,879,500	
キャリアリンク	700	2,250.00	1,575,000	
I B J	1,400	743.00	1,040,200	
アサンテ	900	1,380.00	1,242,000	
バリューHR	1,600	1,406.00	2,249,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	3,370.00	5,055,000	
ライドオンエクспレスホールディングス	700	984.00	688,800	
シグマクシス・ホールディングス	5,100	589.00	3,003,900	
ウィルグループ	1,700	1,048.00	1,781,600	
リクルートホールディングス	126,000	7,825.00	985,950,000	
エラン	1,600	717.00	1,147,200	
日本郵政	163,000	1,957.00	318,991,000	
ベルシステム24ホールディングス	2,500	1,438.00	3,595,000	
鎌倉新書	1,800	460.00	828,000	
エアトリ	1,600	669.00	1,070,400	
アトラエ	1,500	715.00	1,072,500	
ストライクグループ	3,000	1,220.00	3,660,000	
ソラスト	4,400	1,112.00	4,892,800	
インソース	4,500	636.00	2,862,000	
ベイカレント	13,300	5,115.00	68,029,500	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	400	1,053.00	421,200	
アイモバイル	2,700	501.00	1,352,700	
M S - J a p a n	1,200	924.00	1,108,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	15,300	1,869.00	28,595,700	
エル・ティー・エス	200	1,727.00	345,400	
ミダックホールディングス	900	2,150.00	1,935,000	
キュービーネットホールディングス	900	1,322.00	1,189,800	
オープングループ	2,500	207.00	517,500	
マネジメントソリューションズ	1,000	1,265.00	1,265,000	
プロレド・パートナーズ	400	408.00	163,200	
フロンティア・マネジメント	700	555.00	388,500	

アンビスホールディングス	3,900	360.00	1,404,000	
カーブスホールディングス	4,900	824.00	4,037,600	
Mac bee Planet	800	1,214.00	971,200	
ダイレクトマーケティングミックス	1,900	304.00	577,600	
ポピンズ	300	1,385.00	415,500	
LITALICO	1,600	1,532.00	2,451,200	
リロググループ	8,100	2,034.50	16,479,450	
東祥	1,500	765.00	1,147,500	
ビーウィズ	700	1,930.00	1,351,000	
サンウェルズ	1,400	191.00	267,400	
TREホールディングス	4,200	1,606.00	6,745,200	
人・夢・技術グループ	700	1,599.00	1,119,300	
NISSOホールディングス	1,600	572.00	915,200	
大栄環境	3,900	4,300.00	16,770,000	
GENOVA	1,100	570.00	627,000	
日本管財ホールディングス	1,900	2,828.00	5,373,200	
クオオンツ総研ホールディングス	2,100	616.00	1,293,600	
エイチ・アイ・エス	5,300	1,041.00	5,517,300	
ラックランド	800	1,377.00	1,101,600	
共立メンテナンス	7,200	2,363.00	17,013,600	
イチネンホールディングス	1,700	2,134.00	3,627,800	
建設技術研究所	1,900	2,755.00	5,234,500	
スペース	1,300	1,507.00	1,959,100	
燦ホールディングス	1,500	1,363.00	2,044,500	
スバル興業	600	3,505.00	2,103,000	
タナベコンサルティンググループ	1,500	732.00	1,098,000	
ナガワ	500	5,320.00	2,660,000	
東京都競馬	1,300	5,220.00	6,786,000	
カナモト	2,600	4,805.00	12,493,000	
ニシオホールディングス	1,500	4,090.00	6,135,000	
トランス・コスモス	2,300	3,890.00	8,947,000	
乃村工藝社	7,900	1,168.00	9,227,200	
藤田観光	3,600	1,905.00	6,858,000	
KNT-CTホールディングス	900	1,904.00	1,713,600	
トーカイ	1,300	2,443.00	3,175,900	
セコム	33,800	6,163.00	208,309,400	
セントラル警備保障	900	2,670.00	2,403,000	
丹青社	3,800	1,424.00	5,411,200	
メイテックグループホールディングス	6,700	3,022.00	20,247,400	
応用地質	1,600	2,885.00	4,616,000	
船井総研ホールディングス	7,200	1,084.00	7,804,800	
学究社	700	2,301.00	1,610,700	
ナック	1,800	512.00	921,600	

小計	ダイセキ	3,500	4,390.00	15,365,000	
	ステップ	700	2,252.00	1,576,400	
	銘柄数：1,634			95,404,471,010	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
合 計				95,404,471,010	

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

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日立国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2025年 5月15日現在	2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	903,393,344	563,862,254
国債証券	46,426,953,650	49,895,954,700
地方債証券	3,120,981,000	3,151,996,000
特殊債券	3,344,780,035	2,817,092,132
社債券	3,471,263,000	3,240,810,000
未収入金	1,031,482,400	-
未収利息	147,623,950	173,343,464
前払費用	8,321,239	7,822,709
流動資産合計	58,454,798,618	59,850,881,259
資産合計	58,454,798,618	59,850,881,259
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,614,400,000	205,946,686
流動負債合計	1,614,400,000	205,946,686
負債合計	1,614,400,000	205,946,686
純資産の部		
元本等		
元本	44,856,364,552	50,264,431,379
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	11,984,034,066	9,380,503,194
元本等合計	56,840,398,618	59,644,934,573
純資産合計	56,840,398,618	59,644,934,573
負債純資産合計	58,454,798,618	59,850,881,259

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2025年 5月15日現在	2026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	44,856,364,552口	50,264,431,379口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2672円 (12,672円)	1.1866円 (11,866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 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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	2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2025年 5月15日現在	2026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
国債証券	△477,527,450	△1,010,160,150
地方債証券	4,697,000	△46,012,000
特殊債券	△6,504,179	△40,258,040
社債券	3,890,000	△30,574,000
合計	△475,444,629	△1,127,004,190

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	45,618,504,335円	44,856,364,552円
期中追加設定元本額	6,459,965,604円	8,226,014,479円
期中一部解約元本額	7,222,105,387円	2,817,947,652円
期末元本額	44,856,364,552円	50,264,431,379円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式７０）	6,262,736,254円	8,020,466,332円
日立バランスファンド（株式５０）	8,637,916,172円	10,221,097,876円
日立バランスファンド（株式３０）	4,024,862,723円	4,363,745,585円
日立国内債券特化型ファンドN（非課税適格機関投資家専用）	17,639,107,146円	19,881,861,203円
日立国内債券インデックスファンド	8,291,742,257円	7,777,260,383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

（2026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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第４７４回利付国債（２年）	270,000,000	268,639,200	
		第４７５回利付国債（２年）	470,000,000	468,406,700	
		第４７６回利付国債（２年）	490,000,000	488,035,100	
		第４７７回利付国債（２年）	70,000,000	69,773,200	
		第４７８回利付国債（２年）	120,000,000	119,535,600	
		第４７９回利付国債（２年）	170,000,000	169,241,800	
		第４８２回利付国債（２年）	40,000,000	39,958,000	
		第４８３回利付国債（２年）	40,000,000	40,010,800	
		第１５４回利付国債（５年）	190,000,000	187,201,300	
		第１５５回利付国債（５年）	100,000,000	98,432,000	
		第１５６回利付国債（５年）	230,000,000	226,034,800	
		第１５７回利付国債（５年）	480,000,000	469,843,200	
		第１５８回利付国債（５年）	460,000,000	449,443,000	
		第１５９回利付国債（５年）	200,000,000	194,580,000	
		第１６０回利付国債（５年）	250,000,000	243,732,500	
		第１６１回利付国債（５年）	330,000,000	322,396,800	
		第１６２回利付国債（５年）	400,000,000	389,224,000	
		第１６３回利付国債（５年）	520,000,000	507,166,400	
		第１６４回利付国債（５年）	300,000,000	289,908,000	
		第１６７回利付国債（５年）	430,000,000	415,986,300	
		第１６８回利付国債（５年）	460,000,000	447,570,800	
		第１６９回利付国債（５年）	30,000,000	29,103,900	
		第１７０回利付国債（５年）	550,000,000	532,862,000	
		第１７２回利付国債（５年）	240,000,000	231,780,000	
		第１７３回利付国債（５年）	240,000,000	231,501,600	
		第１７４回利付国債（５年）	470,000,000	454,847,200	

第175回利付国債（5年）	330,000,000	320,195,700	
第176回利付国債（5年）	250,000,000	243,457,500	
第177回利付国債（5年）	570,000,000	557,004,000	
第178回利付国債（5年）	490,000,000	475,412,700	
第179回利付国債（5年）	500,000,000	483,195,000	
第180回利付国債（5年）	140,000,000	135,851,800	
第181回利付国債（5年）	460,000,000	448,564,400	
第182回利付国債（5年）	460,000,000	450,501,000	
第183回利付国債（5年）	270,000,000	266,014,800	
第184回利付国債（5年）	120,000,000	119,019,600	
第1回利付国債（40年）	180,000,000	145,076,400	
第2回利付国債（40年）	160,000,000	121,704,000	
第3回利付国債（40年）	130,000,000	97,346,600	
第4回利付国債（40年）	130,000,000	94,985,800	
第5回利付国債（40年）	100,000,000	68,575,000	
第6回利付国債（40年）	90,000,000	59,456,700	
第7回利付国債（40年）	125,000,000	78,081,250	
第8回利付国債（40年）	165,000,000	93,852,000	
第9回利付国債（40年）	193,000,000	74,899,440	
第10回利付国債（40年）	190,000,000	89,011,200	
第11回利付国債（40年）	142,000,000	62,728,500	
第12回利付国債（40年）	131,000,000	49,483,940	
第13回利付国債（40年）	207,000,000	77,028,840	
第14回利付国債（40年）	210,000,000	84,052,500	
第15回利付国債（40年）	270,000,000	121,032,900	
第16回利付国債（40年）	280,000,000	138,611,200	
第17回利付国債（40年）	310,000,000	204,175,300	
第18回利付国債（40年）	200,000,000	167,156,000	
第1回クライメート・トランジション利付国債（5年）	230,000,000	222,973,500	
第2回クライメート・トランジション利付国債（5年）	319,000,000	308,211,420	
第1回クライメート・トランジション利付国債（10年）	180,000,000	158,970,600	
第2回クライメート・トランジション利付国債（10年）	360,000,000	323,863,200	
第347回利付国債（10年）	80,000,000	79,112,000	
第348回利付国債（10年）	220,000,000	216,759,400	
第349回利付国債（10年）	230,000,000	225,676,000	
第350回利付国債（10年）	340,000,000	332,197,000	
第351回利付国債（10年）	180,000,000	175,140,000	
第352回利付国債（10年）	230,000,000	222,787,200	
第353回利付国債（10年）	360,000,000	347,036,400	
第354回利付国債（10年）	460,000,000	441,264,200	
第355回利付国債（10年）	410,000,000	391,140,000	
第356回利付国債（10年）	430,000,000	407,915,200	

第357回利付国債（10年）	390,000,000	367,692,000	
第358回利付国債（10年）	390,000,000	365,539,200	
第359回利付国債（10年）	360,000,000	335,340,000	
第360回利付国債（10年）	590,000,000	546,192,500	
第361回利付国債（10年）	420,000,000	386,437,800	
第362回利付国債（10年）	380,000,000	347,380,800	
第363回利付国債（10年）	350,000,000	317,807,000	
第364回利付国債（10年）	340,000,000	306,669,800	
第365回利付国債（10年）	360,000,000	322,516,800	
第366回利付国債（10年）	380,000,000	340,149,400	
第367回利付国債（10年）	560,000,000	497,705,600	
第368回利付国債（10年）	560,000,000	494,082,400	
第369回利付国債（10年）	480,000,000	429,312,000	
第370回利付国債（10年）	430,000,000	382,231,300	
第371回利付国債（10年）	720,000,000	631,022,400	
第372回利付国債（10年）	680,000,000	609,987,200	
第373回利付国債（10年）	640,000,000	561,689,600	
第374回利付国債（10年）	540,000,000	478,418,400	
第375回利付国債（10年）	530,000,000	478,134,200	
第376回利付国債（10年）	470,000,000	414,511,800	
第377回利付国債（10年）	520,000,000	467,719,200	
第378回利付国債（10年）	500,000,000	455,080,000	
第379回利付国債（10年）	250,000,000	228,435,000	
第380回利付国債（10年）	260,000,000	240,601,400	
第381回利付国債（10年）	110,000,000	105,011,500	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	41,430,800	
第5回利付国債（30年）	5,000,000	5,047,750	
第6回利付国債（30年）	70,000,000	71,194,900	
第8回利付国債（30年）	45,000,000	43,861,500	
第11回利付国債（30年）	135,000,000	129,744,450	
第12回利付国債（30年）	90,000,000	88,590,600	
第13回利付国債（30年）	70,000,000	68,201,700	
第14回利付国債（30年）	120,000,000	119,960,400	
第16回利付国債（30年）	50,000,000	50,086,000	
第17回利付国債（30年）	160,000,000	158,643,200	
第18回利付国債（30年）	155,000,000	152,039,500	
第19回利付国債（30年）	110,000,000	107,613,000	
第20回利付国債（30年）	50,000,000	49,568,000	
第21回利付国債（30年）	100,000,000	97,137,000	
第24回利付国債（30年）	50,000,000	48,914,500	
第25回利付国債（30年）	220,000,000	210,412,400	
第26回利付国債（30年）	180,000,000	173,149,200	
第27回利付国債（30年）	70,000,000	67,494,700	

第28回利付国債（30年）	300,000,000	287,523,000	
第29回利付国債（30年）	290,000,000	272,484,000	
第30回利付国債（30年）	230,000,000	211,933,500	
第31回利付国債（30年）	220,000,000	198,499,400	
第32回利付国債（30年）	215,000,000	194,572,850	
第33回利付国債（30年）	70,000,000	60,405,800	
第34回利付国債（30年）	220,000,000	193,105,000	
第35回利付国債（30年）	80,000,000	67,683,200	
第36回利付国債（30年）	170,000,000	142,490,600	
第37回利付国債（30年）	90,000,000	73,538,100	
第38回利付国債（30年）	180,000,000	143,328,600	
第39回利付国債（30年）	110,000,000	88,528,000	
第40回利付国債（30年）	150,000,000	118,083,000	
第41回利付国債（30年）	20,000,000	15,401,200	
第42回利付国債（30年）	20,000,000	15,306,800	
第43回利付国債（30年）	30,000,000	22,817,700	
第44回利付国債（30年）	130,000,000	98,365,800	
第45回利付国債（30年）	250,000,000	181,327,500	
第46回利付国債（30年）	320,000,000	230,707,200	
第47回利付国債（30年）	140,000,000	102,354,000	
第48回利付国債（30年）	200,000,000	139,786,000	
第49回利付国債（30年）	220,000,000	152,807,600	
第50回利付国債（30年）	150,000,000	90,874,500	
第51回利付国債（30年）	127,000,000	67,310,000	
第52回利付国債（30年）	150,000,000	82,972,500	
第53回利付国債（30年）	160,000,000	89,988,800	
第54回利付国債（30年）	170,000,000	99,625,100	
第55回利付国債（30年）	150,000,000	87,162,000	
第56回利付国債（30年）	160,000,000	92,187,200	
第57回利付国債（30年）	160,000,000	91,414,400	
第58回利付国債（30年）	200,000,000	113,254,000	
第59回利付国債（30年）	210,000,000	114,792,300	
第60回利付国債（30年）	190,000,000	108,592,600	
第61回利付国債（30年）	190,000,000	101,921,700	
第62回利付国債（30年）	210,000,000	105,254,100	
第63回利付国債（30年）	220,000,000	105,760,600	
第64回利付国債（30年）	230,000,000	109,383,400	
第65回利付国債（30年）	150,000,000	70,578,000	
第66回利付国債（30年）	140,000,000	65,175,600	
第67回利付国債（30年）	170,000,000	83,556,700	
第68回利付国債（30年）	240,000,000	116,810,400	
第69回利付国債（30年）	180,000,000	89,589,600	
第70回利付国債（30年）	160,000,000	78,881,600	

第7 1 回利付国債（3 0 年）	165,000,000	80,569,500	
第7 2 回利付国債（3 0 年）	150,000,000	72,585,000	
第7 3 回利付国債（3 0 年）	200,000,000	95,964,000	
第7 4 回利付国債（3 0 年）	190,000,000	99,710,100	
第7 5 回利付国債（3 0 年）	180,000,000	102,623,400	
第7 6 回利付国債（3 0 年）	170,000,000	99,239,200	
第7 7 回利付国債（3 0 年）	140,000,000	85,909,600	
第7 8 回利付国債（3 0 年）	220,000,000	127,267,800	
第7 9 回利付国債（3 0 年）	200,000,000	108,680,000	
第8 0 回利付国債（3 0 年）	170,000,000	108,924,100	
第8 1 回利付国債（3 0 年）	170,000,000	102,919,700	
第8 2 回利付国債（3 0 年）	146,000,000	93,031,200	
第8 3 回利付国債（3 0 年）	200,000,000	140,572,000	
第8 4 回利付国債（3 0 年）	140,000,000	95,820,200	
第8 5 回利付国債（3 0 年）	170,000,000	121,862,800	
第8 6 回利付国債（3 0 年）	130,000,000	95,257,500	
第8 7 回利付国債（3 0 年）	118,000,000	94,513,280	
第8 8 回利付国債（3 0 年）	110,000,000	95,729,700	
第8 9 回利付国債（3 0 年）	90,000,000	81,522,000	
第9 0 回利付国債（3 0 年）	20,000,000	19,183,800	
第9 6 回利付国債（2 0 年）	90,000,000	90,945,000	
第9 7 回利付国債（2 0 年）	210,000,000	212,759,400	
第9 8 回利付国債（2 0 年）	220,000,000	222,600,400	
第9 9 回利付国債（2 0 年）	70,000,000	70,884,100	
第1 0 0 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	101,506,000	
第1 0 2 回利付国債（2 0 年）	180,000,000	183,618,000	
第1 0 3 回利付国債（2 0 年）	50,000,000	50,903,500	
第1 0 4 回利付国債（2 0 年）	20,000,000	20,278,000	
第1 0 5 回利付国債（2 0 年）	190,000,000	192,732,200	
第1 0 6 回利付国債（2 0 年）	120,000,000	121,996,800	
第1 0 7 回利付国債（2 0 年）	170,000,000	172,458,200	
第1 0 8 回利付国債（2 0 年）	160,000,000	161,494,400	
第1 0 9 回利付国債（2 0 年）	90,000,000	90,793,800	
第1 1 0 回利付国債（2 0 年）	150,000,000	152,160,000	
第1 1 2 回利付国債（2 0 年）	320,000,000	324,422,400	
第1 1 3 回利付国債（2 0 年）	210,000,000	212,757,300	
第1 1 5 回利付国債（2 0 年）	120,000,000	121,866,000	
第1 1 6 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	101,472,000	
第1 1 7 回利付国債（2 0 年）	220,000,000	222,409,000	
第1 1 8 回利付国債（2 0 年）	10,000,000	10,058,900	
第1 1 9 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	99,809,000	
第1 2 0 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	99,011,000	
第1 2 1 回利付国債（2 0 年）	140,000,000	140,056,000	

第122回利付国債（20年）	60,000,000	59,770,800	
第123回利付国債（20年）	70,000,000	70,516,600	
第124回利付国債（20年）	120,000,000	120,354,000	
第125回利付国債（20年）	80,000,000	80,848,000	
第126回利付国債（20年）	120,000,000	120,158,400	
第127回利付国債（20年）	80,000,000	79,734,400	
第128回利付国債（20年）	100,000,000	99,469,000	
第129回利付国債（20年）	100,000,000	98,984,000	
第130回利付国債（20年）	150,000,000	148,158,000	
第131回利付国債（20年）	150,000,000	147,400,500	
第132回利付国債（20年）	80,000,000	78,417,600	
第133回利付国債（20年）	100,000,000	98,523,000	
第134回利付国債（20年）	20,000,000	19,657,200	
第135回利付国債（20年）	130,000,000	127,030,800	
第136回利付国債（20年）	80,000,000	77,737,600	
第138回利付国債（20年）	100,000,000	96,266,000	
第139回利付国債（20年）	90,000,000	87,146,100	
第140回利付国債（20年）	220,000,000	213,521,000	
第141回利付国債（20年）	150,000,000	145,138,500	
第142回利付国債（20年）	40,000,000	38,955,200	
第143回利付国債（20年）	130,000,000	124,549,100	
第144回利付国債（20年）	50,000,000	47,594,000	
第145回利付国債（20年）	220,000,000	211,435,400	
第146回利付国債（20年）	330,000,000	315,971,700	
第147回利付国債（20年）	240,000,000	227,232,000	
第148回利付国債（20年）	240,000,000	224,563,200	
第149回利付国債（20年）	280,000,000	260,806,000	
第150回利付国債（20年）	160,000,000	147,088,000	
第151回利付国債（20年）	200,000,000	179,892,000	
第152回利付国債（20年）	355,000,000	317,568,800	
第153回利付国債（20年）	155,000,000	139,160,550	
第154回利付国債（20年）	130,000,000	114,979,800	
第155回利付国債（20年）	210,000,000	181,007,400	
第156回利付国債（20年）	80,000,000	64,370,400	
第157回利付国債（20年）	160,000,000	124,814,400	
第158回利付国債（20年）	280,000,000	223,862,800	
第159回利付国債（20年）	240,000,000	192,386,400	
第160回利付国債（20年）	270,000,000	217,163,700	
第161回利付国債（20年）	260,000,000	204,916,400	
第162回利付国債（20年）	372,000,000	290,662,200	
第163回利付国債（20年）	350,000,000	271,106,500	
第164回利付国債（20年）	340,000,000	257,750,600	
第165回利付国債（20年）	338,000,000	254,013,760	

		第166回利付国債（20年）	570,000,000	436,198,200	
		第167回利付国債（20年）	370,000,000	273,104,400	
		第168回利付国債（20年）	600,000,000	432,558,000	
		第169回利付国債（20年）	257,000,000	180,735,250	
		第170回利付国債（20年）	210,000,000	146,218,800	
		第171回利付国債（20年）	210,000,000	144,771,900	
		第172回利付国債（20年）	200,000,000	138,706,000	
		第173回利付国債（20年）	326,000,000	223,870,720	
		第174回利付国債（20年）	250,000,000	170,067,500	
		第175回利付国債（20年）	230,000,000	157,568,400	
		第176回利付国債（20年）	180,000,000	122,189,400	
		第177回利付国債（20年）	200,000,000	132,184,000	
		第178回利付国債（20年）	230,000,000	153,315,700	
		第179回利付国債（20年）	210,000,000	138,751,200	
		第180回利付国債（20年）	230,000,000	159,024,300	
		第181回利付国債（20年）	170,000,000	118,639,600	
		第182回利付国債（20年）	130,000,000	93,249,000	
		第183回利付国債（20年）	260,000,000	194,914,200	
		第184回利付国債（20年）	170,000,000	120,213,800	
		第185回利付国債（20年）	190,000,000	133,389,500	
		第186回利付国債（20年）	180,000,000	134,749,800	
		第187回利付国債（20年）	190,000,000	136,393,400	
		第188回利付国債（20年）	250,000,000	188,027,500	
		第189回利付国債（20年）	110,000,000	86,572,200	
		第190回利付国債（20年）	70,000,000	53,906,300	
		第191回利付国債（20年）	130,000,000	103,101,700	
		第192回利付国債（20年）	170,000,000	143,474,900	
		第193回利付国債（20年）	140,000,000	119,663,600	
		第194回利付国債（20年）	140,000,000	123,104,800	
		第195回利付国債（20年）	110,000,000	104,107,300	
	小計	銘柄数：270	59,016,000,000	49,895,954,700	
		組入時価比率：83.7%		84.4%	
	合計			49,895,954,700	
地方債証券	日本門	第10回東京都公募公債（東京再生都債）	100,000,000	89,479,000	
		第31回東京都公募公債（20年）	100,000,000	89,513,000	
		令和5年度第9回北海道公募公債（5年）	100,000,000	97,173,000	
		第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	96,575,000	
		第425回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,292,000	
		第9回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	101,278,000	
		第38回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	69,172,000	
		第42回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	65,139,000	

		第2回静岡県公募公債（グリーンボンド・5年）	100,000,000	97,487,000	
		第5回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	98,641,000	
		第9回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	94,647,000	
		平成21年度第16回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	101,123,000	
		平成26年度第4回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	92,385,000	
		令和2年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	66,477,000	
		第10回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	99,531,000	
		平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	100,996,000	
		平成26年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	92,330,000	
		第5回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	101,519,000	
		第22回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	78,719,000	
		平成30年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	74,687,000	
		第3回群馬県公募公債（20年）	100,000,000	96,437,000	
		第204回共同発行市場公募地方債	100,000,000	92,975,000	
		第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	92,755,000	
		第272回共同発行市場公募地方債	100,000,000	91,761,000	
		第13回京都市公募公債（20年）	100,000,000	90,074,000	
		令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	47,567,000	
		令和4年度第3回神戸市公募公債（5年）	100,000,000	98,204,000	
		第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	96,088,000	
		第4回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	101,656,000	
		第19回北九州市公募公債（20年）	100,000,000	88,526,000	
		平成23年度第4回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	98,522,000	
		平成25年度第1回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	95,599,000	
		平成26年度第2回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	91,838,000	
		平成29年度第1回相模原市公募公債	100,000,000	98,483,000	
		第160回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	66,348,000	
		銘柄数：35 組入時価比率：5.3%	3,500,000,000	3,151,996,000	5.3%
	小計				
	合計			3,151,996,000	
特殊債券	日本円	第34回日本政策投資銀行債券	100,000,000	96,697,000	
		第33回日本高速道路債券・機構承継債	100,000,000	101,929,000	
		第55回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,845,000	
		第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,779,000	
		第208回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,500,000	
		第216回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,277,000	

第224回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	74,120,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	88,138,000	
第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	75,944,000	
第354回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,907,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,907,000	
第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,993,000	
第23回公営企業債券（20年）	200,000,000	202,418,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	101,387,000	
第113回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,718,000	
第119回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,271,000	
F197回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,467,000	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	96,855,000	
第153回都市再生債券	100,000,000	47,924,000	
第188回都市再生債券	100,000,000	68,078,000	
第15回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,510,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,184,000	20,244,552	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,568,000	11,632,780	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,891,000	10,934,672	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,821,000	14,709,842	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,522,000	13,489,411	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,263,000	14,150,607	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,946,000	13,812,955	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,881,000	23,773,768	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,691,000	27,928,961	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,905,000	28,435,513	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,945,000	31,608,185	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,765,000	44,678,916	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,301,000	44,966,395	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,009,000	44,880,983	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,898,000	47,117,746	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,103,000	47,665,161	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,959,000	51,860,851	
第162回貸付債権担保住宅金融支	74,860,000	53,664,888	

小計	援機構債券				
	第167回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,844,000	54,503,015		
	第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,075,000	59,460,931		
	第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	37,591,000		
	第41号商工債（10年）	100,000,000	88,317,000		
	銘柄数：43 組入時価比率：4.7%	3,236,431,000	2,817,092,132 4.8%		
	合計		2,817,092,132		
社債券	日本円	第37回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債（2023）	100,000,000	97,773,000	
		第12回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債（202）	100,000,000	99,072,000	
		第6回国際協力機構債券	100,000,000	99,893,000	
		第81回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人）	100,000,000	90,788,000	
		第34回清水建設株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	89,349,000	
		第16回森永乳業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	96,798,000	
		第25回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債（特	100,000,000	96,185,000	
		第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債（社	100,000,000	96,965,000	
		第59回住友化学株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,258,000	
		第55回三井化学株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	62,076,000	
		第41回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債（社債	100,000,000	89,712,000	
		第17回株式会社日立製作所無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,868,000	
		第24回パナソニックホールディングス株式会社無担保社債（社	100,000,000	97,284,000	
		第31回トヨタ自動車株式会社無担保社債（特定社債間限定同等特	100,000,000	88,262,000	
		第85回丸紅株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,751,000	
		第80回三菱商事株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約	100,000,000	99,400,000	
		第61回株式会社三井住友銀行無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	99,261,000	
		第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	93,645,000	
		第97回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	96,714,000	
		第76回三菱UFJリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	93,672,000	
		第71回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,022,000	
		第19回ダイビル株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約	100,000,000	70,123,000	
		第91回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順	100,000,000	95,237,000	
		第130回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	96,676,000	
		第155回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	47,022,000	

小計	第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特	100,000,000	101,116,000	
	第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位	100,000,000	74,679,000	
	第22回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,734,000	
	第25回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	97,956,000	
	第522回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	96,933,000	
	第527回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	90,682,000	
	第338回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	77,425,000	
	第72回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	91,095,000	
	第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	90,330,000	
	第72回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	87,756,000	
	第51回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	48,298,000	
	銘柄数：36	3,600,000,000	3,240,810,000	
	組入時価比率：5.4%		5.5%	
合計		3,240,810,000		
合計			59,105,852,832	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

日立外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2025年 5月15日現在	2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	8,960,025,845	2,151,603,515
コール・ローン	307,894,703	204,261,592
株式	124,412,075,696	163,364,664,780
派生商品評価勘定	272,481,975	228,709,467
未収入金	1,471,108,126	8,126,826
未収配当金	120,641,993	133,337,186
未収利息	2,952	3,357
差入委託証拠金	276,008,142	261,891,351
流動資産合計	135,820,239,432	166,352,598,074
資産合計	135,820,239,432	166,352,598,074
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,942,417	801,317
未払解約金	8,189,000,000	133,000,000
流動負債合計	8,204,942,417	133,801,317
負債合計	8,204,942,417	133,801,317

2025年 5月15日現在

2026年 5月15日現在

純資産の部		
元本等		
元本	18,840,423,181	17,840,016,610
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	108,774,873,834	148,378,780,147
元本等合計	127,615,297,015	166,218,796,757
純資産合計	127,615,297,015	166,218,796,757
負債純資産合計	135,820,239,432	166,352,598,074

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2025年 5月15日現在	2026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	18,840,423,181口	17,840,016,610口
1口当たり純資産額	6.7735円	9.3172円
(1万口当たり純資産額)	(67,735円)	(93,172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 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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	2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	---

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2025年 5月15日現在	2026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	5,611,624,760	21,421,537,273
合計	5,611,624,760	21,421,537,273

(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 2025年 5月16日 至 2026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、通貨関連では為替予約取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額・為替等の変動によるリスクを回避する目的で行ないます。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で、また、通貨関連では外貨建有価証券等の為替変動リスクを回避する目的で利用しております。
4.取引に係るリスクの内容	有価証券先物取引は株式等の相場変動によるリスクを、為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5.取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、資産運用業協会の諸規則、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）

（2025年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			契約額等 うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,923,315,326	—	3,116,546,858	193,231,532
	S&P500 EMINI	2,219,805,949	—	2,376,812,295	157,006,346
	S&PTSE60 2506	122,395,975	—	129,241,680	6,845,705
	EURX50 2506	282,272,260	—	299,941,642	17,669,382
	FTSE100 2506	145,791,482	—	149,772,058	3,980,576
	SMI 2506	61,021,800	—	63,078,480	2,056,680
	SPI200 2506	92,027,860	—	97,700,703	5,672,843
合計		2,923,315,326	—	3,116,546,858	193,231,532

（2026年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			契約額等 うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,572,013,233	—	2,799,683,903	227,670,670
	S&P500 EMINI	1,992,243,373	—	2,207,500,068	215,256,695

	S&PTSE60 2606	89,074,952	—	91,747,616	2,672,664
	EURX50 2606	233,732,774	—	240,780,980	7,048,206
	FTSE100 2606	131,644,378	—	132,082,468	438,090
	SMI 2606	51,365,458	—	53,312,160	1,946,702
	SPI200 2606	73,952,298	—	74,260,611	308,313
合計		2,572,013,233	—	2,799,683,903	227,670,670

時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

※契約額に手数料は含まれておりません。

(通貨関連)

(2025年 5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			契約額等 うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,918,523,224	—	1,904,559,282	△13,963,942
	ドル	1,918,523,224	—	1,904,559,282	△13,963,942
	売建	9,812,523,224	—	9,735,251,256	77,271,968
	ドル	7,894,000,000	—	7,834,266,145	59,733,855
	カナダドル	264,350,000	—	261,733,500	2,616,500
	ユーロ	750,386,000	—	744,660,280	5,725,720
	ポンド	335,450,700	—	331,995,474	3,455,226
	スイスフラン	196,694,400	—	194,880,672	1,813,728
	スウェーデンクローナ	77,922,400	—	77,148,316	774,084
	ノルウェークローネ	14,220,000	—	14,068,400	151,600
	デンマーククローネ	49,305,300	—	48,901,893	403,407
	オーストラリアドル	149,746,600	—	147,707,013	2,039,587
	香港ドル	38,346,700	—	38,041,591	305,109
	シンガポールドル	27,182,400	—	27,015,144	167,256
	イスラエルシェケル	14,918,724	—	14,832,828	85,896
合計		11,731,046,448	—	11,639,810,538	63,308,026

(2026年 5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			契約額等 うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	56,000,000	—	56,237,480	237,480
	ドル	56,000,000	—	56,237,480	237,480
合計		56,000,000	—	56,237,480	237,480

時価の算定方法

為替予約取引

- 1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
- ①計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	34,279,196,579円	18,840,423,181円
期中追加設定元本額	1,500,245,120円	817,399,864円
期中一部解約元本額	16,939,018,518円	1,817,806,435円
期末元本額	18,840,423,181円	17,840,016,610円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式７０）	1,801,152,813円	1,675,672,601円
日立バランスファンド（株式５０）	819,432,002円	691,577,489円
日立バランスファンド（株式３０）	125,183,719円	97,581,415円
日立外国株式特化型ファンド（非課税適格機関投資家専用）	2,616,577,381円	2,102,410,049円
日立外国株式インデックスファンド	13,478,077,266円	13,272,775,056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
（2026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	
ドル	BAKER HUGHES CO	12,061	64.61	779,261.21	
	CHENIERE ENERGY INC	2,600	241.08	626,808.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	2,900	96.70	280,430.00	
	CHEVRON CORP	23,295	186.64	4,347,778.80	
	CONOCOPHILLIPS	15,149	118.97	1,802,276.53	
	DEVON ENERGY CORP	13,770	47.24	650,494.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	2,300	200.26	460,598.00	
	EOG RESOURCES INC	6,600	135.99	897,534.00	
	EQT CORP	7,500	56.57	424,275.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	51,303	152.78	7,838,072.34	
	HALLIBURTON CO	10,352	41.29	427,434.08	
	KINDER MORGAN INC	24,257	33.40	810,183.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	3,651	248.82	908,441.82	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,152	56.84	520,199.68	

ONEOK INC	7,600	91.03	691,828.00	
PHILLIPS 66	4,950	171.51	848,974.50	
SCHLUMBERGER LTD	18,261	55.75	1,018,050.75	
TARGA RESOURCES CORP	2,600	267.48	695,448.00	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	720	388.50	279,720.00	
VALERO ENERGY CORP	3,668	244.77	897,816.36	
WILLIAMS COS INC	14,884	77.69	1,156,337.96	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,690	299.87	806,650.30	
AMCOR PLC	5,680	38.59	219,191.20	
AVERY DENNISON CORP	898	159.11	142,880.78	
BALL CORP	3,052	56.62	172,804.24	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,000	122.97	245,940.00	
COEUR MINING INC	12,600	19.40	244,440.00	
CORTEVA INC	8,275	83.30	689,307.50	
CRH PLC	8,199	107.63	882,458.37	
DOW INC	8,708	38.78	337,696.24	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,168	50.60	261,500.80	
ECOLAB INC	3,100	248.88	771,528.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	17,427	66.14	1,152,621.78	
INTERNATIONAL PAPER CO	6,185	31.60	195,446.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,171	76.09	241,281.39	
LINDE PLC	5,696	511.65	2,914,358.40	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,200	73.27	234,464.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	730	575.23	419,917.90	
NEWMONT CORP	13,353	116.33	1,553,354.49	
NUCOR CORP	2,844	232.85	662,225.40	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,100	220.10	242,110.00	
PPG INDUSTRIES INC	2,756	105.92	291,915.52	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	600	367.84	220,704.00	
RPM INTERNATIONAL INC	1,600	98.39	157,424.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO	2,895	309.18	895,076.10	
SMURFIT WESTROCK PLC	5,773	40.02	231,035.46	
STEEL DYNAMICS INC	1,700	234.68	398,956.00	
VULCAN MATERIALS CO	1,611	275.09	443,169.99	
3M CO	6,476	145.12	939,797.12	
AECOM	1,600	71.00	113,600.00	
AERCAP HOLDINGS NV	2,000	142.07	284,140.00	
ALLEGION PLC	1,000	131.14	131,140.00	
AMETEK INC	2,750	232.14	638,385.00	
AXON ENTERPRISE INC	900	388.19	349,371.00	
BLOOM ENERGY CORP- A	2,700	303.41	819,207.00	
BOEING CO	9,476	229.21	2,171,993.96	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1,400	73.58	103,012.00	

CARLISLE COS INC	520	347.95	180,934.00	
CARRIER GLOBAL CORP	9,335	66.73	622,924.55	
CATERPILLAR INC	5,690	920.22	5,236,051.80	
CNH INDUSTRIAL NV	10,313	10.67	110,039.71	
COMFORT SYSTEMS USA INC	430	2,042.36	878,214.80	
CUMMINS INC	1,680	716.45	1,203,636.00	
CURTISS-WRIGHT CORP	450	750.84	337,878.00	
DEERE & CO	3,132	574.64	1,799,772.48	
DOVER CORP	1,700	214.36	364,412.00	
EATON CORP PLC	4,725	408.10	1,928,272.50	
EMCOR GROUP INC	540	930.03	502,216.20	
EMERSON ELECTRIC CO	6,846	137.88	943,926.48	
FASTENAL CO	13,900	43.98	611,322.00	
FORTIVE CORP	4,008	58.92	236,151.36	
FTAI AVIATION LTD	1,200	258.95	310,740.00	
GE VERNOVA INC	3,301	1,090.53	3,599,839.53	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,776	340.62	945,561.12	
GENERAL ELECTRIC CO	12,835	291.54	3,741,915.90	
GRACO INC	2,100	76.52	160,692.00	
GRAINGER (W W) INC	553	1,284.19	710,157.07	
HEICO CORP	500	297.15	148,575.00	
HEICO CORP-CLASS A	900	222.50	200,250.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	7,769	217.72	1,691,466.68	
HOWMET AEROSPACE INC	4,634	272.37	1,262,162.58	
HUBBELL INC	640	482.03	308,499.20	
IDEX CORP	900	211.40	190,260.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,336	250.77	836,568.72	
INGERSOLL-RAND INC	4,865	71.82	349,404.30	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,900	72.16	137,104.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	7,416	145.03	1,075,542.48	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,260	307.62	695,221.20	
LENNOX INTERNATIONAL INC	390	514.38	200,608.20	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	2,527	520.41	1,315,076.07	
MASCO CORP	2,670	68.26	182,254.20	
NORDSON CORP	600	280.28	168,168.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,660	548.65	910,759.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,817	73.06	351,930.02	
PACCAR INC	6,312	112.60	710,731.20	
PARKER HANNIFIN CORP	1,536	880.43	1,352,340.48	
PENTAIR PLC	1,992	74.88	149,160.96	
QUANTA SERVICES INC	1,800	780.08	1,404,144.00	
ROCKET LAB CORP	5,800	132.55	768,790.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,371	456.54	625,916.34	

RTX CORPORATION	16,296	175.68	2,862,881.28	
SNAP-ON INC	650	366.37	238,140.50	
TEXTRON INC	2,084	91.54	190,769.36	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,721	481.67	1,310,624.07	
TRANSDIGM GROUP INC	684	1,178.82	806,312.88	
UNITED RENTALS INC	770	972.96	749,179.20	
VERTIV HOLDINGS CO	4,400	376.23	1,655,412.00	
WABTEC CORP	2,079	269.43	560,144.97	
WATSCO INC	430	416.08	178,914.40	
XYLEM INC	2,948	109.44	322,629.12	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,945	208.37	1,030,389.65	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,400	143.37	200,718.00	
CINTAS CORP	4,396	165.95	729,516.20	
COPART INC	11,100	32.65	362,415.00	
EQUIFAX INC	1,498	157.72	236,264.56	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,500	112.76	169,140.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,500	125.55	188,325.00	
PAYCHEX INC	3,957	88.83	351,500.31	
REPUBLIC SERVICES INC	2,645	208.68	551,958.60	
ROLLINS INC	3,600	53.42	192,312.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,700	64.87	175,149.00	
TRANSUNION	2,400	66.18	158,832.00	
VERALTO CORP	3,072	85.27	261,949.44	
VERISK ANALYTICS INC	1,660	156.84	260,354.40	
WASTE CONNECTIONS INC	3,126	154.92	484,279.92	
WASTE MANAGEMENT INC	4,935	218.82	1,079,876.70	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,400	159.78	223,692.00	
CSX CORP	22,858	45.92	1,049,639.36	
DELTA AIR LINES INC	2,100	71.55	150,255.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,700	153.61	261,137.00	
FEDEX CORPORATION	2,745	379.98	1,043,045.10	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	28,200	3.57	100,674.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	900	254.66	229,194.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,698	317.64	856,992.72	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,300	198.81	457,263.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	24,000	74.69	1,792,560.00	
UNION PACIFIC CORP	7,224	269.34	1,945,712.16	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,000	96.02	96,020.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,915	98.42	877,414.30	
APTIV PLC	2,700	57.56	155,412.00	
FORD MOTOR COMPANY	47,445	14.48	687,003.60	
GENERAL MOTORS CO	11,300	77.75	878,575.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,800	14.52	142,296.00	

TESLA, INC.	34,400	443.30	15,249,520.00	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,880	94.97	178,543.60	
DR HORTON INC	3,233	139.36	450,550.88	
GARMIN LTD	2,000	234.43	468,860.00	
LENNAR CORP-A	2,500	85.25	213,125.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,280	121.06	154,956.80	
NIKE INC -CL B	14,368	42.02	603,743.36	
NVR INC	34	5,680.61	193,140.74	
PULTE GROUP INC	2,400	113.87	273,288.00	
TAPESTRY INC	2,500	130.24	325,600.00	
AIRBNB INC-CLASS A	5,200	133.67	695,084.00	
BOOKING HOLDINGS INC	9,825	154.48	1,517,766.00	
CARNIVAL CORP LTD	15,603	25.20	393,195.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16,000	32.09	513,440.00	
COMPASS GROUP PLC	20,582	33.31	685,586.42	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,400	194.61	272,454.00	
DOMINO'S PIZZA INC	400	304.01	121,604.00	
DOORDASH INC - A	4,640	153.70	713,168.00	
DRAFTKINGS INC-CL A	5,400	25.15	135,810.00	
EXPEDIA GROUP INC	1,400	217.17	304,038.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,853	316.52	903,031.56	
HYATT HOTELS CORP - CL A	500	169.98	84,990.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	1,738	151.45	263,220.10	
LAS VEGAS SANDS CORP	3,700	50.65	187,405.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	2,789	353.47	985,827.83	
MCDONALD'S CORPORATION	8,665	274.97	2,382,615.05	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,150	265.38	835,947.00	
STARBUCKS CORP	13,816	106.40	1,470,022.40	
YUM! BRANDS INC	3,326	150.63	500,995.38	
ALPHABET INC-CL A	70,830	401.07	28,407,788.10	
ALPHABET INC-CL C	59,220	397.17	23,520,407.40	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,050	148.00	155,400.00	
ECHOSTAR CORP-A	1,700	135.11	229,687.00	
ELECTRONIC ARTS INC	2,912	200.78	584,671.36	
FOX CORP - CLASS A	2,598	65.32	169,701.36	
FOX CORP- CLASS B	1,884	58.60	110,402.40	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	2,600	91.17	237,042.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,000	169.99	339,980.00	
META PLATFORMS INC-A	26,510	618.43	16,394,579.30	
NETFLIX INC	51,628	86.94	4,488,538.32	
NEWS CORP-CLASS A	4,498	26.25	118,072.50	
OMNICOM GROUP	3,840	71.58	274,867.20	
PINTEREST INC- CLASS A	7,400	19.03	140,822.00	

REDDIT INC-CL A	1,200	156.31	187,572.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	7,000	43.72	306,040.00	
SNAP INC - A	13,700	5.36	73,432.00	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	1,900	432.54	821,826.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,200	242.41	533,302.00	
THE WALT DISNEY CO	21,672	105.42	2,284,662.24	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,400	20.41	110,214.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	28,423	27.12	770,831.76	
AMAZON COM INC	117,080	267.22	31,286,117.60	
AUTOZONE INC	203	3,379.52	686,042.56	
BEST BUY COMPANY INC	2,431	56.68	137,789.08	
BURLINGTON STORES INC	760	292.53	222,322.80	
CARVANA CO	8,150	69.53	566,669.50	
DICK'S SPORTING GOODS INC	800	221.46	177,168.00	
EBAY INC	5,636	113.24	638,220.64	
GENUINE PARTS CO	1,710	97.19	166,194.90	
HOME DEPOT INC	12,088	304.35	3,678,982.80	
LOWE'S COMPANIES	6,810	223.61	1,522,784.10	
MERCADOLIBRE INC	556	1,607.37	893,697.72	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10,300	89.68	923,704.00	
ROSS STORES INC	3,900	213.27	831,753.00	
SEA LTD-ADR	4,800	88.33	423,984.00	
TJX COMPANIES INC	13,524	147.35	1,992,761.40	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,400	30.49	195,136.00	
ULTA BEAUTY INC	550	498.28	274,054.00	
WILLIAMS-SONOMA INC	1,500	173.65	260,475.00	
CASEY'S GENERAL STORES INC	450	877.48	394,866.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,399	1,041.25	5,621,708.75	
DOLLAR GENERAL CORP	2,700	105.05	283,635.00	
DOLLAR TREE INC	2,321	89.97	208,820.37	
KROGER CO	7,258	66.79	484,761.82	
SYSCO CORP	5,729	73.05	418,503.45	
TARGET CORP	5,526	123.08	680,140.08	
WALMART INC	53,286	132.46	7,058,263.56	
ALTRIA GROUP INC	20,362	72.41	1,474,412.42	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5,969	81.41	485,936.29	
BUNGE GLOBAL SA	1,700	123.16	209,372.00	
COCA-COLA COMPANY	49,628	80.45	3,992,572.60	
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	2,500	90.83	227,075.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,800	140.61	253,098.00	
GENERAL MILLS INC	6,564	33.13	217,465.32	
HERSHEY CO/THE	1,800	190.32	342,576.00	
HORMEL FOODS CORP	4,000	20.00	80,000.00	

KEURIG DR PEPPER INC	15,600	29.10	453,960.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	10,647	23.31	248,181.57	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,100	46.51	144,181.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	15,742	60.97	959,789.74	
MONSTER BEVERAGE CORP	8,900	85.82	763,798.00	
PEPCICO INC	16,638	148.67	2,473,571.46	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	18,962	191.86	3,638,049.32	
TYSON FOODS INC-CL A	3,600	66.66	239,976.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,000	94.65	283,950.00	
CLOROX COMPANY	1,474	91.17	134,384.58	
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,400	88.84	835,096.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,900	80.83	234,407.00	
KENVUE INC	23,151	17.19	397,965.69	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,038	96.67	390,353.46	
PROCTER & GAMBLE CO	28,436	142.71	4,058,101.56	
ABBOTT LABORATORIES	21,127	84.90	1,793,682.30	
BECTON DICKINSON & CO	3,491	144.47	504,344.77	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,047	53.55	966,416.85	
CARDINAL HEALTH INC	2,914	194.38	566,423.32	
CENCORA, INC.	2,240	261.11	584,886.40	
CENTENE CORP	5,856	58.70	343,747.20	
COOPER COS INC/THE	2,400	60.38	144,912.00	
CVS HEALTH CORPORATION	15,422	97.15	1,498,247.30	
DEXCOM INC	4,900	57.82	283,318.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,100	81.34	577,514.00	
ELEVANCE HEALTH, INC	2,696	396.71	1,069,530.16	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	5,468	62.67	342,679.56	
HCA HEALTHCARE INC	1,940	432.70	839,438.00	
HOLOGIC INC-CVR	2,644	0.00	0.00	
HUMANA INC	1,460	301.35	439,971.00	
IDEXX LABORATORIES INC	980	532.86	522,202.80	
INSULET CORP	850	148.68	126,378.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,310	428.06	1,844,938.60	
LABCORP HOLDINGS INC	1,000	254.02	254,020.00	
MCKESSON CORP	1,512	747.23	1,129,811.76	
MEDTRONIC PLC	15,636	76.97	1,203,502.92	
QUEST DIAGNOSTICS	1,338	187.94	251,463.72	
RESMED INC	1,800	202.46	364,428.00	
SOLVENTUM CORP	1,894	74.42	140,951.48	
STERIS PLC	1,200	215.98	259,176.00	
STRYKER CORP	4,196	305.51	1,281,919.96	
THE CIGNA GROUP	3,223	294.93	950,559.39	
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,994	399.09	4,387,595.46	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	700	170.67	119,469.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,900	156.25	296,875.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,493	82.65	206,046.45	
ABBVIE INC	21,510	210.77	4,533,662.70	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,496	113.26	395,956.96	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,600	293.45	469,520.00	
AMGEN INC	6,525	336.23	2,193,900.75	
BIOGEN INC	1,810	191.37	346,379.70	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24,803	56.77	1,408,066.31	
DANAHER CORP	7,716	164.54	1,269,590.64	
ELI LILLY AND COMPANY	9,778	1,006.70	9,843,512.60	
GILEAD SCIENCES INC	15,100	132.06	1,994,106.00	
ILLUMINA INC	1,900	143.24	272,156.00	
INCYTE CORP	2,000	97.63	195,260.00	
INSMED INC	2,600	115.62	300,612.00	
IQVIA HOLDINGS INC	2,067	170.68	352,795.56	
JOHNSON & JOHNSON	29,269	230.80	6,755,285.20	
MERCK & CO. INC.	30,292	113.41	3,435,415.72	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	248	1,041.91	258,393.68	
NATERA INC	1,600	196.91	315,056.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,200	159.05	190,860.00	
PFIZER INC	69,256	25.75	1,783,342.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,260	712.87	898,216.20	
REVOLUTION MEDICINES INC	2,000	149.47	298,940.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,700	53.40	250,980.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	13,800	35.31	487,278.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,588	448.21	2,056,387.48	
UNITED THERAPEUTICS CORP	520	575.79	299,410.80	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,080	450.41	1,387,262.80	
WATERS CORPORATION	1,186	333.21	395,187.06	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	900	300.19	270,171.00	
ZOETIS INC	5,373	75.48	405,554.04	
BANK OF AMERICA CORP	83,336	49.85	4,154,299.60	
CITIGROUP INC	21,805	124.82	2,721,700.10	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,200	61.18	318,136.00	
FIFTH THIRD BANCORP	10,972	47.70	523,364.40	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	110	1,937.55	213,130.50	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,600	15.51	381,546.00	
JPMORGAN CHASE & CO	33,128	299.91	9,935,418.48	
KEYCORP	11,493	21.08	242,272.44	
M & T BANK CORP	1,844	205.74	379,384.56	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	1,800	95.44	171,792.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,767	213.45	1,017,516.15	

REGIONS FINANCIAL CORP	10,684	26.80	286,331.20	
TRUIST FINANCIAL CORP	15,654	47.13	737,773.02	
US BANCORP	18,994	53.42	1,014,659.48	
WELLS FARGO COMPANY	38,138	73.79	2,814,203.02	
AFFIRM HOLDINGS INC	3,300	67.57	222,981.00	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	6,702	312.77	2,096,184.54	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,144	472.04	540,013.76	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	8,275	21.99	181,967.25	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,257	135.52	712,428.64	
ARES MANAGEMENT CORP - A	2,600	128.53	334,178.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,360	135.98	1,136,792.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	16,750	484.06	8,108,005.00	
BLACKROCK INC	1,794	1,104.03	1,980,629.82	
BLACKSTONE INC	8,900	122.46	1,089,894.00	
BLOCK INC	6,600	71.53	472,098.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,760	185.79	1,441,730.40	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,900	50.04	145,116.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,300	358.67	466,271.00	
CME GROUP INC	4,400	297.70	1,309,880.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,640	212.01	559,706.40	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	3,100	27.66	85,746.00	
CORPAY INC	820	329.17	269,919.40	
EQUITABLE HOLDINGS INC	3,600	42.52	153,072.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	6,466	41.81	270,343.46	
FISERV INC	6,568	53.46	351,125.28	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	700	141.51	99,057.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,925	67.33	196,940.25	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,648	968.96	3,534,766.08	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	5,400	88.28	476,712.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,950	155.72	1,082,254.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	900	134.03	120,627.00	
KKR & CO INC -A	7,600	99.57	756,732.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	990	298.21	295,227.90	
MASTERCARD INC-CLASS A	10,300	489.94	5,046,382.00	
MOODY'S CORP	1,966	432.68	850,648.88	
MORGAN STANLEY	14,470	194.53	2,814,849.10	
MSCI INC	910	569.69	518,417.90	
NASDAQ INC	5,500	90.93	500,115.00	
NORTHERN TRUST CORP	2,321	164.30	381,340.30	
PAYPAL HOLDINGS INC	11,036	45.04	497,061.44	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,350	155.57	365,589.50	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	9,100	80.70	734,370.00	
ROCKET COS INC-CLASS A	11,300	14.28	161,364.00	

S&P GLOBAL INC	3,794	403.92	1,532,472.48	
SCHWAB (CHARLES) CORP	20,504	89.44	1,833,877.76	
SOFI TECHNOLOGIES INC	15,300	16.02	245,106.00	
STATE STREET CORP	3,424	153.76	526,474.24	
SYNCHRONY FINANCIAL	4,311	71.26	307,201.86	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,700	102.41	276,507.00	
TOAST INC-CLASS A	5,600	23.07	129,192.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,400	109.78	153,692.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	20,510	322.52	6,614,885.20	
AFLAC INC	6,138	116.39	714,401.82	
ALLSTATE CORP	3,185	216.45	689,393.25	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	6,525	75.71	494,007.75	
AON PLC	2,495	315.41	786,947.95	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,500	93.46	420,570.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,110	197.68	614,784.80	
BROWN & BROWN INC	3,500	55.78	195,230.00	
CHUBB LTD	4,541	320.09	1,453,528.69	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,940	165.31	320,701.40	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	300	213.31	63,993.00	
EVEREST GROUP, LTD	530	347.99	184,434.70	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,096	47.79	147,957.84	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,432	134.26	460,780.32	
LOEWS CORP	2,196	105.20	231,019.20	
MARKEL GROUP INC.	152	1,846.01	280,593.52	
MARSH & MCLENNAN COS	5,933	160.02	949,398.66	
METLIFE INC	6,826	79.18	540,482.68	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,800	100.77	282,156.00	
PROGRESSIVE CORP	7,136	196.88	1,404,935.68	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,324	103.20	446,236.80	
TRAVELERS COS INC/THE	2,732	298.29	814,928.28	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,203	247.64	297,910.92	
WR BERKLEY CORP	2,975	66.03	196,439.25	
AMERICAN TOWER CORP	5,700	170.50	971,850.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,731	183.54	317,707.74	
CROWN CASTLE INC	5,300	87.31	462,743.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,200	192.84	809,928.00	
EQUINIX INC	1,186	1,079.68	1,280,500.48	
EQUITY RESIDENTIAL	4,300	65.02	279,586.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	800	268.53	214,824.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,600	142.19	369,694.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES	3,300	46.87	154,671.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	8,500	19.56	166,260.00	
INVITATION HOMES INC	7,200	28.48	205,056.00	

IRON MOUNTAIN INCORPORATED	3,606	127.75	460,666.50	
KIMCO REALTY CORP	8,300	23.18	192,394.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,400	127.23	178,122.00	
PROLOGIS INC	11,297	142.66	1,611,630.02	
PUBLIC STORAGE	1,910	303.03	578,787.30	
REALTY INCOME CORP	11,198	61.96	693,828.08	
REGENCY CENTERS CORP	2,100	76.92	161,532.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,300	201.21	261,573.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3,969	202.80	804,913.20	
SUN COMMUNITIES INC	1,500	121.87	182,805.00	
UDR INC	3,700	37.34	138,158.00	
VENTAS INC	5,600	89.96	503,776.00	
VICI PROPERTIES INC	13,100	27.88	365,228.00	
WELLTOWER INC	8,300	217.75	1,807,325.00	
WEYERHAEUSER CO	9,076	23.35	211,924.60	
WP CAREY INC	2,700	73.69	198,963.00	
ACCENTURE PLC-CL A	7,460	163.99	1,223,365.40	
ADOBE INC	5,080	237.01	1,204,010.80	
APPLOVIN CORP-CLASS A	2,810	485.16	1,363,299.60	
ATLASSIAN CORP-CL A	2,000	80.86	161,720.00	
AUTODESK INC	2,600	233.86	608,036.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,330	352.84	1,174,957.20	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,039	120.25	124,939.75	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,800	199.81	759,278.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,000	46.05	276,300.00	
COREWEAVE INC-CL A	2,800	114.21	319,802.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,040	579.95	1,763,048.00	
DATADOG INC - CLASS A	3,700	202.84	750,508.00	
FAIR ISAAC CORP	290	1,076.93	312,309.70	
FORTINET INC	7,700	121.86	938,322.00	
GARTNER INC	920	140.65	129,398.00	
GEN DIGITAL INC	6,300	23.18	146,034.00	
GODADDY INC - CLASS A	1,700	84.97	144,449.00	
HUBSPOT INC	610	183.46	111,910.60	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	11,335	218.37	2,475,223.95	
INTUIT INC	3,386	378.29	1,280,889.94	
IREN LTD	4,000	58.40	233,600.00	
MICROSOFT CORP	85,936	409.43	35,184,776.48	
MICROSTRATEGY INC-CL A	3,140	186.97	587,085.80	
MONDAY.COM LTD	500	69.73	34,865.00	
MONGODB INC	1,000	303.09	303,090.00	
NEBIUS GROUP NV	2,600	221.15	574,990.00	
OKTA INC	2,100	81.05	170,205.00	

ORACLE CORPORATION	20,976	195.61	4,103,115.36
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,800	133.73	3,717,694.00
PALO ALTO NETWORKS INC	9,820	238.21	2,339,222.20
PTC INC	1,500	139.85	209,775.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,310	317.95	416,514.50
SALESFORCE INC	11,362	167.58	1,904,043.96
SAMSARA INC-CL A	4,200	27.99	117,558.00
SERVICENOW INC	12,650	90.50	1,144,825.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,900	150.76	587,964.00
SYNOPSYS INC	2,320	510.02	1,183,246.40
TRIMBLE INCORPORATED	2,900	55.76	161,704.00
TWILIO INC - A	1,900	198.04	376,276.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	530	299.08	158,512.40
VERISIGN INC	1,026	292.95	300,566.70
WORKDAY INC-CLASS A	2,600	118.75	308,750.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,100	98.23	304,513.00
ZSCALER INC	1,230	153.70	189,051.00
AMPHENOL CORP-CL A	14,900	129.19	1,924,931.00
APPLE INC	178,860	298.21	53,337,840.60
ARISTA NETWORKS INC	13,000	147.81	1,921,530.00
CDW CORP/DE	1,600	102.16	163,456.00
CIENA CORP	1,700	591.57	1,005,669.00
CISCO SYSTEMS INC	48,039	115.53	5,549,945.67
COHERENT CORP	1,900	404.94	769,386.00
CORNING INC	9,860	208.28	2,053,640.80
DELL TECHNOLOGIES -C	3,932	247.89	974,703.48
F5 INC	700	364.59	255,213.00
FLEX LTD	4,500	143.60	646,200.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	16,367	34.13	558,605.71
HP INC	11,667	20.77	242,323.59
IONQ INC	3,500	57.47	201,145.00
JABIL INC	1,300	354.34	460,642.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,100	361.55	759,255.00
LUMENTUM HOLDINGS INC	860	1,001.81	861,556.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,035	399.33	812,636.55
NETAPP INC	2,498	119.93	299,585.14
PURE STORAGE INC - CLASS A	3,800	83.80	318,440.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,650	804.76	2,132,614.00
SUPER MICRO COMPUTER INC	6,400	33.03	211,392.00
TE CONNECTIVITY PLC	3,587	206.69	741,397.03
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	580	638.56	370,364.80
WESTERN DIGITAL CORP	4,174	489.15	2,041,712.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	640	258.10	165,184.00

AST SPACEMOBILE INC	2,700	83.01	224,127.00	
AT&T INC	86,263	24.65	2,126,382.95	
COMCAST CORP-CL A	44,150	25.17	1,111,255.50	
T-MOBILE US INC	6,088	188.19	1,145,700.72	
VERIZON COMMUNICATIONS	51,425	47.06	2,420,060.50	
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	72.45	231,840.00	
AMEREN CORPORATION	3,272	109.60	358,611.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,477	128.60	832,942.20	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,400	125.98	302,352.00	
ATMOS ENERGY CORP	1,900	180.87	343,653.00	
CENTRPOINT ENERGY INC	8,100	42.54	344,574.00	
CMS ENERGY CORP	3,700	73.26	271,062.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	4,338	107.13	464,729.94	
CONSTELLATION ENERGY	3,737	275.26	1,028,646.62	
DOMINION ENERGY INC	10,332	62.97	650,606.04	
DTE ENERGY COMPANY	2,527	143.80	363,382.60	
DUKE ENERGY CORP	9,459	124.31	1,175,848.29	
EDISON INTERNATIONAL	4,779	70.73	338,018.67	
ENTERGY CORP	5,438	112.90	613,950.20	
EVERGY INC	2,800	82.73	231,644.00	
EVERSOURCE ENERGY	4,436	68.81	305,241.16	
EXELON CORPORATION	12,231	44.40	543,056.40	
FIRSTENERGY CORP	6,793	44.50	302,288.50	
NEXTERA ENERGY INC	25,076	95.68	2,399,271.68	
NISOURCE INC	5,900	47.42	279,778.00	
NRG ENERGY INC	2,500	134.72	336,800.00	
OKLO INC	1,300	67.21	87,373.00	
P G & E CORP	26,500	16.81	445,465.00	
PPL CORPORATION	8,928	35.78	319,443.84	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,066	77.75	471,631.50	
SEMPRA	7,930	92.86	736,379.80	
SOUTHERN CO	13,423	93.68	1,257,466.64	
VISTRA CORP	4,100	141.90	581,790.00	
WEC ENERGY GROUP INC	3,917	111.64	437,293.88	
XCEL ENERGY INC	7,200	80.03	576,216.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	19,819	449.70	8,912,604.30	
ANALOG DEVICES	5,946	426.79	2,537,693.34	
APPLIED MATERIALS INC	9,652	440.56	4,252,285.12	
ASTERA LABS INC	1,600	228.64	365,824.00	
BROADCOM INC	54,810	439.79	24,104,889.90	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	1,900	184.54	350,626.00	
ENTEGRIS INC	1,800	139.26	250,668.00	
FIRST SOLAR INC	1,200	231.62	277,944.00	

小計	INTEL CORP	54,857	115.93	6,359,572.01	
	KLA CORPORATION	1,601	1,892.94	3,030,596.94	
	LAM RESEARCH CORP	15,300	299.15	4,576,995.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	10,300	182.58	1,880,574.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,700	97.04	650,168.00	
	MICRON TECHNOLOGY	13,697	776.01	10,629,008.97	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	590	1,613.97	952,242.30	
	NVIDIA CORP	295,700	235.74	69,708,318.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,065	294.17	901,631.05	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	4,900	118.37	580,013.00	
	QNTITY ELECTRONICS INC	2,584	164.12	424,086.08	
	QUALCOMM INC	12,936	200.08	2,588,234.88	
	TERADYNE INC	1,900	356.55	677,445.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	11,009	308.17	3,392,643.53	
	CBRE GROUP INC - A	3,600	132.45	476,820.00	
	COSTAR GROUP INC	5,200	31.85	165,620.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	12,600	8.24	103,824.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	2,100	37.37	78,477.00	
	銘柄数：548			795,930,989.98	
				(126,202,817,771)	
	組入時価比率：75.9%			77.2%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	7,200	30.87	222,264.00	
	CAMECO CORP	5,306	154.29	818,662.74	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	25,428	65.30	1,660,448.40	
	CENOVUS ENERGY INC	16,866	41.35	697,409.10	
	ENBRIDGE INC	26,468	77.08	2,040,153.44	
	IMPERIAL OIL LTD	2,112	181.62	383,581.44	
	KEYERA CORP	3,000	55.11	165,330.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,169	66.72	478,315.68	
	SUNCOR ENERGY INC	14,659	91.69	1,344,083.71	
	TC ENERGY CORP	12,579	93.59	1,177,268.61	
	TOURMALINE OIL CORP	4,600	66.35	305,210.00	
	WHITECAP RESOURCES INC	14,400	16.19	233,136.00	
	AGNCIO EAGLE MINES LTD	6,142	264.27	1,623,146.34	
	ALAMOS GOLD INC-CLASS A	5,300	59.63	316,039.00	
	BARRICK MINING CORP	20,633	59.25	1,222,505.25	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,800	87.12	156,816.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	8,467	37.00	313,279.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,300	326.68	751,364.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	8,900	12.53	111,517.00	
	KINROSS GOLD CORP	14,669	42.41	622,112.29	
	LUNDIN GOLD INC	1,400	94.45	132,230.00	
	LUNDIN MINING CORP	8,200	41.37	339,234.00	

NUTRIEN LTD	5,871	97.34	571,483.14	
PAN AMERICAN SILVER CORP	5,100	83.92	427,992.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,575	89.81	500,690.75	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,529	191.05	1,056,315.45	
ATKINSREALIS GROUP INC	2,000	85.48	170,960.00	
BOMBARDIER INC-B	1,100	268.17	294,987.00	
CAE INC	3,606	35.52	128,085.12	
STANTEC INC	1,400	99.91	139,874.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,000	225.53	225,530.00	
WSP GLOBAL INC	1,600	190.99	305,584.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	4,700	27.45	129,015.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,900	51.02	147,958.00	
RB GLOBAL INC	2,300	139.76	321,448.00	
THOMSON REUTERS CORP	1,938	108.61	210,486.18	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,440	154.50	994,980.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	10,940	119.28	1,304,923.20	
TFI INTERNATIONAL INC	900	195.90	176,310.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,260	86.95	283,457.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,100	78.40	164,640.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIO	3,927	104.90	411,942.30	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	605	174.95	105,844.75	
DOLLARAMA INC	3,300	172.84	570,372.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	9,000	79.32	713,880.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,400	46.79	65,506.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,300	60.92	444,716.00	
METRO INC	2,546	88.79	226,059.34	
WESTON (GEORGE) LTD	2,011	95.71	192,472.81	
SAPUTO INC	2,900	39.97	115,913.00	
BANK OF MONTREAL	8,653	209.98	1,816,956.94	
BANK OF NOVA SCOTIA	15,147	106.18	1,608,308.46	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,300	153.67	1,736,471.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,716	205.76	970,364.16	
ROYAL BANK OF CANADA	16,986	252.43	4,287,775.98	
TORONTO-DOMINION BANK	20,647	148.60	3,068,144.20	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	4,915	67.85	333,482.75	
BROOKFIELD CORP	24,890	65.29	1,625,068.10	
IGM FINANCIAL INC	1,046	78.33	81,933.18	
TMX GROUP LTD	3,400	54.05	183,770.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	251	2,194.47	550,811.97	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,318	77.31	256,514.58	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	170.90	187,990.00	
INTACT FINANCIAL CORP	2,100	257.52	540,792.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	20,342	51.50	1,047,613.00	

小計	POWER CORP OF CANADA	6,724	80.72	542,761.28	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	6,813	98.30	669,717.90	
	CGI INC	2,318	85.44	198,049.92	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	244	2,533.15	618,088.60	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,100	92.39	101,629.00	
	OPEN TEXT CORP	3,100	30.70	95,170.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	14,800	133.69	1,978,612.00	
	CELESTICA INC	1,400	523.95	733,530.00	
	BCE INC	982	33.20	32,602.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	4,364	49.02	213,923.28	
	TELUS CORP	6,585	17.00	111,945.00	
	ALTAGAS LTD	3,500	52.82	184,870.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	1,750	50.21	87,867.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	1,800	48.80	87,840.00	
	EMERA INC	3,800	71.80	272,840.00	
	FORTIS INC	6,155	77.41	476,458.55	
	HYDRO ONE LTD	4,000	58.51	234,040.00	
	FIRSTSERVICE CORP	500	178.04	89,020.00	
	銘柄数：83			50,540,492.79	
				(5,832,372,867)	
	組入時価比率：3.5%			3.6%	
ユーロ	BOLLORE SE	9,413	5.25	49,465.31	
	ENI SPA	25,229	23.58	594,899.82	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	5,011	19.35	96,962.85	
	NESTE OYJ	4,949	28.52	141,145.48	
	OMV AG	1,754	61.70	108,221.80	
	REPSOL SA	13,567	22.33	302,951.11	
	TENARIS SA	4,423	26.94	119,155.62	
	TOTALENERGIES SE	24,089	78.28	1,885,686.92	
	AIR LIQUIDE	7,038	178.96	1,259,520.48	
	AKZO NOBEL	2,015	49.85	100,447.75	
	ARCELORMITTAL	5,159	55.00	283,745.00	
	BASF SE	10,803	53.39	576,772.17	
	BUZZI SPA	888	46.79	41,549.52	
	DSM-FIRMENICH AG	2,065	67.80	140,007.00	
	ENSO OY-R SHS	6,691	9.59	64,206.83	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,384	17.78	60,167.52	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	1,614	182.05	293,828.70	
	SYENSQO SA	830	58.80	48,804.00	
	SYMRISE AG	1,632	74.34	121,322.88	
	UPM-KYMMENE OYJ	6,560	25.34	166,230.40	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,124	137.10	291,200.40	
	AIRBUS SE	7,235	172.74	1,249,773.90	

ALSTOM	4,135	17.77	73,478.95	
BOUYGUES SA	2,270	51.72	117,404.40	
BRENTAG SE	1,488	61.64	91,720.32	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	5,437	76.60	416,474.20	
CSG NV	2,430	16.20	39,366.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	5,870	40.74	239,143.80	
DASSAULT AVIATION SA	229	284.20	65,081.80	
EIFFAGE	834	132.75	110,713.50	
FERROVIAL SE	6,194	58.80	364,207.20	
GEA GROUP AG	1,765	54.30	95,839.50	
HENSOLDT AG	745	75.60	56,322.00	
HOCHTIEF AG	180	530.00	95,400.00	
KINGSPAN GROUP PLC	1,871	76.15	142,476.65	
KNORR-BREMSE AG	852	104.20	88,778.40	
KONE OYJ	4,199	49.83	209,236.17	
LEGRAND SA	3,174	154.70	491,017.80	
LEONARDO SPA	4,999	49.85	249,225.14	
METSO CORPORATION	8,208	15.10	123,940.80	
MTU AERO ENGINES AG	665	287.60	191,254.00	
PRYSMIAN SPA	3,393	156.35	530,495.55	
RATIONAL AG	68	651.00	44,268.00	
REXEL SA	2,601	38.07	99,020.07	
RHEINMETALL AG	558	1,143.20	637,905.60	
SAFRAN SA	4,323	283.20	1,224,273.60	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,678	270.95	1,809,404.10	
SIEMENS AG	9,226	273.70	2,525,156.20	
SIEMENS ENERGY AG	9,395	177.00	1,662,915.00	
THALES SA	1,116	223.00	248,868.00	
VINCI SA	6,003	127.45	765,082.35	
WARTSILA OYJ	6,125	36.20	221,725.00	
BUREAU VERITAS SA	3,814	26.56	101,299.84	
RANDSTAD NV	1,433	24.42	34,993.86	
VERISURE PLC	3,310	11.84	39,190.40	
WOLTERS KLUWER	2,800	58.36	163,408.00	
ADP	457	107.80	49,264.60	
AENA SME SA	9,192	23.42	215,276.64	
AYVENS SA	4,143	11.46	47,478.78	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	7,899	8.00	63,192.00	
DHL GROUP	11,618	48.06	558,361.08	
GETLINK SE	3,521	18.57	65,384.97	
INPOST SA	2,640	15.25	40,260.00	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	13,798	4.44	61,318.31	
RYANAIR HOLDINGS PLC	10,202	22.46	229,136.92	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,453	78.18	269,955.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	650	76.65	49,822.50	
CONTINENTAL AG	1,281	68.74	88,055.94	
DR ING HC F PORSCHE AG	1,503	47.00	70,641.00	
FERRARI NV	1,527	287.00	438,249.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	8,745	50.97	445,732.65	
MICHELIN (CGDE)	8,304	31.74	263,568.96	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE(PFD)	1,794	32.14	57,659.16	
RENAULT SA	2,267	28.31	64,178.77	
STELLANTIS NV	24,195	6.70	162,154.89	
VOLKSWAGEN AG PFD	2,551	88.58	225,967.58	
ADIDAS AG	2,063	146.80	302,848.40	
HERMES INTERNATIONAL	385	1,593.50	613,497.50	
KERING	916	244.35	223,824.60	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,046	460.85	1,403,749.10	
MONCLER SPA	2,871	50.92	146,191.32	
ACCOR SA	2,354	44.53	104,823.62	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	5,438	51.26	278,751.88	
DELIVERY HERO SE	2,440	28.25	68,930.00	
SODEXO	1,168	47.36	55,316.48	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	824	55.90	46,061.60	
PUBLICIS GROUPE	2,833	77.62	219,897.46	
SCOUT24 SE	900	75.00	67,500.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	13,257	20.03	265,537.71	
D'IETEREN GROUP	284	174.60	49,586.40	
INDITEX	13,235	49.26	651,956.10	
PROSUS NV	15,908	38.72	615,957.76	
ZALANDO SE	2,961	19.45	57,606.25	
CARREFOUR SA	7,160	17.18	123,044.60	
JERONIMO MARTINS	3,330	18.34	61,072.20	
KESKO OYJ-B SHS	3,606	20.34	73,346.04	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	10,970	36.51	400,514.70	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	11,991	69.68	835,532.88	
DANONE	7,850	61.86	485,601.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	8,127	5.42	44,080.84	
HEINEKEN HOLDING NV	1,514	60.05	90,915.70	
HEINEKEN NV	3,567	64.82	231,212.94	
KERRY GROUP PLC-A	2,089	72.60	151,661.40	
LOTUS BAKERIES	5	10,760.00	53,800.00	
PERNOD-RICARD SA	2,496	61.16	152,655.36	
BEIERSDORF AG	1,217	70.22	85,457.74	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,945	63.88	124,246.60	
HENKEL AG + CO KGAA	1,206	60.10	72,480.60	

L OREAL	2,924	358.90	1,049,423.60	
BIOMERIEUX	481	72.45	34,848.45	
ESSILORLUXOTTICA	3,663	173.20	634,431.60	
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,711	36.99	100,279.89	
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,217	39.07	203,828.19	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,434	22.06	208,114.04	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,048	34.11	138,077.28	
ARGENX SE	750	694.20	520,650.00	
BAYER AG	11,849	38.18	452,394.82	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,418	59.40	84,229.20	
FINANCIERE DE TUBIZE	231	202.40	46,754.40	
GRIFOLS SA	3,938	9.17	36,135.08	
IPSEN	440	165.80	72,952.00	
MERCK KGAA	1,594	119.85	191,040.90	
ORION OYJ	1,263	67.35	85,063.05	
QIAGEN N.V.	2,475	28.59	70,760.25	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,380	51.80	71,484.00	
SANOFI	13,444	73.24	984,638.56	
SARTORIUS AG-VORZUG	308	213.50	65,758.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	342	163.10	55,780.20	
UCB SA	1,526	240.30	366,697.80	
ABN AMRO BANK NV-CVA	7,114	32.89	233,979.46	
AIB GROUP PLC	25,771	9.67	249,205.57	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	24,606	9.46	232,895.79	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	69,568	18.96	1,319,357.12	
BANCO BPM SPA	13,835	13.33	184,420.55	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	88,747	0.93	83,333.43	
BANCO DE SABADELL SA	61,456	3.32	204,033.92	
BANCO SANTANDER SA	178,942	10.24	1,833,439.73	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,436	16.85	192,753.78	
BANKINTER SA	8,597	13.83	118,939.49	
BAWAG GROUP AG	949	148.10	140,546.90	
BNP PARIBAS	12,178	92.03	1,120,741.34	
BPER BANCA SPA	18,370	12.68	232,931.60	
CAIXABANK S.A	47,126	10.97	517,207.85	
COMMERZBANK AG	8,833	36.44	321,874.52	
CREDIT AGRICOLE	13,146	17.17	225,716.82	
ERSTE GROUP BANK AG	3,710	97.10	360,241.00	
FINECOBANK SPA	7,483	21.63	161,857.29	
ING GROEP NV-CVA	35,477	25.94	920,450.76	
INTESA SANPAOLO	169,836	5.82	989,464.53	
KBC GROEP NV	2,838	113.80	322,964.40	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,523	47.26	71,976.98	

SOCIETE GENERAL-A	8,544	67.46	576,378.24	
UNICREDIT SPA	17,051	72.35	1,233,639.85	
ADYEN NV	305	898.00	273,890.00	
AMUNDI SA	811	85.85	69,624.35	
BANCA MEDIOLANUM SPA	2,809	19.76	55,505.84	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	2,811	13.17	37,020.87	
DEUTSCHE BANK AG -REG	22,465	27.23	611,834.27	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,280	243.20	554,496.00	
EURONEXT NV	958	140.80	134,886.40	
EXOR NV	1,072	66.70	71,502.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	944	77.45	73,112.80	
POSTE ITALIANE SPA	5,439	24.38	132,602.82	
SOFINA	217	218.40	47,392.80	
AEGON LTD	15,911	7.25	115,450.21	
AGEAS	1,814	68.65	124,531.10	
ALLIANZ SE-REG	4,626	379.90	1,757,417.40	
ASR NEDERLAND NV	1,884	67.80	127,735.20	
ASSICURAZIONI GENERALI	10,283	39.19	402,990.77	
AXA SA	20,311	39.48	801,878.28	
HANNOVER RUECK SE	744	236.00	175,584.00	
MAPFRE SA	10,607	4.21	44,676.68	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,588	468.10	743,342.80	
NN GROUP NV	3,177	76.22	242,150.94	
SAMPO OYJ-A SHS	29,981	8.84	265,032.04	
TALANX AG	750	104.40	78,300.00	
UNIPOL GRUPPO SPA	4,310	22.33	96,242.30	
COVIVIO	737	54.20	39,945.40	
GECINA SA	607	71.85	43,612.95	
KLEPIERRE	2,570	34.20	87,894.00	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,453	101.50	147,479.50	
CAPGEMINI	1,855	96.70	179,378.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	8,289	19.61	162,588.73	
INDRA SISTEMAS SA	998	50.72	50,618.56	
NEMETSCHEK SE	762	58.75	44,767.50	
SAP SE	12,678	140.80	1,785,062.40	
NOKIA OYJ	63,503	11.92	756,955.76	
CELLNEX TELECOM SA	6,031	28.75	173,391.25	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	44,616	27.81	1,240,770.96	
ELISA OYJ	1,687	40.72	68,694.64	
KONINKLIJKE KPN NV	47,911	4.58	219,671.93	
ORANGE S.A.	22,455	18.53	416,203.42	
TELECOM ITALIA SPA	131,543	0.70	93,290.29	
TELECOM ITALIA-RSP	75,551	0.82	62,102.92	

小計	TELEFONICA SA	44,087	4.03	178,023.30	
	ACCIONA SA	326	260.80	85,020.80	
	E.ON SE	27,159	18.42	500,268.78	
	EDP RENOVAVEIS SA	4,163	14.16	58,948.08	
	EDP RENOVAVEIS-BONUS RIGHTS	4,163	0.12	524.12	
	ELIA GROUP SA/NV	504	134.90	67,989.60	
	ENDESA SA	3,811	36.55	139,292.05	
	ENEL SPA	98,829	9.71	960,321.39	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	38,376	4.40	168,854.40	
	ENGIE	22,096	27.34	604,104.64	
	FORTUM OYJ	5,333	20.24	107,939.92	
	IBERDROLA SA	78,318	19.57	1,532,683.26	
	ITALGAS SPA	7,568	10.36	78,404.48	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,946	27.44	80,838.24	
	REDEIA CORPORACION SA	4,703	14.49	68,146.47	
	RWE AG	7,626	56.42	430,258.92	
	SNAM SPA	24,071	6.33	152,561.99	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	17,253	9.93	171,391.30	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,547	34.66	261,579.02	
	VERBUND AG	899	61.55	55,333.45	
	ASM INTERNATIONAL NV	580	899.80	521,884.00	
	ASML HOLDING NV	4,723	1,367.00	6,456,341.00	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	876	266.70	233,629.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,825	68.07	1,077,207.75	
	STMICROELECTRONICS NV	8,342	55.16	460,144.72	
	LEG IMMOBILIEN SE	983	57.30	56,325.90	
	VONOVIA SE	9,028	22.20	200,421.60	
	銘柄数：221			77,628,229.32	
				(14,341,815,366)	
	組入時価比率：8.6%			8.8%	
ポンド	BP PLC	190,741	5.40	1,031,336.58	
	SHELL PLC-NEW	69,318	31.48	2,182,477.23	
	ANGLO AMERICAN PLC	13,541	40.63	550,170.83	
	ANTOFAGASTA PLC	4,755	42.67	202,895.85	
	ENDEAVOUR MINING PLC	2,278	48.81	111,189.18	
	FRESNILLO PLC	2,552	37.07	94,602.64	
	GLENCORE PLC	121,569	5.95	724,429.67	
	RIO TINTO PLC - REG	13,714	81.54	1,118,239.56	
	SMURFIT WESTROCK PLC	720	30.07	21,650.40	
	BAE SYSTEMS PLC	36,586	19.23	703,548.78	
	BUNZL PLC	4,039	23.50	94,916.50	
	FERGUSON ENTERPRISES INC/DE	2,357	172.80	407,289.60	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	15,565	4.87	75,817.11	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	102,091	11.97	1,222,233.45	
SMITHS GROUP PLC	3,809	25.38	96,672.42	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	972	71.45	69,449.40	
SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	5,140	58.74	301,923.60	
EXPERIAN PLC	11,117	25.64	285,039.88	
INTERTEK GROUP PLC	1,890	56.75	107,257.50	
RELX PLC	22,300	23.65	527,395.00	
RENTOKIL INITIAL PLC	30,537	4.75	145,325.58	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	15,985	2.50	40,042.42	
NEW WHITBREAD PLC	2,017	23.40	47,197.80	
ENTAIN PLC	7,185	5.30	38,137.98	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,035	69.50	141,432.50	
PEARSON PLC	6,999	11.04	77,303.95	
AUTO TRADER GROUP PLC	10,975	4.92	54,018.95	
INFORMA PLC	16,333	8.02	130,990.66	
JD SPORTS FASHION PLC	34,213	0.70	24,038.05	
KINGFISHER PLC	20,658	2.85	58,916.61	
NEXT PLC	1,450	126.30	183,135.00	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	24,218	3.20	77,618.69	
SAINSBURY (J) PLC	21,836	3.06	66,992.84	
TESCO PLC	78,525	4.50	353,912.17	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,982	18.01	71,715.82	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,515	49.62	1,315,674.30	
COCA-COLA HBC AG-CDI	2,652	41.72	110,641.44	
DIAGEO PLC	26,963	15.00	404,445.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	9,234	28.66	264,646.44	
MAGNUM ICE CREAM CO BV/THE	5,971	11.26	67,233.46	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,901	45.46	359,179.46	
UNILEVER PLC	26,537	42.23	1,120,790.19	
SMITH & NEPHEW PLC	10,162	11.04	112,188.48	
ASTRAZENECA PLC	18,828	137.40	2,586,967.20	
GSK PLC	49,656	18.72	929,808.60	
HALEON PLC	108,647	3.29	357,557.27	
BARCLAYS PLC	169,170	4.34	735,381.99	
HSBC HOLDINGS PLC	209,000	13.50	2,821,500.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	717,166	0.96	692,782.35	
NATWEST GROUP PLC	98,268	5.70	560,520.67	
STANDARD CHARTERED PLC	23,517	19.12	449,645.04	
3I GROUP PLC	11,803	21.12	249,279.36	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	5,654	92.12	520,846.48	
M&G PLC	27,406	3.08	84,574.91	
SCHRODERS PLC	8,165	5.83	47,601.95	
WISE GROUP PLC-CL A	7,868	10.01	78,758.68	

小計	ADMIRAL GROUP PLC	3,152	32.94	103,826.88	
	AVIVA PLC	36,784	6.28	231,003.52	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,361	2.63	180,336.31	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	9,256	7.65	70,854.68	
	PRUDENTIAL PLC	30,942	11.68	361,402.56	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	9,342	5.83	54,510.57	
	SEGRO PLC	15,193	7.03	106,806.79	
	SAGE GROUP PLC (THE)	11,516	8.55	98,461.80	
	HALMA PLC	4,666	46.94	219,022.04	
	AIRTEL AFRICA PLC	10,699	3.68	39,393.71	
	BT GROUP PLC	74,692	2.34	175,152.74	
	VODAFONE GROUP PLC	227,003	1.16	263,323.48	
	NEW SEVERN TRENT PLC	3,176	31.34	99,535.84	
	CENTRICA PLC	56,114	2.02	113,462.50	
	NATIONAL GRID PLC	60,392	12.90	779,358.76	
	SSE PLC	14,654	24.59	360,341.86	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,026	13.83	110,999.58	
	銘柄数：73			28,677,131.09	
				(6,083,853,360)	
	組入時価比率：3.7%			3.7%	
スイスフラン	AMRIZE LTD	6,139	40.00	245,560.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	93	666.50	61,984.50	
	GIVAUDAN-REG	112	2,683.00	300,496.00	
	HOLCIM LTD	6,169	76.26	470,447.94	
	SIKA AG-REG	1,838	140.95	259,066.10	
	ABB LTD	19,071	82.86	1,580,223.06	
	BELIMO HOLDING AG-REG	119	788.50	93,831.50	
	GEBERIT AG-REG	414	503.40	208,407.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	273	251.00	68,523.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	500	262.60	131,300.00	
	VAT GROUP AG	319	592.60	189,039.40	
	SGS SA-REG	2,120	84.68	179,521.60	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	566	174.40	98,710.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-RE	6,540	156.55	1,023,837.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	382	201.90	77,125.80	
	AVOLTA AG	1,016	44.04	44,744.64	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	47	1,192.00	56,024.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	9,240.00	129,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	95,900.00	95,900.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	31,379	76.88	2,412,417.52	
	ALCON INC	6,037	49.61	299,495.57	
	SONOVA HOLDING AG-REG	624	174.50	108,888.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,372	83.54	114,616.88	

小計	GALDERMA GROUP AG	2,244	158.35	355,337.40	
	LONZA AG-REG	851	474.20	403,544.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	23,152	116.80	2,704,153.60	
	ROCHE HOLDING AG	8,555	320.00	2,737,600.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	377	328.20	123,731.40	
	SANDOZ GROUP AG	5,134	67.76	347,879.84	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	398	114.40	45,531.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,504	67.94	170,121.76	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	273	883.60	241,222.80	
	UBS GROUP AG	38,633	36.22	1,399,287.26	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	976	212.20	207,107.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	344	837.60	288,134.40	
	SWISS RE AG	3,622	119.45	432,647.90	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,780	563.00	1,002,140.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,865	81.20	151,438.00	
	SWISSCOM AG-REG	319	678.00	216,282.00	
	BKW AG	279	149.20	41,626.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,021	129.20	131,913.20	
	銘柄数：41			19,249,219.47	
				(3,887,187,379)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	3,486	545.60	1,901,961.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,006	305.00	306,830.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	7,060	99.58	703,034.80	
	ADDTECH AB-B SHARES	3,161	325.60	1,029,221.60	
	ALFA LAVAL AB	3,542	541.00	1,916,222.00	
	ASSA ABLOY AB-B	12,113	339.50	4,112,363.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	32,522	174.45	5,673,462.90	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,307	154.20	2,977,139.40	
	BEIJER REF AB	4,764	123.80	589,783.20	
	EPIROC AB-A	8,101	272.60	2,208,332.60	
	EPIROC AB-B	4,519	234.80	1,061,061.20	
	INDUTRADE AB	3,164	192.20	608,120.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,955	193.60	378,488.00	
	LIFCO AB-B SHS	2,836	278.60	790,109.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	20,007	41.62	832,691.34	
	SAAB AB-B	3,934	491.60	1,933,954.40	
	SANDVIK AB	13,196	360.30	4,754,518.80	
	SKANSKA AB-B SHS	3,985	248.70	991,069.50	
	SKF AB-B SHARES	3,983	234.20	932,818.60	
	TRELLEBORG AB-B SHS	2,403	392.00	941,976.00	
	VOLVO AB-B SHS	19,226	318.00	6,113,868.00	
	SECURITAS AB-B SHS	5,687	151.50	861,580.50	

小計	EVOLUTION AB	1,574	640.20	1,007,674.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	5,848	157.20	919,305.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,520	246.90	1,856,688.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	2,254	438.60	988,604.40	
	NORDEA BANK ABP	37,851	167.90	6,355,182.90	
	NORION BANK AB	672	51.60	34,675.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,619	177.80	3,310,458.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,999	128.95	2,320,971.05	
	SWEDBANK AB-A SHARES	10,496	319.70	3,355,571.20	
	EQT AB	5,922	305.40	1,808,578.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,335	485.00	647,475.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,846	478.90	884,049.40	
	INVESTOR AB-B SHS	22,057	365.50	8,061,833.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,003	517.50	519,052.50	
	ERICSSON LM-B SHS	34,375	118.00	4,056,250.00	
	HEXAGON AB-B SHS	25,658	95.28	2,444,694.24	
	TELE2 AB -B SHS	6,386	181.70	1,160,336.20	
	TELIA COMPANY AB	28,595	49.36	1,411,449.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	8,750	53.32	466,550.00	
	SAGAX AB-B	2,901	174.30	505,644.30	
	銘柄数：42			83,733,652.83	
				(1,411,749,386)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	3,674	338.10	1,242,179.40	
	EQUINOR ASA	9,374	347.60	3,258,402.40	
	NORSK HYDRO ASA	16,997	106.80	1,815,279.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,935	526.00	1,017,810.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,395	292.30	1,576,958.50	
	MOWI ASA	5,640	192.50	1,085,700.00	
	ORKLA ASA	8,333	109.30	910,796.90	
	SALMAR ASA	872	546.00	476,112.00	
	DNB BANK ASA	10,642	276.30	2,940,384.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,640	248.60	656,304.00	
	TELENOR ASA	7,475	157.50	1,177,312.50	
	銘柄数：11			16,157,239.90	
				(276,127,229)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,359	378.20	1,648,573.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,230	193.00	237,390.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,423	190.90	2,371,550.70	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	34	14,420.00	490,280.00	
	A.P.MOLLER MAERSK	47	14,695.00	690,665.00	

小計	DSV A/S	2,474	1,591.50	3,937,371.00	
	PANDORA A/S	1,006	516.20	519,297.20	
	CARLSBERG AS-B	1,171	830.60	972,632.60	
	COLOPLAST-B	1,524	399.30	608,533.20	
	DEMANT A/S	951	235.80	224,245.80	
	GENMAB A/S	728	1,684.00	1,225,952.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	39,229	299.20	11,737,316.80	
	DANSKE BANK A/S	8,218	322.60	2,651,126.80	
	TRYG A/S	3,915	150.40	588,816.00	
	ORSTED A/S	6,342	162.55	1,030,892.10	
	銘柄数：15			28,934,643.00	
				(715,264,374)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
オーストラリア ドル	SANTOS LIMITED	39,812	7.67	305,358.04	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	23,515	30.62	720,029.30	
	BHP GROUP LIMITED	61,808	62.06	3,835,804.48	
	EVOLUTION MINING LTD	24,903	13.23	329,466.69	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	20,872	22.99	479,847.28	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	10,702	17.95	192,100.90	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	16,727	21.13	353,441.51	
	RIO TINTO LIMITED	4,477	191.97	859,449.69	
	SOUTH32 LTD	53,686	4.44	238,365.84	
	SGH LTD	2,339	39.61	92,647.79	
	BRAMBLES LTD	16,375	21.82	357,302.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	6,465	30.04	194,208.60	
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,626	8.59	74,097.34	
	TRANSURBAN GROUP	38,487	14.60	561,910.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,679	51.39	343,233.81	
	LOTTERY CORP LTD/THE	25,881	5.27	136,392.87	
	CAR GROUP LTD	4,730	26.17	123,784.10	
	REA GROUP LTD	612	161.24	98,678.88	
	WESFARMERS LTD	13,776	71.73	988,152.48	
	COLES GROUP LTD	16,541	20.66	341,737.06	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	15,131	32.54	492,362.74	
	COCHLEAR LIMITED	792	95.42	75,572.64	
	PRO MEDICUS LTD	693	121.60	84,268.80	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	64,144	2.86	183,451.84	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	6,025	18.51	111,522.75	
	CSL LIMITED	5,869	97.26	570,818.94	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	36,757	34.84	1,280,613.88	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	20,389	156.42	3,189,247.38	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	37,230	36.42	1,355,916.60	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	41,591	35.72	1,485,630.52	

小計	ASX LTD	2,245	58.52	131,377.40	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	4,388	244.53	1,072,997.64	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,273	42.22	180,406.06	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	28,982	7.88	228,378.16	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	32,971	4.59	151,336.89	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	19,301	22.62	436,588.62	
	SUNCORP GROUP LTD	13,295	17.12	227,610.40	
	GOODMAN GROUP	24,582	31.40	771,874.80	
	SCENTRE GROUP	63,673	3.66	233,043.18	
	STOCKLAND	28,182	3.96	111,600.72	
	VICINITY CENTRES	44,582	2.47	110,117.54	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,549	36.67	93,471.83	
	XERO LTD	2,056	73.68	151,486.08	
	TELSTRA GROUP LTD	49,473	5.32	263,196.36	
	APA GROUP	16,942	10.66	180,601.72	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	21,084	11.65	245,628.60	
	銘柄数：46			24,045,131.45	
				(2,745,713,560)	
	組入時価比率：1.7%			1.7%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	20,326	8.39	170,535.14	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,174	34.15	244,992.10	
	INFRATIL LTD	10,694	15.23	162,869.62	
	CONTACT ENERGY LTD	10,561	9.90	104,553.90	
	MERIDIAN ENERGY LTD	17,087	5.91	100,984.17	
	銘柄数：5			783,934.93	
				(73,211,683)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	32,775	73.25	2,400,768.75	
	SWIRE PACIFIC LTD A	4,000	88.10	352,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	17,500	120.20	2,103,500.00	
	MTR CORP	18,218	33.80	615,768.40	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	16,000	34.78	556,480.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	23,000	33.82	777,860.00	
	SANDS CHINA LTD	28,400	16.05	455,820.00	
	WH GROUP LTD	99,500	9.39	934,305.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	45,500	46.20	2,102,100.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,600	423.60	6,184,560.00	
	AIA GROUP LTD	127,400	87.70	11,172,980.00	
	LINK REIT	31,880	41.96	1,337,684.80	
	HKT TRUST AND HKT LTD	50,000	12.66	633,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	8,500	66.35	563,975.00	
	CLP HOLDINGS LIMITED	20,400	77.10	1,572,840.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	136,515	7.44	1,015,671.60	

小計	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,000	65.30	1,110,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	23,275	51.50	1,198,662.50	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	19,259	34.28	660,198.52	
	SINO LAND CO	40,704	12.71	517,347.84	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	18,000	143.30	2,579,400.00	
	THE WHARF (HOLDINGS)	14,000	28.22	395,080.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	21,625	25.92	560,520.00	
	銘柄数：23			39,801,022.41 (805,572,693)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP	17,400	10.70	186,180.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	19,000	10.52	199,880.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	34,200	3.98	136,116.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	18,000	6.27	112,860.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,400	3.80	96,520.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	25,866	60.13	1,555,322.58	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	40,954	22.95	939,894.30	
	UNITED OVERSEAS BANK	15,100	37.37	564,287.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	10,400	21.30	221,520.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	50,733	2.47	125,310.51	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	68,907	2.27	156,418.89	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	91,890	4.87	447,504.30	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	11,800	6.19	73,042.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	30,900	2.63	81,267.00	
	銘柄数：14			4,896,122.58 (607,755,695)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
イスラエル シェケル	ICL GROUP LTD	10,218	19.03	194,448.54	
	ELBIT SYSTEMS LTD	342	2,264.20	774,356.40	
	BANK HAPOALIM BM	15,542	76.53	1,189,429.26	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,998	72.29	1,301,075.42	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	15,018	30.69	460,902.42	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,831	223.50	409,228.50	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	2,690	192.00	516,480.00	
	NICE LTD	767	254.60	195,278.20	
	NOVA LTD	347	1,591.40	552,215.80	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,384	805.00	1,114,120.00	
	AZRIELI GROUP	560	480.60	269,136.00	
	銘柄数：11			6,976,670.54 (381,223,417)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
合 計				163,364,664,780	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

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

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日立外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2025年 5月15日現在	2026年 5月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	74,433,997	84,453,076
コール・ローン	74,741,670	65,196,079
国債証券	49,924,753,784	53,884,152,928
派生商品評価勘定	10,129,915	-
未収入金	1,352,706,655	58,482,416
未収利息	473,471,101	542,555,201
前払費用	44,249,091	31,407,188
流動資産合計	51,954,486,213	54,666,246,888
資産合計	51,954,486,213	54,666,246,888
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,349,300,000	26,600,000
流動負債合計	1,349,300,000	26,600,000
負債合計	1,349,300,000	26,600,000
純資産の部		
元本等		
元本	17,766,460,065	16,815,423,356
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	32,838,726,148	37,824,223,532
元本等合計	50,605,186,213	54,639,646,888
純資産合計	50,605,186,213	54,639,646,888
負債純資産合計	51,954,486,213	54,666,246,888

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	外国為替予約取引 原則として、計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2025年 5月15日現在	2026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	17,766,460,065口	16,815,423,356口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8484円 (28,484円)	3.2494円 (32,494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 2025年 5月16日 至 2026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資産運用業協会の諸規則、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	2026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	①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。 ②コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2025年 5月15日現在	2026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
国債証券	△243,885,637	△66,333,863
合計	△243,885,637	△66,333,863

（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 2025年 5月16日 至 2026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、通貨関連では為替予約取引であります。
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の為替等の変動によるリスクを回避する目的で行ないません。
3. 取引の利用目的	デリバティブ取引は、通貨関連では外貨建有価証券等の為替変動リスクを回避する目的で利用しております。
4. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5. 取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、資産運用業協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2025年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
		契約額等	契約額等 うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,314,651,185	—	1,304,521,270	10,129,915
	ドル	606,009,477	—	601,761,544	4,247,933
	カナダドル	27,776,329	—	27,505,305	271,024
	メキシコペソ	11,008,757	—	10,959,148	49,609
	ユーロ	395,132,072	—	392,161,536	2,970,536
	ポンド	72,834,284	—	72,100,060	734,224
	オーストラリアドル	31,789,602	—	31,406,010	383,592
	マレーシアリングット	19,151,401	—	19,048,196	103,205
	オフショア元	150,949,263	—	149,579,471	1,369,792
合計		1,314,651,185	—	1,304,521,270	10,129,915

時価の算定方法

為替予約取引

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

- ①計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ②計算期間末日において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（2026年 5月15日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2024年 5月16日 至 2025年 5月15日	自 2025年 5月16日 至 2026年 5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	17,585,803,695円	17,766,460,065円
期中追加設定元本額	2,108,021,897円	589,427,049円
期中一部解約元本額	1,927,365,527円	1,540,463,758円
期末元本額	17,766,460,065円	16,815,423,356円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式70）	1,375,191,246円	1,440,754,378円
日立バランスファンド（株式50）	942,448,097円	919,752,404円
日立バランスファンド（株式30）	291,932,042円	264,435,471円
日立外国債券特化型ファンドU（為替ヘッジなし）（非課税適格機関投資家専用）	9,289,459,838円	8,460,330,570円
日立外国債券インデックスファンド	5,867,428,842円	5,730,150,533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

(2026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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	0.375% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,054,023.44	
		0.375% US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,171,382.81	
		0.500% US TREASURY N/B	530,000.00	513,520.31	
		0.500% US TREASURY N/B	1,020,000.00	985,017.19	
		0.500% US TREASURY N/B	630,000.00	606,571.87	
		0.500% US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,033,509.38	
		0.500% US TREASURY N/B	640,000.00	608,650.00	
		0.625% US TREASURY N/B	860,000.00	817,000.00	
		0.625% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,041,992.19	
		0.625% US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,220,734.38	
		0.625% US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,339,781.25	
		0.750% US TREASURY N/B	730,000.00	690,990.62	
		0.875% US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,144,790.63	
		1.000% US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,404,492.19	
		1.125% US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,311,539.06	
		1.125% US TREASURY N/B	730,000.00	683,918.75	
		1.125% US TREASURY N/B	840,000.00	731,784.37	
		1.125% US TREASURY N/B	470,000.00	292,905.47	
		1.125% US TREASURY N/B	580,000.00	357,742.19	
		1.25% US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,270,696.87	
		1.25% US TREASURY N/B	930,000.00	879,721.87	
		1.25% US TREASURY N/B	950,000.00	896,785.16	
		1.250% US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,273,523.44	
		1.250% US TREASURY N/B	900,000.00	843,609.37	
		1.250% US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,216,014.85	
		1.250% US TREASURY N/B	780,000.00	363,126.56	
		1.375% US TREASURY N/B	740,000.00	694,039.06	
		1.375% US TREASURY N/B	640,000.00	597,650.00	
		1.375% US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,309,100.00	
		1.375% US TREASURY N/B	600,000.00	382,265.62	
		1.375% US TREASURY N/B	580,000.00	278,535.94	
		1.500% US TREASURY N/B	860,000.00	807,526.56	
		1.500% US TREASURY N/B	640,000.00	582,550.00	
		1.625% US TREASURY N/B	440,000.00	407,653.12	
		1.625% US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,196,648.43	
		1.625% US TREASURY N/B	940,000.00	481,603.12	
		1.750% US TREASURY N/B	850,000.00	799,996.09	
		1.750% US TREASURY N/B	500,000.00	462,343.75	

1.750% US TREASURY N/B	810,000.00	535,106.25
1.875% US TREASURY N/B	700,000.00	660,023.44
1.875% US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,179,514.06
1.875% US TREASURY N/B	600,000.00	410,859.37
1.875% US TREASURY N/B	830,000.00	452,544.53
1.875% US TREASURY N/B	710,000.00	382,678.90
2.000% US TREASURY N/B	750,000.00	512,226.56
2.000% US TREASURY N/B	410,000.00	234,628.90
2.000% US TREASURY N/B	1,140,000.00	637,153.12
2.25% US TREASURY N/B	660,000.00	475,251.56
2.250% US TREASURY N/B	980,000.00	959,634.37
2.250% US TREASURY N/B	740,000.00	721,384.37
2.250% US TREASURY N/B	150,000.00	96,234.37
2.250% US TREASURY N/B	1,040,000.00	635,293.75
2.250% US TREASURY N/B	820,000.00	484,889.06
2.375% US TREASURY N/B	680,000.00	670,171.87
2.375% US TREASURY N/B	510,000.00	486,890.62
2.375% US TREASURY N/B	680,000.00	647,912.50
2.375% US TREASURY N/B	790,000.00	569,170.31
2.375% US TREASURY N/B	680,000.00	417,615.62
2.500% US TREASURY N/B	440,000.00	303,840.62
2.500% US TREASURY N/B	330,000.00	224,064.84
2.500% US TREASURY N/B	320,000.00	216,400.00
2.625% US TREASURY N/B	780,000.00	751,237.50
2.625% US TREASURY N/B	100,000.00	95,671.87
2.750% US TREASURY N/B	600,000.00	593,906.25
2.750% US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,145,046.09
2.750% US TREASURY N/B	860,000.00	828,018.75
2.750% US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,082,650.00
2.750% US TREASURY N/B	410,000.00	307,435.93
2.750% US TREASURY N/B	450,000.00	313,382.81
2.750% US TREASURY N/B	460,000.00	319,484.37
2.875% US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,134,715.63
2.875% US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,141,115.62
2.875% US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,224,300.00
2.875% US TREASURY N/B	500,000.00	378,476.56
2.875% US TREASURY N/B	270,000.00	197,374.22
2.875% US TREASURY N/B	210,000.00	151,085.15
2.875% US TREASURY N/B	840,000.00	571,659.37
3.000% US TREASURY N/B	270,000.00	212,203.12
3.000% US TREASURY N/B	360,000.00	271,518.75
3.000% US TREASURY N/B	230,000.00	172,374.21
3.000% US TREASURY N/B	220,000.00	163,728.12

3.000% US TREASURY N/B	60,000.00	44,006.25
3.000% US TREASURY N/B	220,000.00	160,840.62
3.000% US TREASURY N/B	430,000.00	312,186.72
3.000% US TREASURY N/B	960,000.00	688,275.00
3.000% US TREASURY N/B	480,000.00	334,800.00
3.125% US TREASURY N/B	970,000.00	948,857.03
3.125% US TREASURY N/B	600,000.00	582,468.75
3.125% US TREASURY N/B	250,000.00	201,660.15
3.125% US TREASURY N/B	430,000.00	339,431.25
3.125% US TREASURY N/B	90,000.00	69,517.96
3.125% US TREASURY N/B	1,020,000.00	755,198.44
3.250% US TREASURY N/B	860,000.00	854,020.31
3.250% US TREASURY N/B	770,000.00	751,832.81
3.250% US TREASURY N/B	540,000.00	439,846.87
3.375% US TREASURY N/B	980,000.00	972,650.00
3.375% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,010,039.05
3.375% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,005,018.75
3.375% US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,019,334.38
3.375% US TREASURY N/B	470,000.00	388,007.03
3.375% US TREASURY N/B	360,000.00	290,025.00
3.500% US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,155,466.41
3.500% US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,282,734.37
3.500% US TREASURY N/B	800,000.00	788,562.50
3.500% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,129,066.41
3.500% US TREASURY N/B	300,000.00	293,812.50
3.500% US TREASURY N/B	590,000.00	576,909.37
3.500% US TREASURY N/B	350,000.00	340,812.50
3.500% US TREASURY N/B	400,000.00	389,000.00
3.500% US TREASURY N/B	1,000,000.00	953,828.13
3.500% US TREASURY N/B	90,000.00	80,128.12
3.625% US TREASURY N/B	690,000.00	684,717.18
3.625% US TREASURY N/B	790,000.00	783,087.50
3.625% US TREASURY N/B	580,000.00	572,025.00
3.625% US TREASURY N/B	600,000.00	589,687.50
3.625% US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,646,006.25
3.625% US TREASURY N/B	200,000.00	195,875.00
3.625% US TREASURY N/B	580,000.00	567,493.75
3.625% US TREASURY N/B	730,000.00	710,552.34
3.625% US TREASURY N/B	310,000.00	260,884.37
3.625% US TREASURY N/B	80,000.00	66,943.75
3.625% US TREASURY N/B	850,000.00	669,175.78
3.625% US TREASURY N/B	480,000.00	377,587.50
3.750% US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,457,718.75

3.750% US TREASURY N/B	650,000.00	648,476.56	
3.750% US TREASURY N/B	300,000.00	298,523.43	
3.750% US TREASURY N/B	700,000.00	694,750.00	
3.750% US TREASURY N/B	550,000.00	542,265.62	
3.750% US TREASURY N/B	550,000.00	540,933.59	
3.750% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,179,937.50	
3.750% US TREASURY N/B	400,000.00	388,000.00	
3.875% US TREASURY N/B	800,000.00	799,000.00	
3.875% US TREASURY N/B	570,000.00	568,975.78	
3.875% US TREASURY N/B	630,000.00	628,425.00	
3.875% US TREASURY N/B	900,000.00	897,398.44	
3.875% US TREASURY N/B	830,000.00	827,406.25	
3.875% US TREASURY N/B	440,000.00	437,112.50	
3.875% US TREASURY N/B	410,000.00	407,053.12	
3.875% US TREASURY N/B	490,000.00	486,401.56	
3.875% US TREASURY N/B	650,000.00	644,464.84	
3.875% US TREASURY N/B	640,000.00	634,150.00	
3.875% US TREASURY N/B	300,000.00	297,164.06	
3.875% US TREASURY N/B	700,000.00	691,550.78	
3.875% US TREASURY N/B	450,000.00	440,226.56	
3.875% US TREASURY N/B	360,000.00	351,534.37	
3.875% US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,186,164.06	
3.875% US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,321,300.78	
3.875% US TREASURY N/B	430,000.00	376,821.09	
3.875% US TREASURY N/B	400,000.00	349,687.50	
4.000% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,150,089.84	
4.000% US TREASURY N/B	700,000.00	699,070.30	
4.000% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,017,848.44	
4.000% US TREASURY N/B	500,000.00	498,593.75	
4.000% US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,484.38	
4.000% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,095,875.00	
4.000% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,145,058.59	
4.000% US TREASURY N/B	400,000.00	397,468.75	
4.000% US TREASURY N/B	790,000.00	780,495.31	
4.000% US TREASURY N/B	470,000.00	463,757.81	
4.000% US TREASURY N/B	950,000.00	936,937.50	
4.000% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,081,351.56	
4.000% US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,376,622.66	
4.000% US TREASURY N/B	790,000.00	761,732.80	
4.000% US TREASURY N/B	370,000.00	330,600.78	
4.000% US TREASURY N/B	720,000.00	607,556.25	
4.125% US TREASURY N/B	570,000.00	571,068.75	
4.125% US TREASURY N/B	890,000.00	891,668.75	

4.125% US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,031,207.03	
4.125% US TREASURY N/B	900,000.00	901,054.69	
4.125% US TREASURY N/B	450,000.00	449,859.37	
4.125% US TREASURY N/B	430,000.00	429,462.50	
4.125% US TREASURY N/B	470,000.00	469,008.59	
4.125% US TREASURY N/B	550,000.00	548,152.34	
4.125% US TREASURY N/B	880,000.00	876,837.50	
4.125% US TREASURY N/B	560,000.00	557,331.25	
4.125% US TREASURY N/B	630,000.00	626,751.56	
4.125% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,189,687.50	
4.125% US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,030,601.56	
4.125% US TREASURY N/B	540,000.00	482,835.94	
4.125% US TREASURY N/B	610,000.00	525,028.90	
4.250% US TREASURY N/B	580,000.00	582,220.31	
4.250% US TREASURY N/B	680,000.00	682,656.25	
4.250% US TREASURY N/B	850,000.00	854,382.81	
4.250% US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,085,821.88	
4.250% US TREASURY N/B	600,000.00	603,046.87	
4.250% US TREASURY N/B	500,000.00	502,187.50	
4.250% US TREASURY N/B	650,000.00	652,539.06	
4.250% US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,334,707.03	
4.250% US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,508,962.50	
4.250% US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,349,342.97	
4.250% US TREASURY N/B	70,000.00	65,772.65	
4.250% US TREASURY N/B	780,000.00	685,668.75	
4.250% US TREASURY N/B	860,000.00	756,128.12	
4.375% US TREASURY N/B	600,000.00	603,140.62	
4.375% US TREASURY N/B	500,000.00	504,804.69	
4.375% US TREASURY N/B	300,000.00	302,390.62	
4.375% US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,440,112.50	
4.375% US TREASURY N/B	60,000.00	57,721.87	
4.375% US TREASURY N/B	160,000.00	153,237.50	
4.375% US TREASURY N/B	210,000.00	199,237.50	
4.375% US TREASURY N/B	490,000.00	456,044.53	
4.500% US TREASURY N/B	800,000.00	804,812.50	
4.500% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,212,281.25	
4.500% US TREASURY N/B	90,000.00	90,675.00	
4.500% US TREASURY N/B	110,000.00	109,252.34	
4.500% US TREASURY N/B	200,000.00	195,437.50	
4.500% US TREASURY N/B	530,000.00	499,483.59	
4.500% US TREASURY N/B	810,000.00	742,795.31	
4.625% US TREASURY N/B	700,000.00	705,578.12	
4.625% US TREASURY N/B	820,000.00	830,826.56	

小計	4.625% US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,259,471.88	
	4.625% US TREASURY N/B	480,000.00	489,450.00	
	4.625% US TREASURY N/B	390,000.00	398,135.15	
	4.625% US TREASURY N/B	600,000.00	612,515.62	
	4.625% US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,512,000.78	
	4.625% US TREASURY N/B	190,000.00	187,209.37	
	4.625% US TREASURY N/B	400,000.00	382,468.75	
	4.625% US TREASURY N/B	500,000.00	476,796.87	
	4.625% US TREASURY N/B	530,000.00	503,582.81	
	4.625% US TREASURY N/B	870,000.00	814,401.56	
	4.625% US TREASURY N/B	860,000.00	805,040.62	
	4.625% US TREASURY N/B	530,000.00	496,667.96	
	4.750% US TREASURY N/B	50,000.00	49,542.96	
	4.750% US TREASURY N/B	530,000.00	516,087.50	
	4.750% US TREASURY N/B	450,000.00	435,656.25	
	4.750% US TREASURY N/B	800,000.00	763,500.00	
	4.750% US TREASURY N/B	370,000.00	353,378.90	
	4.750% US TREASURY N/B	930,000.00	888,949.22	
	4.750% US TREASURY N/B	440,000.00	420,767.17	
	4.875% US TREASURY N/B	170,000.00	166,958.58	
	5.000% US TREASURY N/B	40,000.00	41,806.25	
	5.000% US TREASURY N/B	350,000.00	349,425.78	
	5.250% US TREASURY N/B	110,000.00	113,188.28	
	5.375% US TREASURY N/B	100,000.00	105,421.87	
	6.125% US TREASURY N/B	120,000.00	123,506.25	
	6.250% US TREASURY N/B	110,000.00	118,645.31	
	銘柄数：236	166,360,000.00	152,976,368.30	
			(24,255,932,957)	
	組入時価比率：44.4%		45.0%	
カナダドル	0.500% CANADA GOV'T	340,000.00	301,543.04	
	1.000% CANADA GOV'T	290,000.00	284,799.59	
	1.250% CANADA GOV'T	470,000.00	436,074.19	
	1.500% CANADA GOV'T	460,000.00	422,949.69	
	1.500% CANADA GOV'T	230,000.00	209,289.98	
	1.750% CANADA GOV'T	520,000.00	330,867.66	
	2.000% CANADA GOV'T	140,000.00	137,359.92	
	2.000% CANADA GOV'T	280,000.00	259,767.06	
	2.000% CANADA GOV'T	560,000.00	387,899.72	
	2.250% CANADA GOV'T	270,000.00	266,973.06	
	2.250% CANADA GOV'T	90,000.00	87,947.45	
	2.500% CANADA GOV'T	90,000.00	89,682.86	
	2.500% CANADA GOV'T	50,000.00	49,734.06	
	2.500% CANADA GOV'T	320,000.00	303,901.16	

小計	2.750% CANADA GOV'T	410,000.00	410,140.54
	2.750% CANADA GOV'T	90,000.00	89,904.49
	2.750% CANADA GOV'T	490,000.00	483,122.05
	2.750% CANADA GOV'T	340,000.00	334,052.99
	2.750% CANADA GOV'T	500,000.00	489,569.00
	2.750% CANADA GOV'T	100,000.00	96,005.61
	2.750% CANADA GOV'T	160,000.00	133,484.79
	2.750% CANADA GOV'T	290,000.00	231,119.56
	2.750% CANADA GOV'T	180,000.00	138,373.55
	3.000% CANADA GOV'T	580,000.00	561,316.90
	3.250% CANADA GOV'T	420,000.00	422,314.06
	3.250% CANADA GOV'T	210,000.00	207,544.44
	3.250% CANADA GOV'T	360,000.00	353,576.30
	3.250% CANADA GOV'T	290,000.00	283,859.52
	3.250% CANADA GOV'T	490,000.00	477,777.44
	3.250% CANADA GOV'T	40,000.00	38,838.33
	3.500% CANADA GOV'T	300,000.00	302,949.39
	3.500% CANADA GOV'T	330,000.00	334,082.89
	3.500% CANADA GOV'T	160,000.00	160,628.96
	3.500% CANADA GOV'T	170,000.00	163,078.98
	4.000% CANADA GOV'T	300,000.00	307,599.55
	4.000% CANADA GOV'T	110,000.00	113,359.24
	5.000% CANADA GOV'T	60,000.00	67,448.75
	5.750% CANADA GOV'T	60,000.00	64,650.49
	5.750% CANADA GOV'T	80,000.00	91,727.33
	銘柄数：39	10,630,000.00	9,925,314.59
			(1,145,381,303)
	組入時価比率：2.1%		2.1%
メキシコペソ	10.00%MEX BONOS DESARR F	1,840,000.00	1,938,423.25
	7.500%MEX BONOS DESARR F	1,880,000.00	1,887,619.64
	7.500%MEX BONOS DESARR F	4,400,000.00	4,064,536.08
	7.750%MEX BONOS DESARR F	6,970,000.00	6,705,140.00
	7.750%MEX BONOS DESARR F	4,700,000.00	4,323,003.60
	7.750%MEX BONOS DESARR F	5,880,000.00	4,974,468.24
	8.000%MEX BONOS DESARR F	1,700,000.00	1,572,077.21
	8.000%MEX BONOS DESARR F	2,800,000.00	2,378,426.40
	8.000%MEX BONOS DESARR F	5,400,000.00	4,530,168.00
	8.500%MEX BONOS DESARR F	2,000,000.00	2,029,689.60
	8.500%MEX BONOS DESARR F	5,000,000.00	5,040,835.50
	8.500%MEX BONOS DESARR F	6,280,000.00	6,313,613.70
	8.500%MEX BONOS DESARR F	3,500,000.00	3,496,473.75
	8.500%MEX BONOS DESARR F	2,670,000.00	2,489,834.54
	銘柄数：14	55,020,000.00	51,744,309.51
小計			

			(475,680,262)	
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
ユーロ	0.000.% DEUTSCHLAND REP	380,000.00	343,900.00	
	0.000% BELGIUM KINGDOM	160,000.00	135,776.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	269,472.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	240,000.00	220,320.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	460,000.00	410,642.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	395,865.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	255,900.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	260,000.00	198,640.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	270,000.00	198,801.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	520,000.00	221,520.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	174,636.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	550,000.00	496,320.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	710,000.00	619,688.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	660,000.00	554,862.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	440,000.00	362,472.00	
	0.000% IRISH GOV'T	150,000.00	128,745.00	
	0.000% NETHERLANDS GOV'T	150,000.00	139,740.00	
	0.000% NETHERLANDS GOV'T	150,000.00	133,755.00	
	0.000% NETHERLANDS GOV'T	200,000.00	172,900.00	
	0.000% NETHERLANDS GOV'T	180,000.00	122,922.00	
	0.000% NETHERLANDS GOV'T	240,000.00	97,032.00	
	0.000% REP OF AUSTRIA	220,000.00	198,220.00	
	0.000% REP OF AUSTRIA	230,000.00	200,836.00	
	0.000% REP OF AUSTRIA	250,000.00	149,725.00	
	0.000% SPANISH GOV'T	280,000.00	267,624.00	
	0.100% BELGIUM KINGDOM	230,000.00	205,252.00	
	0.100% SPANISH GOV'T	390,000.00	339,846.00	
	0.125% FINNISH GOV'T	160,000.00	116,496.00	
	0.200% IRISH GOV'T	50,000.00	48,885.00	
	0.200% IRISH GOV'T	150,000.00	133,950.00	
	0.250% BUONI POLIENNALI	240,000.00	229,296.00	
	0.250% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	332,045.00	
	0.250% DEUTSCHLAND REP	420,000.00	393,666.00	
	0.250% NETHERLANDS GOV'T	280,000.00	259,252.00	
	0.300% PORTUGUESE OT'S	150,000.00	130,260.00	
	0.350% BELGIUM KINGDOM	190,000.00	160,854.00	
	0.400% IRISH GOV'T	30,000.00	23,565.00	
	0.450% BUONI POLIENNALI	290,000.00	271,556.00	
	0.475% PORTUGUESE OT'S	190,000.00	169,556.00	
	0.5% BUONI POLIENNALI	280,000.00	266,560.00	
	0.500% DEUTSCHLAND REP	480,000.00	467,952.00	

0.500% DEUTSCHLAND REP	360,000.00	347,076.00
0.500% FINNISH GOV'T	120,000.00	116,604.00
0.500% FRANCE GOV'T	190,000.00	48,849.00
0.500% FRANCE GOV'T	580,000.00	540,154.00
0.500% FRANCE GOV'T	340,000.00	211,956.00
0.500% FRANCE GOV'T	290,000.00	154,976.00
0.500% NETHERLANDS GOV'T	210,000.00	181,650.00
0.500% NETHERLANDS GOV'T	200,000.00	137,380.00
0.500% REP OF AUSTRIA	300,000.00	282,390.00
0.500% SPANISH GOV'T	340,000.00	310,760.00
0.550% IRISH GOV'T	50,000.00	32,865.00
0.600% BUONI POLIENNALI	240,000.00	210,456.00
0.600% SPANISH GOV'T	520,000.00	482,924.00
0.650% BELGIUM KINGDOM	160,000.00	47,920.00
0.700% PORTUGUESE OT'S	100,000.00	97,330.00
0.700% REP OF AUSTRIA	70,000.00	24,143.00
0.700% SPANISH GOV'T	480,000.00	419,664.00
0.750% FINNISH GOV'T	270,000.00	243,081.00
0.750% FRANCE GOV'T	660,000.00	636,768.00
0.750% FRANCE GOV'T	560,000.00	537,432.00
0.750% FRANCE GOV'T	670,000.00	636,031.00
0.750% FRANCE GOV'T	500,000.00	218,800.00
0.750% FRANCE GOV'T	400,000.00	169,560.00
0.750% NETHERLANDS GOV'T	150,000.00	146,895.00
0.750% NETHERLANDS GOV'T	190,000.00	182,476.00
0.750% REP OF AUSTRIA	260,000.00	251,550.00
0.750% REP OF AUSTRIA	100,000.00	51,120.00
0.800% BELGIUM KINGDOM	170,000.00	166,685.00
0.800% BELGIUM KINGDOM	170,000.00	163,387.00
0.800% SPANISH GOV'T	360,000.00	352,080.00
0.850% REP OF AUSTRIA	90,000.00	26,919.00
0.850% SPANISH GOV'T	250,000.00	187,300.00
0.900% BELGIUM KINGDOM	380,000.00	358,568.00
0.900% BUONI POLIENNALI	360,000.00	323,640.00
0.900% IRISH GOV'T	90,000.00	86,940.00
0.900% PORTUGUESE OT'S	160,000.00	128,928.00
0.900% REP OF AUSTRIA	170,000.00	151,606.00
0.95% BUONI POLIENNALI	120,000.00	106,200.00
0.950% BUONI POLIENNALI	300,000.00	293,160.00
0.950% BUONI POLIENNALI	170,000.00	155,924.00
0.950% BUONI POLIENNALI	380,000.00	331,740.00
0.950% BUONI POLIENNALI	330,000.00	246,246.00
0% DEUTSCHLAND REP	220,000.00	206,184.00

0% DEUTSCHLAND REP	330,000.00	285,879.00	
0% DEUTSCHLAND REP	130,000.00	55,575.00	
1.000% BELGIUM KINGDOM	250,000.00	226,350.00	
1.000% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	272,580.00	
1.000% FRANCE GOV'T	590,000.00	580,029.00	
1.000% PORTUGUESE OT'S	90,000.00	47,196.00	
1.000% SPANISH GOV'T	200,000.00	131,280.00	
1.000% SPANISH GOV'T	290,000.00	153,236.00	
1.125% FINNISH GOV'T	90,000.00	77,013.00	
1.150% PORTUGUESE OT'S	150,000.00	102,720.00	
1.200% SPANISH GOV'T	240,000.00	171,096.00	
1.250% BELGIUM KINGDOM	90,000.00	79,299.00	
1.250% DEUTSCHLAND REP	510,000.00	331,041.00	
1.250% FRANCE GOV'T	660,000.00	556,644.00	
1.250% FRANCE GOV'T	700,000.00	555,800.00	
1.250% FRANCE GOV'T	390,000.00	290,901.00	
1.250% SPANISH GOV'T	320,000.00	298,368.00	
1.300% DEUTSCHLAND REP	600,000.00	589,320.00	
1.300% IRISH GOV'T	130,000.00	116,220.00	
1.350% BUONI POLIENNALI	300,000.00	282,000.00	
1.375% FINNISH GOV'T	220,000.00	142,406.00	
1.400% BELGIUM KINGDOM	130,000.00	69,277.00	
1.400% SPANISH GOV'T	430,000.00	419,551.00	
1.400% SPANISH GOV'T	240,000.00	233,400.00	
1.450% BELGIUM KINGDOM	120,000.00	95,832.00	
1.450% SPANISH GOV'T	100,000.00	45,720.00	
1.450% SPANISH GOV'T	360,000.00	353,808.00	
1.450% SPANISH GOV'T	240,000.00	231,336.00	
1.500% BUONI POLIENNALI	170,000.00	108,698.00	
1.500% FINNISH GOV'T	130,000.00	118,300.00	
1.500% FRANCE GOV'T	800,000.00	740,560.00	
1.500% FRANCE GOV'T	490,000.00	281,652.00	
1.500% IRISH GOV'T	160,000.00	104,816.00	
1.500% REP OF AUSTRIA	70,000.00	32,487.00	
1.500% REP OF AUSTRIA	180,000.00	121,806.00	
1.500% SPANISH GOV'T	270,000.00	267,192.00	
1.600% BELGIUM KINGDOM	220,000.00	139,942.00	
1.650% BUONI POLIENNALI	240,000.00	225,288.00	
1.650% BUONI POLIENNALI	330,000.00	302,049.00	
1.650% PORTUGUESE OT'S	20,000.00	18,452.00	
1.700% BUONI POLIENNALI	270,000.00	157,761.00	
1.700% DEUTSCHLAND REP	390,000.00	365,079.00	
1.700% IRISH GOV'T	110,000.00	93,555.00	

1.750% FRANCE GOV'T	480,000.00	371,808.00	
1.750% FRANCE GOV'T	290,000.00	144,536.00	
1.800% BUONI POLIENNALI	300,000.00	222,720.00	
1.800% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	311,760.00	
1.850% SPANISH GOV'T	310,000.00	272,955.00	
1.900% BELGIUM KINGDOM	220,000.00	180,180.00	
1.900% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	297,150.00	
1.900% SPANISH GOV'T	250,000.00	161,750.00	
1.950% PORTUGUESE OT'S	210,000.00	204,792.00	
1.950% SPANISH GOV'T	340,000.00	327,930.00	
2.000% BUONI POLIENNALI	350,000.00	345,555.00	
2.000% FRANCE GOV'T	700,000.00	645,610.00	
2.000% FRANCE GOV'T	380,000.00	254,752.00	
2.000% IRISH GOV'T	140,000.00	109,438.00	
2.000% NETHERLANDS GOV'T	210,000.00	151,830.00	
2.050% BUONI POLIENNALI	340,000.00	337,484.00	
2.100% DEUTSCHLAND REP	230,000.00	226,343.00	
2.100% DEUTSCHLAND REP	500,000.00	490,000.00	
2.100% REP OF AUSTRIA	120,000.00	69,744.00	
2.125% PORTUGUESE OT'S	230,000.00	224,227.00	
2.150% BELGIUM KINGDOM	160,000.00	93,088.00	
2.200% BUONI POLIENNALI	310,000.00	308,326.00	
2.200% DEUTSCHLAND REP	320,000.00	317,312.00	
2.200% DEUTSCHLAND REP	320,000.00	312,768.00	
2.200% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	426,870.00	
2.250% BELGIUM KINGDOM	100,000.00	63,760.00	
2.250% BUONI POLIENNALI	430,000.00	374,272.00	
2.250% PORTUGUESE OT'S	110,000.00	102,938.00	
2.300% DEUTSCHLAND REP	490,000.00	472,703.00	
2.300% DEUTSCHLAND REP	370,000.00	356,939.00	
2.350% BUONI POLIENNALI	180,000.00	177,444.00	
2.350% SPANISH GOV'T	310,000.00	293,508.00	
2.400% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	278,264.00	
2.400% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	345,765.00	
2.400% DEUTSCHLAND REP	150,000.00	147,765.00	
2.400% FRANCE GOV'T	520,000.00	514,592.00	
2.400% IRISH GOV'T	180,000.00	177,210.00	
2.400% REP OF AUSTRIA	150,000.00	142,125.00	
2.400% SPANISH GOV'T	490,000.00	486,962.00	
2.450% BUONI POLIENNALI	220,000.00	205,942.00	
2.450% BUONI POLIENNALI	350,000.00	247,135.00	
2.500% BUONI POLIENNALI	240,000.00	228,096.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	220,000.00	218,570.00	

2.500% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	423,060.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	304,430.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	368,424.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	283,115.00	
2.500% FINNISH GOV'T	80,000.00	78,960.00	
2.500% FRANCE GOV'T	320,000.00	318,880.00	
2.500% FRANCE GOV'T	910,000.00	892,892.00	
2.500% FRANCE GOV'T	300,000.00	238,800.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	100,000.00	98,600.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	170,000.00	165,461.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	100,000.00	96,910.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	190,000.00	182,609.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	140,000.00	133,308.00	
2.550% SPANISH GOV'T	280,000.00	271,180.00	
2.600% BELGIUM KINGDOM	110,000.00	108,295.00	
2.600% DEUTSCHLAND REP	340,000.00	333,098.00	
2.600% DEUTSCHLAND REP	110,000.00	107,008.00	
2.600% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	395,814.00	
2.600% DEUTSCHLAND REP	270,000.00	245,025.00	
2.600% IRISH GOV'T	70,000.00	67,361.00	
2.625% FINNISH GOV'T	150,000.00	130,590.00	
2.650% BUONI POLIENNALI	330,000.00	329,505.00	
2.700% BUONI POLIENNALI	200,000.00	196,700.00	
2.700% BUONI POLIENNALI	200,000.00	154,840.00	
2.700% FRANCE GOV'T	340,000.00	334,050.00	
2.700% SPANISH GOV'T	270,000.00	268,650.00	
2.700% SPANISH GOV'T	250,000.00	201,375.00	
2.750% FINNISH GOV'T	190,000.00	190,247.00	
2.750% FINNISH GOV'T	100,000.00	92,740.00	
2.750% FRANCE GOV'T	820,000.00	819,672.00	
2.750% FRANCE GOV'T	710,000.00	707,373.00	
2.750% FRANCE GOV'T	740,000.00	733,710.00	
2.750% NETHERLANDS GOV'T	270,000.00	239,058.00	
2.800% BUONI POLIENNALI	350,000.00	349,790.00	
2.800% BUONI POLIENNALI	150,000.00	149,430.00	
2.800% BUONI POLIENNALI	210,000.00	145,068.00	
2.850% BELGIUM KINGDOM	250,000.00	239,900.00	
2.850% BUONI POLIENNALI	300,000.00	296,040.00	
2.875% PORTUGUESE OT'S	70,000.00	68,180.00	
2.900% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	345,240.00	
2.900% DEUTSCHLAND REP	220,000.00	192,192.00	
2.900% REP OF AUSTRIA	230,000.00	231,127.00	
2.900% REP OF AUSTRIA	270,000.00	267,516.00	

2.900% REP OF AUSTRIA	220,000.00	216,392.00	
2.900% SPANISH GOV'T	210,000.00	178,017.00	
2.950% BUONI POLIENNALI	360,000.00	358,380.00	
2.950% BUONI POLIENNALI	310,000.00	279,930.00	
3.000% BELGIUM KINGDOM	160,000.00	157,520.00	
3.000% BELGIUM KINGDOM	130,000.00	126,763.00	
3.000% BUONI POLIENNALI	190,000.00	190,475.00	
3.000% BUONI POLIENNALI	90,000.00	90,054.00	
3.000% FINNISH GOV'T	50,000.00	49,530.00	
3.000% FINNISH GOV'T	100,000.00	98,220.00	
3.000% FINNISH GOV'T	20,000.00	19,476.00	
3.000% FRANCE GOV'T	480,000.00	468,192.00	
3.000% FRANCE GOV'T	530,000.00	507,899.00	
3.000% FRANCE GOV'T	400,000.00	305,480.00	
3.000% IRISH GOV'T	30,000.00	27,759.00	
3.000% PORTUGUESE OT'S	90,000.00	87,975.00	
3.000% SPANISH GOV'T	50,000.00	49,560.00	
3.100% BELGIUM KINGDOM	130,000.00	126,061.00	
3.100% BUONI POLIENNALI	190,000.00	170,905.00	
3.100% IRISH GOV'T	60,000.00	59,220.00	
3.100% SPANISH GOV'T	460,000.00	462,944.00	
3.150% BUONI POLIENNALI	240,000.00	238,872.00	
3.150% BUONI POLIENNALI	50,000.00	49,135.00	
3.150% REP OF AUSTRIA	130,000.00	120,757.00	
3.150% REP OF AUSTRIA	70,000.00	61,810.00	
3.150% SPANISH GOV'T	260,000.00	259,844.00	
3.150% SPANISH GOV'T	390,000.00	383,331.00	
3.200% FINNISH GOV'T	70,000.00	64,519.00	
3.200% FRANCE GOV'T	640,000.00	619,328.00	
3.200% REP OF AUSTRIA	40,000.00	39,636.00	
3.250% BUONI POLIENNALI	300,000.00	297,630.00	
3.250% BUONI POLIENNALI	270,000.00	230,310.00	
3.250% DEUTSCHLAND REP	230,000.00	225,101.00	
3.250% FRANCE GOV'T	330,000.00	288,453.00	
3.250% FRANCE GOV'T	270,000.00	215,703.00	
3.250% NETHERLANDS GOV'T	90,000.00	87,201.00	
3.250% SPANISH GOV'T	300,000.00	299,400.00	
3.300% BELGIUM KINGDOM	130,000.00	107,679.00	
3.350% BUONI POLIENNALI	310,000.00	303,614.00	
3.375% PORTUGUESE OT'S	70,000.00	67,298.00	
3.400% BUONI POLIENNALI	220,000.00	222,354.00	
3.450% BELGIUM KINGDOM	110,000.00	102,278.00	
3.450% BELGIUM KINGDOM	110,000.00	101,332.00	

3.450% BUONI POLIENNALI	430,000.00	433,612.00	
3.450% BUONI POLIENNALI	260,000.00	263,146.00	
3.450% BUONI POLIENNALI	250,000.00	243,875.00	
3.450% BUONI POLIENNALI	280,000.00	243,796.00	
3.450% REP OF AUSTRIA	50,000.00	51,215.00	
3.450% SPANISH GOV'T	350,000.00	353,185.00	
3.450% SPANISH GOV'T	230,000.00	216,384.00	
3.450% SPANISH GOV'T	210,000.00	180,390.00	
3.500% BUONI POLIENNALI	300,000.00	305,340.00	
3.500% FRANCE GOV'T	630,000.00	631,764.00	
3.500% FRANCE GOV'T	530,000.00	521,944.00	
3.500% NETHERLANDS GOV'T	60,000.00	58,758.00	
3.500% PORTUGUESE OT'S	160,000.00	158,384.00	
3.500% SPANISH GOV'T	220,000.00	224,290.00	
3.500% SPANISH GOV'T	290,000.00	279,096.00	
3.550% SPANISH GOV'T	340,000.00	347,310.00	
3.600% BUONI POLIENNALI	260,000.00	257,582.00	
3.600% FRANCE GOV'T	320,000.00	299,200.00	
3.625% PORTUGUESE OT'S	70,000.00	64,876.00	
3.650% BUONI POLIENNALI	300,000.00	298,890.00	
3.700% BUONI POLIENNALI	190,000.00	194,560.00	
3.750% BELGIUM KINGDOM	90,000.00	85,392.00	
3.750% NETHERLANDS GOV'T	220,000.00	228,030.00	
3.800% BUONI POLIENNALI	140,000.00	142,842.00	
3.800% REP OF AUSTRIA	50,000.00	49,305.00	
3.850% BUONI POLIENNALI	310,000.00	318,928.00	
3.850% BUONI POLIENNALI	200,000.00	203,760.00	
3.850% BUONI POLIENNALI	250,000.00	253,775.00	
3.850% BUONI POLIENNALI	220,000.00	213,686.00	
4.000% BELGIUM KINGDOM	110,000.00	115,258.00	
4.000% BUONI POLIENNALI	260,000.00	269,542.00	
4.000% BUONI POLIENNALI	380,000.00	386,726.00	
4.000% DEUTSCHLAND REP	370,000.00	399,267.00	
4.000% FRANCE GOV'T	270,000.00	272,727.00	
4.000% FRANCE GOV'T	330,000.00	304,425.00	
4.000% FRANCE GOV'T	260,000.00	236,262.00	
4.000% NETHERLANDS GOV'T	280,000.00	299,796.00	
4.000% SPANISH GOV'T	180,000.00	175,518.00	
4.050% BUONI POLIENNALI	50,000.00	50,765.00	
4.100% BUONI POLIENNALI	50,000.00	48,445.00	
4.150% BUONI POLIENNALI	70,000.00	70,770.00	
4.150% REP OF AUSTRIA	250,000.00	268,400.00	
4.200% BUONI POLIENNALI	300,000.00	313,410.00	

	4.200% SPANISH GOV'T	310,000.00	328,011.00	
	4.250% BELGIUM KINGDOM	250,000.00	258,300.00	
	4.250% DEUTSCHLAND REP	230,000.00	253,552.00	
	4.300% BUONI POLIENNALI	170,000.00	164,016.00	
	4.350% BELGIUM KINGDOM	50,000.00	49,430.00	
	4.350% BUONI POLIENNALI	270,000.00	285,039.00	
	4.400% BUONI POLIENNALI	200,000.00	212,040.00	
	4.400% FRANCE GOV'T	90,000.00	87,885.00	
	4.500% BUONI POLIENNALI	190,000.00	189,791.00	
	4.500% FRANCE GOV'T	470,000.00	493,030.00	
	4.650% BUONI POLIENNALI	80,000.00	81,232.00	
	4.700% SPANISH GOV'T	270,000.00	296,919.00	
	4.750% BUONI POLIENNALI	240,000.00	250,056.00	
	4.750% BUONI POLIENNALI	220,000.00	233,662.00	
	4.750% DEUTSCHLAND REP	160,000.00	166,864.00	
	4.750% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	463,013.00	
	4.750% DEUTSCHLAND REP	290,000.00	335,936.00	
	4.750% FRANCE GOV'T	440,000.00	478,148.00	
	4.900% SPANISH GOV'T	300,000.00	336,600.00	
	5.000% BELGIUM KINGDOM	320,000.00	357,376.00	
	5.000% BUONI POLIENNALI	350,000.00	385,210.00	
	5.000% BUONI POLIENNALI	430,000.00	473,215.00	
	5.000% BUONI POLIENNALI	400,000.00	440,000.00	
	5.150% SPANISH GOV'T	200,000.00	211,280.00	
	5.150% SPANISH GOV'T	210,000.00	242,613.00	
	5.250% BUONI POLIENNALI	570,000.00	612,294.00	
	5.500% BELGIUM KINGDOM	230,000.00	241,408.00	
	5.500% DEUTSCHLAND REP	340,000.00	380,052.00	
	5.500% FRANCE GOV'T	620,000.00	664,888.00	
	5.500% NETHERLANDS GOV'T	220,000.00	230,142.00	
	5.625% DEUTSCHLAND REP	230,000.00	240,741.00	
	5.750% BUONI POLIENNALI	380,000.00	433,162.00	
	5.750% FRANCE GOV'T	410,000.00	467,482.00	
	5.750% SPANISH GOV'T	400,000.00	460,280.00	
	6.000% BUONI POLIENNALI	510,000.00	575,994.00	
	6.000% SPANISH GOV'T	300,000.00	325,230.00	
	6.250% DEUTSCHLAND REP	130,000.00	145,730.00	
	6.500% BUONI POLIENNALI	290,000.00	305,312.00	
	6.500% DEUTSCHLAND REP	150,000.00	156,465.00	
小計	銘柄数：338	92,260,000.00	84,399,637.00	
			(15,592,832,935)	
	組入時価比率：28.5%		28.9%	
ポンド	0.125% UK TREASURY	350,000.00	326,585.00	

0.250% UK TREASURY	310,000.00	249,860.00
0.375% UK TREASURY	220,000.00	184,646.00
0.500% UK TREASURY	350,000.00	315,910.00
0.500% UK TREASURY	430,000.00	100,233.00
0.625% UK TREASURY	340,000.00	232,288.00
0.625% UK TREASURY	310,000.00	105,586.00
0.875% UK TREASURY	210,000.00	186,774.00
0.875% UK TREASURY	340,000.00	259,998.00
0.875% UK TREASURY	210,000.00	92,337.00
1.000% UK TREASURY	440,000.00	361,020.00
1.125% UK TREASURY	140,000.00	39,886.00
1.125% UK TREASURY	290,000.00	180,264.00
1.250% UK TREASURY	190,000.00	183,331.00
1.250% UK TREASURY	360,000.00	204,804.00
1.500% UK TREASURY	230,000.00	113,160.00
1.500% UK TREASURY	100,000.00	42,340.00
1.625% UK TREASURY	250,000.00	92,225.00
1.625% UK TREASURY	90,000.00	84,447.00
1.625% UK TREASURY	110,000.00	47,553.00
1.750% UK TREASURY	390,000.00	277,524.00
1.750% UK TREASURY	360,000.00	155,412.00
2.500% UK TREASURY	280,000.00	143,780.00
3.250% UK TREASURY	360,000.00	329,760.00
3.250% UK TREASURY	270,000.00	200,097.00
3.500% UK TREASURY	220,000.00	167,178.00
3.500% UK TREASURY	240,000.00	159,936.00
3.750% UK TREASURY	250,000.00	218,075.00
3.750% UK TREASURY	180,000.00	133,344.00
3.750% UK TREASURY	340,000.00	248,982.00
4.000% UK TREASURY	410,000.00	398,438.00
4.000% UK TREASURY	250,000.00	188,925.00
4.125% UK TREASURY	570,000.00	564,072.00
4.125% UK TREASURY	310,000.00	304,327.00
4.125% UK TREASURY	150,000.00	144,765.00
4.250% UK TREASURY	320,000.00	319,488.00
4.250% UK TREASURY	250,000.00	245,475.00
4.250% UK TREASURY	450,000.00	431,055.00
4.250% UK TREASURY	280,000.00	263,256.00
4.250% UK TREASURY	190,000.00	171,095.00
4.250% UK TREASURY	160,000.00	141,920.00
4.250% UK TREASURY	250,000.00	208,850.00
4.250% UK TREASURY	230,000.00	188,715.00
4.250% UK TREASURY	320,000.00	255,456.00

小計	4.375% UK TREASURY	500,000.00	499,500.00	
	4.375% UK TREASURY	600,000.00	597,540.00	
	4.375% UK TREASURY	470,000.00	425,914.00	
	4.375% UK TREASURY	380,000.00	310,384.00	
	4.500% UK TREASURY	360,000.00	360,396.00	
	4.500% UK TREASURY	170,000.00	165,801.00	
	4.500% UK TREASURY	380,000.00	368,106.00	
	4.500% UK TREASURY	240,000.00	214,488.00	
	4.625% UK TREASURY	370,000.00	365,153.00	
	4.750% UK TREASURY	300,000.00	303,810.00	
	4.750% UK TREASURY	440,000.00	431,684.00	
	4.750% UK TREASURY	340,000.00	324,768.00	
	4.750% UK TREASURY	410,000.00	373,715.00	
	6.000% UK TREASURY	190,000.00	197,562.00	
	銘柄数：58	17,450,000.00	14,201,993.00	
			(3,012,952,814)	
	組入時価比率：5.5%		5.6%	
スウェーデンクローナ	0.750% SWEDEN GOV'T	1,270,000.00	1,230,376.00	
	0.750% SWEDEN GOV'T	1,500,000.00	1,414,950.00	
	1.750% SWEDEN GOV'T	700,000.00	655,830.00	
	2.250% SWEDEN GOV'T	580,000.00	568,400.00	
	2.250% SWEDEN GOV'T	500,000.00	479,230.00	
	3.500% SWEDEN GOV'T	1,030,000.00	1,087,577.00	
	銘柄数：6	5,580,000.00	5,436,363.00	
小計			(91,657,080)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
ノルウェークローネ	1.250% NORWEGIAN GOV'T	730,000.00	617,945.00	
	1.375% NORWEGIAN GOV'T	1,000,000.00	878,000.00	
	1.750% NORWEGIAN GOV'T	1,150,000.00	1,049,260.00	
	2.125% NORWEGIAN GOV'T	400,000.00	350,960.00	
	3.000% NORWEGIAN GOV'T	740,000.00	674,954.00	
	3.500% NORWEGIAN GOV'T	350,000.00	309,085.00	
	3.625% NORWEGIAN GOV'T	800,000.00	757,120.00	
	3.750% NORWEGIAN GOV'T	400,000.00	379,200.00	
	4.125% NORWEGIAN GOV'T	400,000.00	388,200.00	
	銘柄数：9	5,970,000.00	5,404,724.00	
小計			(92,366,733)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	0.000%KINGDOM OF DENMARK	700,000.00	608,020.00	
	0.250%KINGDOM OF DENMARK	890,000.00	422,750.00	
	0.500%KINGDOM OF DENMARK	690,000.00	671,991.00	
	0.500%KINGDOM OF DENMARK	590,000.00	551,650.00	
	2.250%KINGDOM OF DENMARK	530,000.00	510,443.00	

小計	4.500% KINGDOM OF DENMARK	1,370,000.00	1,580,295.00	
	銘柄数：6	4,770,000.00	4,345,149.00	
	組入時価比率：0.2%		(107,412,083)	0.2%
ポーランドズロチ	1.250% POLAND GOV'T	640,000.00	542,784.00	
	1.750% POLAND GOV'T	860,000.00	702,448.00	
	2.500% POLAND GOV'T	640,000.00	626,688.00	
	2.750% POLAND GOV'T	1,040,000.00	1,005,056.00	
	2.750% POLAND GOV'T	1,200,000.00	1,118,520.00	
	4.500% POLAND GOV'T	1,050,000.00	1,025,010.00	
	4.500% POLAND GOV'T	300,000.00	290,700.00	
	5.000% POLAND GOV'T	660,000.00	658,746.00	
	5.000% POLAND GOV'T	540,000.00	515,916.00	
	5.000% POLAND GOV'T	550,000.00	519,585.00	
	5.750% POLAND GOV'T	500,000.00	512,100.00	
	6.000% POLAND GOV'T	840,000.00	860,832.00	
	7.500% POLAND GOV'T	600,000.00	633,720.00	
小計	銘柄数：13	9,420,000.00	9,012,105.00	
	組入時価比率：0.7%		(392,268,993)	0.7%
オーストラリアドル	1.000% AUSTRALIAN GOV'T	150,000.00	127,286.55	
	1.000% AUSTRALIAN GOV'T	410,000.00	336,144.24	
	1.250% AUSTRALIAN GOV'T	450,000.00	367,748.55	
	1.500% AUSTRALIAN GOV'T	180,000.00	153,985.86	
	1.750% AUSTRALIAN GOV'T	380,000.00	315,341.10	
	1.750% AUSTRALIAN GOV'T	260,000.00	128,469.64	
	2.250% AUSTRALIAN GOV'T	340,000.00	324,115.20	
	2.500% AUSTRALIAN GOV'T	470,000.00	433,293.00	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	330,000.00	320,590.71	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	120,000.00	114,534.60	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	250,000.00	234,539.50	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	300,000.00	251,260.80	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	300,000.00	224,490.00	
	3.000% AUSTRALIAN GOV'T	360,000.00	317,652.48	
	3.000% AUSTRALIAN GOV'T	250,000.00	175,650.00	
	3.25% AUSTRALIAN GOV'T	160,000.00	131,148.00	
	3.250% AUSTRALIAN GOV'T	370,000.00	355,658.43	
	3.500% AUSTRALIAN GOV'T	370,000.00	332,457.95	
	3.750% AUSTRALIAN GOV'T	290,000.00	267,709.44	
	3.750% AUSTRALIAN GOV'T	320,000.00	284,320.00	
	4.250% AUSTRALIAN GOV'T	80,000.00	76,413.44	
	4.250% AUSTRALIAN GOV'T	240,000.00	226,235.28	
	4.250% AUSTRALIAN GOV'T	230,000.00	216,433.45	
	4.500% AUSTRALIAN GOV'T	310,000.00	303,797.83	

小計				
	4.750% AUSTRALIAN GOV'T	180,000.00	174,899.70	
	銘柄数：25	7,100,000.00	6,194,175.75 (707,312,928)	
	組入時価比率：1.3%		1.3%	
ニュージーランド ドル	1.500% NEW ZEALAND GV'T	140,000.00	122,914.12	
	1.750% NEW ZEALAND GV'T	80,000.00	52,265.52	
	2.000% NEW ZEALAND GV'T	200,000.00	175,136.00	
	2.750% NEW ZEALAND GV'T	100,000.00	82,599.40	
	2.750% NEW ZEALAND GV'T	150,000.00	97,498.80	
	3.000% NEW ZEALAND GV'T	300,000.00	292,739.10	
	3.500% NEW ZEALAND GV'T	240,000.00	226,407.84	
	4.250% NEW ZEALAND GV'T	50,000.00	48,994.95	
	4.250% NEW ZEALAND GV'T	120,000.00	115,544.04	
	4.500% NEW ZEALAND GV'T	220,000.00	223,563.34	
	4.500% NEW ZEALAND GV'T	220,000.00	217,754.02	
	銘柄数：11	1,820,000.00	1,655,417.13 (154,599,405)	
小計	組入時価比率：0.3%		0.3%	
シンガポールドル	1.625% SINGAPORE GOV'T	50,000.00	49,475.00	
	1.875% SINGAPORE GOV'T	130,000.00	125,255.00	
	2.250% SINGAPORE GOV'T	30,000.00	30,687.00	
	2.625% SINGAPORE GOV'T	140,000.00	142,828.00	
	2.625% SINGAPORE GOV'T	70,000.00	72,877.00	
	2.750% SINGAPORE GOV'T	90,000.00	95,067.00	
	2.750% SINGAPORE GOV'T	140,000.00	152,768.00	
	2.750% SINGAPORE GOV'T	190,000.00	211,090.00	
	2.875% SINGAPORE GOV'T	70,000.00	71,904.00	
	2.875% SINGAPORE GOV'T	260,000.00	269,334.00	
	2.875% SINGAPORE GOV'T	90,000.00	94,140.00	
	3.000% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	73,896.00	
	3.250% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	74,370.00	
	3.375% SINGAPORE GOV'T	90,000.00	98,370.00	
	銘柄数：14	1,470,000.00	1,562,061.00 (193,898,631)	
小計	組入時価比率：0.4%		0.4%	
マレーシアリン ギット	2.632% MALAYSIAN GOV'T	350,000.00	338,304.40	
	3.237% MALAYSIAN GOV'T	500,000.00	500,281.00	
	3.502% MALAYSIAN GOV'T	430,000.00	431,945.75	
	3.582% MALAYSIAN GOV'T	400,000.00	402,484.40	
	3.757% MALAYSIAN GOV'T	450,000.00	445,137.75	
	3.828% MALAYSIAN GOV'T	420,000.00	426,914.04	
	3.844% MALAYSIAN GOV'T	940,000.00	957,569.54	
	3.885% MALAYSIAN GOV'T	500,000.00	509,675.00	

小計	3.917% MALAYSIAN GOV'T	350,000.00	341,547.50	
	4.065% MALAYSIAN GOV'T	560,000.00	565,078.64	
	4.180% MALAYSIAN GOV'T	130,000.00	133,904.03	
	4.232% MALAYSIAN GOV'T	200,000.00	208,135.80	
	4.498% MALAYSIAN GOV'T	440,000.00	459,169.48	
	4.696% MALAYSIAN GOV'T	350,000.00	382,735.85	
	4.762% MALAYSIAN GOV'T	600,000.00	652,755.60	
	4.893% MALAYSIAN GOV'T	180,000.00	198,587.70	
	4.935% MALAYSIAN GOV'T	180,000.00	202,433.22	
	銘柄数：17	6,980,000.00	7,156,659.70	
			(287,945,340)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ウォン	1.500% KOREA TREASURY	300,000,000.00	269,598,630.00	
	2.375% KOREA TREASURY	300,000,000.00	290,767,500.00	
	2.625% KOREA TREASURY	100,000,000.00	95,664,330.00	
	2.625% KOREA TREASURY	100,000,000.00	88,892,000.00	
	2.750% KOREA TREASURY	200,000,000.00	164,129,580.00	
	2.875% KOREA TREASURY	100,000,000.00	84,227,370.00	
	3.375% KOREA TREASURY	200,000,000.00	193,774,400.00	
	3.500% KOREA TREASURY	400,000,000.00	364,600,000.00	
	3.625% KOREA TREASURY	500,000,000.00	467,815,000.00	
	3.750% KOREA TREASURY	200,000,000.00	196,003,720.00	
	5.500% KOREA TREASURY	200,000,000.00	206,998,200.00	
	銘柄数：11	2,600,000,000.00	2,422,470,730.00	
			(256,202,926)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
イスラエルシェケル	1.000% ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	506,744.00	
	1.300% ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	348,320.00	
	1.500% ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	318,000.00	
	2.250% ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	638,300.00	
	3.750% ISRAEL FIXED BOND	90,000.00	92,223.00	
	3.750% ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	403,640.00	
	3.750% ISRAEL FIXED BOND	460,000.00	466,440.00	
	3.750% ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	606,580.00	
	4.000% ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	486,000.00	
	4.150% ISRAEL FIXED BOND	100,000.00	103,960.00	
	5.500% ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	434,787.00	
	銘柄数：11	4,560,000.00	4,404,994.00	
			(240,700,325)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
オフショア元	1.320% CHINA GOV'T	7,100,000.00	7,108,285.70	
	1.380% CHINA GOV'T	3,200,000.00	3,201,177.60	
	1.400% CHINA GOV'T	9,000,000.00	9,027,315.00	

1.420% CHINA GOV'T	5,800,000.00	5,814,279.60
1.420% CHINA GOV'T	3,400,000.00	3,405,205.40
1.430% CHINA GOV'T	7,700,000.00	7,721,090.30
1.450% CHINA GOV'T	7,800,000.00	7,817,940.00
1.460% CHINA GOV'T	600,000.00	603,132.60
1.490% CHINA GOV'T	4,500,000.00	4,494,024.00
1.540% CHINA GOV'T	3,500,000.00	3,513,625.50
1.550% CHINA GOV'T	6,600,000.00	6,636,313.20
1.610% CHINA GOV'T	8,100,000.00	8,030,056.50
1.620% CHINA GOV'T	5,300,000.00	5,316,689.70
1.630% CHINA GOV'T	1,500,000.00	1,511,256.00
1.660% CHINA GOV'T	7,100,000.00	7,139,390.80
1.670% CHINA GOV'T	5,800,000.00	5,767,369.20
1.740% CHINA GOV'T	400,000.00	405,428.80
1.750% CHINA GOV'T	4,000,000.00	4,002,612.00
1.780% CHINA GOV'T	3,500,000.00	3,539,886.00
1.780% CHINA GOV'T	2,800,000.00	2,804,639.60
1.790% CHINA GOV'T	5,100,000.00	5,172,527.10
1.830% CHINA GOV'T	4,400,000.00	4,442,350.00
1.850% CHINA GOV'T	4,500,000.00	4,527,090.00
1.870% CHINA GOV'T	3,400,000.00	3,465,320.80
1.910% CHINA GOV'T	8,900,000.00	9,057,521.10
1.920% CHINA GOV'T	1,400,000.00	1,289,295.00
2.050% CHINA GOV'T	5,000,000.00	5,103,160.00
2.110% CHINA GOV'T	5,400,000.00	5,563,371.60
2.120% CHINA GOV'T	4,500,000.00	4,642,029.00
2.270% CHINA GOV'T	2,800,000.00	2,919,386.40
2.280% CHINA GOV'T	3,700,000.00	3,839,978.40
2.350% CHINA GOV'T	6,500,000.00	6,814,411.50
2.370% CHINA GOV'T	2,200,000.00	2,262,785.80
2.380% CHINA GOV'T	700,000.00	716,030.00
2.400% CHINA GOV'T	5,300,000.00	5,416,191.90
2.440% CHINA GOV'T	3,900,000.00	3,967,727.40
2.500% CHINA GOV'T	7,700,000.00	7,818,911.10
2.520% CHINA GOV'T	5,000,000.00	5,293,005.00
2.540% CHINA GOV'T	2,600,000.00	2,728,213.80
2.550% CHINA GOV'T	6,600,000.00	6,810,236.40
2.600% CHINA GOV'T	5,300,000.00	5,566,187.20
2.600% CHINA GOV'T	1,300,000.00	1,389,144.90
2.620% CHINA GOV'T	3,700,000.00	3,793,728.40
2.620% CHINA GOV'T	5,100,000.00	5,318,295.30
2.620% CHINA GOV'T	3,100,000.00	3,253,428.30
2.640% CHINA GOV'T	4,900,000.00	5,011,190.80

小計	2.670% CHINA GOV'T	5,000,000.00	5,344,055.00	
	2.670% CHINA GOV'T	2,800,000.00	3,001,297.60	
	2.680% CHINA GOV'T	2,300,000.00	2,417,746.20	
	2.690% CHINA GOV'T	2,800,000.00	2,987,096.00	
	2.750% CHINA GOV'T	1,900,000.00	1,983,581.00	
	2.750% CHINA GOV'T	2,400,000.00	2,561,078.40	
	2.760% CHINA GOV'T	3,100,000.00	3,315,037.70	
	2.790% CHINA GOV'T	3,100,000.00	3,262,616.70	
	2.800% CHINA GOV'T	3,400,000.00	3,544,493.20	
	2.800% CHINA GOV'T	5,000,000.00	5,270,850.00	
	2.800% CHINA GOV'T	1,700,000.00	1,831,010.50	
	2.880% CHINA GOV'T	1,400,000.00	1,518,087.20	
	2.890% CHINA GOV'T	2,700,000.00	2,911,342.50	
	2.910% CHINA GOV'T	4,100,000.00	4,265,426.80	
	3.000% CHINA GOV'T	3,200,000.00	3,672,889.60	
	3.010% CHINA GOV'T	1,500,000.00	1,553,877.00	
	3.020% CHINA GOV'T	3,300,000.00	3,566,861.10	
	3.190% CHINA GOV'T	3,000,000.00	3,536,370.00	
	3.270% CHINA GOV'T	2,000,000.00	2,178,822.00	
	3.280% CHINA GOV'T	2,700,000.00	2,796,832.80	
	3.320% CHINA GOV'T	1,900,000.00	2,278,928.40	
	3.390% CHINA GOV'T	5,500,000.00	6,582,983.00	
	3.530% CHINA GOV'T	2,500,000.00	3,093,095.00	
	3.720% CHINA GOV'T	1,700,000.00	2,157,546.50	
	3.810% CHINA GOV'T	1,500,000.00	1,923,700.50	
	3.860% CHINA GOV'T	2,500,000.00	3,195,655.00	
	銘柄数：72	283,700,000.00	294,792,514.40	
			(6,877,008,213)	
	組入時価比率：12.6%		12.8%	
	合計			53,884,152,928 (53,884,152,928)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2026年 5月29日現在です。

【日立バランスファンド（株式７０）】

【純資産額計算書】

I 資産総額	51,303,541,647円
II 負債総額	44,445,811円
III 純資産総額（I－II）	51,259,095,836円
IV 発行済口数	9,950,007,312口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	5.1517円
（1万口当たり純資産額）	（51,517円）

【日立バランスファンド（株式５０）】

【純資産額計算書】

I 資産総額	31,657,672,661円
II 負債総額	25,296,916円
III 純資産総額（I－II）	31,632,375,745円
IV 発行済口数	9,035,359,366口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.5010円
（1万口当たり純資産額）	（35,010円）

【日立バランスファンド（株式３０）】

【純資産額計算書】

I 資産総額	8,875,925,629円
II 負債総額	13,746,958円
III 純資産総額（I－II）	8,862,178,671円
IV 発行済口数	3,847,263,899口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.3035円
（1万口当たり純資産額）	（23,035円）

（参考）

日立国内株式TOP I Xインデックスマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	99,211,263,726円
II 負債総額	281,035,518円
III 純資産総額（I－II）	98,930,228,208円
IV 発行済口数	20,050,420,902口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.9341円
（1万口当たり純資産額）	（49,341円）

日立国内債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	62,255,688,537円
II 負債総額	1,983,605,700円
III 純資産総額（I－II）	60,272,082,837円
IV 発行済口数	50,505,234,913口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1934円
（1万口当たり純資産額）	（11,934円）

日立外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	167,894,543,767円
II 負債総額	67,775,046円
III 純資産総額（I－II）	167,826,768,721円
IV 発行済口数	17,734,256,674口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	9.4634円
（1万口当たり純資産額）	（94,634円）

日立外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	55,239,176,981円
II 負債総額	400,000円
III 純資産総額（I－II）	55,238,776,981円
IV 発行済口数	16,823,627,319口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.2834円
（1万口当たり純資産額）	（32,834円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- （1）名義書換
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行わないものとしします。
- （2）受益者に対する特典
該当事項はありません。
- （3）譲渡制限の内容
 - ① 譲渡制限はありません。
 - ② 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します。
 - ・前述の申請のある場合には、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します。ただし、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。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、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なわれるよう通知するものとしします。
 - ・前述の振替について、委託会社は、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などにおいて、委託会社が必要と認めた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。
 - ③ 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、委託会社および受託会社に対抗することができません。

- (4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- (5) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律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。
- (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
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かかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令など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) 資本金の額（2026年5月末現在）

資本金の額	： 1億円
発行可能株式総数	： 24,000株
発行済株式総数	： 6,000株
過去5年間ににおける主な資本金の増減	： ありません。

(2) 委託会社の機構（2026年5月末現在）

① 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。

② 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、全社の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を協議し、決定します。

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

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

運用状況の評価のため、リスク管理オフィサーを議長とし、取締役社長、コンプライアンスオフィサー、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。

2026年5月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

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	296,438
	私募	11	562,797
合計		18	859,235

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（2025年4月1日から2026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26期	第27期
(2025年3月31日現在)	(2026年3月31日現在)

資産の部

流動資産

現金及び預金		950		1,063
未収委託者報酬		277,578		296,296
未収運用受託報酬		1,377		587
関係会社預け金	※2	1,648,987	※2	1,840,442
前払費用		43,330		45,825
その他		1,795		1,088
流動資産合計		1,974,018		2,185,302

固定資産

有形固定資産

建物	※1	25,287	※1	23,173
工具器具備品	※1	1,739	※1	1,320
有形固定資産合計		27,027		24,493

無形固定資産

ソフトウェア		43		0
無形固定資産合計		43		0

投資その他の資産

繰延税金資産		41,769		41,778
その他		151		112
投資その他の資産合計		41,921		41,891

固定資産合計

		68,992		66,384
--	--	--------	--	--------

資産合計

		2,043,011		2,251,687
--	--	-----------	--	-----------

(単位：千円)

	第26期	第27期
	(2025年3月31日現在)	(2026年3月31日現在)

負債の部

流動負債

未払金	※2※4	57,980	※2※4	73,451
未払費用		441,331		499,373
未払法人税等	※3	30,251	※3	45,833
預り金		4,088		3,199
賞与引当金		28,984		26,956
流動負債合計		562,635		648,814

固定負債

退職給付引当金		85,150		86,781
資産除去債務		15,625		15,719
固定負債合計		100,775		102,500

負債合計

		663,411		751,314
--	--	---------	--	---------

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	1,004,600	1,125,372
利益剰余金合計	1,079,600	1,200,372
株主資本合計	1,379,600	1,500,372
純資産合計	1,379,600	1,500,372
負債純資産合計	2,043,011	2,251,687

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第26期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）	第27期 （自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	1,230,456	1,259,822
運用受託報酬	420,621	517,791
営業収益計	1,651,077	1,777,613
営業費用		
支払手数料	847,887	865,269
委託計算費	72,316	71,521
調査費	247,268	250,058
営業雑経費		
通信費	2,547	2,581
印刷費	1,622	1,617
諸会費	3,990	3,760
営業雑経費計	8,160	7,960
営業費用計	1,175,632	1,194,809
一般管理費		
給料		
役員報酬	20,140	18,122
給料・手当	135,537	145,875
賞与	4,057	3,428
給料計	159,736	167,425
交際費	447	636
旅費交通費	58	2,042
租税公課	1,064	1,065
不動産賃借料	35,847	37,640
賞与引当金繰入額	53,998	48,974
退職給付費用	5,290	7,417
業務委託費	64,399	80,127
その他の人件費	32,474	32,797
その他の不動産関係費	865	969
減価償却費	2,523	2,388
諸雑費	9,794	12,410
一般管理費計	※1 366,500	※1 393,895
営業利益	108,944	188,908
営業外収益		
受取利息	1,208	3,858
その他	85	93
営業外収益計	※1 1,293	※1 3,951
営業外費用		

その他	143	2,058
営業外費用合計	143	2,058
経常利益	110,094	190,801
税引前当期純利益	110,094	190,801
法人税等	※2 41,868	※2 70,037
法人税等調整額	△2,274	△8
法人税等合計	39,593	70,029
当 期 純 利 益	70,500	120,772

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

(単位：千円)

	株 主 資 本							純資産合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金			株主資本 合計	
		その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金	利益剰余金 合計		
					繰越 利益剰余金			
当期首残高	100,000	200,000	200,000	75,000	934,099	1,009,099	1,309,099	1,309,099
当期変動額								
当期純利益					70,500	70,500	70,500	70,500
当期変動額合計	—	—	—	—	70,500	70,500	70,500	70,500
当期末残高	100,000	200,000	200,000	75,000	1,004,600	1,079,600	1,379,600	1,379,600

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

(単位：千円)

	株 主 資 本							純資産合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金			株主資本 合計	
		その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金	利益剰余金 合計		
					繰越 利益剰余金			
当期首残高	100,000	200,000	200,000	75,000	1,004,600	1,079,600	1,379,600	1,379,600
当期変動額								
当期純利益					120,772	120,772	120,772	120,772
当期変動額合計	—	—	—	—	120,772	120,772	120,772	120,772
当期末残高	100,000	200,000	200,000	75,000	1,125,372	1,200,372	1,500,372	1,500,372

重要な会計方針

1. 固定資産の減価償却の方法	(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 (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
-----------------	--

2. 引当金の計上基準	(1)賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち、当期の負担額を計上しております。 (2)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、計上しております。
3. 収益及び費用の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 (1) 投資助言業務収益 投資助言業務は、投資顧問（助言）契約に基づき、有価証券の価値等または金融商品の価値等の分析に基づく投資判断に関し、顧客のために助言を行う業務です。当該契約については、一定期間にわたり履行義務が充足されると判断し、契約期間を通して収益として認識しております。 (2) 投資一任業務収益 投資一任業務は、投資一任契約に基づき、金融商品の価値等の分析に基づく投資判断に基づいて顧客の財産を投資運用する業務です。当該契約については、一定期間にわたり履行義務が充足されると判断し、運用期間にわたり収益を認識しております。 (3) 投信委託者報酬 投信委託者報酬は、投資信託の運営・管理を行い、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識されます。当該契約については、一定期間にわたり履行義務が充足されると判断し、運用期間にわたり収益を認識しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

第26期 (2025年3月31日現在)	第27期 (2026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。 <table> <tr> <td>建物</td><td>6,140千円</td></tr> <tr> <td>工具器具備品</td><td>682千円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額</td><td>6,822千円</td></tr> </table>	建物	6,140千円	工具器具備品	682千円	減価償却累計額	6,822千円	※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。 <table> <tr> <td>建物</td><td>8,255千円</td></tr> <tr> <td>工具器具備品</td><td>849千円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額</td><td>9,105千円</td></tr> </table>	建物	8,255千円	工具器具備品	849千円	減価償却累計額	9,105千円
建物	6,140千円												
工具器具備品	682千円												
減価償却累計額	6,822千円												
建物	8,255千円												
工具器具備品	849千円												
減価償却累計額	9,105千円												
※2. 関係会社に対する資産及び負債 <table> <tr> <td>関係会社預け金</td><td>1,648,987千円</td></tr> <tr> <td>未払金</td><td>11,277千円</td></tr> </table>	関係会社預け金	1,648,987千円	未払金	11,277千円	※2. 関係会社に対する資産及び負債 <table> <tr> <td>関係会社預け金</td><td>1,840,442千円</td></tr> <tr> <td>未払金</td><td>21,598千円</td></tr> </table>	関係会社預け金	1,840,442千円	未払金	21,598千円				
関係会社預け金	1,648,987千円												
未払金	11,277千円												
関係会社預け金	1,840,442千円												
未払金	21,598千円												
※3. 未払法人税等の内訳 <table> <tr> <td>未払法人税</td><td>19,645千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>8,410千円</td></tr> <tr> <td>未払住民税</td><td>2,195千円</td></tr> </table>	未払法人税	19,645千円	未払事業税	8,410千円	未払住民税	2,195千円	※3. 未払法人税等の内訳 <table> <tr> <td>未払法人税</td><td>30,260千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>12,416千円</td></tr> <tr> <td>未払住民税</td><td>3,155千円</td></tr> </table>	未払法人税	30,260千円	未払事業税	12,416千円	未払住民税	3,155千円
未払法人税	19,645千円												
未払事業税	8,410千円												
未払住民税	2,195千円												
未払法人税	30,260千円												
未払事業税	12,416千円												
未払住民税	3,155千円												
※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26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)								
※1. 関係会社との取引高 <table> <tr> <td>一般管理費</td><td>51,196千円</td></tr> <tr> <td>営業外収益</td><td>1,247千円</td></tr> </table>	一般管理費	51,196千円	営業外収益	1,247千円	※1. 関係会社との取引高 <table> <tr> <td>一般管理費</td><td>57,219千円</td></tr> <tr> <td>営業外収益</td><td>3,869千円</td></tr> </table>	一般管理費	57,219千円	営業外収益	3,869千円
一般管理費	51,196千円								
営業外収益	1,247千円								
一般管理費	57,219千円								
営業外収益	3,869千円								
※2. 法人税等には、住民税及び事業税を含んでおります。	※2. 同左								

(株主資本等変動計算書関係)

第26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026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)

第26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(金融商品関係)

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組み方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組み方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026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26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

第26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026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 85,150千円（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 92,289 千円 退職給付費用 5,290 退職給付の支払額 12,429 退職給付債務の期末残高 85,150 (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 85,150 千円 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 85,150 退職給付引当金 85,150 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 85,150 (3)退職給付費用 退職給付費用 5,290 千円	2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 86,781千円（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 85,150 千円 退職給付費用 5,428 退職給付の支払額 3,798 退職給付債務の期末残高 86,781 (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 86,781 千円 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 86,781 退職給付引当金 86,781 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 86,781 (3)退職給付費 退職給付費用 5,428 千円

(税効果会計関係)

第26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)
--	--

1. 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 (繰延税金資産)			1. 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 (繰延税金資産)		
賞与引当金	10,025	千円	賞与引当金	8,496	千円
退職給付引当金	26,839		退職給付引当金	27,353	
資産除去債務	4,925		資産除去債務	4,954	
未払社会保険料	1,543		未払社会保険料	1,189	
未払事業税	2,909		未払事業税	3,913	
その他	352		その他	376	
繰延税金資産小計	46,595		繰延税金資産小計	46,285	
税務上の繰越欠損金に係る 評価性引当金	—		税務上の繰越欠損金に係る 評価性引当金	—	
将来減算一時差異等の合計に 係る評価性引当額	△931		将来減算一時差異等の合計に 係る評価性引当額	△936	
評価性引当額小計	△931		評価性引当額小計	△936	
繰延税金資産合計	45,663		繰延税金資産合計	45,348	
(繰延税金負債)			(繰延税金負債)		
資産除去債務に対応する 除去費用	3,893		資産除去債務に対応する 除去費用	3,569	
未収還付事業税	—		未収還付事業税	—	
繰延税金負債合計	3,893		繰延税金負債合計	3,569	
繰延税金資産合計	41,769		繰延税金資産合計	41,778	
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率 との差異要因			2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率 との差異要因		
	(%)			(%)	
法定実効税率	34.6		法定実効税率	34.6	
(調整)			(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.3		交際費等永久に損金に算入されない項目	1.8	
その他	△1.0		その他	0.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.9		税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7	
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			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		
当社は、グループ通算制度を適用しており、「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。			当社は、グループ通算制度を適用しており、「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。		
4. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税 金負債の金額の修正			4. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税 金負債の金額の修正		
税法の改正に伴い、2026年4月1日以降に開始する事業 年度以降に解消が見込まれる一時差異等に係る繰延税 金資産及び繰延税金負債については、法定実効税率を 30.6%から31.5%に変更し計算しております。 なお、この税率変更による当事業年度の財務諸表への 影響は軽微であります。			税法の改正に伴い、2026年4月1日以降に開始する事業 年度以降に解消が見込まれる一時差異等に係る繰延税 金資産及び繰延税金負債については、法定実効税率を 30.6%から31.5%に変更し計算しております。 なお、この税率変更による当事業年度の財務諸表への 影響は軽微であります。		

(ストックオプション等関係)

第26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026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26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026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26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)												
1. 当該資産除去債務の概要 当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。	1. 当該資産除去債務の概要 当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。												
2. 当該資産除去債務の金額算定方法 資産除去債務の金額は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。	2. 当該資産除去債務の金額算定方法 資産除去債務の金額は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。												
3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減 <table> <tr> <td>期首残高</td> <td>15,531千円</td> </tr> <tr> <td>時の経過による調整額</td> <td>93千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td>15,625千円</td> </tr> </table>	期首残高	15,531千円	時の経過による調整額	93千円	期末残高	15,625千円	3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減 <table> <tr> <td>期首残高</td> <td>15,625千円</td> </tr> <tr> <td>時の経過による調整額</td> <td>94千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td>15,719千円</td> </tr> </table>	期首残高	15,625千円	時の経過による調整額	94千円	期末残高	15,719千円
期首残高	15,531千円												
時の経過による調整額	93千円												
期末残高	15,625千円												
期首残高	15,625千円												
時の経過による調整額	94千円												
期末残高	15,719千円												

(収益認識に関する注記)

第26期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第27期 (自 2025年4月 1日 至 2026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 投資運用業	セグメント 投資運用業
主要な財又はサービスのライン 投資助言業務収益 100,000千円 投資一任業務収益 320,621千円 投信委託者報酬 1,230,456千円	主要な財又はサービスのライン 投資助言業務収益 120,000千円 投資一任業務収益 397,791千円 投信委託者報酬 1,259,822千円
合計 1,651,077千円	合計 1,777,613千円
収益認識の時期 一時点で移転される財 — 一定の期間にわたり移転 されるサービス 1,651,077千円	収益認識の時期 一時点で移転される財 — 一定の期間にわたり移転 されるサービス 1,777,613千円
合計 1,651,077千円	合計 1,777,613千円
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. 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。

(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しております。

履行義務は契約期間にわたり充足されると判断しておりますが、これは顧客は当社が投資一任業務を行うことにより便益を享受することができ、投資運用業務は契約期間にわたって継続して行うことから、契約期間の経過に伴い義務を履行していると判断しているためです。

投資一任業務に関する取引の対価は、1年間の運用期間満了後、概ね1か月以内に受領しており、履行義務を充足してから対価を受領するまでの期間が通常は1年以内であるため、当該顧客との契約に基づく債権について、重大な金融要素の調整は行っておりません。

(3) 投信委託者報酬

投信委託者報酬は、投資信託の運営・管理を行う業務です。

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

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

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

(セグメント情報等)

前事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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

① 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。

② 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）	259,052
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	253,581
日立国内債券特化型ファンド（大口）	219,796

（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 2025年4月1日 至 2026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

① 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。

② 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	338,634
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	303,363
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	287,448
日立国内債券特化型ファンド（大口）	226,813

（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 2024年4月1日 至 2025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	464,384百万円	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	8,501	未払金	8,501
								預け金の利息	1,207	未収入金	—
								賃借料等の支払い	36,713		
								親会社に対する預け金の増加	1,775,528	関係会社預け金	1,648,987
								親会社に対する預け金の減少	1,703,312		

（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。
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）

当事業年度（自 2025年4月1日 至 2026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	464,384百万円	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	16,103	未払金	16,103
								預け金の利息	3,856	未収入金	—
								賃借料等の支払い	38,609		
								親会社に対する預け金の増加	1,894,098	関係会社預け金	1,840,442
								親会社に対する預け金の減少	1,702,643		

（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。
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26期	第27期
------	------

（自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）	（自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日）
1株当たり純資産額 229,933円37銭 1株当たり当期純利益 11,750円14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 250,062円13銭 1株当たり当期純利益 20,128円75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 70,500千円 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 70,500千円 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 120,772千円 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 120,772千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

（重要な後発事象）

第26期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）	第27期 （自 2025年4月 1日 至 2026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】

委託会社は、「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）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、また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なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、また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）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社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。）または子法人等（委託会社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または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- （4）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- （5）上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、もしくは取引の公正を害し、また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
委託会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
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名 称	資本金の額 (2026年3月末現在)	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に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞

- 名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
 資本金の額 : 10,000百万円（2026年3月末現在）
 事業の内容 : 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に基づき信託業務を営んでいます。
 再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2026年3月末現在)	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に基づき信託業務を営んでいます。

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額 (2026年5月末現在)	事業の内容
野村アセットマネジメント株式会社	17,180百万円 (2026年6月末現在)	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社	310百万円	
三菱UFJアセットマネジメント株式会社	2,000百万円	

2【関係業務の概要】

- (1) 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。
- (3) 投資顧問会社
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】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。
- (3) 投資顧問会社
該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2025年 8月15日	有価証券届出書
2025年 8月15日	有価証券報告書
2026年 2月13日	有価証券届出書
2026年 2月13日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2026年5月27日

日立投資顧問株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 清野 竜
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2025年4月1日から2026年3月31日までの第27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2026年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継

続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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

2026年7月30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 長澤 茂宣
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式70）の2025年5月16日から2026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、日立バランスファンド（株式70）の2026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）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

2026年7月30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 長澤 茂宣
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式50）の2025年5月16日から2026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、日立バランスファンド（株式50）の2026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）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

2026年7月30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 長澤 茂宣
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式30）の2025年5月16日から2026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、日立バランスファンド（株式30）の2026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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。