



日立国内債券インデックスファンド

運用報告書(全体版)

第14期

(決算日 2015年5月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、日立国内債券インデックスファンドは、このたび、第14期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	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、中長期的に投資信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	日立国内債券インデックスファンド	次の日立国内債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日立国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日立国内債券インデックスファンド	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内、外貨建資産は、10%以内とします。
	日立国内債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内、外貨建資産は、10%以内とします。
分配方針	期中には分配を行わず、投資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。	

◎ 日立投資顧問株式会社

東京都千代田区神田練塀町3番地

〈運用報告書(全体版)に関するお問い合わせ先〉

企画総務グループ TEL : (03) 4554-5100

(受付時間 : 9 : 00 ~ 17 : 00 土、日、祝日除く)

ホームページアドレス <http://www.hitachi-im.co.jp/>

日立国内債券インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合指数		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率		騰落率			
10期(2011年5月16日)	11,248	1.6	331.43	1.8	99.0	—	百万円 9,464
11期(2012年5月15日)	11,548	2.7	341.01	2.9	98.5	—	11,153
12期(2013年5月15日)	11,635	0.8	344.21	0.9	101.8	—	10,658
13期(2014年5月15日)	11,942	2.6	353.85	2.8	98.8	—	12,048
14期(2015年5月15日)	12,226	2.4	362.96	2.6	99.4	—	12,909

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合指数		債券組入率	債券先物率
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2014年 5月15日	11,942	—	353.85	—	98.8	—
5月末	11,958	0.1	354.39	0.2	101.9	—
6月末	11,992	0.4	355.41	0.4	100.4	—
7月末	12,010	0.6	356.01	0.6	100.0	—
8月末	12,047	0.9	357.15	0.9	101.2	—
9月末	12,053	0.9	357.41	1.0	101.2	—
10月末	12,107	1.4	359.08	1.5	99.5	—
11月末	12,177	2.0	361.19	2.1	99.5	—
12月末	12,303	3.0	364.96	3.1	99.5	—
2015年 1月末	12,304	3.0	365.07	3.2	99.3	—
2月末	12,235	2.5	363.04	2.6	99.4	—
3月末	12,241	2.5	363.28	2.7	100.0	—
4月末	12,278	2.8	364.50	3.0	99.6	—
(期末) 2015年 5月15日	12,226	2.4	362.96	2.6	99.4	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

《当期中の運用経過》

【期中の基準価額等の推移】

基準価額とベンチマークの推移



*期首を100として指数化

【基準価額の主な変動要因】

〈上昇要因〉

2014年10月末に日銀が追加金融緩和政策を実施したことがプラスに影響しました。

〈下落要因〉

2015年1月半ばに日銀の追加緩和に対する過度な期待が後退したことや、長期・超長期債の入札が不調となりこれらへの需給懸念が浮上した事がマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2014年5月15日	2015年1月19日	2014年5月15日	2015年5月15日
基準価額	11,942円	12,417円	11,942円	12,226円

【当ファンドのベンチマークとの差異】

当ファンドの基準価額は前期末の11,942円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、12,226円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は+2.4%となり、ベンチマーク騰落率+2.6%にほぼ追従したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となりました。

【投資環境】

当期の10年国債利回りは、日銀による国債買入が継続的に需給を下支えした結果、徐々に水準を切り

下げ低下しました。2014年10月末には日銀が追加金融緩和を決定し、国債買入額が一段と増額されたことから、10年国債利回りに更なる低下圧力がかかりました。2015年1月には、原油価格下落を受けてグローバルに新興国の景気減速懸念や期待インフレ率の低下が生じた結果、10年国債利回りは過去最低を記録しました。しかし、その後は低水準の利回りに対する投資家の慎重姿勢が国債入札の不調によって確認されたことをきっかけに、変動性を高めながら利回りは上昇へ転じました。4月に入ると長期・超長期債への需給不安が後退したことなどから金利低下しましたが、4月後半以降は海外金利の大幅上昇に連れられ再度金利上昇しました。

年限別にみると、長期債利回りの低下が進行するにつれて、金利低下圧力がより長い年限の債券利回りに波及した結果、超長期債利回りには低下圧力がかかりました。2014年10月末の追加金融緩和により日銀が超長期債の購入金額を増額したことも、イールドカーブのフラット化に作用しました。

スプレッド市場は、企業業績の改善と日銀の信用緩和策が下支えとなり堅調な展開となりました。高格付債のスプレッド縮小余地が乏しくなる中で、スプレッドの残る中格付が縮小の中心となりました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで+2.6%の上昇となりました。

【当ファンドのポートフォリオ】

〈当ファンド〉

日立国内債券インデックスマザーファンドへの投資を高位に保つ運用を行いました。

〈日立国内債券インデックスマザーファンド〉

わが国の公社債を主要投資対象とします。具体的には、NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとし、ベンチマーク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した。

【今後の運用方針】

当ファンドはパッシブファンドのため、ベンチマークのNOMURA-BPI総合指数に追従する運用を継続してまいります。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2014.5.16~2015.5.15)		
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	17円	0.140%	信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,142円です。
（投 信 会 社）	(8)	(0.065)	委託した資金の運用の対価
（販 売 会 社）	(5)	(0.043)	交付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）	(4)	(0.032)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
合 計	17	0.140	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2014年5月16日から2015年5月15日まで)

ファンド名称	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日立国内債券 インデックス マザーファンド	1,413,900	1,853,400	994,040	1,308,480

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2014年5月16日から2015年5月15日まで)

公社債(日立国内債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第339回 利付国債(2年)	1,800,691	第339回 利付国債(2年)	1,801,476
第117回 利付国債(5年)	1,528,354	第296回 利付国債(10年)	1,025,833
第346回 利付国債(2年)	1,401,582	第93回 利付国債(5年)	854,420
第305回 利付国債(10年)	1,049,806	第89回 利付国債(5年)	852,881
第120回 利付国債(5年)	932,804	第96回 利付国債(5年)	753,840
第118回 利付国債(5年)	851,629	第291回 利付国債(10年)	729,486
第334回 利付国債(10年)	808,000	第91回 利付国債(5年)	702,527
第307回 利付国債(10年)	786,560	第273回 利付国債(10年)	609,096
第106回 利付国債(5年)	753,355	第92回 利付国債(5年)	601,542
第72回 利付国債(20年)	728,976	第90回 利付国債(5年)	601,422

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2014年5月16日から2015年5月15日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細(2015年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日立国内債券インデックスマザーファンド	9,315,650	9,735,510	12,895,656

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2015年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日立国内債券インデックスマザーファンド	12,895,656	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	36,833	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	12,932,489	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2015年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	12,932,489,277円
コール・ローン等	36,832,431
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	12,895,656,836
未 収 利 息	10
(B) 負 債	22,555,059
未 払 解 約 金	13,469,865
未 払 信 託 報 酬	9,085,194
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	12,909,934,218
元 本	10,559,055,539
次 期 繰 越 損 益 金	2,350,878,679
(D) 受 益 権 総 口 数	10,559,055,539口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,226円

(注1) 当ファンドの期首元本額は10,089,212,079円、期中追加設定元本額は3,157,122,869円、期中一部解約元本額は2,687,279,409円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,2226円です。

■損益の状況

当期(自2014年5月16日 至2015年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,264円
受 取 利 息	4,264
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	264,976,744
売 買 益	321,587,530
売 買 損	△ 56,610,786
(C) 信 託 報 酬 等	△ 17,963,086
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	247,017,922
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	518,905,600
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,584,955,157
(配 当 等 相 当 額)	(1,289,576,787)
(売 買 損 益 相 当 額)	(295,378,370)
(G) 計 (D+E+F)	2,350,878,679
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,350,878,679
追 加 信 託 差 損 益 金	1,584,955,157
(配 当 等 相 当 額)	(1,289,576,787)
(売 買 損 益 相 当 額)	(295,378,370)
分 配 準 備 積 立 金	765,923,522

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<お知らせ>

「投資信託及び投資法人に関する法律」ならびに一般社団法人投資信託協会規則の改正に伴い、所要の約款変更を行いました。(適用日：2014年12月1日)

＜補足情報＞

日立国内債券インデックスマザーファンドの組入資産の明細(2015年5月15日現在)

下記は、日立国内債券インデックスマザーファンド全体(107,594,753千口)の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	2015年5月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	102,560,000 (2,570,000)	111,480,045 (2,914,280)	78.2 (2.0)	— (—)	48.7 (2.0)	20.2 (0.1)	9.2 (—)
地 方 債 証 券	9,027,200 (9,027,200)	9,495,262 (9,495,262)	6.7 (6.7)	— (—)	3.5 (3.5)	2.7 (2.7)	0.4 (0.4)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	10,843,822 (10,684,867)	11,471,759 (11,304,409)	8.0 (7.9)	— (—)	4.7 (4.7)	2.3 (2.2)	1.0 (1.0)
金 融 債 証 券	900,000 (900,000)	903,586 (903,586)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.3 (0.3)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	8,200,000 (8,200,000)	8,527,318 (8,527,318)	6.0 (6.0)	— (—)	2.3 (2.3)	3.1 (3.1)	0.6 (0.6)
合 計	131,531,022 (31,382,067)	141,877,971 (33,144,856)	99.5 (23.3)	— (—)	59.3 (12.5)	28.7 (8.4)	11.5 (2.3)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) —印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注6) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアキュムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債銘柄別

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第341回 利付国債(2年)	0.1	350,000	350,413	2016/ 6/15
第342回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,254	2016/ 7/15
第343回 利付国債(2年)	0.1	700,000	700,952	2016/ 8/15
第344回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,290	2016/ 9/15
第346回 利付国債(2年)	0.1	1,400,000	1,402,296	2016/11/15
第 97回 利付国債(5年)	0.4	1,000,000	1,004,510	2016/ 6/20
第 98回 利付国債(5年)	0.3	400,000	401,368	2016/ 6/20
第 99回 利付国債(5年)	0.4	700,000	703,843	2016/ 9/20
第100回 利付国債(5年)	0.3	800,000	803,320	2016/ 9/20
第101回 利付国債(5年)	0.4	800,000	805,208	2016/12/20
第102回 利付国債(5年)	0.3	850,000	854,182	2016/12/20
第103回 利付国債(5年)	0.3	800,000	804,552	2017/ 3/20
第104回 利付国債(5年)	0.2	600,000	602,310	2017/ 3/20
第106回 利付国債(5年)	0.2	1,250,000	1,255,987	2017/ 9/20
第107回 利付国債(5年)	0.2	700,000	703,710	2017/12/20
第108回 利付国債(5年)	0.1	300,000	300,813	2017/12/20
第109回 利付国債(5年)	0.1	500,000	501,485	2018/ 3/20
第110回 利付国債(5年)	0.3	400,000	403,456	2018/ 3/20
第111回 利付国債(5年)	0.4	600,000	606,888	2018/ 3/20
第112回 利付国債(5年)	0.4	600,000	607,500	2018/ 6/20
第113回 利付国債(5年)	0.3	1,000,000	1,009,410	2018/ 6/20
第114回 利付国債(5年)	0.3	500,000	504,925	2018/ 9/20
第115回 利付国債(5年)	0.2	1,050,000	1,056,835	2018/ 9/20
第116回 利付国債(5年)	0.2	1,270,000	1,278,191	2018/12/20
第117回 利付国債(5年)	0.2	1,580,000	1,589,985	2019/ 3/20
第118回 利付国債(5年)	0.2	850,000	855,193	2019/ 6/20
第119回 利付国債(5年)	0.1	300,000	300,609	2019/ 6/20
第120回 利付国債(5年)	0.2	930,000	935,226	2019/ 9/20
第121回 利付国債(5年)	0.1	380,000	380,490	2019/ 9/20
第122回 利付国債(5年)	0.1	380,000	380,345	2019/12/20
第123回 利付国債(5年)	0.1	580,000	580,139	2020/ 3/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	480,000	555,552	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	190,000	217,145	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	300,000	340,938	2031/12/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第148回 利付国債(20年)	1.5	70,000	74,894	2034/ 3/20
第105回 利付国債(5年)	0.2	1,550,000	1,556,634	2017/ 6/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	540,000	668,233	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	340,000	403,376	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	220,000	261,210	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	470,000	558,392	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	400,000	452,824	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	450,000	496,440	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	310,000	323,624	2054/ 3/20
第280回 利付国債(10年)	1.9	470,000	479,790	2016/ 6/20
第281回 利付国債(10年)	2.0	500,000	510,960	2016/ 6/20
第282回 利付国債(10年)	1.7	830,000	849,073	2016/ 9/20
第283回 利付国債(10年)	1.8	450,000	460,944	2016/ 9/20
第284回 利付国債(10年)	1.7	1,000,000	1,027,250	2016/12/20
第285回 利付国債(10年)	1.7	910,000	938,646	2017/ 3/20
第286回 利付国債(10年)	1.8	700,000	726,376	2017/ 6/20
第287回 利付国債(10年)	1.9	390,000	405,510	2017/ 6/20
第288回 利付国債(10年)	1.7	870,000	904,704	2017/ 9/20
第289回 利付国債(10年)	1.5	950,000	987,021	2017/12/20
第290回 利付国債(10年)	1.4	300,000	311,997	2018/ 3/20
第291回 利付国債(10年)	1.3	500,000	518,575	2018/ 3/20
第292回 利付国債(10年)	1.7	170,000	178,245	2018/ 3/20
第293回 利付国債(10年)	1.8	300,000	316,722	2018/ 6/20
第294回 利付国債(10年)	1.7	300,000	315,795	2018/ 6/20
第295回 利付国債(10年)	1.5	400,000	418,588	2018/ 6/20
第297回 利付国債(10年)	1.4	430,000	451,199	2018/12/20
第298回 利付国債(10年)	1.3	950,000	993,424	2018/12/20
第299回 利付国債(10年)	1.3	500,000	524,225	2019/ 3/20
第300回 利付国債(10年)	1.5	400,000	422,444	2019/ 3/20
第301回 利付国債(10年)	1.5	1,000,000	1,059,150	2019/ 6/20
第302回 利付国債(10年)	1.4	280,000	295,419	2019/ 6/20
第303回 利付国債(10年)	1.4	570,000	603,060	2019/ 9/20
第304回 利付国債(10年)	1.3	550,000	579,518	2019/ 9/20
第305回 利付国債(10年)	1.3	1,080,000	1,140,501	2019/12/20
第306回 利付国債(10年)	1.4	700,000	744,324	2020/ 3/20
第307回 利付国債(10年)	1.3	840,000	889,148	2020/ 3/20
第308回 利付国債(10年)	1.3	580,000	615,542	2020/ 6/20
第309回 利付国債(10年)	1.1	710,000	746,316	2020/ 6/20
第310回 利付国債(10年)	1.0	780,000	817,065	2020/ 9/20
第311回 利付国債(10年)	0.8	430,000	445,867	2020/ 9/20
第312回 利付国債(10年)	1.2	1,380,000	1,463,545	2020/12/20
第313回 利付国債(10年)	1.3	800,000	854,704	2021/ 3/20
第314回 利付国債(10年)	1.1	370,000	391,012	2021/ 3/20
第315回 利付国債(10年)	1.2	800,000	851,696	2021/ 6/20
第316回 利付国債(10年)	1.1	600,000	635,340	2021/ 6/20
第317回 利付国債(10年)	1.1	630,000	668,209	2021/ 9/20
第318回 利付国債(10年)	1.0	800,000	843,496	2021/ 9/20
第319回 利付国債(10年)	1.1	300,000	318,696	2021/12/20
第320回 利付国債(10年)	1.0	840,000	886,872	2021/12/20
第321回 利付国債(10年)	1.0	800,000	845,152	2022/ 3/20
第322回 利付国債(10年)	0.9	400,000	419,872	2022/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	400,000	419,860	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	800,000	834,128	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	950,000	989,795	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	400,000	413,712	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	700,000	729,211	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	1,000,000	1,026,100	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	1,000,000	1,041,530	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	800,000	833,216	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	307,572	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	740,000	757,952	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	560,000	573,221	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	380,000	388,705	2024/ 6/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	51,246	2029/ 9/20

銘柄名		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
第4回	利付国債(30年)	2.9	100,000	130,228	2030/11/20
第5回	利付国債(30年)	2.2	5,000	5,997	2031/5/20
第6回	利付国債(30年)	2.4	150,000	184,323	2031/11/20
第7回	利付国債(30年)	2.3	155,000	187,968	2032/5/20
第8回	利付国債(30年)	1.8	45,000	50,895	2032/11/22
第11回	利付国債(30年)	1.7	65,000	72,134	2033/6/20
第12回	利付国債(30年)	2.1	90,000	105,669	2033/9/20
第13回	利付国債(30年)	2.0	70,000	80,908	2033/12/20
第14回	利付国債(30年)	2.4	120,000	146,744	2034/3/20
第15回	利付国債(30年)	2.5	420,000	520,560	2034/6/20
第16回	利付国債(30年)	2.5	380,000	470,842	2034/9/20
第17回	利付国債(30年)	2.4	340,000	414,908	2034/12/20
第18回	利付国債(30年)	2.3	410,000	492,516	2035/3/20
第19回	利付国債(30年)	2.3	460,000	552,634	2035/6/20
第20回	利付国債(30年)	2.5	420,000	519,023	2035/9/20
第21回	利付国債(30年)	2.3	340,000	407,462	2035/12/20
第22回	利付国債(30年)	2.5	550,000	679,365	2036/3/20
第23回	利付国債(30年)	2.5	630,000	778,308	2036/6/20
第24回	利付国債(30年)	2.5	550,000	679,552	2036/9/20
第25回	利付国債(30年)	2.3	260,000	311,441	2036/12/20
第26回	利付国債(30年)	2.4	480,000	584,208	2037/3/20
第27回	利付国債(30年)	2.5	420,000	519,388	2037/9/20
第28回	利付国債(30年)	2.5	520,000	644,051	2038/3/20
第29回	利付国債(30年)	2.4	290,000	353,771	2038/9/20
第30回	利付国債(30年)	2.3	380,000	456,627	2039/3/20
第31回	利付国債(30年)	2.2	320,000	378,496	2039/9/20
第32回	利付国債(30年)	2.3	400,000	481,880	2040/3/20
第33回	利付国債(30年)	2.0	470,000	536,284	2040/9/20
第34回	利付国債(30年)	2.2	410,000	485,587	2041/3/20
第35回	利付国債(30年)	2.0	520,000	593,164	2041/9/20
第36回	利付国債(30年)	2.0	400,000	456,156	2042/3/20
第37回	利付国債(30年)	1.9	400,000	447,056	2042/9/20
第38回	利付国債(30年)	1.8	200,000	218,872	2043/3/20
第39回	利付国債(30年)	1.9	300,000	335,310	2043/6/20
第40回	利付国債(30年)	1.8	350,000	382,672	2043/9/20
第41回	利付国債(30年)	1.7	270,000	288,597	2043/12/20
第42回	利付国債(30年)	1.7	200,000	213,642	2044/3/20
第43回	利付国債(30年)	1.7	280,000	298,905	2044/6/20
第44回	利付国債(30年)	1.7	130,000	138,686	2044/9/20
第33回	利付国債(20年)	3.8	70,000	73,573	2016/9/20
第36回	利付国債(20年)	3.0	70,000	74,921	2017/9/20
第38回	利付国債(20年)	2.7	90,000	96,917	2018/3/20
第39回	利付国債(20年)	2.6	350,000	375,910	2018/3/20
第41回	利付国債(20年)	1.5	40,000	42,252	2019/3/20
第42回	利付国債(20年)	2.6	370,000	406,430	2019/3/20
第43回	利付国債(20年)	2.9	130,000	146,012	2019/9/20
第46回	利付国債(20年)	2.2	60,000	66,418	2020/6/22
第47回	利付国債(20年)	2.2	110,000	122,339	2020/9/21
第48回	利付国債(20年)	2.5	70,000	79,297	2020/12/21
第49回	利付国債(20年)	2.1	60,000	66,910	2021/3/22
第50回	利付国債(20年)	1.9	40,000	44,142	2021/3/22
第51回	利付国債(20年)	2.0	30,000	33,420	2021/6/21
第52回	利付国債(20年)	2.1	65,000	73,054	2021/9/21
第53回	利付国債(20年)	2.1	60,000	67,677	2021/12/20
第54回	利付国債(20年)	2.2	160,000	181,518	2021/12/20
第55回	利付国債(20年)	2.0	100,000	112,446	2022/3/21
第56回	利付国債(20年)	2.0	330,000	371,771	2022/6/20
第57回	利付国債(20年)	1.9	130,000	145,545	2022/6/20
第58回	利付国債(20年)	1.9	340,000	381,531	2022/9/20
第59回	利付国債(20年)	1.7	170,000	188,638	2022/12/20
第60回	利付国債(20年)	1.4	100,000	108,686	2022/12/20
第61回	利付国債(20年)	1.0	140,000	148,012	2023/3/20
第62回	利付国債(20年)	0.8	230,000	239,551	2023/6/20
第63回	利付国債(20年)	1.8	130,000	145,800	2023/6/20

銘	柄	名	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
(国債証券)				%	千円		千円									
第 64回	利付国債(20年)			1.9	110,000			124,470						2023/	9/	20
第 65回	利付国債(20年)			1.9	430,000			488,015						2023/	12/	20
第 66回	利付国債(20年)			1.8	80,000			90,123						2023/	12/	20
第 67回	利付国債(20年)			1.9	650,000			738,881						2024/	3/	20
第 68回	利付国債(20年)			2.2	275,000			319,836						2024/	3/	20
第 69回	利付国債(20年)			2.1	420,000			484,654						2024/	3/	20
第 70回	利付国債(20年)			2.4	520,000			615,238						2024/	6/	20
第 71回	利付国債(20年)			2.2	200,000			233,100						2024/	6/	20
第 72回	利付国債(20年)			2.1	760,000			881,881						2024/	9/	20
第 73回	利付国債(20年)			2.0	620,000			714,574						2024/	12/	20
第 74回	利付国債(20年)			2.1	510,000			592,528						2024/	12/	20
第 75回	利付国債(20年)			2.1	410,000			477,764						2025/	3/	20
第 76回	利付国債(20年)			1.9	440,000			503,888						2025/	3/	20
第 77回	利付国債(20年)			2.0	260,000			300,359						2025/	3/	20
第 78回	利付国債(20年)			1.9	190,000			218,057						2025/	6/	20
第 79回	利付国債(20年)			2.0	100,000			115,738						2025/	6/	20
第 80回	利付国債(20年)			2.1	380,000			443,710						2025/	6/	20
第 81回	利付国債(20年)			2.0	230,000			266,671						2025/	9/	20
第 82回	利付国債(20年)			2.1	280,000			327,423						2025/	9/	20
第 83回	利付国債(20年)			2.1	490,000			573,745						2025/	12/	20
第 84回	利付国債(20年)			2.0	540,000			626,815						2025/	12/	20
第 85回	利付国債(20年)			2.1	300,000			351,867						2026/	3/	20
第 86回	利付国債(20年)			2.3	110,000			131,296						2026/	3/	20
第 87回	利付国債(20年)			2.2	180,000			212,985						2026/	3/	20
第 88回	利付国債(20年)			2.3	180,000			215,280						2026/	6/	20
第 89回	利付国債(20年)			2.2	200,000			236,962						2026/	6/	20
第 90回	利付国債(20年)			2.2	200,000			237,376						2026/	9/	20
第 91回	利付国債(20年)			2.3	60,000			71,898						2026/	9/	20
第 92回	利付国債(20年)			2.1	400,000			470,880						2026/	12/	20
第 93回	利付国債(20年)			2.0	200,000			233,392						2027/	3/	20
第 94回	利付国債(20年)			2.1	200,000			235,756						2027/	3/	20
第 95回	利付国債(20年)			2.3	350,000			421,092						2027/	6/	20
第 96回	利付国債(20年)			2.1	90,000			106,172						2027/	6/	20
第 97回	利付国債(20年)			2.2	340,000			405,528						2027/	9/	20
第 98回	利付国債(20年)			2.1	180,000			212,484						2027/	9/	20
第 99回	利付国債(20年)			2.1	730,000			862,706						2027/	12/	20
第100回	利付国債(20年)			2.2	300,000			358,485						2028/	3/	20
第101回	利付国債(20年)			2.4	310,000			378,076						2028/	3/	20
第102回	利付国債(20年)			2.4	180,000			219,715						2028/	6/	20
第103回	利付国債(20年)			2.3	150,000			181,273						2028/	6/	20
第104回	利付国債(20年)			2.1	200,000			236,690						2028/	6/	20
第105回	利付国債(20年)			2.1	390,000			461,682						2028/	9/	20
第106回	利付国債(20年)			2.2	160,000			191,382						2028/	9/	20
第107回	利付国債(20年)			2.1	150,000			177,711						2028/	12/	20
第108回	利付国債(20年)			1.9	400,000			463,588						2028/	12/	20
第109回	利付国債(20年)			1.9	220,000			255,070						2029/	3/	20
第110回	利付国債(20年)			2.1	220,000			260,990						2029/	3/	20
第111回	利付国債(20年)			2.2	340,000			408,013						2029/	6/	20
第112回	利付国債(20年)			2.1	320,000			379,635						2029/	6/	20
第113回	利付国債(20年)			2.1	410,000			486,383						2029/	9/	20
第114回	利付国債(20年)			2.1	420,000			498,493						2029/	12/	20
第115回	利付国債(20年)			2.2	220,000			264,030						2029/	12/	20
第116回	利付国債(20年)			2.2	500,000			599,990						2030/	3/	20
第117回	利付国債(20年)			2.1	430,000			510,220						2030/	3/	20
第118回	利付国債(20年)			2.0	320,000			374,976						2030/	6/	20
第119回	利付国債(20年)			1.8	170,000			194,456						2030/	6/	20
第123回	利付国債(20年)			2.1	400,000			474,372						2030/	12/	20
第124回	利付国債(20年)			2.0	230,000			269,373						2030/	12/	20
第125回	利付国債(20年)			2.2	550,000			660,077						2031/	3/	20
第126回	利付国債(20年)			2.0	150,000			175,545						2031/	3/	20
第127回	利付国債(20年)			1.9	250,000			288,852						2031/	3/	20
第128回	利付国債(20年)			1.9	650,000			750,301						2031/	6/	20
第129回	利付国債(20年)			1.8	200,000			227,856						2031/	6/	20
第130回	利付国債(20年)			1.8	400,000			455,496						2031/	9/	20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	168,412	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	224,226	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	200,000	227,146	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	200,000	223,882	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	100,000	110,395	2032/ 3/20
第137回 利付国債(20年)	1.7	200,000	223,530	2032/ 6/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	200,000	217,288	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	740,000	825,692	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	300,000	334,161	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	160,000	180,768	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	200,000	219,158	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	200,000	215,952	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	500,000	554,880	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	330,000	365,514	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	450,000	490,018	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	410,000	437,597	2034/ 6/20
第 12回 ポーランド共和国円貨債券(2012)	1.05	100,000	101,706	2017/11/ 8
小 計	—	102,560,000	111,480,045	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
第 10回 東京都公募公債(東京再生都債)	2.31	100,000	116,974	2039/ 9/20
第646回 東京都公募公債	1.99	200,000	208,068	2017/ 6/20
第656回 東京都公募公債	1.51	100,000	104,091	2018/ 3/20
第661回 東京都公募公債	1.6	100,000	105,131	2018/ 9/20
第664回 東京都公募公債	1.4	150,000	157,108	2018/12/20
第707回 東京都公募公債	0.87	100,000	104,419	2022/ 3/18
第708回 東京都公募公債	0.89	100,000	104,540	2022/ 6/20
第710回 東京都公募公債	0.81	100,000	103,982	2022/ 6/20
第727回 東京都公募公債	0.72	100,000	103,003	2023/12/20
第728回 東京都公募公債	0.65	100,000	102,421	2023/12/20
平成22年度第 4回 北海道公募公債	1.28	100,000	105,453	2020/ 6/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	116,092	2025/ 6/20
第145回 神奈川県公募公債	1.8	100,000	103,172	2017/ 3/20
第160回 神奈川県公募公債	1.57	100,000	105,655	2019/ 3/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	102,914	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,204	2024/ 9/20
第 8回 大阪府公募公債(20年)	1.83	100,000	112,307	2031/12/22
第 99回 大阪府公募公債(5年)	0.24	144,000	144,645	2018/10/30
第304回 大阪府公募公債(10年)	1.98	150,200	156,406	2017/ 7/28
第327回 大阪府公募公債(10年)	1.69	100,000	106,326	2019/ 6/28
平成22年度第 5回 京都府公募公債	1.26	100,000	106,016	2020/12/21
平成26年度第 5回 京都府公募公債(20年)	1.455	100,000	104,731	2034/ 8/10
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,043	2029/11/19
平成21年度第 3回 兵庫県公募公債	1.62	100,000	105,942	2019/ 5/22
平成22年度第 8回 静岡県公募公債	1.059	100,000	104,679	2020/ 8/25
平成21年度第 10回 静岡県公募公債	1.4	100,000	106,005	2020/ 3/18
平成24年度第 6回 静岡県公募公債(5年)	0.22	200,000	200,656	2017/ 8/21
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	101,215	2024/10/24
平成21年度第 3回 愛知県公募公債(10年)	1.66	100,000	106,326	2019/ 6/26
平成22年度第 9回 愛知県公募公債(10年)	1.153	100,000	105,269	2020/ 9/30
平成22年度第 11回 愛知県公募公債(10年)	0.932	100,000	104,132	2020/10/29
平成25年度第 9回 愛知県公募公債(10年)	0.849	100,000	104,097	2023/ 7/25
平成26年度第 3回 愛知県公募公債(10年)	0.665	100,000	102,339	2024/ 4/30
平成22年度第 6回 広島県公募公債	1.26	100,000	106,059	2021/ 1/25
平成22年度第 8回 埼玉県公募公債	1.0	47,000	49,134	2020/11/26
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	115,150	2030/11/12
平成23年度第 10回 埼玉県公募公債	0.99	100,000	105,181	2022/ 2/24
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	101,205	2024/ 9/26
平成21年度第 11回 福岡県公募公債	1.44	100,000	106,119	2020/ 2/25
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	106,214	2034/ 5/26
平成18年度第 6回 千葉県公募公債	1.7	100,000	102,591	2016/12/22
平成18年度第 7回 千葉県公募公債	1.8	100,000	103,050	2017/ 2/24
平成20年度第 6回 千葉県公募公債	1.64	130,000	136,992	2018/10/25
平成21年度第 7回 千葉県公募公債	1.33	100,000	105,305	2019/10/25
平成25年度第 3回 千葉県公募公債	0.89	100,000	104,419	2023/ 6/23

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
第 47回 共同発行市場公募地方債	1.8	200,000	206,100	2017/ 2/24
第 50回 共同発行市場公募地方債	1.7	300,000	309,882	2017/ 5/25
第 52回 共同発行市場公募地方債	1.9	106,000	110,250	2017/ 7/25
第 63回 共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	105,624	2018/ 6/25
第 72回 共同発行市場公募地方債	1.46	100,000	105,251	2019/ 3/25
第 75回 共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,240	2019/ 6/25
第 77回 共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	212,072	2019/ 8/23
第 84回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	105,934	2020/ 3/25
第 89回 共同発行市場公募地方債	1.04	100,000	104,580	2020/ 8/25
第 91回 共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,945	2020/10/23
第 94回 共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	106,006	2021/ 1/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,510	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,097	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	207,446	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,798	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	104,583	2023/ 7/25
第125回 共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	207,728	2023/ 8/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,484	2023/11/24
平成24年度第 3回 島根県公募公債	0.13	100,000	100,100	2018/ 3/23
平成21年度第 4回 大阪市公募公債	1.62	200,000	212,502	2019/ 8/20
第467回 名古屋市公募公債(10年)	1.62	100,000	106,116	2019/ 6/20
第475回 名古屋市公募公債(10年)	1.15	100,000	105,783	2021/ 6/18
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	102,442	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	116,168	2025/ 9/19
平成18年度第 3回 京都市公募公債	1.9	100,000	103,233	2017/ 2/27
第 5回 横浜市公募公債	1.265	100,000	106,012	2020/12/11
平成19年度第 3回 横浜市公募公債	1.76	100,000	103,942	2017/ 9/20
平成21年度第 3回 横浜市公募公債	1.4	100,000	105,492	2019/ 9/20
第 25回 横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	110,879	2032/ 7/16
第 81回 川崎市公募公債	1.57	100,000	105,655	2019/ 3/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	100,056	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	101,833	2029/10/22
第 1回 北九州市公募公債(20年)	2.46	100,000	120,224	2026/ 6/19
平成23年度第 5回 広島市公募公債	1.01	100,000	105,212	2022/ 2/25
平成20年度第 1回 千葉市公募公債	1.55	100,000	104,301	2018/ 4/25
小 計	—	9,027,200	9,495,262	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 3回 政府保証原子力損害賠償支援機構債	0.117	100,000	100,192	2018/ 5/23
第 23回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.645	108,000	110,592	2024/ 3/18
第 9回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	110,105	2021/ 3/26
第 30回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	700,000	721,441	2017/ 3/28
第 31回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	100,000	103,732	2017/12/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	128,074	2034/ 6/20
第 38回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.87	100,000	105,435	2018/ 6/20
第 47回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	201,000	208,569	2017/12/27
第 48回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.71	100,000	106,029	2019/ 3/20
第 55回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.22	100,000	118,301	2030/ 2/8
第 60回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	105,464	2018/ 6/29
第110回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.94	100,000	104,316	2023/ 6/20
第122回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	108,000	112,445	2020/11/30
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	100,000	100,836	2024/ 6/20
第147回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	105,250	2021/10/29
第153回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	112,849	2031/12/26
第157回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	104,693	2022/ 2/28
第163回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	100,000	104,718	2022/ 5/31
第168回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	100,000	104,243	2022/ 7/29
第169回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	100,000	109,880	2032/ 7/30
第173回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	106,000	110,286	2022/ 9/30
第186回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	205,714	2023/ 3/17
第224回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.72	100,000	105,791	2044/ 8/31
第 1回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,713	2019/ 6/14
第 2回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.502	300,000	306,228	2021/12/24
第 4回 公営企業債券(20年)	2.09	200,000	227,550	2023/ 9/20
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	118,581	2030/ 3/28

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 7回 地方公共団体金融機構	1.4	134,000	140,902	2019/ 4/15
第 11回 地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	106,188	2020/ 4/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	116,880	2031/ 1/28
第 20回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	111,634	2032/ 1/28
第 34回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	104,719	2022/ 3/14
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	103,852	2022/ 6/28
20年第39回地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	103,063	2034/ 9/28
第 46回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	102,857	2023/ 3/17
第 48回 地方公共団体金融機構債券	0.813	100,000	103,374	2023/ 5/26
第 56回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	100,000	103,345	2024/ 1/19
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	101,335	2024/ 9/13
第882回 政府保証公営企業債券	1.6	200,000	208,538	2018/ 2/19
第 13回 中日本高速道路株式会社債(一般担保付、独立行政法人)	1.49	100,000	105,931	2019/12/20
第 4回 東京都住宅供給公社債券	2.05	100,000	102,355	2016/ 9/20
第871回 政府保証公営企業債券	1.8	101,000	103,983	2017/ 1/25
第 3回 株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	1.43	100,000	105,463	2019/ 9/20
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	101,335	2024/ 9/13
第126回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	200,000	211,822	2021/ 1/29
第 2回 政府保証阪神高速道路株式会社社債	1.7	100,000	103,007	2017/ 3/16
第 7回 日本政策投資銀行債券	1.4	100,000	106,026	2020/ 2/17
第 23回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.6	101,000	106,097	2018/ 8/20
第 23回 株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間)	0.692	100,000	102,134	2019/ 3/20
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	120,977	2037/ 3/19
第 17回 道路債券	1.54	100,000	108,767	2022/12/20
第 21回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	102,680	2016/11/30
第 27回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	206,230	2017/ 2/28
第 32回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.61	100,000	104,242	2018/ 3/20
第 34回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	201,000	207,715	2017/ 5/26
第 40回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.69	100,000	104,879	2018/ 6/20
第 87回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	200,000	211,920	2019/ 8/30
第 97回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	117,912	2029/12/28
第120回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	106,000	110,317	2020/10/30
第216回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.483	100,000	105,850	2034/ 4/28
第 6回 中小企業債券	0.79	100,000	101,915	2018/ 3/20
第 21回 都市再生債券	1.72	100,000	105,373	2018/ 9/20
第 49回 都市再生債券	1.46	100,000	107,052	2021/ 2/26
第 56回 政府保証関西国際空港債券	1.4	200,000	212,060	2020/ 2/25
第 38回 日本学生支援債券	0.1	100,000	99,965	2017/ 2/20
第 30回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.49	100,000	105,979	2019/12/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,004	2024/ 5/29
第 1回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	21,919	23,042	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	32,819	35,366	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	22,559	24,028	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	33,693	36,576	2042/ 8/10
第 14回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.86	200,000	209,902	2018/ 3/20
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	35,441	38,413	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	47,342	50,658	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	24,955	26,447	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	90,854	99,206	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	45,674	49,721	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	44,165	47,785	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	58,191	62,168	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	65,022	69,357	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	65,589	69,599	2045/ 6/10
第 37回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.4	100,000	105,333	2019/ 9/20
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	31,839	34,786	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	147,680	158,943	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	33,215	36,257	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	73,997	78,621	2046/ 7/10
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	166,394	174,687	2047/ 2/10
第 60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	252,459	263,562	2047/ 5/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	112,964	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	89,515	93,122	2048/ 2/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	97,714	99,114	2049/10/10

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券(除く金融債))				
第90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	97,855	98,707	2049/11/10
第93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	98,931	97,463	2050/2/10
第11回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.067	100,000	105,192	2022/2/18
第13回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.802	100,000	103,214	2023/2/8
第113回 福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	119,808	2027/12/20
小計	—	10,843,822	11,471,759	—
(金融債券)				
い第740号商工債	0.45	100,000	100,493	2017/1/27
い第741号商工債	0.45	100,000	100,517	2017/2/27
い第751号商工債	0.25	100,000	100,247	2017/12/27
い第743号農林債	0.45	100,000	100,513	2017/4/27
い第752号農林債	0.3	200,000	200,590	2018/1/26
い第756号農林債	0.3	100,000	100,352	2018/5/25
第267回 信金中金債(5年)	0.45	100,000	100,535	2017/2/27
第272回 信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,339	2017/7/27
小計	—	900,000	903,586	—
(普通社債券(含む投資法人債券))				
第528回 東京電力株式会社社債(一般担保付)	1.905	100,000	102,564	2019/6/13
第540回 東京電力株式会社社債(一般担保付)	1.64	100,000	101,667	2018/4/25
第547回 東京電力株式会社社債(一般担保付)	1.948	100,000	102,981	2020/7/24
第490回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	1.444	100,000	104,759	2019/7/25
第492回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	1.405	100,000	104,803	2019/10/25
第448回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	2.16	100,000	105,500	2018/6/20
第492回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.609	100,000	100,662	2019/3/20
第354回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	1.905	100,000	104,980	2018/5/25
第366回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	1.39	100,000	105,130	2020/5/25
第382回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.517	100,000	100,627	2021/5/25
第308回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.769	100,000	100,964	2024/9/25
第450回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	1.473	100,000	104,793	2019/7/25
第233回 四国電力株式会社社債(一般担保付)	2.95	100,000	107,938	2018/4/25
第393回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	2.01	100,000	103,667	2017/6/23
第411回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	1.394	100,000	104,634	2020/5/25
第258回 北海道電力株式会社社債(一般担保付)	3.95	100,000	104,066	2016/6/24
第20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)	0.289	100,000	100,451	2017/12/20
第5回 大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位)	0.443	100,000	100,972	2021/6/18
第5回 明治ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.325	100,000	100,538	2017/12/20
第41回 住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.64	100,000	105,779	2019/10/18
第38回 三菱化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.02	100,000	107,493	2019/8/13
第63回 新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.942	100,000	106,805	2019/6/20
第21回 ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.681	100,000	100,936	2024/7/30
第59回 株式会社東芝無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.567	100,000	98,626	2019/12/11
第8回 パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.05	100,000	106,734	2019/3/20
第33回 川崎重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.581	100,000	100,512	2016/7/25
第1回 B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債(一般)	0.85	100,000	101,166	2017/8/9
第56回 日産自動車株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	0.554	100,000	101,174	2020/3/19
第1回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付)	3.0	100,000	107,914	2018/2/19
第15回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付)	0.382	100,000	100,677	2021/6/18
第84回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.5	100,000	106,051	2021/6/14
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)	2.2	100,000	112,712	2029/7/13
第19回 豊田通商株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.954	100,000	102,299	2026/7/10
第58回 三井物産株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	1.94	100,000	102,875	2016/12/20
第66回 三菱商事株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約)	2.08	100,000	104,317	2017/7/28
第48回 株式会社クレディセゾン無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.038	100,000	103,213	2023/10/20
第16回 イオン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.01	100,000	102,591	2018/11/21
第7回 株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	2.5	100,000	108,594	2019/6/3
第7回 株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	2.08	100,000	104,198	2017/7/27
第30回 株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(特定社債間)	0.34	200,000	200,744	2017/7/25
第9回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.01	100,000	108,454	2020/7/22
第28回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.56	100,000	106,623	2021/1/20
第57回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定)	2.22	100,000	113,443	2022/10/27
第107回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定)	1.575	100,000	105,710	2019/7/17
株式会社三井住友フィナンシャルグループ第1回無担保劣後社債	0.849	100,000	100,703	2024/9/12
第7回 株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.606	100,000	106,146	2020/9/28
第1回 三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(特定社債間限定同)	0.345	200,000	200,882	2017/6/7

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第 4回 三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(0.34	100,000	100,615	2018/ 9/ 4
第 22回 株式会社三井住友銀行無担保変動利付社債(社債間限定同	1.43	100,000	105,638	2020/ 9/28
第 31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	0.418	100,000	100,522	2021/ 6/18
第 58回 トヨタファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同等	0.285	100,000	100,485	2018/12/20
第176回 オリックス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約	0.354	200,000	200,366	2019/ 2/27
第 19回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位	0.487	100,000	100,755	2017/ 5/29
第 31回 三菱地所株式会社無担保社債	3.125	100,000	107,158	2017/ 9/26
第 58回 三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約	2.9	100,000	126,472	2032/ 5/20
第 95回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	101,028	2024/ 1/26
第 98回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	99,961	2024/ 6/10
第 99回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.836	100,000	99,345	2024/ 7/29
第 5回 イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.903	100,000	101,146	2024/ 3/22
第 54回 小田急電鉄株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	102,188	2017/12/15
第 52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	1.62	100,000	104,331	2018/ 4/20
第 53回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順	2.35	100,000	119,578	2028/ 4/21
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	2.26	100,000	118,212	2027/12/20
第 5回 東海旅客鉄道株式会社普通社債(一般担保付)	2.6	100,000	111,098	2020/ 1/28
第 44回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位	1.667	100,000	105,980	2019/ 6/19
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	1.917	100,000	104,392	2044/10/28
第 34回 日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.594	100,000	101,088	2018/ 6/18
第 51回 日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保	2.06	100,000	102,129	2016/ 6/20
第 39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)	0.929	100,000	102,100	2024/ 2/20
第 12回 北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.751	100,000	101,851	2018/ 9/ 5
第 9回 西部瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.056	100,000	104,074	2020/10/22
第 11回 フランス相互信用連合銀行(BMCM)	0.528	100,000	100,534	2017/ 3/17
クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債	0.865	100,000	100,371	2024/11/28
第 15回 ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーショ	2.215	100,000	109,665	2020/11/20
第 21回 ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーショ	1.299	100,000	101,741	2016/11/25
第 9回 ジェー・ビー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー円	1.32	200,000	203,842	2017/2 / 9
第 21回 コーベラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	0.708	100,000	101,258	2018/ 5/24
第 25回 コーベラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	0.434	100,000	100,328	2019/ 5/22
小 計	—	8,200,000	8,527,318	—
合 計	—	131,531,022	141,877,971	—

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

日立国内債券インデックスマザーファンド

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額 総
	期 騰 落	中 率			
11期(2011年3月31日)	円 12,003	% 1.8	% 99.3	% —	百万円 67,744
12期(2012年4月 2日)	12,333	2.7	98.7	—	90,652
13期(2013年4月 1日)	12,793	3.7	98.9	—	115,548
14期(2014年3月31日)	12,880	0.7	99.2	—	103,743
15期(2015年3月31日)	13,259	2.9	100.0	—	142,236

(注) 債券先物比率は、買い建て比率-売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2014年 3月31日	円 12,880	% —	352.80	% —	% 99.2	% —
4月末	12,899	0.1	353.31	0.1	99.0	—
5月末	12,938	0.5	354.39	0.4	102.0	—
6月末	12,976	0.7	355.41	0.7	100.5	—
7月末	12,997	0.9	356.01	0.9	100.1	—
8月末	13,038	1.2	357.15	1.2	101.2	—
9月末	13,047	1.3	357.41	1.3	101.2	—
10月末	13,107	1.8	359.08	1.8	99.5	—
11月末	13,184	2.4	361.19	2.4	99.5	—
12月末	13,322	3.4	364.96	3.4	99.6	—
2015年 1月末	13,325	3.5	365.07	3.5	99.4	—
2月末	13,251	2.9	363.04	2.9	99.5	—
(期 末) 2015年 3月31日	13,259	2.9	363.28	3.0	100.0	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買い建て比率-売り建て比率。

■売買及び取引の状況(2014年4月1日から2015年3月31日まで)

		買付額	売付額
国 内		千円	千円
	国債証券	47,981,466	18,011,497
	地方債証券	3,214,219	1,151,182
	特殊債証券	4,406,573	809,443 (166,841)
	社債証券	3,576,143	1,716,827

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■主要な売買銘柄(2014年4月1日から2015年3月31日まで)

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第117回 利付国債(5年)	1,828,453	第339回 利付国債(2年)	1,801,476
第339回 利付国債(2年)	1,800,691	第296回 利付国債(10年)	1,025,833
第346回 利付国債(2年)	1,401,582	第93回 利付国債(5年)	854,420
第305回 利付国債(10年)	1,049,806	第89回 利付国債(5年)	852,881
第120回 利付国債(5年)	932,804	第96回 利付国債(5年)	753,840
第118回 利付国債(5年)	851,629	第291回 利付国債(10年)	729,486
第334回 利付国債(10年)	808,000	第91回 利付国債(5年)	702,527
第307回 利付国債(10年)	786,560	第273回 利付国債(10年)	609,096
第106回 利付国債(5年)	753,355	第92回 利付国債(5年)	601,542
第72回 利付国債(20年)	728,976	第90回 利付国債(5年)	601,422

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2014年4月1日から2015年3月31日まで)

期中の利害関係人との取引はありません。

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細(2015年3月31日現在)

公社債

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	103,130,000 (2,650,000)	112,254,620 (3,011,811)	78.9 (2.1)	— (—)	48.6 (2.0)	20.6 (0.1)	9.7 (—)
地 方 債 証 券	8,527,200 (8,527,200)	8,995,504 (8,995,504)	6.3 (6.3)	— (—)	3.5 (3.5)	2.3 (2.3)	0.4 (0.4)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	10,942,062 (10,782,123)	11,588,842 (11,420,580)	8.1 (8.0)	— (—)	4.9 (4.8)	2.2 (2.1)	1.1 (1.1)
金 融 債 証 券	900,000 (900,000)	903,556 (903,556)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.2 (0.2)
普 通 社 債 証 券 (含む投資法人債券)	8,200,000 (8,200,000)	8,532,055 (8,532,055)	6.0 (6.0)	— (—)	2.3 (2.3)	3.1 (3.1)	0.6 (0.6)
合 計	131,699,262 (31,059,323)	142,274,578 (32,863,507)	100.0 (23.1)	— (—)	59.3 (12.7)	28.7 (8.1)	12.0 (2.3)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注6) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアキュムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債銘柄別

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	
(国債証券)				
第340回 利付国債(2年)	0.1	550,000	550,429	2016/ 5/15
第341回 利付国債(2年)	0.1	350,000	350,294	2016/ 6/15
第342回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,178	2016/ 7/15
第343回 利付国債(2年)	0.1	700,000	700,665	2016/ 8/15
第344回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,202	2016/ 9/15
第346回 利付国債(2年)	0.1	1,400,000	1,401,582	2016/11/15
第 97回 利付国債(5年)	0.4	1,000,000	1,004,490	2016/ 6/20
第 98回 利付国債(5年)	0.3	400,000	401,312	2016/ 6/20
第 99回 利付国債(5年)	0.4	700,000	703,801	2016/ 9/20
第100回 利付国債(5年)	0.3	800,000	803,168	2016/ 9/20
第101回 利付国債(5年)	0.4	800,000	805,080	2016/12/20
第102回 利付国債(5年)	0.3	850,000	853,935	2016/12/20
第103回 利付国債(5年)	0.3	800,000	804,080	2017/ 3/20
第104回 利付国債(5年)	0.2	600,000	601,884	2017/ 3/20
第106回 利付国債(5年)	0.2	1,250,000	1,254,775	2017/ 9/20
第107回 利付国債(5年)	0.2	700,000	702,849	2017/12/20
第108回 利付国債(5年)	0.1	300,000	300,405	2017/12/20
第109回 利付国債(5年)	0.1	500,000	500,665	2018/ 3/20
第110回 利付国債(5年)	0.3	400,000	402,900	2018/ 3/20
第111回 利付国債(5年)	0.4	600,000	606,126	2018/ 3/20
第112回 利付国債(5年)	0.4	600,000	606,546	2018/ 6/20
第113回 利付国債(5年)	0.3	1,000,000	1,007,700	2018/ 6/20
第114回 利付国債(5年)	0.3	500,000	503,975	2018/ 9/20
第115回 利付国債(5年)	0.2	1,050,000	1,054,714	2018/ 9/20
第116回 利付国債(5年)	0.2	1,270,000	1,275,638	2018/12/20
第117回 利付国債(5年)	0.2	1,720,000	1,727,464	2019/ 3/20
第118回 利付国債(5年)	0.2	850,000	853,561	2019/ 6/20
第119回 利付国債(5年)	0.1	300,000	300,000	2019/ 6/20
第120回 利付国債(5年)	0.2	930,000	933,720	2019/ 9/20
第121回 利付国債(5年)	0.1	380,000	379,829	2019/ 9/20
第122回 利付国債(5年)	0.1	380,000	379,642	2019/12/20
第123回 利付国債(5年)	0.1	580,000	579,141	2020/ 3/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	60,000	67,148	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	480,000	557,668	2030/ 9/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第122回 利付国債(20年)	1.8	290,000	332,664	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	300,000	342,468	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	70,000	75,219	2034/ 3/20
第105回 利付国債(5年)	0.2	1,550,000	1,555,316	2017/ 6/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	390,000	495,276	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	320,000	389,689	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	220,000	268,239	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	470,000	573,658	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	400,000	465,260	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	450,000	509,562	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	330,000	354,063	2054/ 3/20
第280回 利付国債(10年)	1.9	470,000	480,683	2016/ 6/20
第281回 利付国債(10年)	2.0	500,000	511,975	2016/ 6/20
第282回 利付国債(10年)	1.7	830,000	850,343	2016/ 9/20
第283回 利付国債(10年)	1.8	450,000	461,691	2016/ 9/20
第284回 利付国債(10年)	1.7	1,000,000	1,028,670	2016/12/20
第285回 利付国債(10年)	1.7	990,000	1,022,353	2017/ 3/20
第286回 利付国債(10年)	1.8	700,000	727,195	2017/ 6/20
第287回 利付国債(10年)	1.9	390,000	406,017	2017/ 6/20
第288回 利付国債(10年)	1.7	870,000	905,496	2017/ 9/20
第289回 利付国債(10年)	1.5	950,000	987,382	2017/12/20
第290回 利付国債(10年)	1.4	300,000	311,985	2018/ 3/20
第291回 利付国債(10年)	1.3	500,000	518,495	2018/ 3/20
第292回 利付国債(10年)	1.7	200,000	209,766	2018/ 3/20
第293回 利付国債(10年)	1.8	450,000	475,209	2018/ 6/20
第294回 利付国債(10年)	1.7	300,000	315,843	2018/ 6/20
第295回 利付国債(10年)	1.5	400,000	418,556	2018/ 6/20
第297回 利付国債(10年)	1.4	430,000	451,121	2018/12/20
第298回 利付国債(10年)	1.3	950,000	993,139	2018/12/20
第299回 利付国債(10年)	1.3	500,000	524,000	2019/ 3/20
第300回 利付国債(10年)	1.5	400,000	422,360	2019/ 3/20
第301回 利付国債(10年)	1.5	1,000,000	1,059,000	2019/ 6/20
第302回 利付国債(10年)	1.4	280,000	295,344	2019/ 6/20
第303回 利付国債(10年)	1.4	510,000	539,253	2019/ 9/20
第304回 利付国債(10年)	1.3	550,000	579,100	2019/ 9/20
第305回 利付国債(10年)	1.3	1,140,000	1,203,099	2019/12/20
第306回 利付国債(10年)	1.4	700,000	744,030	2020/ 3/20
第307回 利付国債(10年)	1.3	910,000	962,752	2020/ 3/20
第308回 利付国債(10年)	1.3	310,000	328,792	2020/ 6/20
第309回 利付国債(10年)	1.1	710,000	745,677	2020/ 6/20
第310回 利付国債(10年)	1.0	780,000	816,402	2020/ 9/20
第311回 利付国債(10年)	0.8	430,000	445,398	2020/ 9/20
第312回 利付国債(10年)	1.2	1,380,000	1,462,965	2020/12/20
第313回 利付国債(10年)	1.3	800,000	854,632	2021/ 3/20
第314回 利付国債(10年)	1.1	370,000	390,893	2021/ 3/20
第315回 利付国債(10年)	1.2	750,000	798,742	2021/ 6/20
第316回 利付国債(10年)	1.1	600,000	635,298	2021/ 6/20
第317回 利付国債(10年)	1.1	630,000	668,341	2021/ 9/20
第318回 利付国債(10年)	1.0	800,000	843,560	2021/ 9/20
第319回 利付国債(10年)	1.1	300,000	318,846	2021/12/20
第320回 利付国債(10年)	1.0	840,000	887,191	2021/12/20
第321回 利付国債(10年)	1.0	970,000	1,025,765	2022/ 3/20
第322回 利付国債(10年)	0.9	400,000	420,240	2022/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	400,000	420,064	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	800,000	834,440	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	950,000	990,850	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	400,000	414,096	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	700,000	729,974	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	1,000,000	1,026,930	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	1,000,000	1,042,600	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	800,000	834,064	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	307,686	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	740,000	758,537	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	560,000	573,664	2024/ 3/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第334回 利付国債(10年)	0.6	540,000	552,792	2024/ 6/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	51,441	2029/ 9/20
第 4回 利付国債(30年)	2.9	100,000	130,636	2030/11/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	6,021	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	150,000	184,963	2031/11/20
第 7回 利付国債(30年)	2.3	155,000	188,890	2032/ 5/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	51,165	2032/11/22
第 11回 利付国債(30年)	1.7	65,000	72,457	2033/ 6/20
第 12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	106,177	2033/ 9/20
第 13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	81,356	2033/12/20
第 14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	147,368	2034/ 3/20
第 15回 利付国債(30年)	2.5	420,000	523,236	2034/ 6/20
第 16回 利付国債(30年)	2.5	380,000	473,271	2034/ 9/20
第 17回 利付国債(30年)	2.4	340,000	417,023	2034/12/20
第 18回 利付国債(30年)	2.3	410,000	495,403	2035/ 3/20
第 19回 利付国債(30年)	2.3	330,000	398,455	2035/ 6/20
第 20回 利付国債(30年)	2.5	420,000	522,160	2035/ 9/20
第 21回 利付国債(30年)	2.3	340,000	410,570	2035/12/20
第 22回 利付国債(30年)	2.5	550,000	684,673	2036/ 3/20
第 23回 利付国債(30年)	2.5	600,000	747,060	2036/ 6/20
第 24回 利付国債(30年)	2.5	570,000	709,821	2036/ 9/20
第 25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	313,866	2036/12/20
第 26回 利付国債(30年)	2.4	480,000	588,820	2037/ 3/20
第 27回 利付国債(30年)	2.5	420,000	524,512	2037/ 9/20
第 28回 利付国債(30年)	2.5	520,000	650,483	2038/ 3/20
第 29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	357,651	2038/ 9/20
第 30回 利付国債(30年)	2.3	380,000	461,662	2039/ 3/20
第 31回 利付国債(30年)	2.2	320,000	383,062	2039/ 9/20
第 32回 利付国債(30年)	2.3	400,000	487,800	2040/ 3/20
第 33回 利付国債(30年)	2.0	470,000	543,343	2040/ 9/20
第 34回 利付国債(30年)	2.2	410,000	492,135	2041/ 3/20
第 35回 利付国債(30年)	2.0	520,000	601,749	2041/ 9/20
第 36回 利付国債(30年)	2.0	400,000	463,304	2042/ 3/20
第 37回 利付国債(30年)	1.9	400,000	454,092	2042/ 9/20
第 38回 利付国債(30年)	1.8	200,000	222,332	2043/ 3/20
第 39回 利付国債(30年)	1.9	300,000	340,320	2043/ 6/20
第 40回 利付国債(30年)	1.8	350,000	388,783	2043/ 9/20
第 41回 利付国債(30年)	1.7	270,000	293,503	2043/12/20
第 42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	217,290	2044/ 3/20
第 43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	304,035	2044/ 6/20
第 44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	141,078	2044/ 9/20
第 33回 利付国債(20年)	3.8	70,000	73,873	2016/ 9/20
第 36回 利付国債(20年)	3.0	70,000	75,100	2017/ 9/20
第 38回 利付国債(20年)	2.7	90,000	97,058	2018/ 3/20
第 39回 利付国債(20年)	2.6	350,000	376,362	2018/ 3/20
第 40回 利付国債(20年)	2.3	70,000	75,401	2018/ 9/20
第 41回 利付国債(20年)	1.5	40,000	42,236	2019/ 3/20
第 42回 利付国債(20年)	2.6	370,000	406,763	2019/ 3/20
第 43回 利付国債(20年)	2.9	130,000	146,160	2019/ 9/20
第 45回 利付国債(20年)	2.4	10,000	11,119	2020/ 3/20
第 46回 利付国債(20年)	2.2	60,000	66,424	2020/ 6/22
第 47回 利付国債(20年)	2.2	110,000	122,336	2020/ 9/21
第 48回 利付国債(20年)	2.5	70,000	79,397	2020/12/21
第 49回 利付国債(20年)	2.1	60,000	66,961	2021/ 3/22
第 50回 利付国債(20年)	1.9	40,000	44,167	2021/ 3/22
第 51回 利付国債(20年)	2.0	30,000	33,450	2021/ 6/21
第 52回 利付国債(20年)	2.1	65,000	73,146	2021/ 9/21
第 53回 利付国債(20年)	2.1	60,000	67,781	2021/12/20
第 54回 利付国債(20年)	2.2	160,000	181,814	2021/12/20
第 55回 利付国債(20年)	2.0	100,000	112,678	2022/ 3/21
第 56回 利付国債(20年)	2.0	270,000	304,789	2022/ 6/20
第 57回 利付国債(20年)	1.9	130,000	145,824	2022/ 6/20
第 58回 利付国債(20年)	1.9	340,000	381,969	2022/ 9/20
第 59回 利付国債(20年)	1.7	90,000	99,994	2022/12/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第 60回 利付国債(20年)	1.4	100,000	108,872	2022/12/20
第 61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	148,198	2023/ 3/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	239,798	2023/ 6/20
第 63回 利付国債(20年)	1.8	130,000	146,104	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	110,000	124,689	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	430,000	488,862	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	80,000	90,271	2023/12/20
第 67回 利付国債(20年)	1.9	650,000	740,135	2024/ 3/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	275,000	320,331	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	420,000	485,570	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	520,000	616,829	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	200,000	233,660	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	830,000	964,883	2024/ 9/20
第 73回 利付国債(20年)	2.0	620,000	716,137	2024/12/20
第 74回 利付国債(20年)	2.1	510,000	593,874	2024/12/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	410,000	478,162	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	400,000	458,592	2025/ 3/20
第 77回 利付国債(20年)	2.0	260,000	300,726	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	218,294	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	115,875	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	380,000	444,060	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	250,000	290,190	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	280,000	327,992	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	140,000	164,206	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	540,000	627,825	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	300,000	352,458	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	80,000	95,713	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	180,000	213,471	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	180,000	215,785	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	237,624	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	200,000	238,040	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	72,065	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	400,000	472,148	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	234,130	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	200,000	236,390	2027/ 3/20
第 95回 利付国債(20年)	2.3	350,000	422,530	2027/ 6/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	106,516	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	340,000	406,881	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	180,000	213,300	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	730,000	866,035	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	300,000	359,682	2028/ 3/20
第101回 利付国債(20年)	2.4	310,000	379,629	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	220,620	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	182,005	2028/ 6/20
第104回 利付国債(20年)	2.1	200,000	237,608	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	390,000	463,476	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	160,000	192,139	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	150,000	178,291	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	400,000	465,316	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	220,000	256,025	2029/ 3/20
第110回 利付国債(20年)	2.1	220,000	261,844	2029/ 3/20
第111回 利付国債(20年)	2.2	340,000	409,115	2029/ 6/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	320,000	380,880	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	410,000	487,973	2029/ 9/20
第114回 利付国債(20年)	2.1	420,000	499,787	2029/12/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	220,000	264,915	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	500,000	601,995	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	410,000	487,748	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	300,000	352,902	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	170,000	195,044	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	400,000	476,260	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	230,000	270,422	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	500,000	602,935	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	150,000	176,104	2031/ 3/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第127回 利付国債(20年)	1.9	250,000	290,160	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	650,000	753,714	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	200,000	228,872	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	400,000	457,204	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	169,029	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	225,048	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	200,000	228,000	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	200,000	224,870	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	100,000	110,873	2032/ 3/20
第137回 利付国債(20年)	1.7	200,000	224,520	2032/ 6/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	200,000	218,212	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	740,000	829,984	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	300,000	335,904	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	160,000	181,865	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	200,000	220,286	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	200,000	217,046	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	500,000	557,365	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	400,000	445,036	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	450,000	492,178	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	490,000	525,676	2034/ 6/20
第 12回 ポーランド共和国円貨債券(2012)	1.05	100,000	101,738	2017/11/ 8
小 計	—	103,130,000	112,254,620	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
第 10回 東京都公募公債(東京再生都債)	2.31	100,000	118,418	2039/ 9/20
第646回 東京都公募公債	1.99	200,000	208,424	2017/ 6/20
第656回 東京都公募公債	1.51	100,000	104,172	2018/ 3/20
第661回 東京都公募公債	1.6	100,000	105,138	2018/ 9/20
第664回 東京都公募公債	1.4	150,000	157,059	2018/12/20
第707回 東京都公募公債	0.87	100,000	104,528	2022/ 3/18
第708回 東京都公募公債	0.89	100,000	104,579	2022/ 6/20
第710回 東京都公募公債	0.81	100,000	104,011	2022/ 6/20
第727回 東京都公募公債	0.72	100,000	103,176	2023/12/20
第728回 東京都公募公債	0.65	100,000	102,582	2023/12/20
平成22年度第 4回 北海道公募公債	1.28	100,000	105,387	2020/ 6/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	116,125	2025/ 6/20
第145回 神奈川県公募公債	1.8	100,000	103,352	2017/ 3/20
第160回 神奈川県公募公債	1.57	100,000	105,623	2019/ 3/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	103,041	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,311	2024/ 9/20
第 8回 大阪府公募公債(20年)	1.83	100,000	112,937	2031/12/22
第 99回 大阪府公募公債(5年)	0.24	144,000	144,398	2018/10/30
第304回 大阪府公募公債(10年)	1.98	150,200	156,658	2017/ 7/28
第327回 大阪府公募公債(10年)	1.69	100,000	106,338	2019/ 6/28
平成22年度第 5回 京都府公募公債	1.26	100,000	106,062	2020/12/21
平成26年度第 5回 京都府公募公債(20年)	1.455	100,000	105,245	2034/ 8/10
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,468	2029/11/19
平成21年度第 3回 兵庫県公募公債	1.62	100,000	105,943	2019/ 5/22
平成22年度第 8回 静岡県公募公債	1.059	100,000	104,655	2020/ 8/25
平成21年度第 10回 静岡県公募公債	1.4	100,000	106,003	2020/ 3/18
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	101,260	2024/10/24
平成21年度第 3回 愛知県公募公債(10年)	1.66	100,000	106,338	2019/ 6/26
平成22年度第 9回 愛知県公募公債(10年)	1.153	100,000	105,244	2020/ 9/30
平成22年度第 11回 愛知県公募公債(10年)	0.932	100,000	104,098	2020/10/29
平成25年度第 9回 愛知県公募公債(10年)	0.849	100,000	104,245	2023/ 7/25
平成26年度第 3回 愛知県公募公債(10年)	0.665	100,000	102,546	2024/ 4/30
平成22年度第 6回 広島県公募公債	1.26	100,000	106,119	2021/ 1/25
平成22年度第 8回 埼玉県公募公債	1.0	47,000	49,131	2020/11/26
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	115,662	2030/11/12
平成23年度第 10回 埼玉県公募公債	0.99	100,000	105,271	2022/ 2/24
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	101,310	2024/ 9/26
平成21年度第 11回 福岡県公募公債	1.44	100,000	106,154	2020/ 2/25
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	106,795	2034/ 5/26
平成18年度第 6回 千葉県公募公債	1.7	100,000	102,778	2016/12/22
平成18年度第 7回 千葉県公募公債	1.8	100,000	103,243	2017/ 2/24

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
平成20年度第 6回 千葉県公募公債	1.64	130,000	136,990	2018/10/25
平成21年度第 7回 千葉県公募公債	1.33	100,000	105,283	2019/10/25
平成25年度第 3回 千葉県公募公債	0.89	100,000	104,614	2023/ 6/23
第 47回 共同発行市場公募地方債	1.8	200,000	206,486	2017/ 2/24
第 52回 共同発行市場公募地方債	1.9	106,000	110,423	2017/ 7/25
第 63回 共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	105,689	2018/ 6/25
第 72回 共同発行市場公募地方債	1.46	100,000	105,207	2019/ 3/25
第 75回 共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,249	2019/ 6/25
第 77回 共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	212,052	2019/ 8/23
第 84回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	105,928	2020/ 3/25
第 89回 共同発行市場公募地方債	1.04	100,000	104,553	2020/ 8/25
第 91回 共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,910	2020/10/23
第 94回 共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	106,034	2021/ 1/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,548	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,201	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	207,804	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,962	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	104,782	2023/ 7/25
第125回 共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	208,014	2023/ 8/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,646	2023/11/24
平成24年度第 3回 島根県公募公債	0.13	100,000	100,011	2018/ 3/23
平成21年度第 4回 大阪市公募公債	1.62	200,000	212,496	2019/ 8/20
第467回 名古屋市公募公債(10年)	1.62	100,000	106,145	2019/ 6/20
第475回 名古屋市公募公債(10年)	1.15	100,000	105,832	2021/ 6/18
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	102,639	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	116,400	2025/ 9/19
平成18年度第 3回 京都市公募公債	1.9	100,000	103,438	2017/ 2/27
第 5回 横浜市公募公債	1.265	100,000	106,062	2020/12/11
平成19年度第 3回 横浜市公募公債	1.76	100,000	104,107	2017/ 9/20
平成21年度第 3回 横浜市公募公債	1.4	100,000	105,485	2019/ 9/20
第 25回 横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	111,516	2032/ 7/16
第 81回 川崎市公募公債	1.57	100,000	105,644	2019/ 3/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	100,149	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	102,087	2029/10/22
第 1回 北九州市公募公債(20年)	2.46	100,000	120,566	2026/ 6/19
平成23年度第 5回 広島市公募公債	1.01	100,000	105,337	2022/ 2/25
平成20年度第 1回 千葉市公募公債	1.55	100,000	104,386	2018/ 4/25
小 計	—	8,527,200	8,995,504	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 3回 政府保証原子力損害賠償支援機構債	0.117	100,000	100,052	2018/ 5/23
第 23回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.645	108,000	110,768	2024/ 3/18
第 9回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	110,188	2021/ 3/26
第 30回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	700,000	722,547	2017/ 3/28
第 31回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	100,000	103,824	2017/12/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	128,828	2034/ 6/20
第 38回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.87	100,000	105,481	2018/ 6/20
第 47回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	201,000	208,752	2017/12/27
第 48回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.71	100,000	105,987	2019/ 3/20
第 55回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.22	100,000	118,780	2030/ 2/8
第 60回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	105,501	2018/ 6/29
第110回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.94	100,000	104,466	2023/ 6/20
第122回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	108,000	112,395	2020/11/30
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	100,000	100,926	2024/ 6/20
第147回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	105,229	2021/10/29
第153回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	113,498	2031/12/26
第157回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	104,773	2022/ 2/28
第163回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	100,000	104,740	2022/ 5/31
第168回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	100,000	104,275	2022/ 7/29
第169回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	100,000	110,503	2032/ 7/30
第173回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	106,000	110,394	2022/ 9/30
第186回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	205,964	2023/ 3/17
第224回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.72	100,000	107,577	2044/ 8/31
第 1回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,686	2019/ 6/14
第 2回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.502	300,000	306,009	2021/12/24

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 4回 公営企業債券(20年)	2.09	200,000	228,098	2023/ 9/20
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	119,064	2030/ 3/28
第 7回 地方公共団体金融機構	1.4	134,000	140,811	2019/ 4/15
第 11回 地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	106,170	2020/ 4/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	117,468	2031/ 1/28
第 20回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	112,244	2032/ 1/28
第 34回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	104,799	2022/ 3/14
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	103,840	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	103,552	2034/ 9/28
第 46回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	102,982	2023/ 3/17
第 48回 地方公共団体金融機構債券	0.813	100,000	103,547	2023/ 5/26
第 56回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	100,000	103,480	2024/ 1/19
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	101,402	2024/ 9/13
第882回 政府保証公営企業債券	1.6	200,000	208,702	2018/ 2/19
第 13回 中日本高速道路株式会社債(一般担保付、独立行政法人)	1.49	100,000	105,933	2019/12/20
第 4回 東京都住宅供給公社債券	2.05	100,000	102,553	2016/ 9/20
第871回 政府保証公営企業債券	1.8	101,000	104,175	2017/ 1/25
第 3回 株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	1.43	100,000	105,408	2019/ 9/20
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	101,402	2024/ 9/13
第126回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	200,000	211,810	2021/ 1/29
第 2回 政府保証阪神高速道路株式会社債	1.7	100,000	103,179	2017/ 3/16
第 5回 政府保証中日本高速道路債券	2.0	53,000	54,163	2016/ 5/20
第 7回 日本政策投資銀行債券	1.4	100,000	106,009	2020/ 2/17
第 23回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.6	101,000	106,099	2018/ 8/20
第 23回 株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間)	0.692	100,000	101,956	2019/ 3/20
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	122,155	2037/ 3/19
第 17回 道路債券	1.54	100,000	108,913	2022/12/20
第 21回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	102,872	2016/11/30
第 27回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	206,582	2017/ 2/28
第 32回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.61	100,000	104,314	2018/ 3/20
第 34回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	201,000	207,996	2017/ 5/26
第 40回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.69	100,000	104,904	2018/ 6/20
第 87回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	200,000	211,846	2019/ 8/30
第 97回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	118,395	2029/12/28
第120回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	106,000	110,250	2020/10/30
第216回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.483	100,000	106,324	2034/ 4/28
第 6回 中小企業債券	0.79	100,000	101,889	2018/ 3/20
第 21回 都市再生債券	1.72	100,000	105,371	2018/ 9/20
第 49回 都市再生債券	1.46	100,000	107,054	2021/ 2/26
第 56回 政府保証関西国際空港債券	1.4	200,000	212,072	2020/ 2/25
第 38回 日本学生支援債券	0.1	100,000	99,927	2017/ 2/20
第 30回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.49	100,000	105,982	2019/12/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,158	2024/ 5/29
第 1回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	22,517	23,639	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	34,412	37,079	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	23,226	24,707	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	35,131	38,145	2042/ 8/10
第 14回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.86	200,000	210,106	2018/ 3/20
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	37,340	40,430	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	48,828	52,119	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	25,939	27,450	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	94,228	102,894	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	47,352	51,555	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	45,490	49,263	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	60,168	64,329	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	67,582	72,028	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	67,898	72,018	2045/ 6/10
第 37回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.4	100,000	105,275	2019/ 9/20
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	33,444	36,480	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	153,600	165,201	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	34,541	37,659	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	77,091	81,874	2046/ 7/10
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	169,456	178,028	2047/ 2/10
第 60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	257,328	268,866	2047/ 5/10

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))				
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	113,203	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	90,600	94,366	2048/ 2/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	98,365	99,954	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	98,710	99,751	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	99,816	98,540	2050/ 2/10
第 11回 成田国際空港株式会社債(一般担保付)	1.067	100,000	105,245	2022/ 2/18
第 13回 成田国際空港株式会社債(一般担保付)	0.802	100,000	103,300	2023/ 2/ 8
第113回 福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	120,329	2027/12/20
小 計	—	10,942,062	11,588,842	—
(金融債券)				
い第740号 商工債	0.45	100,000	100,533	2017/ 1/27
い第741号 商工債	0.45	100,000	100,555	2017/ 2/27
い第751号 商工債	0.25	100,000	100,218	2017/12/27
い第743号 農林債	0.45	100,000	100,536	2017/ 4/27
い第752号 農林債	0.3	200,000	200,558	2018/ 1/26
い第756号 農林債	0.3	100,000	100,249	2018/ 5/25
第267回 信金中金債(5年)	0.45	100,000	100,574	2017/ 2/27
第272回 信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,333	2017/ 7/27
小 計	—	900,000	903,556	—
(普通社債券(含む投資法人債券))				
第528回 東京電力株式会社社債(一般担保付)	1.905	100,000	101,020	2019/ 6/13
第540回 東京電力株式会社社債(一般担保付)	1.64	100,000	100,541	2018/ 4/25
第547回 東京電力株式会社社債(一般担保付)	1.948	100,000	101,319	2020/ 7/24
第490回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	1.444	100,000	104,698	2019/ 7/25
第492回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	1.405	100,000	104,744	2019/10/25
第448回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	2.16	100,000	105,548	2018/ 6/20
第492回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.609	100,000	100,441	2019/ 3/20
第354回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	1.905	100,000	105,025	2018/ 5/25
第366回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	1.39	100,000	105,074	2020/ 5/25
第382回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.517	100,000	100,517	2021/ 5/25
第308回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.769	100,000	101,056	2024/ 9/25
第450回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	1.473	100,000	104,732	2019/ 7/25
第233回 四国電力株式会社社債(一般担保付)	2.95	100,000	108,121	2018/ 4/25
第393回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	2.01	100,000	103,810	2017/ 6/23
第411回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	1.394	100,000	104,566	2020/ 5/25
第258回 北海道電力株式会社社債(一般担保付)	3.95	100,000	104,509	2016/ 6/24
第 20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)	0.289	100,000	100,376	2017/12/20
第 5回 大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位)	0.443	100,000	100,886	2021/ 6/18
第 5回 明治ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.325	100,000	100,396	2017/12/20
第 41回 住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.64	100,000	105,707	2019/10/18
第 38回 三菱化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.02	100,000	107,470	2019/ 8/13
第 63回 新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.942	100,000	106,787	2019/ 6/20
第 21回 ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	0.681	100,000	101,064	2024/ 7/30
第 59回 株式会社東芝無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.567	100,000	100,741	2019/12/11
第 8回 パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.05	100,000	106,732	2019/ 3/20
第 33回 川崎重工株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.581	100,000	100,517	2016/ 7/25
第 1回 B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債(一般)	0.85	100,000	101,185	2017/ 8/ 9
第 56回 日産自動車株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約)	0.554	100,000	100,982	2020/ 3/19
第 1回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付)	3.0	100,000	108,153	2018/ 2/19
第 15回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付)	0.382	100,000	100,558	2021/ 6/18
第 84回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.5	100,000	106,099	2021/ 6/14
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)	2.2	100,000	113,482	2029/ 7/13
第 19回 豊田通商株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.954	100,000	102,575	2026/ 7/10
第 58回 三井物産株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	1.94	100,000	103,076	2016/12/20
第 66回 三菱商事株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約)	2.08	100,000	104,429	2017/ 7/28
第 48回 株式会社クレディセゾン無担保社債(社債間限定同順位特約)	1.038	100,000	103,403	2023/10/20
第 16回 イオン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.01	100,000	102,482	2018/11/21
第 7回 株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	2.5	100,000	108,634	2019/ 6/ 3
第 7回 株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	2.08	100,000	104,351	2017/ 7/27
第 30回 株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(特定社債間)	0.34	200,000	200,630	2017/ 7/25
第 9回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.01	100,000	108,473	2020/ 7/22
第 28回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.56	100,000	106,635	2021/ 1/20
第 57回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定)	2.22	100,000	113,762	2022/10/27
第107回 株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定)	1.575	100,000	105,722	2019/ 7/17

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第 1回 株式会社三井住友フィナンシャルグループ無担保劣後社債	0.849	100,000	100,816	2024/ 9/12
第 7回 株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.606	100,000	106,088	2020/ 9/28
第 1回 三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(特定社債間限定同	0.345	200,000	200,792	2017/ 6/ 7
第 4回 三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(0.34	100,000	100,476	2018/ 9/ 4
第 22回 株式会社三井住友銀行無担保変動利付社債(社債間限定同	1.43	100,000	105,569	2020/ 9/28
第 31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	0.418	100,000	100,610	2021/ 6/18
第 58回 トヨタファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同等	0.285	100,000	100,295	2018/12/20
第176回 オリックス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約	0.354	200,000	199,978	2019/ 2/27
第 19回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位	0.487	100,000	100,686	2017/ 5/29
第 31回 三菱地所株式会社無担保社債	3.125	100,000	107,385	2017/ 9/26
第 58回 三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約	2.9	100,000	127,246	2032/ 5/20
第 95回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	101,540	2024/ 1/26
第 98回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	100,452	2024/ 6/10
第 99回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.836	100,000	99,823	2024/ 7/29
第 5回 イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.903	100,000	101,368	2024/ 3/22
第 54回 小田急電鉄株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	102,137	2017/12/15
第 52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	1.62	100,000	104,388	2018/ 4/20
第 53回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順	2.35	100,000	120,097	2028/ 4/21
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	2.26	100,000	118,778	2027/12/20
第 5回 東海旅客鉄道株式会社普通社債(一般担保付)	2.6	100,000	111,214	2020/ 1/28
第 44回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位	1.667	100,000	105,961	2019/ 6/19
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	1.917	100,000	106,160	2044/10/28
第 34回 日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.594	100,000	100,905	2018/ 6/18
第 51回 日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保	2.06	100,000	102,360	2016/ 6/20
第 39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)	0.929	100,000	102,302	2024/ 2/20
第 12回 北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付	0.751	100,000	101,721	2018/ 9/ 5
第 9回 西部瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.056	100,000	103,993	2020/10/22
第 11回 フランス相互信用連合銀行(BMCM)	0.528	100,000	100,532	2017/ 3/17
第 6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.865	100,000	100,550	2024/11/28
第 15回 ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーショ	2.215	100,000	109,783	2020/11/20
第 21回 ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーショ	1.299	100,000	101,850	2016/11/25
第 9回 ジェー・ビー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー円	1.32	200,000	203,966	2017/ 2/ 9
第 21回 コーベラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	0.708	100,000	101,138	2018/ 5/24
第 25回 コーベラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	0.434	100,000	100,068	2019/ 5/22
小 計	—	8,200,000	8,532,055	—
合 計	—	131,699,262	142,274,578	—

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2015年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 142,274,578	% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,878,376	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	145,152,954	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2015年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	145,152,954,488円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	718,923,433
公 社 債(評価額)	142,274,578,598
未 収 入 金	1,903,699,000
未 収 利 息	251,761,039
前 払 費 用	3,992,418
(B) 負 債	2,916,503,500
未 払 金	2,913,903,500
未 払 解 約 金	2,600,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	142,236,450,988
元 本	107,277,861,428
次 期 繰 越 損 益 金	34,958,589,560
(D) 受 益 権 総 口 数	107,277,861,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,259円

(注1) 当ファンドの期首元本額は80,544,467,269円、期中追加設定元本額は30,218,608,722円、期中一部解約元本額は3,485,214,563円です。

(注2) 元本の内訳

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)	84,953,978,315円
日立国内債券インデックスファンド	9,775,616,634円
日立バランスファンド(株式50)	6,326,172,952円
日立バランスファンド(株式30)	3,360,331,743円
日立バランスファンド(株式70)	2,861,761,784円

(注3) 1口当たり純資産額は1.3259円です。

■損益の状況

当期(自2014年4月1日 至2015年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,567,205,189円
受 取 利 息	1,567,205,189
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,088,544,259
売 買 益	2,483,265,604
売 買 損	△ 394,721,345
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	3,655,749,448
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	23,199,353,602
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,194,399,922
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 1,090,913,412
(G) 計 (C+D+E+F)	34,958,589,560
次 期 繰 越 損 益 金(G)	34,958,589,560

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。