



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21期

(決算日 2022年5月16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21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

東京都台東区東上野二丁目16番1号

〈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) 6284-3610

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			
17期(2018年5月15日)	円	%		%	%	%	百万円
	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
21期(2022年5月16日)	12,684	△2.0	379.46	△1.9	99.1	—	13,855

(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) 2021年 5月17日	円	%		%	%	%
	12,945	—	386.85	—	99.0	—
5月末	12,936	△0.1	386.62	△0.1	99.1	—
6月末	12,942	△0.0	386.90	0.0	98.9	—
7月末	13,005	0.5	388.81	0.5	99.0	—
8月末	12,993	0.4	388.46	0.4	99.2	—
9月末	12,948	0.0	387.12	0.1	99.1	—
10月末	12,933	△0.1	386.72	△0.0	99.1	—
11月末	12,963	0.1	387.65	0.2	99.2	—
12月末	12,932	△0.1	386.84	△0.0	99.0	—
2022年 1月末	12,840	△0.8	384.06	△0.7	99.0	—
2月末	12,775	△1.3	382.13	△1.2	99.0	—
3月末	12,739	△1.6	381.04	△1.5	99.5	—
4月末	12,706	△1.8	380.12	△1.7	99.2	—
(期 末) 2022年 5月16日	12,684	△2.0	379.46	△1.9	99.1	—

(注1) 騰落率は期首比です。

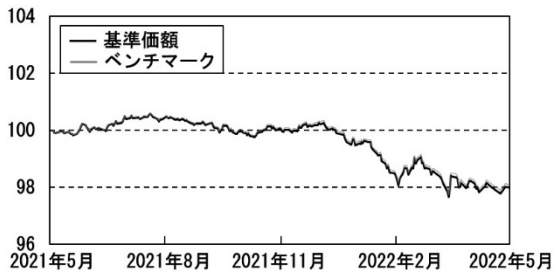
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(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景気先行き懸念などから、日本銀行が緩和的な金融政策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て、国内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	2021年5月17日	2021年8月4日	2022年3月29日	2022年5月16日
基 準 価 額	12,945円	13,022円	12,641円	12,684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12,945円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、12,684円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲2.0%となり、ベンチマーク騰落率▲1.9%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、米国金融政策の引き締め転換にもなう海外金利の上昇につられる形で、年度末にかけて上昇基調となりました。

新型コロナウイルスの感染拡大による景気先行き懸念から、長期金利は夏場にかけて0.00%程度まで低下しました。しかしその後は、景気の先行きに対する慎重な見方が和らぐとともに、米国ではインフレの高進を受けて金融政策が引き締め方向へ大きく転換したことから、国内外の金利は上昇基調となりました。2022年に入ると、長期金利が0.25%に近づいたことから、日銀は国債指値オペの実施や国債買い入れ金額の増額により長期金利の急激な上昇に対処することで、イールドカーブコントロール政策の継続を図りました。

年限別にみると、日銀の買い入れ金額が相対的に少ない超長期年限は、海外金利の上昇を受けて利回りの上昇が続きました。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。日本銀行の金融緩和政策の継続がスプレッド縮小を促しました。円建外債については、3月以降の海外金融市場におけるリスク回避的な動きを受けて、スプレッド拡大となりました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで▲1.9%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
	(2021. 5. 18～2022. 5. 16)		
	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12, 892円です。 委託した資金の運用の対価 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
（ 投 信 会 社 ）	（ 8 ）	（ 0. 066 ）	
（ 販 売 会 社 ）	（ 4 ）	（ 0. 033 ）	
（ 受 託 会 社 ）	（ 3 ）	（ 0. 022 ）	
(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。

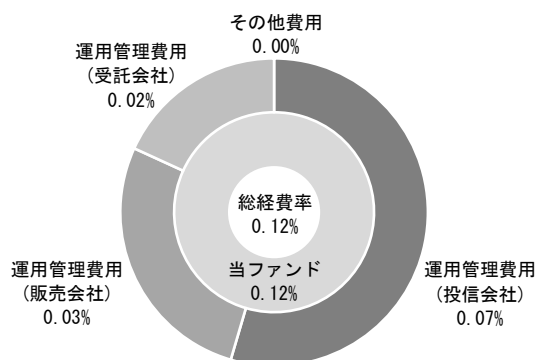
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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(2021年5月18日から2022年5月16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 777,906	千円 1,094,900	千口 1,169,406	千円 1,644,200

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2021年5月18日から2022年5月16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424回 利付国債(2年)	1,203,144	第424回 利付国債(2年)	1,201,206
第362回 利付国債(10年)	1,105,913	第141回 利付国債(5年)	885,979
第364回 利付国債(10年)	902,531	第328回 利付国債(10年)	816,569
第365回 利付国債(10年)	812,243	第135回 利付国債(5年)	601,688
第433回 利付国債(2年)	700,554	第345回 利付国債(10年)	555,462
第14回 利付国債(40年)	684,841	第362回 利付国債(10年)	532,173
第434回 利付国債(2年)	640,697	第413回 利付国債(2年)	511,132
第149回 利付国債(5年)	532,513	第142回 利付国債(5年)	503,370
第176回 利付国債(20年)	525,647	第421回 利付国債(2年)	501,320
第143回 利付国債(5年)	524,188	第143回 利付国債(5年)	452,572

(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(2021年5月18日から2022年5月16日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細(2022年5月16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 10,376,399	千口 9,984,899	千円 13,840,068

(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(2022年5月16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 13,840,068	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	51,164	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	13,891,232	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

2022年5月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	13,891,232,427円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	31,063,577
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	13,840,068,850
未 収 入 金	20,100,000
(B) 負 債	36,120,192
未 払 解 約 金	27,663,916
未 払 信 託 報 酬	8,456,191
未 払 利 息	85
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	13,855,112,235
元 本	10,923,314,552
次 期 繰 越 損 益 金	2,931,797,683
(D) 受 益 権 総 口 数	10,923,314,552口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,684円

(注1) 当ファンドの期首元本額は11,338,045,888円、期中追加設定元本額は2,227,350,124円、期中一部解約元本額は2,642,081,460円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,2684円です。

■損益の状況

当期(自2021年5月18日 至2022年5月16日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△24,990円
支 払 利 息	△24,990
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△254,988,605
売 買 益	18,187,240
売 買 損	△273,175,845
(C) 信 託 報 酬 等	△17,327,945
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△272,341,540
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	300,143,777
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,903,995,446
(配 当 等 相 当 額)	(2,648,678,846)
(売 買 損 益 相 当 額)	(255,316,600)
(G) 計 (D + E + F)	2,931,797,683
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,931,797,683
追 加 信 託 差 損 益 金	2,903,995,446
(配 当 等 相 当 額)	(2,648,678,846)
(売 買 損 益 相 当 額)	(255,316,600)
分 配 準 備 積 立 金	374,913,945
繰 越 損 益 金	△347,111,708

(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(2,648,678,846円)および分配準備積立金(374,913,945円)より分配対象収益は3,023,592,791円(10,000口当たり2,768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(2022年5月16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(58, 203, 603千口)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	2022年5月16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 58,620,000 (620,000)	千円 61,570,383 (715,033)	% 76.3 (0.9)	% — (—)	% 54.3 (0.9)	% 14.3 (—)	% 7.7 (—)
地 方 債 証 券	6,401,000 (6,401,000)	6,637,108 (6,637,108)	8.2 (8.2)	— (—)	3.2 (3.2)	4.3 (4.3)	0.8 (0.8)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	5,603,747 (5,603,747)	5,897,358 (5,897,358)	7.3 (7.3)	— (—)	4.3 (4.3)	2.2 (2.2)	0.9 (0.9)
金 融 債 券	200,000 (200,000)	199,402 (199,402)	0.2 (0.2)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	— (—)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	5,700,000 (5,700,000)	5,770,870 (5,770,870)	7.2 (7.2)	— (—)	2.6 (2.6)	3.1 (3.1)	1.5 (1.5)
合 計	76,524,747 (18,524,747)	80,075,122 (19,219,772)	99.3 (23.8)	— (—)	64.3 (10.9)	24.1 (9.8)	10.8 (3.1)

(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428回 利付国債(2年)	0.005	150,000	150,165	2023/ 9/ 1
第429回 利付国債(2年)	0.005	130,000	130,152	2023/10/ 1
第431回 利付国債(2年)	0.005	390,000	390,510	2023/12/ 1
第432回 利付国債(2年)	0.005	120,000	120,156	2024/ 1/ 1
第433回 利付国債(2年)	0.005	700,000	700,896	2024/ 2/ 1
第434回 利付国債(2年)	0.005	590,000	590,790	2024/ 3/ 1
第136回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,202	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,242	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	500,000	501,395	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	550,000	551,672	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	240,000	240,777	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	90,000	90,316	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	150,000	150,583	2024/12/20
第143回 利付国債(5年)	0.1	950,000	954,047	2025/ 3/20
第144回 利付国債(5年)	0.1	540,000	542,424	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	400,000	401,872	2025/ 9/20
第149回 利付国債(5年)	0.005	330,000	330,214	2026/ 9/20
第150回 利付国債(5年)	0.005	400,000	400,180	2026/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	111,282	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	240,000	273,712	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	67,935	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	300,000	344,214	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	271,380	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	241,155	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	207,432	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	169,509	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	130,000	169,863	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	238,881	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	222,645	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	148,280	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	182,443	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	240,000	197,109	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	211,580	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	185,770	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	165,000	137,601	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	440,000	365,068	2060/ 3/20
第14回 利付国債(40年)	0.7	490,000	434,296	2061/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	440,000	444,259	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	708,295	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	302,745	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	250,000	252,692	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	80,000	80,980	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	140,000	141,920	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	202,582	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	200,000	202,856	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	250,000	252,272	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	364,608	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	50,689	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	121,767	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	670,000	678,073	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	430,000	432,064	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	220,000	221,080	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	490,000	492,342	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	260,000	261,253	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	450,000	451,957	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	500,000	502,035	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	460,000	461,591	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	630,000	631,751	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	340,000	340,690	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	180,000	180,217	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	200,000	200,062	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	660,000	659,564	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	579,014	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	498,595	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	420,000	418,168	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	380,000	377,860	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	830,000	824,546	2030/ 3/20
第359回 利付国債(10年)	0.1	370,000	367,199	2030/ 6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1	450,000	446,121	2030/ 9/20
第361回 利付国債(10年)	0.1	550,000	544,659	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1	670,000	662,737	2031/ 3/20
第363回 利付国債(10年)	0.1	280,000	276,634	2031/ 6/20
第364回 利付国債(10年)	0.1	520,000	513,344	2031/ 9/20
第365回 利付国債(10年)	0.1	820,000	809,233	2031/12/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	47,718	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	5,877	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	84,217	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	52,041	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	155,206	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	107,596	2033/ 9/20
第13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	83,054	2033/12/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	148,221	2034/ 3/20
第17回 利付国債(30年)	2.4	160,000	199,084	2034/12/20
第18回 利付国債(30年)	2.3	155,000	191,435	2035/ 3/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	136,171	2035/ 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 20回 利付国債(30年)	2.5	50,000	63,302	2035/ 9/20
第 21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	124,337	2035/12/20
第 23回 利付国債(30年)	2.5	180,000	229,509	2036/ 6/20
第 25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	325,650	2036/12/20
第 26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	228,353	2037/ 3/20
第 27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	412,089	2037/ 9/20
第 28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	387,501	2038/ 3/20
第 29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	371,292	2038/ 9/20
第 30回 利付国債(30年)	2.3	230,000	291,364	2039/ 3/20
第 31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	275,514	2039/ 9/20
第 32回 利付国債(30年)	2.3	215,000	273,462	2040/ 3/20
第 33回 利付国債(30年)	2.0	70,000	85,628	2040/ 9/20
第 34回 利付国債(30年)	2.2	300,000	378,051	2041/ 3/20
第 35回 利付国債(30年)	2.0	230,000	282,384	2041/ 9/20
第 36回 利付国債(30年)	2.0	170,000	209,047	2042/ 3/20
第 37回 利付国債(30年)	1.9	340,000	412,290	2042/ 9/20
第 38回 利付国債(30年)	1.8	180,000	215,033	2043/ 3/20
第 39回 利付国債(30年)	1.9	180,000	218,493	2043/ 6/20
第 40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	179,308	2043/ 9/20
第 41回 利付国債(30年)	1.7	120,000	141,186	2043/12/20
第 42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	235,436	2044/ 3/20
第 43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	329,786	2044/ 6/20
第 44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	153,194	2044/ 9/20
第 45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	284,302	2044/12/20
第 46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	363,961	2045/ 3/20
第 47回 利付国債(30年)	1.6	140,000	162,146	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	223,166	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	245,467	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	295,851	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	210,237	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	238,516	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	281,310	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	313,500	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	146,778	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	293,202	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	253,536	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	291,873	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	236,930	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	158,648	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	198,011	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	187,779	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	225,542	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	199,083	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	240,000	207,732	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	230,000	198,862	2050/ 3/20
第 67回 利付国債(30年)	0.6	140,000	127,437	2050/ 6/20
第 68回 利付国債(30年)	0.6	140,000	127,209	2050/ 9/20
第 69回 利付国債(30年)	0.7	100,000	93,225	2050/12/20
第 71回 利付国債(30年)	0.7	20,000	18,584	2051/ 6/20
第 72回 利付国債(30年)	0.7	130,000	120,603	2051/ 9/20
第 73回 利付国債(30年)	0.7	200,000	185,240	2051/12/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	232,226	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	164,265	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	237,249	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	230,000	236,883	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	85,000	88,548	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	124,788	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	157,716	2024/ 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 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	104,725	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	90,000	94,543	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	116,728	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	253,315	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	201,445	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	106,334	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	191,959	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	192,299	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	278,636	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	215,366	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	140,000	150,253	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	216,340	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	272,347	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	500,000	542,770	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	273,757	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	218,188	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	295,938	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	66,024	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	153,542	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	219,258	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	230,000	253,257	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	99,523	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	210,000	234,255	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	20,000	22,203	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	370,000	412,313	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	450,000	506,052	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	205,383	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	170,242	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	214,093	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	160,000	181,299	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	192,210	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	200,000	223,510	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	90,000	100,869	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	320,000	364,304	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	239,750	2029/ 9/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	138,315	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	115,663	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	220,000	252,755	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	10,000	11,447	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	112,877	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	70,000	81,237	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	180,000	207,374	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	250,000	293,182	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	120,000	138,644	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	80,000	91,735	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	100,000	114,976	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	114,085	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	150,000	171,622	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	170,250	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	227,598	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	300,000	345,324	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	230,000	262,535	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	210,000	237,684	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	112,361	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	102,011	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	290,000	331,902	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	380,000	435,518	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	120,000	138,766	2032/12/20

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143回 利付国債(20年)	1.6	230,000	261,530	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	250,000	281,645	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	402,388	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	437,406	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	240,000	273,883	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	380,000	430,201	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	430,000	481,999	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	450,000	493,753	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	455,000	499,453	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	270,000	299,859	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	80,000	87,829	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	110,000	117,901	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	350,000	346,815	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	240,000	230,822	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	100,000	100,134	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	120,000	121,632	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	320,000	328,387	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	190,000	191,991	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	280,000	282,380	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	281,806	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	350,000	346,188	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	335,501	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	314,848	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	314,220	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	211,972	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	264,516	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	235,442	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	197,148	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	180,000	171,570	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	230,000	218,741	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	310,000	293,923	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	280,000	269,676	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5	190,000	182,609	2041/ 3/20
第177回 利付国債(20年)	0.4	150,000	141,231	2041/ 6/20
第178回 利付国債(20年)	0.5	300,000	287,328	2041/ 9/20
第179回 利付国債(20年)	0.5	310,000	296,251	2041/12/20
小 計	—	58,620,000	61,570,383	—
(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	125,903	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	101,101	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,109	2024/12/20
第741回 東京都公募公債	0.435	100,000	101,149	2025/ 3/19
平成26年度第 15回 北海道公募公債	0.434	200,000	202,248	2025/ 2/27
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	101,518	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	106,417	2025/ 6/20
第 20回 神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	113,714	2032/ 6/18
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	100,936	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,220	2024/ 9/20
第251回 神奈川県公募公債	0.199	100,000	98,924	2031/ 3/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	113,697	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	101,228	2024/10/30
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	100,297	2027/10/29
平成27年度第 7回 京都府公募公債	0.515	200,000	203,160	2025/ 9/17
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	114,707	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,195	2025/ 2/26
平成29年度第 22回 兵庫県公募公債	0.19	100,000	100,225	2028/ 1/21
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	105,671	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	101,279	2024/10/24

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	101,453	2025/ 9/19
令和 3年度第 5回 静岡県公募公債(5年)	0.005	200,000	199,550	2026/ 6/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	112,688	2034/ 5/15
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,438	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	113,629	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	101,240	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	101,162	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	112,047	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	112,718	2034/ 5/26
第 14回 千葉県公募公債(20年)	1.137	100,000	107,933	2033/ 4/15
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	100,040	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,977	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	100,599	2028/10/31
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	101,073	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	100,991	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	102,199	2024/ 3/25
第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	200,000	202,546	2024/ 7/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,187	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,161	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,977	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	100,000	100,618	2027/ 7/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	98,890	2030/ 6/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	100,067	2026/11/30
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	100,984	2023/11/29
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,505	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	108,016	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	105,310	2024/ 6/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	106,927	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,547	2027/ 8/13
第 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	114,594	2033/ 1/28
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,719	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	107,514	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	101,068	2023/12/20
第 4回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	113,120	2028/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,065	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	104,855	2029/10/22
平成26年度第 2回 千葉市公募公債	0.505	300,000	303,606	2024/11/27
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,397	2027/ 9/17
小 計	—	6,401,000	6,637,108	—
(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	200,062	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	109,319	2024/ 3/18
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	128,226	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	114,558	2030/ 2/ 8
第128回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	101,214	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	200,000	202,178	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	104,731	2029/ 6/20
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	113,153	2032/ 7/30
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	116,632	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	108,521	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	100,328	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	114,929	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	115,328	2031/ 1/28
第 23回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	223,052	2027/ 9/24
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	112,374	2028/ 4/25
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	101,258	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	101,376	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	100,502	2028/10/27

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119回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.04	100,000	98,976	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	104,994	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	101,094	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	101,258	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	129,007	2037/ 3/19
第 12回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.52	100,000	110,044	2026/ 6/19
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	112,098	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	202,628	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	101,290	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	99,847	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	99,876	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	105,830	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	101,281	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	101,028	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	100,030	2023/12/20
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	109,646	2026/ 3/20
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,245	10,316	2042/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,844	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	11,839	12,115	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	112,739	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	12,128	12,476	2043/ 8/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	32,138	33,838	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	17,978	19,052	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	16,711	17,597	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	22,280	23,516	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	20,992	22,077	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	21,600	22,708	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	10,307	10,386	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	39,662	41,641	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	11,492	11,762	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	21,232	22,177	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	113,541	2030/ 7/16
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	57,260	59,848	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	106,411	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	40,092	41,878	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	40,575	41,844	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	44,974	46,249	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	46,395	47,521	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	51,651	52,125	2050/ 2/10
第 99回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.584	100,000	107,202	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	75,046	74,714	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	76,026	75,882	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	75,750	75,696	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	80,774	80,549	2053/ 2/10
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	83,194	82,478	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	85,264	84,177	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	88,645	86,268	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	90,795	89,345	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	101,338	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,366	2026/12/18
小 計	—	5,603,747	5,897,358	—
(金融債券)	%	千円	千円	
い第853号 商工債	0.09	100,000	99,734	2026/ 6/26
い第857号 商工債	0.09	100,000	99,668	2026/10/27
小 計	—	200,000	199,402	—
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第522回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.47	100,000	100,153	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	99,711	2025/12/19

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402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,232	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	101,434	2024/ 9/25
第321回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.365	100,000	100,145	2027/ 4/23
第499回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.405	100,000	100,080	2027/11/25
第508回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.465	100,000	99,965	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	100,493	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	114,892	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	101,313	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	100,320	2026/ 5/22
第 1回 国際石油開発帝石株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.08	100,000	99,773	2026/ 3/16
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	99,871	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(特定社債間限定同順位)	0.03	200,000	199,766	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	99,599	2028/ 9/14
第 16回 アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位)	0.08	100,000	99,584	2026/ 3/13
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)	0.06	100,000	99,928	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	100,101	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	98,838	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	99,904	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	99,364	2026/ 7/31
第 33回 住友金属鉱山株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	100,000	99,466	2026/ 9/15
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	199,754	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	99,888	2023/12/22
第 38回 三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	200,000	199,062	2026/ 9/ 1
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	111,752	2029/ 7/13
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	101,059	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	199,976	2025/ 7/15
第 16回 NTTファイナンス株式会社無担保社債(日本電信電話株)	0.18	100,000	100,056	2025/12/19
第 69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)	0.09	200,000	199,150	2026/ 6/19
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	98,714	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	99,012	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	101,100	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	113,194	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	99,905	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	111,157	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	117,784	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	99,949	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	99,944	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	105,448	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	99,693	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	100,319	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	98,151	2031/ 1/20
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	100,201	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	100,206	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	100,504	2025/ 7/16
第 44回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.4	200,000	199,308	2026/ 4/22
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	100,064	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	99,943	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	100,615	2024/11/28
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	100,030	2024/ 1/23
小 計	—	5,700,000	5,770,870	—
合 計	—	76,524,747	80,075,122	—

(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			
18期(2018年4月 2日)	円	%	%	%	百万円
	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
22期(2022年3月31日)	13,919	△1.2	99.6	—	80,918

(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) 2021年 3月31日	円	%		%	%	%
	14,087	—	385.72	—	99.2	—
4月末	14,114	0.2	386.44	0.2	99.0	—
5月末	14,120	0.2	386.62	0.2	99.2	—
6月末	14,128	0.3	386.90	0.3	99.0	—
7月末	14,198	0.8	388.81	0.8	99.1	—
8月末	14,187	0.7	388.46	0.7	99.2	—
9月末	14,139	0.4	387.12	0.4	99.2	—
10月末	14,124	0.3	386.72	0.3	99.1	—
11月末	14,158	0.5	387.65	0.5	99.3	—
12月末	14,126	0.3	386.84	0.3	99.0	—
2022年 1月末	14,027	△0.4	384.06	△0.4	99.0	—
2月末	13,957	△0.9	382.13	△0.9	99.0	—
(期 末) 2022年 3月31日	13,919	△1.2	381.04	△1.2	99.6	—

(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(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	12,753,656	20,677,790
	地 方 債 証 券	617,435	1,024,735
	特 殊 債 券	742,132	2,745,712 (143,662)
	社 債 券 (投資法人債券を含む)	1,203,921	502,991

(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 (2021年4月1日から2022年3月31日まで)

公社債

買 付		金 額	売 付		金 額
銘	柄		銘	柄	
		千円			千円
第362回	利付国債(10年)	1,206,049	第424回	利付国債(2年)	890,924
第424回	利付国債(2年)	1,203,144	第141回	利付国債(5年)	885,979
第364回	利付国債(10年)	902,531	第328回	利付国債(10年)	816,569
第365回	利付国債(10年)	812,243	第156回	利付国債(20年)	714,866
第433回	利付国債(2年)	700,554	第361回	利付国債(10年)	602,848
第143回	利付国債(5年)	625,090	第135回	利付国債(5年)	601,688
第14回	利付国債(40年)	594,378	第345回	利付国債(10年)	555,462
第176回	利付国債(20年)	537,078	第362回	利付国債(10年)	532,173
第149回	利付国債(5年)	532,513	第413回	利付国債(2年)	511,132
第144回	利付国債(5年)	403,700	第139回	利付国債(5年)	503,471

(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 (2021年4月1日から2022年3月31日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細 (2022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	58,780,000 (620,000)	62,095,908 (718,944)	76.7 (0.9)	— (—)	54.5 (0.9)	14.2 (—)	8.0 (—)
地 方 債 証 券	6,301,000 (6,301,000)	6,534,694 (6,534,694)	8.1 (8.1)	— (—)	3.1 (3.1)	4.3 (4.3)	0.8 (0.8)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	5,653,256 (5,643,384)	5,960,623 (5,950,747)	7.4 (7.4)	— (—)	4.3 (4.3)	2.2 (2.2)	0.9 (0.9)
金 融 債 券	100,000 (100,000)	99,621 (99,621)	0.1 (0.1)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)	— (—)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	5,800,000 (5,800,000)	5,874,948 (5,874,948)	7.3 (7.3)	— (—)	2.7 (2.7)	3.0 (3.0)	1.6 (1.6)
合 計	76,634,256 (18,464,384)	80,565,795 (19,178,955)	99.6 (23.7)	— (—)	64.6 (10.9)	23.7 (9.5)	11.3 (3.3)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) —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424回 利付国債(2年)	0.005	310,000	310,251	2023/ 5/ 1
第428回 利付国債(2年)	0.005	150,000	150,138	2023/ 9/ 1
第429回 利付国債(2年)	0.005	130,000	130,126	2023/10/ 1
第431回 利付国債(2年)	0.005	390,000	390,390	2023/12/ 1
第432回 利付国債(2年)	0.005	120,000	120,115	2024/ 1/ 1
第433回 利付国債(2年)	0.005	700,000	700,637	2024/ 2/ 1
第434回 利付国債(2年)	0.005	370,000	370,318	2024/ 3/ 1
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	140,289	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,235	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	500,000	501,290	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	550,000	551,512	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	120,000	120,372	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	90,000	90,299	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	150,000	150,550	2024/12/20
第143回 利付国債(5年)	0.1	950,000	953,800	2025/ 3/20
第144回 利付国債(5年)	0.1	540,000	542,257	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	430,000	431,788	2025/ 9/20
第149回 利付国債(5年)	0.005	330,000	329,851	2026/ 9/20
第150回 利付国債(5年)	0.005	400,000	399,620	2026/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	111,818	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	240,000	275,016	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	68,252	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	230,622	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	273,585	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	245,082	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	210,385	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	171,986	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	130,000	173,004	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	244,226	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	228,007	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	152,281	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	187,642	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	240,000	203,745	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	218,545	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	192,472	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	165,000	142,926	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	440,000	379,456	2060/ 3/20
第14回 利付国債(40年)	0.7	440,000	405,829	2061/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	596,259	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	708,862	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	302,913	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	250,000	252,797	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	80,000	81,007	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	140,000	141,989	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	202,646	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	200,000	202,912	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	250,000	252,280	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	364,651	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	50,692	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	121,749	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	670,000	677,852	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	430,000	431,788	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	220,000	220,880	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	490,000	491,857	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	260,000	260,917	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	450,000	451,561	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347回 利付国債(10年)	0.1	500,000	501,560	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	460,000	461,380	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	630,000	631,612	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	340,000	340,707	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	180,000	180,277	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	200,000	200,192	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	660,000	660,217	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	620,000	620,000	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	499,460	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	420,000	419,218	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	380,000	378,981	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	830,000	827,053	2030/ 3/20
第359回 利付国債(10年)	0.1	370,000	368,346	2030/ 6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1	450,000	447,552	2030/ 9/20
第361回 利付国債(10年)	0.1	550,000	546,452	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1	670,000	664,975	2031/ 3/20
第363回 利付国債(10年)	0.1	280,000	277,589	2031/ 6/20
第364回 利付国債(10年)	0.1	670,000	663,460	2031/ 9/20
第365回 利付国債(10年)	0.1	820,000	811,406	2031/12/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	47,955	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	5,910	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	84,641	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	52,339	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	156,276	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	108,445	2033/ 9/20
第13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	83,710	2033/12/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	149,456	2034/ 3/20
第17回 利付国債(30年)	2.4	160,000	200,923	2034/12/20
第18回 利付国債(30年)	2.3	155,000	193,089	2035/ 3/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	137,274	2035/ 6/20
第20回 利付国債(30年)	2.5	50,000	63,870	2035/ 9/20
第21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	125,364	2035/12/20
第23回 利付国債(30年)	2.5	180,000	231,478	2036/ 6/20
第25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	328,445	2036/12/20
第26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	230,511	2037/ 3/20
第27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	415,785	2037/ 9/20
第28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	391,323	2038/ 3/20
第29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	374,990	2038/ 9/20
第30回 利付国債(30年)	2.3	230,000	294,289	2039/ 3/20
第31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	278,524	2039/ 9/20
第32回 利付国債(30年)	2.3	215,000	276,294	2040/ 3/20
第33回 利付国債(30年)	2.0	70,000	86,439	2040/ 9/20
第34回 利付国債(30年)	2.2	250,000	318,115	2041/ 3/20
第35回 利付国債(30年)	2.0	230,000	285,142	2041/ 9/20
第36回 利付国債(30年)	2.0	170,000	211,306	2042/ 3/20
第37回 利付国債(30年)	1.9	340,000	417,159	2042/ 9/20
第38回 利付国債(30年)	1.8	180,000	217,792	2043/ 3/20
第39回 利付国債(30年)	1.9	180,000	221,542	2043/ 6/20
第40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	181,816	2043/ 9/20
第41回 利付国債(30年)	1.7	120,000	143,163	2043/12/20
第42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	238,760	2044/ 3/20
第43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	334,482	2044/ 6/20
第44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	155,392	2044/ 9/20
第45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	288,357	2044/12/20
第46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	369,190	2045/ 3/20
第47回 利付国債(30年)	1.6	140,000	164,508	2045/ 6/20
第48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	226,396	2045/ 9/20
第49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	249,046	2045/12/20

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 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	300,300	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	213,487	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	242,301	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	285,846	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	318,672	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	149,217	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	297,792	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	257,527	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	296,808	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	240,925	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	161,379	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	201,385	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	190,736	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	229,073	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	202,220	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	240,000	210,804	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	230,000	202,045	2050/ 3/20
第 67回 利付国債(30年)	0.6	140,000	129,528	2050/ 6/20
第 68回 利付国債(30年)	0.6	140,000	129,453	2050/ 9/20
第 69回 利付国債(30年)	0.7	100,000	95,002	2050/12/20
第 71回 利付国債(30年)	0.7	20,000	18,964	2051/ 6/20
第 72回 利付国債(30年)	0.7	130,000	123,082	2051/ 9/20
第 73回 利付国債(30年)	0.7	200,000	189,288	2051/12/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	232,440	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	164,617	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	237,721	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	230,000	237,325	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	85,000	88,747	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	125,054	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	158,110	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	104,963	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	90,000	94,752	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	116,975	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	253,792	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	201,816	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	106,541	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	192,353	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	192,628	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	279,146	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	215,746	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	140,000	150,501	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	216,704	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	272,865	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	500,000	543,745	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	274,200	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	218,518	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	296,360	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	66,125	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	153,696	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	219,540	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	230,000	253,611	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	99,656	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	210,000	234,698	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	20,000	22,243	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	370,000	413,264	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	450,000	507,258	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	205,968	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	170,712	2028/ 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105回	利付国債(20年)	2.1	190,000	214,707	2028/ 9/20
第106回	利付国債(20年)	2.2	160,000	181,836	2028/ 9/20
第107回	利付国債(20年)	2.1	170,000	192,825	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	200,000	224,182	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	90,000	101,242	2029/ 3/20
第112回	利付国債(20年)	2.1	220,000	251,354	2029/ 6/20
第113回	利付国債(20年)	2.1	210,000	240,878	2029/ 9/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	120,000	139,040	2029/12/20
第116回	利付国債(20年)	2.2	100,000	116,277	2030/ 3/20
第117回	利付国債(20年)	2.1	220,000	254,073	2030/ 3/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	10,000	11,506	2030/ 6/20
第119回	利付国債(20年)	1.8	100,000	113,442	2030/ 6/20
第123回	利付国債(20年)	2.1	70,000	81,643	2030/12/20
第124回	利付国債(20年)	2.0	180,000	208,395	2030/12/20
第125回	利付国債(20年)	2.2	250,000	294,822	2031/ 3/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	120,000	139,395	2031/ 3/20
第127回	利付国債(20年)	1.9	80,000	92,224	2031/ 3/20
第128回	利付国債(20年)	1.9	100,000	115,598	2031/ 6/20
第129回	利付国債(20年)	1.8	100,000	114,691	2031/ 6/20
第130回	利付国債(20年)	1.8	150,000	172,468	2031/ 9/20
第131回	利付国債(20年)	1.7	150,000	171,072	2031/ 9/20
第132回	利付国債(20年)	1.7	200,000	228,714	2031/12/20
第134回	利付国債(20年)	1.8	300,000	346,737	2032/ 3/20
第135回	利付国債(20年)	1.7	230,000	263,584	2032/ 3/20
第136回	利付国債(20年)	1.6	210,000	238,612	2032/ 3/20
第138回	利付国債(20年)	1.5	100,000	112,849	2032/ 6/20
第139回	利付国債(20年)	1.6	90,000	102,464	2032/ 6/20
第140回	利付国債(20年)	1.7	290,000	333,758	2032/ 9/20
第141回	利付国債(20年)	1.7	380,000	438,212	2032/12/20
第142回	利付国債(20年)	1.8	120,000	139,638	2032/12/20
第143回	利付国債(20年)	1.6	230,000	263,283	2033/ 3/20
第144回	利付国債(20年)	1.5	250,000	283,507	2033/ 3/20
第145回	利付国債(20年)	1.7	350,000	405,160	2033/ 6/20
第146回	利付国債(20年)	1.7	380,000	440,705	2033/ 9/20
第147回	利付国債(20年)	1.6	240,000	275,949	2033/12/20
第149回	利付国債(20年)	1.5	380,000	433,747	2034/ 6/20
第150回	利付国債(20年)	1.4	430,000	485,981	2034/ 9/20
第151回	利付国債(20年)	1.2	450,000	497,794	2034/12/20
第152回	利付国債(20年)	1.2	455,000	503,284	2035/ 3/20
第153回	利付国債(20年)	1.3	270,000	302,216	2035/ 6/20
第154回	利付国債(20年)	1.2	80,000	88,520	2035/ 9/20
第155回	利付国債(20年)	1.0	110,000	118,815	2035/12/20
第156回	利付国債(20年)	0.4	350,000	349,534	2036/ 3/20
第157回	利付国債(20年)	0.2	240,000	232,603	2036/ 6/20
第158回	利付国債(20年)	0.5	100,000	100,884	2036/ 9/20
第159回	利付国債(20年)	0.6	140,000	142,997	2036/12/20
第160回	利付国債(20年)	0.7	280,000	289,814	2037/ 3/20
第161回	利付国債(20年)	0.6	260,000	264,799	2037/ 6/20
第162回	利付国債(20年)	0.6	320,000	325,296	2037/ 9/20
第163回	利付国債(20年)	0.6	280,000	284,286	2037/12/20
第164回	利付国債(20年)	0.5	350,000	349,223	2038/ 3/20
第165回	利付国債(20年)	0.5	340,000	338,728	2038/ 6/20
第166回	利付国債(20年)	0.7	310,000	317,982	2038/ 9/20
第167回	利付国債(20年)	0.5	320,000	317,305	2038/12/20
第168回	利付国債(20年)	0.4	220,000	214,046	2039/ 3/20
第169回	利付国債(20年)	0.3	280,000	267,097	2039/ 6/20
第170回	利付国債(20年)	0.3	250,000	237,762	2039/ 9/20
第171回	利付国債(20年)	0.3	210,000	199,111	2039/12/20

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172回 利付国債(20年)	0.4	180,000	173,178	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	230,000	220,632	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	310,000	296,484	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	280,000	272,081	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5	160,000	155,160	2041/ 3/20
第177回 利付国債(20年)	0.4	150,000	142,618	2041/ 6/20
第178回 利付国債(20年)	0.5	300,000	289,965	2041/ 9/20
第179回 利付国債(20年)	0.5	330,000	318,562	2041/12/20
小 計	—	58,780,000	62,095,908	—
(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	127,174	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	101,143	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,138	2024/12/20
第741回 東京都公募公債	0.435	100,000	101,185	2025/ 3/19
平成26年度第 15回 北海道公募公債	0.434	200,000	202,344	2025/ 2/27
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	101,557	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	106,659	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	101,006	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,257	2024/ 9/20
第251回 神奈川県公募公債	0.199	100,000	99,292	2031/ 3/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	114,269	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	101,270	2024/10/30
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	100,249	2027/10/29
平成27年度第 7回 京都府公募公債	0.515	200,000	203,216	2025/ 9/17
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	115,239	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,231	2025/ 2/26
平成29年度第 22回 兵庫県公募公債	0.19	100,000	100,201	2028/ 1/21
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	105,915	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	101,310	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	101,475	2025/ 9/19
令和 3年度第 5回 静岡県公募公債(5年)	0.005	200,000	199,368	2026/ 6/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	113,667	2034/ 5/15
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,392	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	114,204	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	101,267	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	101,193	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	112,417	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	113,701	2034/ 5/26
第 14回 千葉県公募公債(20年)	1.137	100,000	108,622	2033/ 4/15
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	100,943	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,863	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	100,709	2028/10/31
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	101,188	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,055	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	102,250	2024/ 3/25
第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	200,000	202,640	2024/ 7/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,230	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,195	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,863	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	100,000	100,527	2027/ 7/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	99,194	2030/ 6/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	99,930	2026/11/30
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	101,048	2023/11/29
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,393	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	108,900	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	105,603	2024/ 6/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	107,153	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,453	2027/ 8/13

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 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	115,328	2033/ 1/28
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,649	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	107,736	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	101,129	2023/12/20
第 4回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	113,451	2028/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,078	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	105,201	2029/10/22
平成26年度第 2回 千葉市公募公債	0.505	300,000	303,699	2024/11/27
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,325	2027/ 9/17
小 計	—	6,301,000	6,534,694	—
(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	200,050	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	109,357	2024/ 3/18
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	129,379	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	115,134	2030/ 2/ 8
第128回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	101,296	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	200,000	202,326	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	104,990	2029/ 6/20
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	113,621	2032/ 7/30
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	118,182	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	109,338	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	100,322	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	115,510	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	115,930	2031/ 1/28
第 23回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	223,458	2027/ 9/24
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	112,661	2028/ 4/25
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	101,297	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	101,396	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	100,610	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	99,124	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	105,019	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	101,213	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	101,297	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	130,217	2037/ 3/19
第 12回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.52	100,000	110,304	2026/ 6/19
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	113,195	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	202,722	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	101,299	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	99,730	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	99,937	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	106,109	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	101,369	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	101,113	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	100,027	2023/12/20
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	109,912	2026/ 3/20
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,459	10,553	2042/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	10,888	11,051	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	12,117	12,420	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	113,004	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	12,280	12,653	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	19,288	19,297	2022/ 4/ 8
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	9,872	9,876	2022/ 4/ 8
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	32,882	34,639	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	18,253	19,340	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	16,932	17,832	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	22,695	23,962	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	21,478	22,581	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	22,035	23,157	2045/ 6/10

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 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	10,509	10,613	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	40,860	42,893	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	11,751	12,048	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	21,930	22,894	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	114,061	2030/ 7/16
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	60,418	63,115	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	106,614	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	40,893	42,747	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	41,370	42,704	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	45,806	47,153	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	47,221	48,424	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	52,474	53,027	2050/ 2/10
第 99回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.584	100,000	107,358	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	75,861	75,662	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	76,930	76,915	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	76,630	76,706	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	81,671	81,577	2053/ 2/10
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	84,144	83,543	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	86,325	85,367	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	89,653	87,410	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	91,631	90,325	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	101,363	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,281	2026/12/18
小 計	—	5,653,256	5,960,623	—
(金融債券)	%	千円	千円	
い第853号 商工債	0.09	100,000	99,621	2026/ 6/26
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第522回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.47	100,000	100,316	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	99,793	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	100,184	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	101,459	2024/ 9/25
第321回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.365	100,000	100,215	2027/ 4/23
第499回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.405	100,000	100,194	2027/11/25
第508回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.465	100,000	100,303	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	100,412	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	115,488	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	101,343	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	100,266	2026/ 5/22
第 1回 国際石油開発帝石株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.08	100,000	99,662	2026/ 3/16
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特約付)	0.13	100,000	99,784	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(特定社債間限定同順位特約付)	0.03	200,000	199,700	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	99,580	2028/ 9/14
第 16回 アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	0.08	100,000	99,447	2026/ 3/13
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	99,864	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	100,000	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	98,932	2028/10/25
第 16回 株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.15	100,000	99,801	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	99,261	2026/ 7/31
第 33回 住友金属鉱山株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	100,000	99,341	2026/ 9/15
第 11回 株式会社LIXILグループ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.01	200,000	199,672	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	99,829	2023/12/22
第 38回 三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	200,000	198,818	2026/ 9/ 1
第 85回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.2	100,000	112,102	2029/ 7/13
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	101,075	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	199,846	2025/ 7/15
第 16回 NTTファイナンス株式会社無担保社債(日本電信電話株)	0.18	100,000	99,956	2025/12/19
第 69回 株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	200,000	198,912	2026/ 6/19
第 76回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.37	100,000	98,967	2030/ 1/23

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 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	99,401	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	101,129	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	113,698	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	99,968	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	111,337	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	119,204	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	99,845	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	99,888	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	105,613	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	99,577	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	100,120	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	99,039	2031/ 1/20
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	100,221	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	100,232	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	100,590	2025/ 7/16
第 44回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.4	200,000	199,676	2026/ 4/22
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	100,024	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	99,916	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	100,657	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	100,278	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	100,013	2024/ 1/23
小 計	—	5,800,000	5,874,948	—
合 計	—	76,634,256	80,565,795	—

(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(2022年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 80,565,795	% 98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,204,825	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	81,770,620	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

2022年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	81,770,620,852円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	907,966,062
公 社 債(評価額)	80,565,795,252
未 収 入 金	200,106,000
未 収 利 息	95,501,895
前 払 費 用	1,251,643
(B) 負 債	851,852,287
未 払 金	822,049,800
未 払 解 約 金	29,800,000
未 払 利 息	2,487
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	80,918,768,565
元 本	58,133,569,260
次 期 繰 越 損 益 金	22,785,199,305
(D) 受 益 権 総 口 数	58,133,569,260口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,919円

(注1) 当ファンドの期首元本額は65,849,341,831円、期中追加設定元本額は3,103,015,670円、期中一部解約元本額は10,818,788,241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)

32,844,381,022円

日立国内債券インデックスファンド

10,110,588,627円

日立バランスファンド(株式50)

7,185,745,445円

日立バランスファンド(株式70)

4,194,404,905円

日立バランスファンド(株式30)

3,798,449,261円

(注3) 1口当たり純資産額は1.3919円です。

■損益の状況

当期(自2021年4月1日 至2022年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	737,720,542円
受 取 利 息	738,417,114
支 払 利 息	△696,572
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,667,775,872
売 買 益	29,721,133
売 買 損	△1,697,497,005
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△930,055,330
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	26,910,701,158
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,261,265,236
(F) 解 約 差 損 益 金	△4,456,711,759
(G) 計 (C + D + E + F)	22,785,199,305
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	22,785,199,305

(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。