



日立国内債券インデックスファンド

■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。	

運用報告書(全体版)

第19期

(決算日 2020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19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。

日立投資顧問株式会社

東京都千代田区神田練堀町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、祝日および12月31日～1月3日を除く

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 比 率	債券先物 比 率	純資産 総 額
		期 中 騰落率		期 中 騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2016年5月16日)	13,012	6.4	386.79	6.6	99.3	—	14,637
16期(2017年5月15日)	12,741	△2.1	379.17	△2.0	99.4	—	14,552
17期(2018年5月15日)	12,812	0.6	381.62	0.6	99.5	—	14,872
18期(2019年5月15日)	13,022	1.6	388.32	1.8	99.3	—	15,651
19期(2020年5月15日)	13,009	△0.1	388.38	0.0	99.5	—	15,792

(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 比 率	債券先物 比 率
		騰落率		騰落率		
(期 首) 2019年 5月15日	円 13,022	% —	388.32	% —	% 99.3	% —
5月末	13,088	0.5	390.32	0.5	99.1	—
6月末	13,165	1.1	392.69	1.1	99.3	—
7月末	13,179	1.2	393.15	1.2	98.5	—
8月末	13,353	2.5	398.50	2.6	99.3	—
9月末	13,211	1.5	394.27	1.5	99.1	—
10月末	13,159	1.1	392.61	1.1	99.4	—
11月末	13,113	0.7	391.33	0.8	99.2	—
12月末	13,073	0.4	390.14	0.5	99.1	—
2020年 1月末	13,126	0.8	391.77	0.9	99.0	—
2月末	13,227	1.6	394.74	1.7	99.3	—
3月末	13,012	△0.1	388.45	0.0	100.2	—
4月末	13,056	0.3	389.79	0.4	99.6	—
(期 末) 2020年 5月15日	13,009	△0.1	388.38	0.0	99.5	—

(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＞

新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気低迷を受けて、日銀をはじめ各国の中央銀行が緩和的な金融政策スタンスを強化したことがプラスに影響しました。

＜下落要因＞

2019年後半は株価が堅調に推移したこと、期末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動の停滞を受けて、積極的な財政政策に伴う国債増発懸念がマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2019年5月15日	2019年9月4日	2020年3月19日	2020年5月15日
基 準 価 額	13,022円	13,375円	12,967円	13,009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13,022円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、13,009円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲0.1%となり、ベンチマーク騰落率0.0%にはほぼ追随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】

当期の国内長期金利は、日銀によるイールドカーブコントロール政策の下、期を通じて低水準で推移しました。

5月以降は、トランプ米大統領による対中関税の引き上げ

表明によって通商問題悪化への懸念が高まったことや、欧米中央銀行の金融緩和に向けた姿勢が強まったことで、一段と金利低下が進み、8月には一時▲0.30%程度まで低下しました。9月に入ると、日銀の黒田総裁が過度な金利低下に対する警戒的な意見を表明したことや、日銀の国債買入れ金額が減額されたことなどから、金利上昇に転じました。2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大による景気先行き不透明感の拡大から再び金利低下したのち、利益確定の売りや保有資産を現金へと逃避する動きを受けて金利上昇するなど上下に振れる展開となりました。

年別別にみると、中長期年限の金利が上昇した一方、超長期年限については高い利回りを求める安定した投資家需要に支えられて金利低下しました。その結果、イールドカーブはフラットニングが進みました。

スプレッド市場は拡大しました。新型コロナウイルスの感染拡大をきっかけとした急速な景気見通しの悪化を受けて、期末にかけて事業債のスプレッドは拡大しました。海外金融市場におけるリスク回避的な動きを反映して、円建外債のスプレッドも拡大しました。もっとも、本邦企業の健全な財務状況や緩和的な金融政策を背景に、海外金融市場に比べると小幅なスプレッド拡大にとどまりました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで+0.0%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総合指数に追随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
	(2019. 5. 16～2020. 5. 15)		
	金 額	比 率	
(a)信 託 報 酬	16円	0. 121%	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13, 146円です。
（投 信 会 社）	（ 9）	（0. 066）	委託した資金の運用の対価
（販 売 会 社）	（ 4）	（0. 033）	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）	（ 3）	（0. 022）	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)そ の 他 費 用	0	0. 000	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕
（そ の 他）	（ 0）	（0. 000）	
合 計	16	0. 121	

(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。

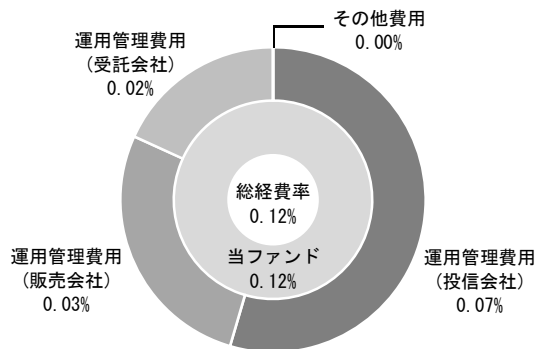
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

<参考情報>

○総経費率

当期中の運用・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口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.12%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、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含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2019年5月16日から2020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
日 立 国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 1, 202, 739	千円 1, 721, 800	千口 1, 105, 864	千円 1, 577, 800

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄 (2019年5月16日から2020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138回 利付国債 (5年)	916, 038	第127回 利付国債 (5年)	1, 043, 484
第402回 利付国債 (2年)	805, 616	第312回 利付国債 (10年)	912, 807
第357回 利付国債 (10年)	743, 054	第125回 利付国債 (5年)	803, 011
第140回 利付国債 (5年)	734, 257	第124回 利付国債 (5年)	752, 115
第356回 利付国債 (10年)	713, 077	第310回 利付国債 (10年)	739, 723
第141回 利付国債 (5年)	659, 729	第308回 利付国債 (10年)	670, 150
第355回 利付国債 (10年)	618, 768	第126回 利付国債 (5年)	651, 839
第350回 利付国債 (10年)	596, 520	第133回 利付国債 (5年)	606, 918
第354回 利付国債 (10年)	594, 575	第325回 利付国債 (10年)	511, 845
第142回 利付国債 (5年)	559, 531	第63回 利付国債 (20年)	424, 964

(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 (2019年5月16日から2020年5月15日まで)
利害関係人の発行する有価証券等
<日立国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	千円 100, 099	千円 0	千円 97, 231

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立キャピタルです。

■組入資産の明細 (2020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
日 立 国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 11, 026, 306	千口 11, 123, 181	千円 15, 774, 896

(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 (2020年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日 立 国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 15, 774, 896	% 99. 1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	140, 097	0. 9
投 資 信 託 財 産 総 額	15, 914, 993	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

2020年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,914,993,811円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	62,697,465
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	15,774,896,346
未 収 入 金	77,400,000
(B) 負 債	122,816,915
未 払 解 約 金	113,106,404
未 払 信 託 報 酬	9,710,331
未 払 利 息	180
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	15,792,176,896
元 本	12,139,336,401
次 期 繰 越 損 益 金	3,652,840,495
(D) 受 益 権 総 口 数	12,139,336,401口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,009円

(注1) 当ファンドの期首元本額は12,018,848,802円、期中追加設定元本額は3,454,211,054円、期中一部解約元本額は3,333,723,455円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,3009円です。

■損益の状況

当期(自2019年5月16日 至2020年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△33,425円
支 払 利 息	△33,425
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△25,948,608
売 買 益	8,270,593
売 買 損	△34,219,201
(C) 信 託 報 酬 等	△19,409,612
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△45,391,645
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	621,248,230
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,076,983,910
(配 当 等 相 当 額)	(2,738,931,602)
(売 買 損 益 相 当 額)	(338,052,308)
(G) 計 (D + E + F)	3,652,840,495
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	3,652,840,495
追 加 信 託 差 損 益 金	3,076,983,910
(配 当 等 相 当 額)	(2,738,931,602)
(売 買 損 益 相 当 額)	(338,052,308)
分 配 準 備 積 立 金	621,269,042
繰 越 損 益 金	△45,412,457

(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。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(3,031,571,453円)および分配準備積立金(621,269,042円)より分配対象収益は3,652,840,495円(10,000口当たり3,009円)ですが、当期に分配した金額はありません。

<お知らせ>

該当事項はございません。

<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(2020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(64,108,529千口)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	2020年5月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB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
国 債 証 券	千円 64,445,000 (1,120,000)	千円 71,055,606 (1,331,245)	% 78.2 (1.5)	% — (—)	% 55.4 (1.4)	% 15.2 (0.1)	% 7.6 (—)
地 方 債 証 券	5,918,000 (5,918,000)	6,213,097 (6,213,097)	6.8 (6.8)	— (—)	3.2 (3.2)	3.3 (3.3)	0.3 (0.3)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	7,204,928 (7,192,755)	7,609,001 (7,596,520)	8.4 (8.4)	— (—)	4.7 (4.6)	3.2 (3.2)	0.6 (0.6)
金 融 債 券	500,000 (500,000)	499,856 (499,856)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	5,100,000 (5,100,000)	5,202,222 (5,202,222)	5.7 (5.7)	— (—)	2.3 (2.3)	2.5 (2.5)	0.9 (0.9)
合 計	83,167,928 (19,830,755)	90,579,783 (20,842,940)	99.6 (22.9)	— (—)	65.5 (11.5)	24.7 (9.5)	9.4 (1.9)

(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402回 利付国債(2年)	0.1	800,000	802,512	2021/ 7/ 1
第404回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,724	2021/ 9/ 1
第128回 利付国債(5年)	0.1	560,000	561,708	2021/ 6/20
第129回 利付国債(5年)	0.1	800,000	802,960	2021/ 9/20
第130回 利付国債(5年)	0.1	300,000	301,314	2021/12/20
第131回 利付国債(5年)	0.1	420,000	422,129	2022/ 3/20
第132回 利付国債(5年)	0.1	350,000	352,016	2022/ 6/20
第133回 利付国債(5年)	0.1	350,000	352,261	2022/ 9/20
第134回 利付国債(5年)	0.1	490,000	493,503	2022/12/20
第135回 利付国債(5年)	0.1	420,000	423,234	2023/ 3/20
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	141,152	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,873	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	600,000	605,526	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	300,000	302,895	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	520,000	525,241	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	550,000	555,764	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	550,000	555,841	2024/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	116,027	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	280,000	334,328	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	71,022	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	239,784	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	283,346	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	270,855	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	234,768	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	192,632	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	180,000	268,943	2051/ 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 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	275,463	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	257,621	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	150,000	206,884	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	200,000	258,388	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	340,000	330,167	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	300,000	341,043	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	220,846	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	100,000	100,162	2059/ 3/20
第315回 利付国債(10年)	1.2	700,000	710,514	2021/ 6/20
第317回 利付国債(10年)	1.1	630,000	640,804	2021/ 9/20
第318回 利付国債(10年)	1.0	400,000	406,324	2021/ 9/20
第319回 利付国債(10年)	1.1	300,000	306,129	2021/12/20
第320回 利付国債(10年)	1.0	710,000	723,369	2021/12/20
第321回 利付国債(10年)	1.0	400,000	408,668	2022/ 3/20
第322回 利付国債(10年)	0.9	200,000	203,964	2022/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	204,532	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	360,000	367,401	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	400,000	409,172	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	306,792	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	350,000	358,837	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	760,000	776,689	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	607,587	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	722,582	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	307,659	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	750,000	770,445	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	420,000	432,159	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	510,000	525,631	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	205,592	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	100,000	102,910	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	100,000	101,962	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	369,198	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	400,000	410,756	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	420,000	431,856	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	590,000	604,118	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	550,000	557,276	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	420,000	425,796	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	750,000	760,785	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	720,000	730,764	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	710,000	720,763	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	380,000	385,977	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	520,000	528,278	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	650,000	660,445	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	800,000	812,640	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	440,000	446,811	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	550,000	558,310	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	590,000	598,407	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	587,980	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	506,385	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	420,000	425,111	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	380,000	384,195	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	80,000	80,826	2030/ 3/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	50,558	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	6,179	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	88,672	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	54,388	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	162,175	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	113,103	2033/ 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 13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	87,249	2033/12/20
第 14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	156,391	2034/ 3/20
第 18回 利付国債(30年)	2.3	100,000	130,450	2035/ 3/20
第 19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	143,942	2035/ 6/20
第 20回 利付国債(30年)	2.5	100,000	134,237	2035/ 9/20
第 21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	131,553	2035/12/20
第 23回 利付国債(30年)	2.5	180,000	243,775	2036/ 6/20
第 25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	345,462	2036/12/20
第 26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	242,726	2037/ 3/20
第 27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	438,947	2037/ 9/20
第 28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	413,853	2038/ 3/20
第 29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	397,259	2038/ 9/20
第 30回 利付国債(30年)	2.3	280,000	380,528	2039/ 3/20
第 31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	296,687	2039/ 9/20
第 32回 利付国債(30年)	2.3	230,000	316,128	2040/ 3/20
第 33回 利付国債(30年)	2.0	240,000	317,613	2040/ 9/20
第 34回 利付国債(30年)	2.2	300,000	410,580	2041/ 3/20
第 35回 利付国債(30年)	2.0	320,000	426,972	2041/ 9/20
第 36回 利付国債(30年)	2.0	330,000	442,259	2042/ 3/20
第 37回 利付国債(30年)	1.9	380,000	503,093	2042/ 9/20
第 38回 利付国債(30年)	1.8	250,000	326,660	2043/ 3/20
第 39回 利付国債(30年)	1.9	180,000	239,603	2043/ 6/20
第 40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	196,722	2043/ 9/20
第 41回 利付国債(30年)	1.7	120,000	154,965	2043/12/20
第 42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	258,552	2044/ 3/20
第 43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	362,770	2044/ 6/20
第 44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	168,610	2044/ 9/20
第 45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	312,970	2044/12/20
第 46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	400,886	2045/ 3/20
第 47回 利付国債(30年)	1.6	100,000	127,799	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	246,302	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	271,073	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	326,190	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	231,592	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	263,369	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	311,427	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	348,067	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	163,069	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	326,358	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	282,679	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	326,379	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	265,585	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	178,321	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	223,015	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	211,866	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	255,015	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	225,556	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	240,000	235,329	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	100,000	98,039	2050/ 3/20
第 51回 利付国債(20年)	2.0	30,000	30,717	2021/ 6/21
第 52回 利付国債(20年)	2.1	65,000	66,998	2021/ 9/21
第 53回 利付国債(20年)	2.1	60,000	62,178	2021/12/20
第 54回 利付国債(20年)	2.2	110,000	114,170	2021/12/20
第 55回 利付国債(20年)	2.0	100,000	104,017	2022/ 3/21
第 56回 利付国債(20年)	2.0	230,000	240,520	2022/ 6/20
第 57回 利付国債(20年)	1.9	130,000	135,673	2022/ 6/20
第 59回 利付国債(20年)	1.7	100,000	104,881	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	104,100	2022/12/20
第 61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	144,670	2023/ 3/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	236,856	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	171,046	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	247,026	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	80,000	85,632	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	175,000	190,839	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	130,398	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	165,673	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	109,626	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	290,000	318,309	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	121,883	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	263,592	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	209,655	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	110,857	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	200,466	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	200,518	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	291,033	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	224,994	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	340,000	380,575	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	226,104	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	285,570	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	287,117	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	228,466	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	310,032	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	69,279	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	160,650	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	229,154	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	200,000	230,534	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	104,250	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	140,000	163,938	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	180,000	209,444	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	300,000	350,622	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	200,000	236,246	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	216,437	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	179,143	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	224,692	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	160,000	190,556	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	201,711	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	200,000	233,854	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	220,000	258,084	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	220,000	262,831	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	251,905	2029/ 9/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	145,531	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	121,704	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	220,000	265,581	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	140,000	168,082	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	118,043	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	300,000	365,565	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	230,000	277,837	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	250,000	308,272	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	250,000	302,877	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	250,000	300,180	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	200,000	240,808	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	119,301	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	300,000	358,806	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	177,712	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132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	237,484	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	300,000	360,510	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	230,000	273,695	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	210,000	247,432	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	116,794	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	106,190	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	290,000	346,358	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	380,000	454,757	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	120,000	145,096	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	230,000	272,865	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	250,000	293,432	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	420,455	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	457,341	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	390,000	465,012	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	380,000	449,543	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	430,000	503,345	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	410,000	468,794	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	500,000	572,050	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	300,000	348,084	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	300,000	343,887	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	380,000	424,361	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	350,000	358,270	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	210,000	208,212	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	320,000	332,038	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	170,000	179,050	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	310,000	331,467	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	230,000	242,003	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	320,000	336,377	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	294,280	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	350,000	361,543	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	350,764	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	330,695	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	329,817	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	222,730	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	278,238	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	248,185	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	208,265	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	30,000	30,306	2040/ 3/20
第 25回 メキシコ合衆国円貨債券(2018)	0.6	100,000	96,115	2023/ 4/20
小 計	—	64,445,000	71,055,606	—
(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	135,201	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	102,132	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,986	2024/12/20
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,151	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	110,420	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	102,257	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	102,255	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	118,201	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,180	2024/10/30
第 3回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	108,821	2027/ 7/16
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,869	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	102,005	2025/ 2/26
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	108,244	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	102,324	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	102,217	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,602	2034/ 5/15

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29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,934	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	118,195	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	102,285	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	102,052	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	116,527	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,636	2034/ 5/26
平成24年度第 9回 千葉県公募公債	0.82	100,000	102,195	2023/ 2/24
平成25年度第 1回 千葉県公募公債	0.58	100,000	101,618	2023/ 4/25
平成25年度第 3回 千葉県公募公債	0.89	100,000	102,669	2023/ 6/23
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	103,950	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,839	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	101,500	2028/10/31
第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	117,000	119,038	2022/ 5/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,813	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	101,776	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,139	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,855	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	102,809	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,221	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	103,453	2024/ 3/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,147	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,996	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,839	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	100,000	100,928	2027/ 7/23
平成28年度第 3回 島根県公募公債	0.001	100,000	99,956	2021/11/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	99,967	2026/11/30
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	102,194	2023/11/29
平成24年度第 1回 熊本市公募公債	0.796	100,000	101,948	2022/11/30
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,632	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	111,352	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	110,357	2024/ 6/20
第475回 名古屋市公募公債(10年)	1.15	100,000	101,223	2021/ 6/18
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	101,732	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	110,953	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,899	2027/ 8/13
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,975	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	111,573	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	102,337	2023/12/20
第 50回 川崎市公募公債(5年)	0.01	100,000	99,957	2022/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,885	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	107,365	2029/10/22
平成23年度第 5回 広島市公募公債	1.01	100,000	101,748	2022/ 2/25
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,765	2027/ 9/17
小 計	—	5,918,000	6,213,097	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
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	110,654	2024/ 3/18
第 38回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	99,988	2023/ 2/17
第 13回 道路債券	2.28	100,000	105,310	2022/ 9/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	135,125	2034/ 6/20
第 55回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.22	100,000	119,830	2030/ 2/ 8
第 92回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	101,707	2022/ 6/20
第 98回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,949	2022/12/20
第100回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.784	100,000	101,985	2022/12/20
第128回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	102,373	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	100,000	102,127	2024/ 6/20
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	101,840	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	117,302	2032/ 7/30

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	108,051	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	100,000	101,881	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	127,251	2044/ 8/31
第239回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	112,421	2035/ 2/28
第 5回 政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.173	100,000	100,623	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	120,279	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	120,634	2031/ 1/28
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	117,078	2028/ 4/25
第 25回 地方公共団体金融機構債券	1.178	200,000	202,618	2021/ 6/28
第 34回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	101,740	2022/ 3/14
第 37回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	400,000	407,440	2022/ 6/17
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	101,763	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	115,175	2034/ 9/28
第 42回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	100,000	102,001	2022/11/14
第 46回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	101,881	2023/ 3/17
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	102,334	2024/ 9/13
第 76回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	102,131	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	101,412	2028/10/27
第119回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.04	100,000	99,911	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	106,888	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	102,880	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	102,334	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	136,926	2037/ 3/19
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	116,539	2034/ 4/28
第229回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	200,000	204,762	2024/10/31
第261回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.381	100,000	101,969	2025/11/28
第288回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	100,000	99,809	2026/ 9/30
第354回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	100,000	100,654	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	108,642	2029/ 6/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,540	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	102,383	2023/10/20
第 22回 新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.05	100,000	100,035	2023/12/20
第 38回 関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.112	100,000	101,763	2021/12/20
第 1回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.51	11,225	11,378	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	12,945	13,347	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.82	11,365	11,571	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	13,623	14,177	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	15,251	15,960	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	117,549	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	15,164	15,929	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	23,450	23,991	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	12,173	12,480	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	40,870	43,877	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	23,104	24,999	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	20,962	22,450	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	27,786	29,779	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	28,700	30,436	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	28,951	30,635	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,044	13,632	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	59,490	63,319	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,331	15,114	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	30,400	32,197	2046/ 7/10
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	82,132	86,940	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	109,766	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,907	51,606	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	49,443	51,520	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	54,972	57,151	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))	%	千円	千円	
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,400	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	61,493	62,807	2050/ 2/10
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	84,869	85,764	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,903	87,099	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	86,010	87,269	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	90,492	91,731	2053/ 2/10
第132回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.092	100,000	107,547	2028/ 3/17
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	94,225	94,951	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	95,873	96,219	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	97,859	96,751	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	99,521	99,532	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	101,905	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,294	2026/12/18
第 11回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.067	100,000	101,865	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	102,111	2023/ 2/ 8
小 計	—	7,204,928	7,609,001	—
(金融債券)	%	千円	千円	
第327回 信金中金債(5年)	0.06	100,000	100,018	2022/ 2/25
第335回 信金中金債(5年)	0.1	100,000	100,097	2022/10/27
第341回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,147	2023/ 4/27
第238号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,594	2022/11/25
小 計	—	500,000	499,856	—
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第530回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	0.274	100,000	99,109	2029/ 6/25
第517回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.19	100,000	100,015	2023/ 6/20
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,109	2024/10/25
第308回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.769	100,000	102,328	2024/ 9/25
第508回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.465	100,000	100,301	2029/ 4/25
第451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	100,444	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	120,106	2030/12/13
第 36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)	0.06	100,000	100,054	2021/ 6/18
第 24回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.609	100,000	102,426	2024/ 9/20
第 30回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.17	100,000	100,238	2026/ 5/22
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	100,315	2021/ 6/18
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)	0.395	100,000	99,718	2028/ 9/14
第 8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)	0.12	100,000	99,718	2023/ 1/30
第 12回 日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	0.11	100,000	99,573	2023/ 9/ 8
第 30回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.375	100,000	99,582	2027/ 7/16
第 32回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	100,000	99,508	2025/ 7/18
第 4回 日本土地建物株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.734	100,000	100,874	2028/10/25
第 57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)	0.24	100,000	99,743	2024/ 9/13
第 12回 ヤフー株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.37	100,000	97,832	2026/ 7/31
第 7回 新日鐵住金株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.12	100,000	99,447	2023/ 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	101,689	2024/ 7/30
第 16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)	0.3	100,000	99,867	2023/ 9/20
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	100,279	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	101,377	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	113,796	2029/ 7/13
第 20回 株式会社りそなホールディングス無担保社債(社債間限定同順位)	0.27	100,000	99,694	2025/ 7/23
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	100,457	2024/ 9/12
第 31回 株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位)	0.418	100,000	100,299	2021/ 6/18
第 80回 日立キャピタル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.28	100,000	97,231	2029/10/19
第 75回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.22	100,000	99,445	2025/ 1/23
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)	0.31	100,000	98,530	2030/ 4/16
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	102,077	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	101,619	2024/ 3/22
第 65回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	2.149	100,000	117,203	2029/12/21

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 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約付)	2.26	100,000	115,034	2027/12/20
第 71回	東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	1.917	100,000	126,995	2044/10/28
第 22回	東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	0.215	100,000	99,860	2027/ 6/21
第 11回	日本通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.2	100,000	98,856	2026/ 7/14
第 25回	KDD I 株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.395	100,000	99,508	2028/11/22
第 35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)	1.126	100,000	102,393	2022/10/20
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	102,631	2024/ 2/20
第 7回	東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.46	100,000	100,524	2022/10/24
第 14回	東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.43	100,000	100,347	2023/ 7/24
第 34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)	1.064	100,000	101,367	2021/ 9/22
第 17回	北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.25	100,000	100,170	2024/ 3/14
第 3回	東京都競馬株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.18	100,000	99,595	2023/ 7/ 5
第 1回	ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20クレディ・アグリコル・エス・エー第6回 円貨社債)	0.64	100,000	99,948	2022/ 1/27
第 1回	H S B Cホールディングス	0.865	100,000	101,869	2024/11/28
第 6回	ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債(201)	0.45	100,000	99,829	2021/ 9/24
第 10回	オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201)	0.65	100,000	98,131	2023/ 5/30
		0.293	100,000	100,162	2024/ 1/23
小 計		—	5,100,000	5,202,222	—
合 計		—	83,167,928	90,579,783	—

(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 比 率	債券先物 比 率	純資産 総 額
		期 中 騰落率			
	円	%	%	%	百万円
16期(2016年3月31日)	13,974	5.4	99.6	—	122,106
17期(2017年3月31日)	13,813	△1.2	100.2	—	102,643
18期(2018年4月 2日)	13,944	0.9	99.8	—	92,283
19期(2019年4月 1日)	14,186	1.7	99.5	—	97,559
20期(2020年3月31日)	14,183	△0.0	100.2	—	98,352

(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 比 率	債券先物 比 率
		騰落率		騰落率		
(期 首) 2019年 4月 1日	円 14,186	% —	388.52	% —	% 99.5	% —
4月末	14,162	△0.2	387.94	△0.1	99.5	—
5月末	14,252	0.5	390.32	0.5	99.1	—
6月末	14,337	1.1	392.69	1.1	99.4	—
7月末	14,354	1.2	393.15	1.2	98.6	—
8月末	14,545	2.5	398.50	2.6	99.4	—
9月末	14,391	1.4	394.27	1.5	99.2	—
10月末	14,336	1.1	392.61	1.1	99.5	—
11月末	14,287	0.7	391.33	0.7	99.3	—
12月末	14,245	0.4	390.14	0.4	99.2	—
2020年 1月末	14,305	0.8	391.77	0.8	99.1	—
2月末	14,416	1.6	394.74	1.6	99.3	—
(期 末) 2020年 3月31日	14,183	△0.0	388.45	△0.0	100.2	—

(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。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期
	(2019.4.2～2020.3.31)
	金 額
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0円 (0)
合 計	0

(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。

(a) その他費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	16,970,665	15,829,252
	地 方 債 証 券	960,671	958,329
	特 殊 債 券	1,938,184	922,530 (121,195)
	社 債 券	1,330,171	812,859

(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) ()内は償還等による減少分で、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 (2019年4月2日から2020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138回 利付国債(5年)	916,038	第127回 利付国債(5年)	1,103,780
第402回 利付国債(2年)	805,616	第312回 利付国債(10年)	912,807
第357回 利付国債(10年)	743,054	第125回 利付国債(5年)	803,011
第356回 利付国債(10年)	713,077	第124回 利付国債(5年)	752,115
第141回 利付国債(5年)	659,729	第310回 利付国債(10年)	739,723
第350回 利付国債(10年)	596,520	第308回 利付国債(10年)	670,150
第354回 利付国債(10年)	594,575	第126回 利付国債(5年)	651,839
第140回 利付国債(5年)	582,745	第133回 利付国債(5年)	606,918
第142回 利付国債(5年)	559,531	第101回 利付国債(20年)	377,294
第32回 利付国債(30年)	550,171	第314回 利付国債(10年)	375,083

(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 (2019年4月2日から2020年3月31日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	千円	千円	千円
公 社 債	100,099	0	97,121

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立キャピタルです。

■組入資産の明細 (2020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	69,995,000 (1,220,000)	77,504,348 (1,452,180)	78.8 (1.5)	— (—)	55.6 (1.4)	15.8 (0.1)	7.4 (—)
地 方 債 証 券	6,428,000 (6,428,000)	6,720,652 (6,720,652)	6.8 (6.8)	— (—)	3.5 (3.5)	3.0 (3.0)	0.3 (0.3)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	7,926,041 (7,913,641)	8,354,716 (8,341,977)	8.5 (8.5)	— (—)	4.5 (4.5)	3.4 (3.4)	0.5 (0.5)
金 融 債 証 券	500,000 (500,000)	498,592 (498,592)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債)	5,400,000 (5,400,000)	5,496,393 (5,496,393)	5.6 (5.6)	— (—)	2.3 (2.3)	2.3 (2.3)	0.9 (0.9)
合 計	90,249,041 (21,461,641)	98,574,702 (22,509,796)	100.2 (22.9)	— (—)	65.9 (11.7)	25.1 (9.3)	9.2 (1.8)

(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) ー印は組み入れなし。

(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402回 利付国債(2年)	0.1	800,000	802,400	2021/ 7/ 1
第404回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,668	2021/ 9/ 1
第128回 利付国債(5年)	0.1	560,000	561,568	2021/ 6/20
第129回 利付国債(5年)	0.1	800,000	802,768	2021/ 9/20
第130回 利付国債(5年)	0.1	300,000	301,215	2021/12/20
第131回 利付国債(5年)	0.1	420,000	421,986	2022/ 3/20
第132回 利付国債(5年)	0.1	350,000	351,907	2022/ 6/20
第133回 利付国債(5年)	0.1	350,000	352,170	2022/ 9/20
第134回 利付国債(5年)	0.1	490,000	493,341	2022/12/20
第135回 利付国債(5年)	0.1	420,000	423,129	2023/ 3/20
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	141,086	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,802	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	900,000	907,398	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	300,000	302,628	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	370,000	373,448	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	650,000	656,422	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	550,000	555,610	2024/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	115,877	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	280,000	333,782	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	70,900	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	238,696	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	440,000	516,313	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	274,347	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	237,849	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	195,228	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	180,000	273,036	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	279,729	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	261,689	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	150,000	210,516	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	200,000	262,966	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	620,000	614,203	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	300,000	347,745	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	225,624	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	100,000	102,336	2059/ 3/20
第315回 利付国債(10年)	1.2	700,000	711,368	2021/ 6/20
第316回 利付国債(10年)	1.1	400,000	406,004	2021/ 6/20
第317回 利付国債(10年)	1.1	630,000	641,421	2021/ 9/20
第318回 利付国債(10年)	1.0	400,000	406,660	2021/ 9/20
第319回 利付国債(10年)	1.1	300,000	306,363	2021/12/20
第320回 利付国債(10年)	1.0	710,000	723,830	2021/12/20
第321回 利付国債(10年)	1.0	400,000	408,952	2022/ 3/20
第322回 利付国債(10年)	0.9	200,000	204,082	2022/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	204,630	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	360,000	367,531	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	900,000	921,087	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	306,879	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	650,000	666,685	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	760,000	776,750	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	607,735	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	722,694	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	307,635	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	750,000	770,175	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	630,000	648,074	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	510,000	525,682	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	205,666	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	100,000	102,992	2024/12/20

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337回 利付国債(10年)	0.3	100,000	102,018	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	369,446	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	400,000	411,140	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	420,000	432,264	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	590,000	604,620	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	550,000	557,436	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	720,000	730,152	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	750,000	761,257	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	720,000	731,469	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	710,000	721,984	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	380,000	386,790	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	520,000	529,422	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	650,000	661,401	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	800,000	813,176	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	440,000	446,921	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	550,000	558,200	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	590,000	598,271	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	587,302	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	505,775	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	420,000	424,174	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	480,000	484,190	2029/12/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	50,583	2029/ 9/20
第 4回 利付国債(30年)	2.9	200,000	259,904	2030/11/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	6,163	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	88,318	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	54,112	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	161,285	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	112,504	2033/ 9/20
第13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	86,767	2033/12/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	155,659	2034/ 3/20
第18回 利付国債(30年)	2.3	100,000	129,856	2035/ 3/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	143,270	2035/ 6/20
第20回 利付国債(30年)	2.5	300,000	400,839	2035/ 9/20
第21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	131,008	2035/12/20
第22回 利付国債(30年)	2.5	200,000	269,092	2036/ 3/20
第23回 利付国債(30年)	2.5	180,000	243,127	2036/ 6/20
第24回 利付国債(30年)	2.5	200,000	270,974	2036/ 9/20
第25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	344,988	2036/12/20
第26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	242,595	2037/ 3/20
第27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	439,424	2037/ 9/20
第28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	414,993	2038/ 3/20
第29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	398,674	2038/ 9/20
第30回 利付国債(30年)	2.3	280,000	382,211	2039/ 3/20
第31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	298,544	2039/ 9/20
第32回 利付国債(30年)	2.3	530,000	733,138	2040/ 3/20
第33回 利付国債(30年)	2.0	240,000	319,612	2040/ 9/20
第34回 利付国債(30年)	2.2	300,000	413,661	2041/ 3/20
第35回 利付国債(30年)	2.0	320,000	430,166	2041/ 9/20
第36回 利付国債(30年)	2.0	330,000	445,615	2042/ 3/20
第37回 利付国債(30年)	1.9	380,000	507,459	2042/ 9/20
第38回 利付国債(30年)	1.8	250,000	329,865	2043/ 3/20
第39回 利付国債(30年)	1.9	180,000	241,990	2043/ 6/20
第40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	198,682	2043/ 9/20
第41回 利付国債(30年)	1.7	270,000	352,144	2043/12/20
第42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	261,146	2044/ 3/20
第43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	366,438	2044/ 6/20
第44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	170,326	2044/ 9/20
第45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	316,490	2044/12/20

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 46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	405,424	2045/ 3/20
第 47回 利付国債(30年)	1.6	200,000	258,532	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	249,110	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	274,183	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	329,778	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	234,026	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	266,221	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	314,484	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	351,584	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	300,000	329,859	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	330,108	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	286,306	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	330,183	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	268,675	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	260,000	293,228	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	225,647	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	214,613	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	290,000	288,489	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	228,792	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	220,000	218,836	2049/12/20
第 51回 利付国債(20年)	2.0	30,000	30,783	2021/ 6/21
第 52回 利付国債(20年)	2.1	65,000	67,145	2021/ 9/21
第 53回 利付国債(20年)	2.1	60,000	62,307	2021/12/20
第 54回 利付国債(20年)	2.2	110,000	114,418	2021/12/20
第 55回 利付国債(20年)	2.0	100,000	104,206	2022/ 3/21
第 56回 利付国債(20年)	2.0	230,000	240,929	2022/ 6/20
第 57回 利付国債(20年)	1.9	130,000	135,887	2022/ 6/20
第 59回 利付国債(20年)	1.7	100,000	105,024	2022/12/20
第 60回 利付国債(20年)	1.4	100,000	104,205	2022/12/20
第 61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	144,754	2023/ 3/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	236,913	2023/ 6/20
第 63回 利付国債(20年)	1.8	400,000	424,956	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	171,294	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	247,316	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	80,000	85,724	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	175,000	191,143	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	130,592	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	166,029	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	109,838	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	290,000	319,011	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	122,202	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	264,223	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	210,212	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	111,163	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	201,038	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	201,070	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	291,868	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	225,638	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	340,000	381,626	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	226,684	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	286,360	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	230,000	262,068	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	287,907	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	229,072	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	310,953	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	69,492	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	161,165	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	229,950	2027/ 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 94回	利付国債(20年)	2.1	200,000	231,356	2027/ 3/20
第 96回	利付国債(20年)	2.1	90,000	104,663	2027/ 6/20
第 97回	利付国債(20年)	2.2	140,000	164,609	2027/ 9/20
第 98回	利付国債(20年)	2.1	180,000	210,283	2027/ 9/20
第 99回	利付国債(20年)	2.1	300,000	351,897	2027/12/20
第100回	利付国債(20年)	2.2	300,000	355,413	2028/ 3/20
第102回	利付国債(20年)	2.4	180,000	217,022	2028/ 6/20
第103回	利付国債(20年)	2.3	150,000	179,610	2028/ 6/20
第105回	利付国債(20年)	2.1	190,000	225,134	2028/ 9/20
第106回	利付国債(20年)	2.2	160,000	190,950	2028/ 9/20
第107回	利付国債(20年)	2.1	170,000	202,101	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	200,000	234,260	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	220,000	258,293	2029/ 3/20
第112回	利付国債(20年)	2.1	220,000	263,199	2029/ 6/20
第113回	利付国債(20年)	2.1	210,000	251,886	2029/ 9/20
第114回	利付国債(20年)	2.1	320,000	384,947	2029/12/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	120,000	145,520	2029/12/20
第116回	利付国債(20年)	2.2	100,000	121,624	2030/ 3/20
第117回	利付国債(20年)	2.1	320,000	386,016	2030/ 3/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	140,000	167,927	2030/ 6/20
第119回	利付国債(20年)	1.8	100,000	117,912	2030/ 6/20
第123回	利付国債(20年)	2.1	300,000	364,800	2030/12/20
第124回	利付国債(20年)	2.0	230,000	277,232	2030/12/20
第125回	利付国債(20年)	2.2	250,000	307,452	2031/ 3/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	250,000	302,020	2031/ 3/20
第127回	利付国債(20年)	1.9	250,000	299,302	2031/ 3/20
第128回	利付国債(20年)	1.9	320,000	384,118	2031/ 6/20
第129回	利付国債(20年)	1.8	100,000	118,926	2031/ 6/20
第130回	利付国債(20年)	1.8	300,000	357,432	2031/ 9/20
第131回	利付国債(20年)	1.7	150,000	177,016	2031/ 9/20
第132回	利付国債(20年)	1.7	200,000	236,386	2031/12/20
第134回	利付国債(20年)	1.8	300,000	358,614	2032/ 3/20
第135回	利付国債(20年)	1.7	230,000	272,230	2032/ 3/20
第136回	利付国債(20年)	1.6	250,000	292,960	2032/ 3/20
第138回	利付国債(20年)	1.5	100,000	116,198	2032/ 6/20
第139回	利付国債(20年)	1.6	90,000	105,658	2032/ 6/20
第140回	利付国債(20年)	1.7	290,000	344,604	2032/ 9/20
第141回	利付国債(20年)	1.7	380,000	452,390	2032/12/20
第142回	利付国債(20年)	1.8	120,000	144,354	2032/12/20
第143回	利付国債(20年)	1.6	230,000	271,211	2033/ 3/20
第144回	利付国債(20年)	1.5	250,000	291,630	2033/ 3/20
第145回	利付国債(20年)	1.7	350,000	418,148	2033/ 6/20
第146回	利付国債(20年)	1.7	380,000	454,768	2033/ 9/20
第147回	利付国債(20年)	1.6	390,000	462,294	2033/12/20
第149回	利付国債(20年)	1.5	380,000	446,446	2034/ 6/20
第150回	利付国債(20年)	1.4	430,000	499,758	2034/ 9/20
第151回	利付国債(20年)	1.2	410,000	465,628	2034/12/20
第152回	利付国債(20年)	1.2	600,000	682,230	2035/ 3/20
第153回	利付国債(20年)	1.3	300,000	345,927	2035/ 6/20
第154回	利付国債(20年)	1.2	300,000	341,940	2035/ 9/20
第155回	利付国債(20年)	1.0	380,000	422,149	2035/12/20
第156回	利付国債(20年)	0.4	380,000	386,969	2036/ 3/20
第157回	利付国債(20年)	0.2	130,000	128,286	2036/ 6/20
第158回	利付国債(20年)	0.5	320,000	330,822	2036/ 9/20
第159回	利付国債(20年)	0.6	170,000	178,403	2036/12/20
第160回	利付国債(20年)	0.7	310,000	330,553	2037/ 3/20
第161回	利付国債(20年)	0.6	330,000	346,490	2037/ 6/20
第162回	利付国債(20年)	0.6	320,000	336,214	2037/ 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163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	294,131	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	450,000	465,340	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	351,441	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	331,411	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	330,464	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	223,346	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	330,000	329,399	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	249,540	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	209,609	2039/12/20
第25回 メキシコ合衆国円貨債券(2018)	0.6	100,000	98,874	2023/ 4/20
小 計	—	69,995,000	77,504,348	—
(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	135,918	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	102,067	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,898	2024/12/20
第748回 東京都公募公債	0.456	100,000	101,937	2025/ 9/19
第754回 東京都公募公債	0.06	100,000	99,762	2026/ 3/19
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	101,973	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	110,443	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	102,215	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	102,182	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	118,341	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,148	2024/10/30
第405回 大阪府公募公債(10年)	0.19	100,000	100,410	2026/ 2/26
第420回 大阪府公募公債(10年)	0.17	110,000	110,077	2027/ 5/28
第 3回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	108,592	2027/ 7/16
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,729	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,958	2025/ 2/26
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	107,903	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	102,250	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	102,073	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,156	2034/ 5/15
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,567	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	118,151	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	102,212	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	101,965	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	116,266	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,180	2034/ 5/26
平成24年度第 9回 千葉県公募公債	0.82	100,000	102,186	2023/ 2/24
平成25年度第 1回 千葉県公募公債	0.58	100,000	101,575	2023/ 4/25
平成25年度第 3回 千葉県公募公債	0.89	100,000	102,659	2023/ 6/23
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	104,516	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,604	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	101,092	2028/10/31
第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	117,000	119,072	2022/ 5/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,838	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	101,793	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,128	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,827	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	102,798	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,181	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	103,407	2024/ 3/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,065	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,898	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,606	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	200,000	201,110	2027/ 7/23
平成28年度第 3回 島根県公募公債	0.001	100,000	99,891	2021/11/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	99,729	2026/11/30

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25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	102,154	2023/11/29
平成24年度第 1回 熊本市公募公債	0.796	100,000	101,946	2022/11/30
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,401	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	111,106	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	110,530	2024/ 6/20
第475回 名古屋市公募公債(10年)	1.15	100,000	101,311	2021/ 6/18
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	101,698	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	110,994	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,531	2027/ 8/13
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,749	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	111,606	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	102,303	2023/12/20
第 50回 川崎市公募公債(5年)	0.01	100,000	99,876	2022/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,794	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	107,102	2029/10/22
平成23年度第 5回 広島市公募公債	1.01	100,000	101,799	2022/ 2/25
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,404	2027/ 9/17
小 計	—	6,428,000	6,720,652	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
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	110,674	2024/ 3/18
第 38回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	200,000	199,856	2023/ 2/17
第 13回 道路債券	2.28	100,000	105,550	2022/ 9/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	134,518	2034/ 6/20
第 55回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.22	100,000	119,846	2030/ 2/ 8
第 92回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	101,773	2022/ 6/20
第 98回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,998	2022/12/20
第100回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.784	100,000	102,036	2022/12/20
第128回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	102,444	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	100,000	102,192	2024/ 6/20
第135回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.939	100,000	107,228	2029/ 6/20
第148回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.485	100,000	102,098	2024/12/20
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	101,894	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	116,691	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	108,103	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	100,000	101,900	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	128,493	2044/ 8/31
第239回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	111,632	2035/ 2/28
第 5回 政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.173	100,000	100,586	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	120,113	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	120,413	2031/ 1/28
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	117,159	2028/ 4/25
第 25回 地方公共団体金融機構債券	1.178	200,000	202,840	2021/ 6/28
第 34回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	101,826	2022/ 3/14
第 37回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	400,000	407,696	2022/ 6/17
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	101,830	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	114,349	2034/ 9/28
第 42回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	100,000	102,045	2022/11/14
第 46回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	101,900	2023/ 3/17
第 56回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	200,000	205,528	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	102,332	2024/ 9/13
第 76回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	102,039	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	101,347	2028/10/27
第119回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.04	100,000	99,909	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	106,882	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	102,923	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	102,332	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	136,742	2037/ 3/19
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	115,793	2034/ 4/28

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220回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	102,646	2024/ 6/28
第229回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	200,000	204,756	2024/10/31
第261回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.381	100,000	101,869	2025/11/28
第288回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	100,000	99,739	2026/ 9/30
第354回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	100,000	100,664	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	108,761	2029/ 6/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,617	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	102,401	2023/10/20
第 22回 新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.05	100,000	99,999	2023/12/20
第 38回 関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.112	100,000	101,864	2021/12/20
第 1回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.51	11,522	11,688	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	13,217	13,643	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.82	11,589	11,812	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	13,865	14,443	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	15,611	16,339	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	117,645	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	15,391	16,178	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	23,848	24,443	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	12,400	12,739	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	41,724	44,824	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	23,370	25,313	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	21,317	22,845	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	28,359	30,414	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	29,850	31,646	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	30,077	31,836	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,380	13,995	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	60,946	64,868	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,508	15,277	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	30,892	32,722	2046/ 7/10
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,806	88,699	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	110,076	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	49,676	52,371	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	50,534	52,603	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	55,764	57,905	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	57,342	59,300	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	62,431	63,660	2050/ 2/10
第102回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.441	100,000	109,092	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	85,637	86,356	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	86,690	87,712	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	86,916	88,003	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	91,291	92,359	2053/ 2/10
第132回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.092	100,000	107,499	2028/ 3/17
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	95,000	95,515	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	96,596	96,729	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	98,492	97,157	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	100,000	99,800	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	102,025	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,226	2026/12/18
第 11回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.067	100,000	101,956	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	102,160	2023/ 2/ 8
小 計	—	7,926,041	8,354,716	—
(金融債券)	%	千円	千円	
第327回 信金中金債(5年)	0.06	100,000	99,837	2022/ 2/25
第335回 信金中金債(5年)	0.1	100,000	99,832	2022/10/27
第341回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	99,799	2023/ 4/27
第238号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,124	2022/11/25
小 計	—	500,000	498,592	—

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530回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	0.274	100,000	98,523	2029/ 6/25
第517回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.19	100,000	99,744	2023/ 6/20
第382回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.517	100,000	100,446	2021/ 5/25
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	99,774	2024/10/25
第308回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.769	100,000	102,054	2024/ 9/25
第508回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.465	100,000	99,781	2029/ 4/25
第451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	100,103	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	119,887	2030/12/13
第 36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)	0.06	100,000	100,029	2021/ 6/18
第 24回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.609	100,000	102,450	2024/ 9/20
第 30回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.17	100,000	100,182	2026/ 5/22
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	100,323	2021/ 6/18
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)	0.395	100,000	99,755	2028/ 9/14
第 8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)	0.12	100,000	99,657	2023/ 1/30
第 12回 日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	0.11	100,000	99,471	2023/ 9/ 8
第 30回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.375	100,000	99,796	2027/ 7/16
第 32回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	100,000	99,530	2025/ 7/18
第 4回 日本土地建物株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.734	100,000	100,928	2028/10/25
第 57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)	0.24	100,000	99,720	2024/ 9/13
第 12回 ヤフー株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.37	100,000	97,865	2026/ 7/31
第 7回 新日鐵住金株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.12	100,000	99,407	2023/ 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	101,678	2024/ 7/30
第 16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)	0.3	100,000	100,016	2023/ 9/20
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	100,268	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	101,481	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	114,233	2029/ 7/13
第 20回 株式会社りそなホールディングス無担保社債(社債間限定同順位)	0.27	100,000	99,671	2025/ 7/23
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	99,766	2024/ 9/12
第 2回 NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.26	100,000	99,722	2026/12/18
第 31回 株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位)	0.418	100,000	100,305	2021/ 6/18
第 80回 日立キャピタル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.28	100,000	97,121	2029/10/19
第 75回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.22	100,000	98,924	2025/ 1/23
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)	0.31	100,000	98,343	2030/ 4/16
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	102,078	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	101,594	2024/ 3/22
第 65回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	2.149	100,000	116,542	2029/12/21
第126回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	0.275	100,000	99,602	2028/ 1/26
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約付)	2.26	100,000	114,623	2027/12/20
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	128,473	2044/10/28
第 22回 東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	0.215	100,000	99,292	2027/ 6/21
第 11回 日本通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.2	100,000	98,910	2026/ 7/14
第 25回 KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.395	100,000	99,544	2028/11/22
第 35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)	1.126	100,000	102,388	2022/10/20
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	102,403	2024/ 2/20
第 7回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.46	100,000	100,363	2022/10/24
第 14回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.43	100,000	99,965	2023/ 7/24
第 34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)	1.064	100,000	101,416	2021/ 9/22
第 17回 北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.25	100,000	99,847	2024/ 3/14
第 3回 東京競馬株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.18	100,000	99,546	2023/ 7/ 5
第 1回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債)	0.64	100,000	99,936	2022/ 1/27
第 1回 H S B Cホールディングス	0.865	100,000	101,880	2024/11/28
第 6回 ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債(2)	0.45	100,000	99,511	2021/ 9/24
第 10回 オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201)	0.65	100,000	97,390	2023/ 5/30
第 10回 オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201)	0.293	100,000	100,137	2024/ 1/23
小 計	—	5,400,000	5,496,393	—
合 計	—	90,249,041	98,574,702	—

(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(2020年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 98,574,702	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,438,263	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	100,012,965	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

2020年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	100,012,965,968円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	905,575,088
公 社 債(評価額)	98,574,702,909
未 収 入 金	406,911,000
未 収 利 息	124,710,044
前 払 費 用	1,066,927
(B) 負 債	1,660,109,993
未 払 金	1,644,906,300
未 払 解 約 金	15,200,000
未 払 利 息	2,605
そ の 他 未 払 費 用	1,088
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	98,352,855,975
元 本	69,344,130,164
次 期 繰 越 損 益 金	29,008,725,811
(D) 受 益 権 総 口 数	69,344,130,164口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,183円

(注1) 当ファンドの期首元本額は68,772,463,677円、期中追加設定元本額は7,455,857,381円、期中一部解約元本額は6,884,190,894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)

45,750,587,717円

日立国内債券インデックスファンド

11,293,170,697円

日立バランスファンド(株式50)

5,863,871,238円

日立バランスファンド(株式30)

3,541,012,796円

日立バランスファンド(株式70)

2,895,487,716円

(注3) 1口当たり純資産額は1.4183円です。

■損益の状況

当期(自2019年4月2日 至2020年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	941,380,318円
受 取 利 息	941,844,641
そ の 他 収 益 金	93,000
支 払 利 息	△557,323
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,041,720,796
売 買 益	237,370,002
売 買 損	△1,279,090,798
(C) 信 託 報 酬 等	△3,961
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△100,344,439
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,787,331,899
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,280,547,457
(G) 解 約 差 損 益 金	△2,958,809,106
(H) 計 (D + E + F + G)	29,008,725,811
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	29,008,725,811

(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。

(注4) 損益の状況の中で(G)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。