



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20期

(決算日 2021年5月17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20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			
16期(2017年5月15日)	円	%		%	%	%	百万円
	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
20期(2021年5月17日)	12,945	△0.5	386.85	△0.4	99.0	—	14,676

(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) 2020年 5月15日	円	%		%	%	%
	13,009	—	388.38	—	99.5	—
5月末	12,998	△0.1	388.13	△0.1	99.5	—
6月末	12,947	△0.5	386.56	△0.5	99.1	—
7月末	12,990	△0.1	387.91	△0.1	99.0	—
8月末	12,929	△0.6	386.09	△0.6	98.8	—
9月末	12,966	△0.3	387.22	△0.3	99.1	—
10月末	12,943	△0.5	386.63	△0.4	99.1	—
11月末	12,960	△0.4	387.12	△0.3	99.3	—
12月末	12,961	△0.4	387.20	△0.3	99.0	—
2021年 1月末	12,927	△0.6	386.25	△0.5	98.8	—
2月末	12,820	△1.5	383.06	△1.4	102.4	—
3月末	12,908	△0.8	385.72	△0.7	99.1	—
4月末	12,932	△0.6	386.44	△0.5	98.9	—
(期 末) 2021年 5月17日	12,945	△0.5	386.85	△0.4	99.0	—

(注1) 騰落率は期首比です。

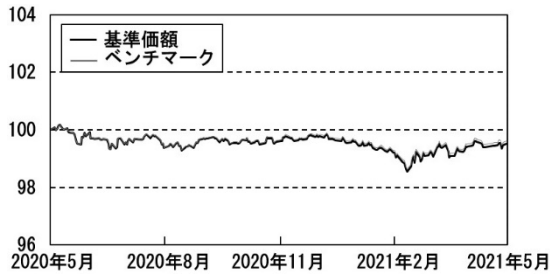
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(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継続したことがプラスに影響しました。

＜下落要因＞

年明け以降、海外金利の上昇に連動したこと、新型コロナウイルス対応の大型財政政策実施に伴う国債増発、日銀の消極的な国債買い入れ姿勢の影響などから、金利が上昇したことがマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2020年5月15日	2020年5月22日	2021年2月26日	2021年5月17日
基 準 価 額	13,009円	13,033円	12,820円	12,945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13,009円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、12,945円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲0.5%となり、ベンチマーク騰落率▲0.4%に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。

期初、1回目の緊急事態宣言の解除後は、世界的に経済活動が再開されていく中で、景気の先行きに対する悲観的な見方は和らいだものの、各国中央銀行の金融緩和策の後押しを受けて、金利は低水準での推移を続けました。2021年に入ると、2回目の緊急事態宣言が再発出される中、米国での大規模な財政出動と新型コロナウイルスのワクチン普及による経済活動の正常化期待から、海外金利が大きく上昇したため、国内金利も上昇基調となりました。

年限別にみると、長期・超長期年限は、新型コロナウイルス対応の大型財政政策実施に伴う国債増発と、日銀の消極的な国債買い入れ姿勢の影響を受けて、金利上昇が続きました。その結果、イールドカーブはスティープニングしました。

スプレッド市場は、全般的にスプレッドが縮小しました。各国中央銀行の積極的な金融緩和姿勢や政府による財政政策のもと、景気の回復とリスク資産価格の上昇が続いたことで、スプレッドは縮小しました。新型コロナウイルスによる企業業績の落ち込みは概ね想定範囲内にとどまっていることや、日銀社債オペによる市場下支えなどもスプレッドの縮小を促しました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで▲0.4%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
	(2020. 5. 16～2021. 5. 17)		
	金 額	比 率	
(a)信 託 報 酬	16円	0.122%	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12,940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	—	—	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）	（―）	（―）	
合 計	16	0.122	

(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。

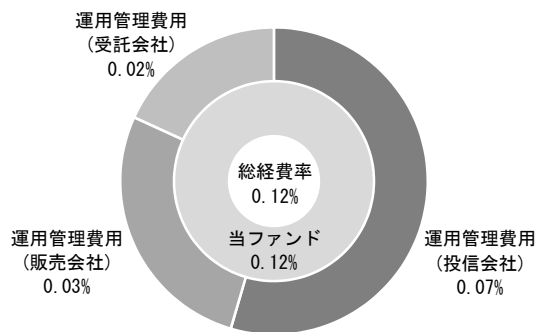
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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(2020年5月16日から2021年5月17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 702, 072	千円 991, 500	千口 1, 448, 854	千円 2, 046, 700

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2020年5月16日から2021年5月17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143回 利付国債(5年)	1, 210, 832	第129回 利付国債(5年)	802, 324
第361回 利付国債(10年)	1, 143, 722	第402回 利付国債(2年)	802, 280
第413回 利付国債(2年)	1, 014, 652	第320回 利付国債(10年)	718, 570
第13回 利付国債(40年)	837, 918	第315回 利付国債(10年)	710, 066
第360回 利付国債(10年)	806, 114	第317回 利付国債(10年)	638, 874
第87回 利付国債(20年)	778, 939	第412回 利付国債(2年)	621, 506
第358回 利付国債(10年)	757, 033	第128回 利付国債(5年)	561, 556
第156回 利付国債(20年)	676, 532	第332回 利付国債(10年)	512, 175
第141回 利付国債(5年)	625, 277	第139回 利付国債(5年)	503, 471
第412回 利付国債(2年)	623, 217	第413回 利付国債(2年)	501, 347

(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(2020年5月16日から2021年5月17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 0	千円 0	千円 99, 698

(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(2021年5月17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, 123, 181	千口 10, 376, 399	千円 14, 660, 815

(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(2021年5月17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 14, 660, 815	% 99. 5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	67, 769	0. 5
投 資 信 託 財 産 総 額	14, 728, 584	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

2021年5月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,728,584,906円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	36,569,615
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	14,660,815,291
未 収 入 金	31,200,000
(B) 負 債	51,788,022
未 払 解 約 金	42,318,401
未 払 信 託 報 酬	9,469,521
未 払 利 息	100
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	14,676,796,884
元 本	11,338,045,888
次 期 繰 越 損 益 金	3,338,750,996
(D) 受 益 権 総 口 数	11,338,045,888口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,945円

(注1) 当ファンドの期首元本額は12,139,336,401円、期中追加設定元本額は2,412,115,921円、期中一部解約元本額は3,213,406,434円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.2945円です。

■損益の状況

当期(自2020年5月16日 至2021年5月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△28,104円
支 払 利 息	△28,104
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△40,966,491
売 買 益	7,269,105
売 買 損	△48,235,596
(C) 信 託 報 酬 等	△19,063,207
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△60,057,802
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	440,630,808
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,958,177,990
(配 当 等 相 当 額)	(2,663,017,938)
(売 買 損 益 相 当 額)	(295,160,052)
(G) 計 (D + E + F)	3,338,750,996
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	3,338,750,996
追 加 信 託 差 損 益 金	2,958,177,990
(配 当 等 相 当 額)	(2,663,017,938)
(売 買 損 益 相 当 額)	(295,160,052)
分 配 準 備 積 立 金	475,379,267
繰 越 損 益 金	△94,806,261

(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(2,863,371,729円)および分配準備積立金(475,379,267円)より分配対象収益は3,338,750,996円(10,000口当たり2,944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(2021年5月17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, 207, 713千口)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	2021年5月17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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	64,360,000 (720,000)	69,607,429 (836,284)	76.7 (0.9)	— (—)	54.7 (0.8)	14.9 (—)	7.2 (0.1)
地 方 債 証 券	6,601,000 (6,601,000)	6,893,487 (6,893,487)	7.6 (7.6)	— (—)	3.0 (3.0)	3.7 (3.7)	0.9 (0.9)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	7,478,976 (7,468,021)	7,860,983 (7,849,902)	8.7 (8.7)	— (—)	4.3 (4.3)	2.4 (2.4)	2.0 (2.0)
金 融 債 券	400,000 (400,000)	400,213 (400,213)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	5,000,000 (5,000,000)	5,115,231 (5,115,231)	5.6 (5.6)	— (—)	2.8 (2.8)	2.8 (2.8)	0.1 (0.1)
合 計	83,839,976 (20,189,021)	89,877,343 (21,095,118)	99.1 (23.3)	— (—)	64.7 (10.8)	23.8 (8.9)	10.6 (3.6)

(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413回 利付国債(2年)	0.1	510,000	511,218	2022/ 6/ 1
第416回 利付国債(2年)	0.1	30,000	30,093	2022/ 9/ 1
第417回 利付国債(2年)	0.1	400,000	401,320	2022/10/ 1
第418回 利付国債(2年)	0.1	40,000	40,140	2022/11/ 1
第421回 利付国債(2年)	0.1	500,000	502,010	2023/ 2/ 1
第422回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,876	2023/ 3/ 1
第423回 利付国債(2年)	0.005	50,000	50,131	2023/ 4/ 1
第132回 利付国債(5年)	0.1	350,000	350,857	2022/ 6/20
第133回 利付国債(5年)	0.1	350,000	351,057	2022/ 9/20
第134回 利付国債(5年)	0.1	390,000	391,427	2022/12/20
第135回 利付国債(5年)	0.1	600,000	602,598	2023/ 3/20
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	140,688	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,552	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	500,000	503,120	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	300,000	302,049	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	120,000	120,874	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	970,000	977,653	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	650,000	655,388	2024/12/20
第143回 利付国債(5年)	0.1	880,000	887,629	2025/ 3/20
第144回 利付国債(5年)	0.1	390,000	393,525	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	50,000	50,480	2025/ 9/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	114,181	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	240,000	281,416	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	69,796	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	235,758	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	279,928	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	261,235	2048/ 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 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	225,366	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	183,847	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	180,000	255,470	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	260,917	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	243,527	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	162,943	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	201,278	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	340,000	310,994	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	235,644	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	207,988	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	165,000	155,128	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	550,000	516,406	2060/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	202,238	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	360,000	363,636	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	200,000	202,486	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	303,945	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	350,000	355,162	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	810,000	820,894	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	601,564	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	715,379	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	305,181	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	250,000	254,777	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	250,000	255,270	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	140,000	143,192	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	204,264	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	400,000	409,092	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	250,000	253,877	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	367,286	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	51,068	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	122,722	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	670,000	682,830	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	430,000	434,179	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	420,000	424,187	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	750,000	757,642	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	810,000	818,415	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	840,000	848,862	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	600,000	606,420	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	660,000	666,930	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	630,000	636,665	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	340,000	343,498	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	440,000	444,378	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	400,000	403,824	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	590,000	595,380	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	584,999	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	504,045	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	520,000	523,900	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	380,000	382,606	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	830,000	835,121	2030/ 3/20
第359回 利付国債(10年)	0.1	370,000	372,009	2030/ 6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1	800,000	803,712	2030/ 9/20
第361回 利付国債(10年)	0.1	950,000	953,163	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1	100,000	100,244	2031/ 3/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	49,261	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	6,058	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	86,834	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	53,556	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	159,848	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	111,199	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	85,844	2033/12/20
第 14回	利付国債(30年)	2.4	120,000	153,621	2034/ 3/20
第 17回	利付国債(30年)	2.4	160,000	206,713	2034/12/20
第 18回	利付国債(30年)	2.3	155,000	198,696	2035/ 3/20
第 19回	利付国債(30年)	2.3	110,000	141,365	2035/ 6/20
第 20回	利付国債(30年)	2.5	50,000	65,850	2035/ 9/20
第 21回	利付国債(30年)	2.3	100,000	129,224	2035/12/20
第 23回	利付国債(30年)	2.5	180,000	239,067	2036/ 6/20
第 25回	利付国債(30年)	2.3	260,000	339,222	2036/12/20
第 26回	利付国債(30年)	2.4	180,000	238,233	2037/ 3/20
第 27回	利付国債(30年)	2.5	320,000	430,678	2037/ 9/20
第 28回	利付国債(30年)	2.5	300,000	405,789	2038/ 3/20
第 29回	利付国債(30年)	2.4	290,000	389,107	2038/ 9/20
第 30回	利付国債(30年)	2.3	230,000	306,072	2039/ 3/20
第 31回	利付国債(30年)	2.2	220,000	289,898	2039/ 9/20
第 32回	利付国債(30年)	2.3	215,000	288,330	2040/ 3/20
第 33回	利付国債(30年)	2.0	70,000	90,432	2040/ 9/20
第 34回	利付国債(30年)	2.2	250,000	333,320	2041/ 3/20
第 35回	利付国債(30年)	2.0	230,000	299,225	2041/ 9/20
第 36回	利付国債(30年)	2.0	370,000	482,942	2042/ 3/20
第 37回	利付国債(30年)	1.9	380,000	490,154	2042/ 9/20
第 38回	利付国債(30年)	1.8	250,000	318,375	2043/ 3/20
第 39回	利付国債(30年)	1.9	180,000	233,379	2043/ 6/20
第 40回	利付国債(30年)	1.8	150,000	191,497	2043/ 9/20
第 41回	利付国債(30年)	1.7	120,000	150,914	2043/12/20
第 42回	利付国債(30年)	1.7	200,000	251,774	2044/ 3/20
第 43回	利付国債(30年)	1.7	280,000	352,839	2044/ 6/20
第 44回	利付国債(30年)	1.7	130,000	163,979	2044/ 9/20
第 45回	利付国債(30年)	1.5	250,000	304,685	2044/12/20
第 46回	利付国債(30年)	1.5	320,000	390,233	2045/ 3/20
第 47回	利付国債(30年)	1.6	140,000	174,045	2045/ 6/20
第 48回	利付国債(30年)	1.4	200,000	239,842	2045/ 9/20
第 49回	利付国債(30年)	1.4	220,000	263,936	2045/12/20
第 50回	利付国債(30年)	0.8	300,000	318,126	2046/ 3/20
第 51回	利付国債(30年)	0.3	240,000	226,272	2046/ 6/20
第 52回	利付国債(30年)	0.5	260,000	256,822	2046/ 9/20
第 53回	利付国債(30年)	0.6	300,000	303,024	2046/12/20
第 54回	利付国債(30年)	0.8	320,000	338,096	2047/ 3/20
第 55回	利付国債(30年)	0.8	150,000	158,374	2047/ 6/20
第 56回	利付国債(30年)	0.8	300,000	316,527	2047/ 9/20
第 57回	利付国債(30年)	0.8	260,000	274,123	2047/12/20
第 58回	利付国債(30年)	0.8	300,000	316,059	2048/ 3/20
第 59回	利付国債(30年)	0.7	250,000	257,022	2048/ 6/20
第 60回	利付国債(30年)	0.9	160,000	172,286	2048/ 9/20
第 61回	利付国債(30年)	0.7	210,000	215,224	2048/12/20
第 62回	利付国債(30年)	0.5	210,000	204,258	2049/ 3/20
第 63回	利付国債(30年)	0.4	260,000	245,726	2049/ 6/20
第 64回	利付国債(30年)	0.4	230,000	216,756	2049/ 9/20
第 65回	利付国債(30年)	0.4	240,000	225,804	2049/12/20
第 66回	利付国債(30年)	0.4	230,000	216,034	2050/ 3/20
第 67回	利付国債(30年)	0.6	140,000	138,626	2050/ 6/20
第 68回	利付国債(30年)	0.6	180,000	178,000	2050/ 9/20
第 69回	利付国債(30年)	0.7	160,000	162,387	2050/12/20
第 56回	利付国債(20年)	2.0	230,000	235,336	2022/ 6/20
第 57回	利付国債(20年)	1.9	130,000	132,874	2022/ 6/20
第 59回	利付国債(20年)	1.7	100,000	102,910	2022/12/20
第 60回	利付国債(20年)	1.4	100,000	102,432	2022/12/20
第 61回	利付国債(20年)	1.0	140,000	142,914	2023/ 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 62回	利付国債(20年)	0.8	230,000	234,482	2023/ 6/20
第 64回	利付国債(20年)	1.9	160,000	167,630	2023/ 9/20
第 65回	利付国債(20年)	1.9	230,000	242,141	2023/12/20
第 66回	利付国債(20年)	1.8	230,000	241,543	2023/12/20
第 68回	利付国債(20年)	2.2	185,000	197,278	2024/ 3/20
第 69回	利付国債(20年)	2.1	120,000	127,622	2024/ 3/20
第 70回	利付国債(20年)	2.4	150,000	161,775	2024/ 6/20
第 71回	利付国債(20年)	2.2	100,000	107,229	2024/ 6/20
第 72回	利付国債(20年)	2.1	290,000	311,709	2024/ 9/20
第 75回	利付国債(20年)	2.1	110,000	119,416	2025/ 3/20
第 76回	利付国債(20年)	1.9	240,000	258,693	2025/ 3/20
第 78回	利付国債(20年)	1.9	190,000	205,733	2025/ 6/20
第 79回	利付国債(20年)	2.0	100,000	108,692	2025/ 6/20
第 80回	利付国債(20年)	2.1	180,000	196,385	2025/ 6/20
第 81回	利付国債(20年)	2.0	180,000	196,614	2025/ 9/20
第 82回	利付国債(20年)	2.1	260,000	285,131	2025/ 9/20
第 83回	利付国債(20年)	2.1	200,000	220,398	2025/12/20
第 84回	利付国債(20年)	2.0	140,000	153,631	2025/12/20
第 85回	利付国債(20年)	2.1	200,000	221,338	2026/ 3/20
第 86回	利付国債(20年)	2.3	250,000	279,102	2026/ 3/20
第 87回	利付国債(20年)	2.2	500,000	555,775	2026/ 3/20
第 88回	利付国債(20年)	2.3	250,000	280,625	2026/ 6/20
第 89回	利付国債(20年)	2.2	200,000	223,478	2026/ 6/20
第 90回	利付国債(20年)	2.2	270,000	303,191	2026/ 9/20
第 91回	利付国債(20年)	2.3	60,000	67,698	2026/ 9/20
第 92回	利付国債(20年)	2.1	140,000	157,186	2026/12/20
第 93回	利付国債(20年)	2.0	200,000	224,400	2027/ 3/20
第 94回	利付国債(20年)	2.1	230,000	259,410	2027/ 3/20
第 96回	利付国債(20年)	2.1	90,000	101,976	2027/ 6/20
第 97回	利付国債(20年)	2.2	210,000	240,292	2027/ 9/20
第 98回	利付国債(20年)	2.1	20,000	22,757	2027/ 9/20
第 99回	利付国債(20年)	2.1	370,000	422,887	2027/12/20
第100回	利付国債(20年)	2.2	450,000	519,475	2028/ 3/20
第102回	利付国債(20年)	2.4	180,000	211,228	2028/ 6/20
第103回	利付国債(20年)	2.3	150,000	174,957	2028/ 6/20
第105回	利付国債(20年)	2.1	190,000	219,778	2028/ 9/20
第106回	利付国債(20年)	2.2	160,000	186,254	2028/ 9/20
第107回	利付国債(20年)	2.1	170,000	197,402	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	200,000	229,196	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	90,000	103,484	2029/ 3/20
第112回	利付国債(20年)	2.1	220,000	257,375	2029/ 6/20
第113回	利付国債(20年)	2.1	210,000	246,584	2029/ 9/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	120,000	142,436	2029/12/20
第116回	利付国債(20年)	2.2	100,000	119,128	2030/ 3/20
第117回	利付国債(20年)	2.1	220,000	260,143	2030/ 3/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	10,000	11,780	2030/ 6/20
第119回	利付国債(20年)	1.8	100,000	115,993	2030/ 6/20
第123回	利付国債(20年)	2.1	70,000	83,618	2030/12/20
第124回	利付国債(20年)	2.0	180,000	213,301	2030/12/20
第125回	利付国債(20年)	2.2	250,000	302,030	2031/ 3/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	120,000	142,629	2031/ 3/20
第127回	利付国債(20年)	1.9	80,000	94,304	2031/ 3/20
第128回	利付国債(20年)	1.9	100,000	118,276	2031/ 6/20
第129回	利付国債(20年)	1.8	100,000	117,275	2031/ 6/20
第130回	利付国債(20年)	1.8	300,000	352,746	2031/ 9/20
第131回	利付国債(20年)	1.7	150,000	174,835	2031/ 9/20
第132回	利付国債(20年)	1.7	200,000	233,660	2031/12/20
第134回	利付国債(20年)	1.8	300,000	354,492	2032/ 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135回 利付国債(20年)	1.7	230,000	269,311	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	210,000	243,644	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	115,166	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	104,634	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	290,000	341,272	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	380,000	448,126	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	120,000	142,884	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	230,000	269,104	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	250,000	289,592	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	414,421	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	450,828	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	240,000	282,307	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	380,000	443,862	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	430,000	497,376	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	450,000	509,206	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	455,000	515,223	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	300,000	344,043	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	280,000	317,489	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	110,000	121,699	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	630,000	642,140	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	220,000	217,450	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	320,000	330,112	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	170,000	177,860	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	340,000	360,559	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	230,000	240,221	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	320,000	333,913	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	291,891	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	350,000	358,918	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	348,221	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	327,471	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	326,870	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	220,734	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	275,508	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	245,517	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	206,007	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	360,000	359,053	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	230,000	228,983	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	310,000	308,338	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	480,000	485,630	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5	40,000	40,437	2041/ 3/20
第 25回 メキシコ合衆国円貨債券(2018)	0.6	100,000	100,141	2023/ 4/20
小 計	—	64,360,000	69,607,429	—
(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	132,294	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	101,673	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,627	2024/12/20
第741回 東京都公募公債	0.435	100,000	101,626	2025/ 3/19
平成26年度第 15回 北海道公募公債	0.434	200,000	203,124	2025/ 2/27
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,071	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	108,593	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	101,628	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,806	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	116,774	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	101,762	2024/10/30
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	100,802	2027/10/29
平成27年度第 7回 京都府公募公債	0.515	200,000	204,370	2025/ 9/17
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	117,839	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,659	2025/ 2/26

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 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	107,480	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	101,872	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	102,040	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,124	2034/ 5/15
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	101,039	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	116,800	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	101,831	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	101,680	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	114,825	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,160	2034/ 5/26
第 14回 千葉県公募公債(20年)	1.137	100,000	110,518	2033/ 4/15
平成24年度第 9回 千葉県公募公債	0.82	100,000	101,438	2023/ 2/24
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	103,745	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	100,136	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	101,515	2028/10/31
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	100,972	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	100,987	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	101,402	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,241	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	101,970	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,640	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	102,873	2024/ 3/25
第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	200,000	203,834	2024/ 7/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,745	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,651	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	100,135	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	100,000	101,016	2027/ 7/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	100,090	2030/ 6/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	100,248	2026/11/30
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	101,623	2023/11/29
平成24年度第 1回 熊本市公募公債	0.796	100,000	101,210	2022/11/30
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,737	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	111,217	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	107,886	2024/ 6/20
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	101,157	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	109,154	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,994	2027/ 8/13
第 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	117,819	2033/ 1/28
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	101,034	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	109,777	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	101,738	2023/12/20
第 50回 川崎市公募公債(5年)	0.01	100,000	100,000	2022/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,548	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	106,811	2029/10/22
平成26年度第 2回 千葉市公募公債	0.505	300,000	305,244	2024/11/27
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,883	2027/ 9/17
小 計	—	6,601,000	6,893,487	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 16回 政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	0.001	200,000	199,980	2023/11/27
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	109,960	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	100,028	2023/ 2/17
第 13回 道路債券	2.28	100,000	103,052	2022/ 9/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	133,055	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	117,735	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	100,901	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	101,211	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	101,234	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	101,839	2024/ 6/20

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130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	300,000	304,959	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	106,307	2029/ 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	101,024	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	115,777	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	107,211	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	101,251	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	124,683	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	111,615	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	100,454	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	118,243	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	118,664	2031/ 1/28
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	115,051	2028/ 4/25
第 37回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	400,000	403,948	2022/ 6/17
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	100,939	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	114,234	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	101,226	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	101,251	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	101,778	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	101,789	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	101,250	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	99,725	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	106,170	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	101,969	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	101,778	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	134,200	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	115,474	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	203,660	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	101,680	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	99,999	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	100,541	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	107,654	2029/ 6/20
第 55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.842	200,000	203,064	2023/ 3/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	101,954	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	101,686	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	100,000	2023/12/20
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	112,278	2026/ 3/20
第 1回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.51	9,973	10,015	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,614	11,893	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.82	10,038	10,092	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	12,037	12,333	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	13,298	13,808	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	115,392	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	13,210	13,693	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	21,110	21,376	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	10,955	11,080	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	36,158	38,550	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	20,103	21,545	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	18,372	19,457	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	24,720	26,363	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	24,116	25,519	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	24,515	25,917	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	11,635	11,939	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	49,140	52,065	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,799	13,306	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	26,418	27,882	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	116,548	2030/ 7/16
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	71,886	75,872	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	108,290	2025/12/19

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 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	44,455	46,829	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	44,774	46,560	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	49,692	51,560	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	50,949	52,683	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	56,492	57,614	2050/ 2/10
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	80,101	80,785	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	81,184	82,115	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	81,148	82,138	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,629	86,657	2053/ 2/10
第132回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.092	100,000	106,622	2028/ 3/17
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	88,785	89,417	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,658	90,968	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	93,547	92,509	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	95,465	95,527	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	101,822	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,389	2026/12/18
第 13回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.802	100,000	101,353	2023/ 2/ 8
小 計	—	7,478,976	7,860,983	—
(金融債券)	%	千円	千円	
第335回 信金中金債(5年)	0.1	100,000	100,100	2022/10/27
第341回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,145	2023/ 4/27
第238号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,968	2022/11/25
小 計	—	400,000	400,213	—
(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	100,111	2029/ 6/25
第522回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.47	100,000	101,411	2028/ 9/20
第535回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.18	100,000	100,251	2025/12/19
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,602	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	102,311	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	101,555	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	101,578	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	118,050	2030/12/13
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	101,870	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	100,516	2026/ 5/22
第 22回 大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順)	0.13	100,000	100,098	2025/ 9/12
第 6回 日揮ホールディングス株式会社無担保社債(特定社債間限定)	0.03	200,000	199,814	2023/ 7/14
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	100,088	2028/ 9/14
第 13回 株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社)	0.06	100,000	100,018	2023/12/20
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	100,454	2027/ 7/16
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	99,310	2028/10/25
第 16回 株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順)	0.15	100,000	100,141	2025/ 9/17
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	99,049	2026/ 7/31
第 11回 株式会社LIXILグループ無担保社債(社債間限定同順)	0.01	200,000	199,812	2023/ 7/18
第 20回 パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	0.08	100,000	99,992	2023/12/22
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	114,605	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)	0.27	100,000	100,177	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	101,414	2024/ 9/12
第 3回 みずほリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	200,000	200,602	2025/ 7/15
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)	0.28	100,000	99,698	2029/10/19
第 76回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.37	100,000	100,408	2030/ 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	99,341	2030/ 4/16
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	101,909	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)	2.149	100,000	116,469	2029/12/21
第130回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同)	0.295	100,000	100,915	2028/ 9/27
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	113,739	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	124,524	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	100,483	2027/ 6/21
第 25回 東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	0.24	100,000	100,553	2027/12/15

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 47回 阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債(阪急電鉄	1.202	100,000	107,604	2029/ 7/18
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	99,756	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	100,165	2028/11/22
第 72回 電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.35	100,000	100,225	2031/ 1/20
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	100,475	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	100,603	2023/ 7/24
第 17回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.43	100,000	100,656	2023/10/18
第 38回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.58	100,000	101,080	2025/ 7/16
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	100,357	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	99,908	2023/ 7/ 5
クレディ・アグリコル・エス・エー第6回 円貨社債	0.865	100,000	102,052	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	0.65	100,000	100,356	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	100,126	2024/ 1/23
小 計	—	5,000,000	5,115,231	—
合 計	—	83,839,976	89,877,343	—

(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
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
21期(2021年3月31日)	14,087	△0.7	99.2	—	92,760

(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) 2020年 3月31日	円 14,183	% —	388.45	% —	% 100.2	% —
4月末	14,232	0.3	389.79	0.3	99.6	—
5月末	14,171	△0.1	388.13	△0.1	99.6	—
6月末	14,116	△0.5	386.56	△0.5	99.2	—
7月末	14,165	△0.1	387.91	△0.1	99.1	—
8月末	14,100	△0.6	386.09	△0.6	98.9	—
9月末	14,141	△0.3	387.22	△0.3	99.2	—
10月末	14,118	△0.5	386.63	△0.5	99.2	—
11月末	14,138	△0.3	387.12	△0.3	99.4	—
12月末	14,140	△0.3	387.20	△0.3	99.1	—
2021年 1月末	14,105	△0.5	386.25	△0.6	98.9	—
2月末	13,989	△1.4	383.06	△1.4	102.5	—
(期 末) 2021年 3月31日	14,087	△0.7	385.72	△0.7	99.2	—

(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

該当事項はありません。

■売買及び取引の状況(2020年4月1日から2021年3月31日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	19,048,607	23,737,256
	地 方 債 証 券	1,568,609	1,246,742
	特 殊 債 券	944,427	1,332,144 (123,123)
	社 債 券	3,012,440	3,318,966

(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 (2020年4月1日から2021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143回 利付国債(5年)	1,109,930	第129回 利付国債(5年)	802,324
第361回 利付国債(10年)	1,043,558	第402回 利付国債(2年)	802,280
第413回 利付国債(2年)	1,014,652	第320回 利付国債(10年)	718,570
第358回 利付国債(10年)	838,218	第325回 利付国債(10年)	715,309
第13回 利付国債(40年)	819,120	第315回 利付国債(10年)	710,066
第360回 利付国債(10年)	806,114	第317回 利付国債(10年)	638,874
第87回 利付国債(20年)	778,939	第128回 利付国債(5年)	561,556
第156回 利付国債(20年)	676,532	第332回 利付国債(10年)	512,175
第141回 利付国債(5年)	625,277	第20回 利付国債(30年)	508,927
第412回 利付国債(2年)	623,217	第413回 利付国債(2年)	501,347

(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 (2020年4月1日から2021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	—	—	99,025

(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 (2021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	66,350,000 (720,000)	71,511,072 (835,635)	77.1 (0.9)	— (—)	54.5 (0.8)	15.6 (0.1)	7.0 (—)
地 方 債 証 券	6,718,000 (6,718,000)	7,009,346 (7,009,346)	7.6 (7.6)	— (—)	2.9 (2.9)	3.7 (3.7)	1.0 (1.0)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	7,502,918 (7,491,832)	7,881,671 (7,870,442)	8.5 (8.5)	— (—)	4.2 (4.2)	2.3 (2.3)	2.0 (2.0)
金 融 債 証 券	400,000 (400,000)	400,217 (400,217)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)	0.3 (0.3)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	5,100,000 (5,100,000)	5,209,011 (5,209,011)	5.6 (5.6)	— (—)	2.7 (2.7)	2.7 (2.7)	0.2 (0.2)
合 計	86,070,918 (20,429,832)	92,011,318 (21,324,652)	99.2 (23.0)	— (—)	64.2 (10.6)	24.4 (8.9)	10.5 (3.5)

(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412回 利付国債(2年)	0.1	170,000	170,423	2022/ 5/ 1
第413回 利付国債(2年)	0.1	510,000	511,366	2022/ 6/ 1
第416回 利付国債(2年)	0.1	30,000	30,098	2022/ 9/ 1
第417回 利付国債(2年)	0.1	400,000	401,412	2022/10/ 1
第418回 利付国債(2年)	0.1	40,000	40,149	2022/11/ 1
第421回 利付国債(2年)	0.1	500,000	502,210	2023/ 2/ 1
第422回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,960	2023/ 3/ 1
第132回 利付国債(5年)	0.1	350,000	350,959	2022/ 6/20
第133回 利付国債(5年)	0.1	350,000	351,158	2022/ 9/20
第134回 利付国債(5年)	0.1	390,000	391,544	2022/12/20
第135回 利付国債(5年)	0.1	600,000	602,778	2023/ 3/20
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	140,747	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,595	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	500,000	503,345	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	800,000	805,600	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	120,000	120,910	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	970,000	977,779	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	650,000	655,466	2024/12/20
第143回 利付国債(5年)	0.1	780,000	786,832	2025/ 3/20
第144回 利付国債(5年)	0.1	390,000	393,552	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	50,000	50,471	2025/ 9/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	114,119	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	240,000	281,191	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	69,733	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	235,438	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	278,904	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	259,419	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	223,988	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	182,910	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	180,000	254,444	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	260,144	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	243,090	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	162,620	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	200,828	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	340,000	310,474	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	235,004	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	207,396	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	165,000	154,636	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	650,000	608,335	2060/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	202,502	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	360,000	364,064	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	200,000	202,726	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	304,266	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	350,000	355,579	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	810,000	821,655	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	602,277	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	716,226	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	305,466	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	250,000	255,050	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	250,000	255,472	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	310,000	317,365	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	204,356	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	400,000	409,268	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	250,000	253,922	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	367,459	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	51,091	2025/ 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340回	利付国債(10年)	0.4	120,000	122,749	2025/ 9/20
第341回	利付国債(10年)	0.3	670,000	682,709	2025/12/20
第342回	利付国債(10年)	0.1	580,000	585,492	2026/ 3/20
第343回	利付国債(10年)	0.1	420,000	424,069	2026/ 6/20
第344回	利付国債(10年)	0.1	750,000	757,207	2026/ 9/20
第345回	利付国債(10年)	0.1	810,000	817,905	2026/12/20
第346回	利付国債(10年)	0.1	840,000	848,047	2027/ 3/20
第347回	利付国債(10年)	0.1	600,000	605,802	2027/ 6/20
第348回	利付国債(10年)	0.1	660,000	666,210	2027/ 9/20
第349回	利付国債(10年)	0.1	630,000	635,940	2027/12/20
第350回	利付国債(10年)	0.1	480,000	484,521	2028/ 3/20
第351回	利付国債(10年)	0.1	440,000	443,814	2028/ 6/20
第352回	利付国債(10年)	0.1	550,000	554,521	2028/ 9/20
第353回	利付国債(10年)	0.1	590,000	594,554	2028/12/20
第354回	利付国債(10年)	0.1	580,000	583,920	2029/ 3/20
第355回	利付国債(10年)	0.1	500,000	503,075	2029/ 6/20
第356回	利付国債(10年)	0.1	520,000	522,854	2029/ 9/20
第357回	利付国債(10年)	0.1	380,000	381,812	2029/12/20
第358回	利付国債(10年)	0.1	830,000	833,328	2030/ 3/20
第359回	利付国債(10年)	0.1	370,000	371,184	2030/ 6/20
第360回	利付国債(10年)	0.1	800,000	801,504	2030/ 9/20
第361回	利付国債(10年)	0.1	1,050,000	1,051,008	2030/12/20
第 1回	利付国債(30年)	2.8	40,000	49,320	2029/ 9/20
第 5回	利付国債(30年)	2.2	5,000	6,053	2031/ 5/20
第 6回	利付国債(30年)	2.4	70,000	86,764	2031/11/20
第 8回	利付国債(30年)	1.8	45,000	53,435	2032/11/22
第11回	利付国債(30年)	1.7	135,000	159,437	2033/ 6/20
第12回	利付国債(30年)	2.1	90,000	110,941	2033/ 9/20
第13回	利付国債(30年)	2.0	70,000	85,629	2033/12/20
第14回	利付国債(30年)	2.4	120,000	153,270	2034/ 3/20
第17回	利付国債(30年)	2.4	160,000	206,179	2034/12/20
第18回	利付国債(30年)	2.3	155,000	198,150	2035/ 3/20
第19回	利付国債(30年)	2.3	110,000	140,962	2035/ 6/20
第20回	利付国債(30年)	2.5	50,000	65,665	2035/ 9/20
第21回	利付国債(30年)	2.3	100,000	128,831	2035/12/20
第23回	利付国債(30年)	2.5	180,000	238,329	2036/ 6/20
第25回	利付国債(30年)	2.3	260,000	338,065	2036/12/20
第26回	利付国債(30年)	2.4	180,000	237,414	2037/ 3/20
第27回	利付国債(30年)	2.5	320,000	429,148	2037/ 9/20
第28回	利付国債(30年)	2.5	300,000	404,274	2038/ 3/20
第29回	利付国債(30年)	2.4	290,000	387,561	2038/ 9/20
第30回	利付国債(30年)	2.3	230,000	304,526	2039/ 3/20
第31回	利付国債(30年)	2.2	220,000	288,360	2039/ 9/20
第32回	利付国債(30年)	2.3	215,000	286,511	2040/ 3/20
第33回	利付国債(30年)	2.0	70,000	89,826	2040/ 9/20
第34回	利付国債(30年)	2.2	350,000	463,914	2041/ 3/20
第35回	利付国債(30年)	2.0	230,000	297,102	2041/ 9/20
第36回	利付国債(30年)	2.0	370,000	479,416	2042/ 3/20
第37回	利付国債(30年)	1.9	380,000	486,453	2042/ 9/20
第38回	利付国債(30年)	1.8	250,000	315,890	2043/ 3/20
第39回	利付国債(30年)	1.9	180,000	231,550	2043/ 6/20
第40回	利付国債(30年)	1.8	150,000	189,967	2043/ 9/20
第41回	利付国債(30年)	1.7	120,000	149,684	2043/12/20
第42回	利付国債(30年)	1.7	200,000	249,700	2044/ 3/20
第43回	利付国債(30年)	1.7	280,000	350,263	2044/ 6/20
第44回	利付国債(30年)	1.7	130,000	162,769	2044/ 9/20
第45回	利付国債(30年)	1.5	250,000	302,372	2044/12/20
第46回	利付国債(30年)	1.5	320,000	387,241	2045/ 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 47回 利付国債(30年)	1.6	140,000	172,708	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	237,690	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	261,547	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	315,081	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	223,982	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	254,534	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	300,333	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	335,507	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	157,152	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	314,064	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	271,973	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	313,560	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	254,952	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	170,916	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	213,467	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	202,545	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	243,627	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	214,893	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	240,000	223,852	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	230,000	214,672	2050/ 3/20
第 67回 利付国債(30年)	0.6	140,000	137,604	2050/ 6/20
第 68回 利付国債(30年)	0.6	180,000	176,898	2050/ 9/20
第 69回 利付国債(30年)	0.7	200,000	201,736	2050/12/20
第 56回 利付国債(20年)	2.0	230,000	235,966	2022/ 6/20
第 57回 利付国債(20年)	1.9	130,000	133,213	2022/ 6/20
第 59回 利付国債(20年)	1.7	100,000	103,146	2022/12/20
第 60回 利付国債(20年)	1.4	100,000	102,629	2022/12/20
第 61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	143,119	2023/ 3/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	234,786	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	168,072	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	242,813	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	230,000	242,185	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	185,000	197,839	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	127,970	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	162,267	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	107,532	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	290,000	312,495	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	119,709	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	259,272	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	206,188	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	108,943	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	196,860	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	197,020	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	285,753	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	220,816	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	140,000	153,907	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	221,852	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	279,810	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	600,000	668,550	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	281,257	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	223,956	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	303,744	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	67,828	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	157,448	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	224,672	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	230,000	259,750	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	102,103	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	210,000	240,597	2027/ 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 98回 利付国債(20年)	2.1	20,000	22,784	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	370,000	423,354	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	450,000	520,240	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	211,491	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	175,158	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	219,974	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	160,000	186,436	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	197,562	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	200,000	229,338	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	90,000	103,500	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	220,000	257,441	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	246,626	2029/ 9/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	142,524	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	119,193	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	220,000	260,260	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	10,000	11,778	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	115,953	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	70,000	83,598	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	180,000	213,231	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	250,000	301,957	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	120,000	142,570	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	80,000	94,256	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	200,000	236,296	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	117,137	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	300,000	352,302	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	174,598	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	233,322	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	300,000	353,979	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	230,000	268,899	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	210,000	243,247	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	114,958	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	104,455	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	290,000	340,497	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	380,000	447,066	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	120,000	142,558	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	230,000	268,416	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	250,000	288,827	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	413,357	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	449,627	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	240,000	281,505	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	380,000	442,194	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	430,000	495,411	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	450,000	507,042	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	455,000	512,989	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	300,000	342,780	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	280,000	316,265	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	110,000	121,111	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	970,000	983,182	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	220,000	216,167	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	320,000	328,489	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	170,000	176,859	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	340,000	358,536	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	230,000	238,822	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	320,000	331,939	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	290,138	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	350,000	356,692	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	346,031	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	325,450	2038/ 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167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	324,755	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	219,080	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	273,386	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	243,602	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	204,208	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	360,000	355,921	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	230,000	227,161	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	310,000	305,855	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	600,000	602,700	2040/12/20
第 25回 メキシコ合衆国円貨債券(2018)	0.6	100,000	99,634	2023/ 4/20
小 計	—	66,350,000	71,511,072	—
(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	131,558	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	101,709	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,648	2024/12/20
第741回 東京都公募公債	0.435	100,000	101,645	2025/ 3/19
平成26年度第 15回 北海道公募公債	0.434	200,000	203,156	2025/ 2/27
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,084	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	108,813	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	101,705	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,833	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	116,740	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	101,787	2024/10/30
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	100,719	2027/10/29
平成27年度第 7回 京都府公募公債	0.515	200,000	204,408	2025/ 9/17
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	117,864	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,679	2025/ 2/26
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	107,450	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	101,901	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	102,055	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	115,678	2034/ 5/15
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,959	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	116,844	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	101,859	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	101,703	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	114,911	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	115,713	2034/ 5/26
第 14回 千葉県公募公債(20年)	1.137	100,000	110,168	2033/ 4/15
平成24年度第 9回 千葉県公募公債	0.82	100,000	101,532	2023/ 2/24
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	103,102	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,972	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	101,388	2028/10/31
第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	117,000	118,177	2022/ 5/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,078	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	101,087	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	101,494	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,316	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	102,075	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,700	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	102,930	2024/ 3/25
第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	200,000	203,916	2024/ 7/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,770	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,670	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,972	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	100,000	100,942	2027/ 7/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	99,817	2030/ 6/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	100,084	2026/11/30
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	101,682	2023/11/29

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24年度第 1回 熊本市公募公債	0.796	100,000	101,303	2022/11/30
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,666	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	110,778	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	108,180	2024/ 6/20
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	101,228	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	109,377	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,919	2027/ 8/13
第 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	117,466	2033/ 1/28
平成28年度第5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,968	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	109,999	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	101,796	2023/12/20
第 50回 川崎市公募公債(5年)	0.01	100,000	99,993	2022/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,566	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	106,691	2029/10/22
平成26年度第 2回 千葉市公募公債	0.505	300,000	305,319	2024/11/27
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,804	2027/ 9/17
小 計	—	6,718,000	7,009,346	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 16回 政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	0.001	200,000	199,958	2023/11/27
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	110,035	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	100,030	2023/ 2/17
第 13回 道路債券	2.28	100,000	103,349	2022/ 9/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	132,697	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	117,695	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	101,006	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	101,310	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	101,333	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	101,882	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	300,000	305,067	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	106,194	2029/ 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	101,134	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	115,503	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	107,328	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	101,340	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	123,752	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	111,108	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	100,462	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	118,200	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	118,686	2031/ 1/28
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	115,171	2028/ 4/25
第 37回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	400,000	404,412	2022/ 6/17
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	101,046	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	113,714	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	101,332	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	101,340	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	101,823	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	101,819	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	101,157	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	99,521	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	106,190	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	102,086	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	101,823	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	133,898	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	115,027	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	203,752	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	101,704	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	99,890	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	100,401	2028/ 7/31

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 93回 都市再生債券	1.102	100,000	107,515	2029/ 6/20
第 55回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.842	200,000	203,276	2023/ 3/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,006	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	101,770	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	99,986	2023/12/20
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	112,522	2026/ 3/20
第 1回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.51	10,180	10,235	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,844	12,150	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.82	10,265	10,336	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	12,328	12,675	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	13,597	14,135	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	115,525	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	13,757	14,272	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	21,528	21,832	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	11,086	11,229	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	36,752	39,169	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	20,661	22,122	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	18,633	19,735	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	25,110	26,769	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	24,873	26,314	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	25,169	26,589	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	11,894	12,229	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	52,542	55,663	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	13,093	13,627	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	27,249	28,760	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	116,466	2030/ 7/16
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	74,254	78,314	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	108,446	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	45,279	47,626	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	45,679	47,448	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	50,684	52,524	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	51,924	53,598	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	57,251	58,279	2050/ 2/10
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	80,966	81,416	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	82,024	82,771	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	81,986	82,793	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	86,531	87,256	2053/ 2/10
第132回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.092	100,000	106,601	2028/ 3/17
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	89,671	89,933	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	91,668	91,543	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	94,320	92,798	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	96,120	95,689	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	101,799	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,284	2026/12/18
第 13回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.802	100,000	101,454	2023/ 2/ 8
小 計	—	7,502,918	7,881,671	—
(金融債券)	%	千円	千円	
第335回 信金中金債(5年)	0.1	100,000	100,111	2022/10/27
第341回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,156	2023/ 4/27
第238号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,950	2022/11/25
小 計	—	400,000	400,217	—
(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	99,830	2029/ 6/25
第522回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.47	100,000	101,205	2028/ 9/20
第535回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.18	100,000	100,187	2025/12/19
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,602	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	102,375	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	101,219	2029/ 4/25

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451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	101,395	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	118,011	2030/12/13
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	101,917	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	100,383	2026/ 5/22
第 22回 大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位)	0.13	100,000	100,046	2025/ 9/12
第 6回 日揮ホールディングス株式会社無担保社債(特定社債間限定)	0.03	200,000	199,786	2023/ 7/14
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	99,921	2028/ 9/14
第 13回 株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.06	100,000	100,034	2023/12/20
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	100,153	2027/ 7/16
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	99,131	2028/10/25
第 16回 株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位)	0.15	100,000	100,091	2025/ 9/17
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	98,781	2026/ 7/31
第 11回 株式会社LIXILグループ無担保社債(社債間限定同順位)	0.01	200,000	199,786	2023/ 7/18
第 20回 パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.08	100,000	100,006	2023/12/22
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	113,464	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)	0.27	100,000	100,152	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	101,447	2024/ 9/12
第 3回 みずほリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	200,000	200,430	2025/ 7/15
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	99,025	2029/10/19
第 76回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.37	100,000	99,760	2030/ 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	98,623	2030/ 4/16
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	101,979	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	116,222	2029/12/21
第130回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	0.295	100,000	100,516	2028/ 9/27
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	113,743	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	123,615	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	100,246	2027/ 6/21
第 25回 東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	0.24	100,000	100,331	2027/12/15
第 47回 阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債(阪急電鉄)	1.202	100,000	107,418	2029/ 7/18
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	99,683	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	99,991	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	101,672	2022/10/20
第 72回 電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.35	100,000	99,812	2031/ 1/20
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	100,538	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	100,677	2023/ 7/24
第 17回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.43	100,000	100,718	2023/10/18
第 38回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.58	100,000	101,211	2025/ 7/16
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	100,344	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	99,895	2023/ 7/ 5
クレディ・アグリコル・エス・エー第6回 円貨社債	0.865	100,000	102,127	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)	0.65	100,000	100,381	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	100,132	2024/ 1/23
小 計	—	5,100,000	5,209,011	—
合 計	—	86,070,918	92,011,318	—

(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 (2021年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 92,011,318	% 98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,245,135	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	93,256,453	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

2021年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	93,256,453,610円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	737,923,608
公 社 債(評価額)	92,011,318,304
未 収 入 金	401,060,000
未 収 利 息	103,881,948
前 払 費 用	2,269,750
(B) 負 債	496,410,621
未 払 金	492,708,600
未 払 解 約 金	3,700,000
未 払 利 息	2,021
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	92,760,042,989
元 本	65,849,341,831
次 期 繰 越 損 益 金	26,910,701,158
(D) 受 益 権 総 口 数	65,849,341,831口
1万口当たり基準価額 (C / D)	14,087円

(注1) 当ファンドの期首元本額は69,344,130,164円、期中追加設定元本額は8,286,116,050円、期中一部解約元本額は11,780,904,383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)

40,008,441,258円

日立国内債券インデックスファンド

11,015,511,123円

日立バランスファンド(株式50)

7,062,476,674円

日立バランスファンド(株式30)

3,900,238,740円

日立バランスファンド(株式70)

3,862,674,036円

(注3) 1口当たり純資産額は1,4087円です。

■損益の状況

当期(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	792,111,918円
受 取 利 息	792,819,960
支 払 利 息	△708,042
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,379,236,105
売 買 益	83,535,196
売 買 損	△1,462,771,301
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△587,124,187
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	29,008,725,811
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,398,912,886
(F) 解 約 差 損 益 金	△4,909,813,352
(G) 計 (C + D + E + F)	26,910,701,158
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	26,910,701,158

(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。