



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22期

(決算日 2023年5月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、日立国内債券インデックスファンドは、このたび、第22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			
	円	%		%	%	%	百万円
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
22期(2023年5月15日)	12,530	△1.2	375.21	△1.1	99.0	—	13,300

(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) 2022年 5月16日	円 12,684	% —	379.46	% —	% 99.1	% —
5月末	12,686	0.0	379.54	0.0	99.0	—
6月末	12,568	△0.9	376.08	△0.9	99.1	—
7月末	12,647	△0.3	378.55	△0.2	99.1	—
8月末	12,617	△0.5	377.67	△0.5	99.0	—
9月末	12,483	△1.6	373.60	△1.5	99.1	—
10月末	12,469	△1.7	373.25	△1.6	99.1	—
11月末	12,406	△2.2	371.33	△2.1	99.1	—
12月末	12,243	△3.5	366.60	△3.4	80.3	—
2023年 1月末	12,203	△3.8	365.59	△3.7	98.9	—
2月末	12,341	△2.7	369.57	△2.6	99.0	—
3月末	12,512	△1.4	374.74	△1.2	99.2	—
4月末	12,547	△1.1	375.61	△1.0	99.0	—
(期 末) 2023年 5月15日	円 12,530	% △1.2	375.21	% △1.1	% 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＞

期末にかけて、日本銀行による緩和的な金融政策の修正の思惑が高まる中、政策修正を行わず据え置いたことがプラスに影響しました。

＜下落要因＞

12月の金融政策決定会合において、日銀が長期金利の許容変動幅を±0.50%に拡大し、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	2022年5月16日	2022年5月25日	2023年1月12日	2023年5月15日
基 準 価 額	12,684円	12,731円	12,162円	12,530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12,684円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、12,530円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲1.2%となり、ベンチマーク騰落率▲1.1%にほぼ追従したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となりました。

【投資環境】

当期の国内長期金利は上昇となりました。海外各国におけるインフレの高進と金融引き締めを背景に、海外金利が上昇基調となるなか、長期金利はイールドカーブコントロール政策のレンジ上限付近の0.25%程度での推移が続きました。その後は、12月の金融政策決定会合において、日銀が長期金利の許容変動幅を±0.50%に拡大したため、長期金利は新たなレンジ上限まで上昇しました。期末にかけては、金融政策決定会合での政策修正への思惑や、米地銀の破綻をきっかけに金融不安が高まったことを材料に上下し、長期金利は0.40%付近で期末を迎えました。

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年限は、金利上昇幅が大きくなりました。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、一般的にスプレッドが拡大しました。海外中央銀行の引き締めの金融政策や欧米の金融不安などを背景に、円建外債や劣後債を中心に、クレジットスプレッドは拡大の動きとなりました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで▲1.1%となりました。

【当ファンドのポートフォリオ】

＜当ファンド＞

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

＜日立国内債券インデックスマザーファンド＞

わが国の公社債を主要投資対象とします。具体的には、NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとし、ベンチマークに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行いました。

【今後の運用方針】

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

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2022. 5. 17～2023. 5. 15)		
	金 額	比 率	
(a)信 託 報 酬	15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, 476円です。
（投 信 会 社）	（ 8 ）	(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	15	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。

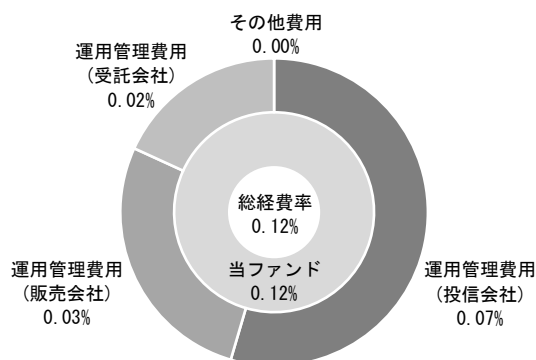
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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(2022年5月17日から2023年5月15日まで)

ファン ド 名 称	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日 立 国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 730, 216	千円 997, 600	千口 1, 023, 634	千円 1, 399, 300

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2022年5月17日から2023年5月15日まで)

公社債(日立国内債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第368回 利付国債(10年)	881, 759	第330回 利付国債(10年)	708, 029
第367回 利付国債(10年)	629, 153	第433回 利付国債(2年)	701, 022
第437回 利付国債(2年)	500, 745	第143回 利付国債(5年)	700, 882
第150回 利付国債(5年)	499, 264	第434回 利付国債(2年)	590, 183
第149回 利付国債(5年)	431, 036	第365回 利付国債(10年)	571, 706
第366回 利付国債(10年)	428, 610	第139回 利付国債(5年)	550, 599
第369回 利付国債(10年)	411, 997	第138回 利付国債(5年)	501, 241
第443回 利付国債(2年)	369, 889	第358回 利付国債(10年)	489, 432
第355回 利付国債(10年)	329, 622	第329回 利付国債(10年)	444, 179
第181回 利付国債(20年)	328, 423	第368回 利付国債(10年)	444, 050

(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(2022年5月17日から2023年5月15日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
	千円	千円	千円
公 社 債	105, 935	0	104, 877

(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、日立製作所です。

■組入資産の明細(2023年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日 立 国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	9, 984, 899	9, 691, 480	13, 286, 050

(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(2023年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日 立 国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	13, 286, 050	99. 7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	41, 797	0. 3
投 資 信 託 財 産 総 額	13, 327, 847	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

2023年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	13,327,847,040円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	39,996,163
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	13,286,050,877
未 収 入 金	1,800,000
(B) 負 債	27,285,083
未 払 解 約 金	19,439,660
未 払 信 託 報 酬	7,845,311
未 払 利 息	112
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	13,300,561,957
元 本	10,615,046,141
次 期 繰 越 損 益 金	2,685,515,816
(D) 受 益 権 総 口 数	10,615,046,141口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,530円

(注1) 当ファンドの期首元本額は10,923,314,552円、期中追加設定元本額は2,017,896,515円、期中一部解約元本額は2,326,164,926円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,2530円です。

■損益の状況

当期(自2022年5月17日 至2023年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△23,220円
支 払 利 息	△23,220
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△110,524,368
売 買 益	36,018,330
売 買 損	△146,542,698
(C) 信 託 報 酬 等	△16,082,667
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△126,630,255
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	22,366,401
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,789,779,670
(配 当 等 相 当 額)	(2,636,648,556)
(売 買 損 益 相 当 額)	(153,131,114)
(G) 計 (D + E + F)	2,685,515,816
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,685,515,816
追 加 信 託 差 損 益 金	2,789,779,670
(配 当 等 相 当 額)	(2,636,648,556)
(売 買 損 益 相 当 額)	(153,131,114)
分 配 準 備 積 立 金	301,611,571
繰 越 損 益 金	△405,875,425

(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(2,636,648,556円)および分配準備積立金(301,611,571円)より分配対象収益は2,938,260,127円(10,000口当たり2,767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(2023年5月15日現在)

下記は、日立国内債券インデックスマザーファンド全体(40,576,096千口)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	2023年5月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年 以上	2年 以上	2年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	43,025,000 (620,000)	44,312,106 (702,072)	79.7 (1.3)	— (—)	55.4 (1.3)	17.2 (—)	7.1 (—)
地 方 債 証 券	3,500,000 (3,500,000)	3,669,288 (3,669,288)	6.6 (6.6)	— (—)	3.5 (3.5)	1.1 (1.1)	2.0 (2.0)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	3,142,437 (3,142,437)	3,304,088 (3,304,088)	5.9 (5.9)	— (—)	3.9 (3.9)	1.9 (1.9)	0.2 (0.2)
金 融 債 券	200,000 (200,000)	199,035 (199,035)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	— (—)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	3,600,000 (3,600,000)	3,622,840 (3,622,840)	6.5 (6.5)	— (—)	2.4 (2.4)	3.6 (3.6)	0.5 (0.5)
合 計	53,467,437 (11,062,437)	55,107,358 (11,497,323)	99.1 (20.7)	— (—)	65.2 (11.0)	24.1 (6.9)	9.8 (2.7)

(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437回 利付国債(2年)	0.005	60,000	60,084	2024/ 6/ 1
第438回 利付国債(2年)	0.005	150,000	150,210	2024/ 7/ 1
第439回 利付国債(2年)	0.005	110,000	110,159	2024/ 8/ 1
第440回 利付国債(2年)	0.005	280,000	280,417	2024/ 9/ 1
第441回 利付国債(2年)	0.005	290,000	290,437	2024/10/ 1
第442回 利付国債(2年)	0.005	100,000	100,153	2024/11/ 1
第443回 利付国債(2年)	0.005	370,000	370,599	2024/12/ 1
第444回 利付国債(2年)	0.005	70,000	70,108	2025/ 1/ 1
第447回 利付国債(2年)	0.005	30,000	30,039	2025/ 4/ 1
第140回 利付国債(5年)	0.1	80,000	80,192	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	170,000	170,481	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	150,000	150,454	2024/12/20
第143回 利付国債(5年)	0.1	250,000	250,782	2025/ 3/20
第144回 利付国債(5年)	0.1	540,000	541,809	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	380,000	381,383	2025/ 9/20
第146回 利付国債(5年)	0.1	120,000	120,468	2025/12/20
第147回 利付国債(5年)	0.005	100,000	100,142	2026/ 3/20
第148回 利付国債(5年)	0.005	220,000	220,270	2026/ 6/20
第149回 利付国債(5年)	0.005	660,000	660,660	2026/ 9/20
第150回 利付国債(5年)	0.005	490,000	490,259	2026/12/20
第151回 利付国債(5年)	0.005	200,000	199,960	2027/ 3/20
第152回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,345	2027/ 3/20
第153回 利付国債(5年)	0.005	180,000	179,814	2027/ 6/20
第154回 利付国債(5年)	0.1	60,000	60,117	2027/ 9/20
第155回 利付国債(5年)	0.3	100,000	101,007	2027/12/20
第156回 利付国債(5年)	0.2	110,000	110,578	2027/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	109,795	2030/ 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121回 利付国債(20年)	1.9	240,000	269,056	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	66,830	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	100,000	112,618	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	265,504	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	227,431	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	194,632	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	157,998	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	130,000	158,121	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	100,000	117,519	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	80,000	92,406	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	138,291	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	169,671	2055/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	195,863	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	100,000	85,747	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	85,000	65,261	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	160,000	121,742	2060/ 3/20
第14回 利付国債(40年)	0.7	210,000	170,471	2061/ 3/20
第15回 利付国債(40年)	1.0	250,000	222,320	2062/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	180,000	181,422	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	201,646	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	200,000	201,886	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	250,000	251,557	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	363,121	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	50,482	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	121,282	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	270,000	272,457	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	230,000	230,947	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	220,000	220,919	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	490,000	492,048	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	260,000	261,027	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	450,000	451,552	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	430,000	431,229	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	310,000	310,604	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	230,000	230,209	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	340,000	339,915	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	180,000	179,816	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	200,000	199,734	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	460,000	459,103	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	578,486	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	410,000	408,634	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	260,000	258,936	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	390,000	388,089	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	340,000	337,929	2030/ 3/20
第359回 利付国債(10年)	0.1	420,000	416,766	2030/ 6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1	430,000	425,652	2030/ 9/20
第361回 利付国債(10年)	0.1	200,000	197,614	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1	270,000	266,268	2031/ 3/20
第363回 利付国債(10年)	0.1	280,000	275,682	2031/ 6/20
第364回 利付国債(10年)	0.1	120,000	117,949	2031/ 9/20
第365回 利付国債(10年)	0.1	350,000	343,700	2031/12/20
第366回 利付国債(10年)	0.2	230,000	227,428	2032/ 3/20
第367回 利付国債(10年)	0.2	230,000	227,058	2032/ 6/20
第368回 利付国債(10年)	0.2	440,000	433,633	2032/ 9/20
第369回 利付国債(10年)	0.5	410,000	414,743	2032/12/20
第370回 利付国債(10年)	0.5	130,000	131,168	2033/ 3/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	46,650	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	5,756	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	82,273	2031/11/20

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 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	50,941	2032/11/22
第 11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	151,883	2033/ 6/20
第 12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	104,941	2033/ 9/20
第 13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	81,015	2033/12/20
第 14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	144,118	2034/ 3/20
第 17回 利付国債(30年)	2.4	160,000	193,216	2034/12/20
第 18回 利付国債(30年)	2.3	155,000	185,779	2035/ 3/20
第 19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	132,056	2035/ 6/20
第 20回 利付国債(30年)	2.5	50,000	61,309	2035/ 9/20
第 21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	120,404	2035/12/20
第 24回 利付国債(30年)	2.5	120,000	148,176	2036/ 9/20
第 25回 利付国債(30年)	2.3	220,000	266,347	2036/12/20
第 26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	220,707	2037/ 3/20
第 27回 利付国債(30年)	2.5	70,000	86,937	2037/ 9/20
第 28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	373,614	2038/ 3/20
第 29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	357,332	2038/ 9/20
第 30回 利付国債(30年)	2.3	230,000	280,284	2039/ 3/20
第 31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	264,910	2039/ 9/20
第 32回 利付国債(30年)	2.3	215,000	262,480	2040/ 3/20
第 33回 利付国債(30年)	2.0	70,000	82,170	2040/ 9/20
第 34回 利付国債(30年)	2.2	220,000	265,399	2041/ 3/20
第 35回 利付国債(30年)	2.0	30,000	35,224	2041/ 9/20
第 36回 利付国債(30年)	2.0	170,000	199,644	2042/ 3/20
第 37回 利付国債(30年)	1.9	70,000	81,067	2042/ 9/20
第 38回 利付国債(30年)	1.8	180,000	204,859	2043/ 3/20
第 39回 利付国債(30年)	1.9	110,000	127,204	2043/ 6/20
第 40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	170,721	2043/ 9/20
第 41回 利付国債(30年)	1.7	20,000	22,391	2043/12/20
第 42回 利付国債(30年)	1.7	20,000	22,395	2044/ 3/20
第 43回 利付国債(30年)	1.7	30,000	33,599	2044/ 6/20
第 44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	145,496	2044/ 9/20
第 45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	270,042	2044/12/20
第 46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	345,584	2045/ 3/20
第 47回 利付国債(30年)	1.6	140,000	153,809	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	211,712	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	232,786	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	20,000	18,733	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	200,032	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	226,597	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	230,000	204,621	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	297,369	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	139,044	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	100,000	92,462	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	239,792	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	30,000	27,597	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	223,945	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	149,651	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	186,515	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	176,645	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	211,926	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	186,808	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	20,000	16,218	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	10,000	8,064	2050/ 3/20
第 67回 利付国債(30年)	0.6	140,000	118,815	2050/ 6/20
第 68回 利付国債(30年)	0.6	140,000	118,435	2050/ 9/20
第 69回 利付国債(30年)	0.7	100,000	86,756	2050/12/20
第 70回 利付国債(30年)	0.7	30,000	25,974	2051/ 3/20
第 71回 利付国債(30年)	0.7	30,000	25,948	2051/ 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 72回	利付国債(30年)	0.7	130,000	112,330	2051/ 9/20
第 73回	利付国債(30年)	0.7	200,000	172,644	2051/12/20
第 74回	利付国債(30年)	1.0	190,000	177,482	2052/ 3/20
第 75回	利付国債(30年)	1.3	180,000	180,954	2052/ 6/20
第 76回	利付国債(30年)	1.4	170,000	175,098	2052/ 9/20
第 77回	利付国債(30年)	1.6	100,000	107,911	2052/12/20
第 78回	利付国債(30年)	1.4	110,000	113,339	2053/ 3/20
第 70回	利付国債(20年)	2.4	150,000	154,147	2024/ 6/20
第 71回	利付国債(20年)	2.2	100,000	102,545	2024/ 6/20
第 72回	利付国債(20年)	2.1	90,000	92,684	2024/ 9/20
第 75回	利付国債(20年)	2.1	110,000	114,406	2025/ 3/20
第 76回	利付国債(20年)	1.9	140,000	145,091	2025/ 3/20
第 79回	利付国債(20年)	2.0	100,000	104,322	2025/ 6/20
第 80回	利付国債(20年)	2.1	180,000	188,157	2025/ 6/20
第 81回	利付国債(20年)	2.0	180,000	188,695	2025/ 9/20
第 82回	利付国債(20年)	2.1	60,000	63,039	2025/ 9/20
第 84回	利付国債(20年)	2.0	140,000	147,463	2025/12/20
第 85回	利付国債(20年)	2.1	200,000	212,214	2026/ 3/20
第 87回	利付国債(20年)	2.2	120,000	127,670	2026/ 3/20
第 88回	利付国債(20年)	2.3	250,000	268,090	2026/ 6/20
第 89回	利付国債(20年)	2.2	200,000	213,852	2026/ 6/20
第 90回	利付国債(20年)	2.2	270,000	290,128	2026/ 9/20
第 91回	利付国債(20年)	2.3	60,000	64,674	2026/ 9/20
第 92回	利付国債(20年)	2.1	140,000	150,628	2026/12/20
第 93回	利付国債(20年)	2.0	200,000	215,292	2027/ 3/20
第 94回	利付国債(20年)	2.1	90,000	97,227	2027/ 3/20
第 96回	利付国債(20年)	2.1	90,000	97,621	2027/ 6/20
第 97回	利付国債(20年)	2.2	210,000	229,538	2027/ 9/20
第 98回	利付国債(20年)	2.1	20,000	21,774	2027/ 9/20
第 99回	利付国債(20年)	2.1	70,000	76,493	2027/12/20
第100回	利付国債(20年)	2.2	100,000	110,123	2028/ 3/20
第102回	利付国債(20年)	2.4	180,000	200,836	2028/ 6/20
第103回	利付国債(20年)	2.3	50,000	55,534	2028/ 6/20
第105回	利付国債(20年)	2.1	190,000	209,989	2028/ 9/20
第106回	利付国債(20年)	2.2	120,000	133,262	2028/ 9/20
第107回	利付国債(20年)	2.1	170,000	188,608	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	200,000	219,670	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	90,000	99,180	2029/ 3/20
第110回	利付国債(20年)	2.1	150,000	167,040	2029/ 3/20
第112回	利付国債(20年)	2.1	320,000	357,801	2029/ 6/20
第113回	利付国債(20年)	2.1	210,000	235,674	2029/ 9/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	120,000	135,936	2029/12/20
第116回	利付国債(20年)	2.2	100,000	113,656	2030/ 3/20
第117回	利付国債(20年)	2.1	220,000	248,556	2030/ 3/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	10,000	11,259	2030/ 6/20
第119回	利付国債(20年)	1.8	100,000	111,194	2030/ 6/20
第123回	利付国債(20年)	2.1	70,000	79,684	2030/12/20
第124回	利付国債(20年)	2.0	120,000	135,706	2030/12/20
第125回	利付国債(20年)	2.2	80,000	91,894	2031/ 3/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	120,000	135,997	2031/ 3/20
第127回	利付国債(20年)	1.9	80,000	90,050	2031/ 3/20
第128回	利付国債(20年)	1.9	100,000	112,824	2031/ 6/20
第129回	利付国債(20年)	1.8	100,000	112,032	2031/ 6/20
第130回	利付国債(20年)	1.8	150,000	168,391	2031/ 9/20
第131回	利付国債(20年)	1.7	150,000	167,169	2031/ 9/20
第132回	利付国債(20年)	1.7	80,000	89,424	2031/12/20
第134回	利付国債(20年)	1.8	20,000	22,555	2032/ 3/20
第135回	利付国債(20年)	1.7	130,000	145,490	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136回 利付国債(20年)	1.6	80,000	88,844	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	110,332	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	100,093	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	220,000	246,771	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	150,000	168,411	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	40,000	45,280	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	130,000	144,842	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	50,000	55,235	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	220,000	247,513	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	330,000	371,520	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	240,000	267,916	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	280,000	309,758	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	170,000	186,229	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	200,000	214,640	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	455,000	488,155	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	270,000	292,634	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	80,000	85,715	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	110,000	115,152	2035/12/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	240,000	226,692	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	120,000	117,572	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	120,000	118,878	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	270,000	270,510	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	210,000	207,171	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	80,000	78,700	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	90,000	88,281	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	200,000	192,934	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	40,000	38,461	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	60,000	59,220	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	305,625	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	206,175	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	257,283	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	228,785	2039/ 9/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	10,000	9,241	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	230,000	211,862	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	170,000	156,073	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	280,000	260,610	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5	10,000	9,278	2041/ 3/20
第177回 利付国債(20年)	0.4	150,000	136,312	2041/ 6/20
第178回 利付国債(20年)	0.5	230,000	212,170	2041/ 9/20
第179回 利付国債(20年)	0.5	30,000	27,604	2041/12/20
第180回 利付国債(20年)	0.8	280,000	271,334	2042/ 3/20
第181回 利付国債(20年)	0.9	60,000	59,085	2042/ 6/20
第182回 利付国債(20年)	1.1	110,000	111,964	2042/ 9/20
第183回 利付国債(20年)	1.4	80,000	85,523	2042/12/20
第184回 利付国債(20年)	1.1	40,000	40,528	2043/ 3/20
小 計	—	43,025,000	44,312,106	—
(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	119,863	2039/ 9/20
第 31回 東京都公募公債(20年)	1.238	100,000	105,433	2034/ 9/20
第741回 東京都公募公債	0.435	100,000	100,688	2025/ 3/19
平成26年度第 15回 北海道公募公債	0.434	100,000	100,657	2025/ 2/27
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	100,972	2025/10/30
第 20回 神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	109,502	2032/ 6/18
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	100,714	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	110,955	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	100,714	2024/10/30
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	99,889	2027/10/29
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	112,072	2029/11/19

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	104,335	2028/11/20
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	100,939	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	108,645	2034/ 5/15
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	110,860	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	100,722	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	100,694	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	109,616	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	108,611	2034/ 5/26
第 5回 千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	110,481	2028/ 9/21
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	96,221	2038/ 8/20
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	100,718	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	100,698	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,777	2026/10/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	98,232	2030/ 6/25
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	104,781	2025/ 9/19
第 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	110,161	2033/ 1/28
第 4回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	110,492	2028/ 6/20
平成23年度第 4回 福岡市公募公債(20年)	1.89	100,000	110,958	2031/ 8/19
平成25年度第 1回 福岡市公募公債(20年)	1.808	100,000	110,635	2033/ 7/19
平成26年度第 2回 福岡市公募公債(20年)	1.49	100,000	108,069	2034/ 6/20
平成26年度第 2回 千葉市公募公債	0.505	300,000	302,163	2024/11/27
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,021	2027/ 9/17
小 計	—	3,500,000	3,669,288	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	121,882	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	111,815	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	100,649	2024/ 6/20
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	110,605	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	105,295	2035/ 2/28
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	112,208	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	112,249	2031/ 1/28
第 23回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	217,560	2027/ 9/24
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	109,688	2028/ 4/25
第 76回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	100,861	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	99,811	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	98,721	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	103,490	2027/10/29
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	122,415	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	108,787	2034/ 4/28
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	100,814	2025/11/28
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	99,461	2028/ 7/31
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	106,920	2026/ 3/20
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	109,894	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	10,918	11,075	2043/ 8/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	28,182	29,405	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	16,075	16,906	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	14,846	15,487	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	20,223	21,250	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	18,640	19,482	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	19,447	20,304	2045/ 6/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	10,434	10,584	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	18,631	19,348	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	110,833	2030/ 7/16
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	41,148	41,928	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	42,212	42,839	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	47,557	47,478	2050/ 2/10
第 99回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.584	100,000	105,304	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	70,322	68,826	2051/12/10

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117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	71,211	69,849	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	70,805	69,531	2052/ 3/10
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	77,975	75,692	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	79,802	77,061	2054/ 5/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	86,188	82,723	2055/ 3/10
第185回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.58	97,821	95,139	2057/10/10
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	99,910	2026/12/18
小 計	—	3,142,437	3,304,088	—
(金融債券)	%	千円	千円	
い第853号 商工債	0.09	100,000	99,566	2026/ 6/26
い第857号 商工債	0.09	100,000	99,469	2026/10/27
小 計	—	200,000	199,035	—
(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	99,381	2028/ 9/20
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,042	2024/10/25
第321回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.365	100,000	100,021	2027/ 4/23
第527回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.32	100,000	95,911	2031/ 2/25
第451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	100,139	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	111,728	2030/12/13
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	99,924	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	0.08	100,000	99,445	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	0.13	100,000	99,928	2025/ 9/12
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	99,265	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	0.08	100,000	99,516	2026/ 3/13
第 41回 株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債(社債	0.33	100,000	95,317	2031/ 6/ 3
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	99,881	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	98,997	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	0.09	100,000	99,421	2026/ 9/15
第 17回 株式会社日立製作所無担保社債(社債間限定同順位特約付	1.371	100,000	104,877	2028/12/13
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	100,000	99,329	2026/ 9/ 1
第 26回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付	0.05	100,000	99,519	2026/ 3/18
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	109,142	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	100,209	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	100,000	99,687	2025/ 7/15
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	0.09	100,000	99,406	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	97,316	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	97,606	2030/ 4/16
第 91回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順	1.751	100,000	108,646	2032/12/27
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	98,880	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	108,305	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	107,639	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	99,313	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	99,122	2027/12/15
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	99,800	2026/ 7/14
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	96,313	2031/ 1/20
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	100,041	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	198,458	2026/ 4/22
クレディ・アグリコル・エス・エー第6回 円貨社債	0.865	100,000	100,316	2024/11/28
小 計	—	3,600,000	3,622,840	—
合 計	—	53,467,437	55,107,358	—

(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			
19期(2019年4月 1日)	円	%	%	%	百万円
	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
23期(2023年3月31日)	13,687	△1.7	99.2	—	55,320

(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) 2022年 3月31日	円	%		%	%	%
	13,919	—	381.04	—	99.6	—
4月末	13,884	△0.3	380.12	△0.2	99.3	—
5月末	13,864	△0.4	379.54	△0.4	99.1	—
6月末	13,736	△1.3	376.08	△1.3	99.2	—
7月末	13,824	△0.7	378.55	△0.7	99.1	—
8月末	13,793	△0.9	377.67	△0.9	99.0	—
9月末	13,647	△2.0	373.60	△2.0	99.2	—
10月末	13,633	△2.1	373.25	△2.0	99.2	—
11月末	13,566	△2.5	371.33	△2.5	99.2	—
12月末	13,389	△3.8	366.60	△3.8	80.4	—
2023年 1月末	13,347	△4.1	365.59	△4.1	99.0	—
2月末	13,499	△3.0	369.57	△3.0	99.1	—
(期 末) 2023年 3月31日	13,687	△1.7	374.74	△1.7	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

項 目	当 期
	(2022.4.1～2023.3.31)
	金 額
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0円 (0)
合 計	0

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	10,425,176	26,131,614
	地 方 債 証 券	660,593	3,420,761
	特 殊 債 券	413,704	2,683,067 (144,420)
	社 債 券 (投資法人債券を含む)	511,766	2,794,821

(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 (2022年4月1日から2023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367回 利付国債(10年)	629,153	第330回 利付国債(10年)	708,029
第437回 利付国債(2年)	500,745	第433回 利付国債(2年)	701,022
第150回 利付国債(5年)	499,264	第143回 利付国債(5年)	700,882
第368回 利付国債(10年)	457,891	第434回 利付国債(2年)	640,242
第149回 利付国債(5年)	431,036	第329回 利付国債(10年)	595,714
第366回 利付国債(10年)	428,610	第365回 利付国債(10年)	571,706
第369回 利付国債(10年)	411,997	第139回 利付国債(5年)	550,599
第443回 利付国債(2年)	369,889	第364回 利付国債(10年)	532,422
第355回 利付国債(10年)	329,622	第138回 利付国債(5年)	501,241
第181回 利付国債(20年)	328,423	第358回 利付国債(10年)	489,432

(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 (2022年4月1日から2023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	105,935	0	105,063

(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、日立製作所です。

■組入資産の明細 (2023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	42,825,000 (620,000)	44,172,388 (702,319)	79.8 (1.3)	— (—)	55.6 (1.3)	16.8 (—)	7.4 (—)
地 方 債 証 券	3,500,000 (3,500,000)	3,669,392 (3,669,392)	6.6 (6.6)	— (—)	3.5 (3.5)	1.1 (1.1)	2.0 (2.0)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	3,162,870 (3,162,870)	3,325,098 (3,325,098)	6.0 (6.0)	— (—)	4.1 (4.1)	1.7 (1.7)	0.2 (0.2)
金 融 債 証 券	200,000 (200,000)	198,980 (198,980)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	— (—)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	3,500,000 (3,500,000)	3,524,049 (3,524,049)	6.4 (6.4)	— (—)	2.2 (2.2)	3.6 (3.6)	0.5 (0.5)
合 計	53,187,870 (10,982,870)	54,889,908 (11,419,838)	99.2 (20.6)	— (—)	65.5 (11.1)	23.6 (6.8)	10.2 (2.7)

(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436回 利付国債(2年)	0.005	60,000	60,077	2024/ 5/ 1
第437回 利付国債(2年)	0.005	60,000	60,094	2024/ 6/ 1
第438回 利付国債(2年)	0.005	150,000	150,232	2024/ 7/ 1
第439回 利付国債(2年)	0.005	110,000	110,174	2024/ 8/ 1
第440回 利付国債(2年)	0.005	280,000	280,453	2024/ 9/ 1
第441回 利付国債(2年)	0.005	290,000	290,475	2024/10/ 1
第442回 利付国債(2年)	0.005	100,000	100,174	2024/11/ 1
第443回 利付国債(2年)	0.005	370,000	370,677	2024/12/ 1
第444回 利付国債(2年)	0.005	70,000	70,128	2025/ 1/ 1
第140回 利付国債(5年)	0.1	240,000	240,626	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	170,000	170,498	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	150,000	150,501	2024/12/20
第143回 利付国債(5年)	0.1	250,000	250,932	2025/ 3/20
第144回 利付国債(5年)	0.1	540,000	542,154	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	380,000	381,641	2025/ 9/20
第146回 利付国債(5年)	0.1	120,000	120,537	2025/12/20
第147回 利付国債(5年)	0.005	100,000	100,177	2026/ 3/20
第148回 利付国債(5年)	0.005	220,000	220,352	2026/ 6/20
第149回 利付国債(5年)	0.005	660,000	660,686	2026/ 9/20
第150回 利付国債(5年)	0.005	490,000	490,088	2026/12/20
第151回 利付国債(5年)	0.005	200,000	199,880	2027/ 3/20
第152回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,316	2027/ 3/20
第153回 利付国債(5年)	0.005	130,000	129,807	2027/ 6/20
第154回 利付国債(5年)	0.1	60,000	60,106	2027/ 9/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	109,799	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	240,000	269,318	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	66,889	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	100,000	112,548	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	265,077	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	226,936	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	194,560	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	158,091	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	130,000	158,377	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	100,000	117,572	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	80,000	92,340	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	138,172	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	169,682	2055/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	195,806	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	100,000	85,815	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	85,000	65,296	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	160,000	122,390	2060/ 3/20
第14回 利付国債(40年)	0.7	210,000	171,435	2061/ 3/20
第15回 利付国債(40年)	1.0	230,000	205,509	2062/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	180,000	181,564	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	201,760	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	200,000	202,044	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	250,000	251,695	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	363,463	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	50,532	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	121,407	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	270,000	272,678	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	230,000	231,055	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	220,000	221,025	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	490,000	492,121	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	260,000	260,964	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	450,000	451,422	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	430,000	431,083	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	310,000	310,551	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349回	利付国債(10年)	0.1	230,000	230,213	2027/12/20
第350回	利付国債(10年)	0.1	340,000	340,081	2028/ 3/20
第351回	利付国債(10年)	0.1	180,000	179,953	2028/ 6/20
第352回	利付国債(10年)	0.1	200,000	199,782	2028/ 9/20
第353回	利付国債(10年)	0.1	460,000	459,213	2028/12/20
第354回	利付国債(10年)	0.1	580,000	578,457	2029/ 3/20
第355回	利付国債(10年)	0.1	410,000	408,483	2029/ 6/20
第356回	利付国債(10年)	0.1	260,000	258,668	2029/ 9/20
第357回	利付国債(10年)	0.1	510,000	506,787	2029/12/20
第358回	利付国債(10年)	0.1	340,000	337,433	2030/ 3/20
第359回	利付国債(10年)	0.1	420,000	416,123	2030/ 6/20
第360回	利付国債(10年)	0.1	250,000	247,250	2030/ 9/20
第361回	利付国債(10年)	0.1	200,000	197,280	2030/12/20
第362回	利付国債(10年)	0.1	270,000	265,696	2031/ 3/20
第363回	利付国債(10年)	0.1	280,000	274,957	2031/ 6/20
第364回	利付国債(10年)	0.1	120,000	117,726	2031/ 9/20
第365回	利付国債(10年)	0.1	350,000	343,178	2031/12/20
第366回	利付国債(10年)	0.2	230,000	227,792	2032/ 3/20
第367回	利付国債(10年)	0.2	230,000	229,066	2032/ 6/20
第368回	利付国債(10年)	0.2	10,000	10,037	2032/ 9/20
第369回	利付国債(10年)	0.5	410,000	416,949	2032/12/20
第 1回	利付国債(30年)	2.8	40,000	46,728	2029/ 9/20
第 5回	利付国債(30年)	2.2	5,000	5,758	2031/ 5/20
第 6回	利付国債(30年)	2.4	70,000	82,300	2031/11/20
第 8回	利付国債(30年)	1.8	45,000	50,940	2032/11/22
第11回	利付国債(30年)	1.7	135,000	151,699	2033/ 6/20
第12回	利付国債(30年)	2.1	90,000	104,841	2033/ 9/20
第13回	利付国債(30年)	2.0	70,000	80,925	2033/12/20
第14回	利付国債(30年)	2.4	120,000	143,992	2034/ 3/20
第17回	利付国債(30年)	2.4	160,000	193,001	2034/12/20
第18回	利付国債(30年)	2.3	155,000	185,442	2035/ 3/20
第19回	利付国債(30年)	2.3	110,000	131,880	2035/ 6/20
第20回	利付国債(30年)	2.5	50,000	61,231	2035/ 9/20
第21回	利付国債(30年)	2.3	100,000	120,296	2035/12/20
第24回	利付国債(30年)	2.5	120,000	147,945	2036/ 9/20
第25回	利付国債(30年)	2.3	260,000	314,020	2036/12/20
第26回	利付国債(30年)	2.4	180,000	220,037	2037/ 3/20
第27回	利付国債(30年)	2.5	70,000	86,721	2037/ 9/20
第28回	利付国債(30年)	2.5	300,000	372,123	2038/ 3/20
第29回	利付国債(30年)	2.4	290,000	356,804	2038/ 9/20
第30回	利付国債(30年)	2.3	230,000	279,820	2039/ 3/20
第31回	利付国債(30年)	2.2	220,000	264,426	2039/ 9/20
第32回	利付国債(30年)	2.3	215,000	261,990	2040/ 3/20
第33回	利付国債(30年)	2.0	70,000	81,930	2040/ 9/20
第34回	利付国債(30年)	2.2	220,000	264,629	2041/ 3/20
第35回	利付国債(30年)	2.0	30,000	35,141	2041/ 9/20
第36回	利付国債(30年)	2.0	170,000	199,319	2042/ 3/20
第37回	利付国債(30年)	1.9	70,000	80,857	2042/ 9/20
第38回	利付国債(30年)	1.8	180,000	204,642	2043/ 3/20
第39回	利付国債(30年)	1.9	110,000	126,966	2043/ 6/20
第40回	利付国債(30年)	1.8	150,000	170,386	2043/ 9/20
第41回	利付国債(30年)	1.7	20,000	22,344	2043/12/20
第42回	利付国債(30年)	1.7	20,000	22,329	2044/ 3/20
第43回	利付国債(30年)	1.7	30,000	33,499	2044/ 6/20
第44回	利付国債(30年)	1.7	130,000	145,182	2044/ 9/20
第45回	利付国債(30年)	1.5	250,000	269,415	2044/12/20
第46回	利付国債(30年)	1.5	320,000	344,774	2045/ 3/20
第47回	利付国債(30年)	1.6	140,000	153,454	2045/ 6/20
第48回	利付国債(30年)	1.4	200,000	211,188	2045/ 9/20
第49回	利付国債(30年)	1.4	220,000	232,205	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	20,000	18,677	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	199,334	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	225,846	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	230,000	203,957	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	296,454	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	138,612	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	100,000	92,173	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	239,036	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	30,000	27,483	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	222,997	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	149,182	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	186,074	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	176,192	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	211,559	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	186,484	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	20,000	16,190	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	10,000	8,050	2050/ 3/20
第 67回 利付国債(30年)	0.6	140,000	118,748	2050/ 6/20
第 68回 利付国債(30年)	0.6	140,000	118,486	2050/ 9/20
第 69回 利付国債(30年)	0.7	100,000	86,802	2050/12/20
第 70回 利付国債(30年)	0.7	30,000	25,988	2051/ 3/20
第 71回 利付国債(30年)	0.7	30,000	25,962	2051/ 6/20
第 72回 利付国債(30年)	0.7	130,000	112,507	2051/ 9/20
第 73回 利付国債(30年)	0.7	200,000	172,740	2051/12/20
第 74回 利付国債(30年)	1.0	190,000	177,632	2052/ 3/20
第 75回 利付国債(30年)	1.3	180,000	181,150	2052/ 6/20
第 76回 利付国債(30年)	1.4	170,000	175,491	2052/ 9/20
第 77回 利付国債(30年)	1.6	100,000	108,051	2052/12/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	154,584	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	102,813	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	90,000	92,906	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	114,733	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	140,000	145,474	2025/ 3/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	104,612	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	188,701	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	189,225	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	60,000	63,223	2025/ 9/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	140,000	147,862	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	212,784	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	120,000	128,026	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	268,910	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	214,484	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	290,835	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	64,838	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	150,921	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	215,674	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	90,000	97,409	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	97,798	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	210,000	230,015	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	20,000	21,817	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	70,000	76,659	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	100,000	110,422	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	201,472	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	50,000	55,705	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	210,483	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	120,000	133,588	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	189,051	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	200,000	220,144	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	90,000	99,394	2029/ 3/20
第110回 利付国債(20年)	2.1	150,000	167,431	2029/ 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112回	利付国債(20年)	2.1	320,000	358,412	2029/ 6/20
第113回	利付国債(20年)	2.1	210,000	235,920	2029/ 9/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	120,000	136,036	2029/12/20
第116回	利付国債(20年)	2.2	100,000	113,732	2030/ 3/20
第117回	利付国債(20年)	2.1	220,000	248,699	2030/ 3/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	10,000	11,263	2030/ 6/20
第119回	利付国債(20年)	1.8	100,000	111,219	2030/ 6/20
第123回	利付国債(20年)	2.1	70,000	79,711	2030/12/20
第124回	利付国債(20年)	2.0	120,000	135,740	2030/12/20
第125回	利付国債(20年)	2.2	80,000	91,926	2031/ 3/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	120,000	136,021	2031/ 3/20
第127回	利付国債(20年)	1.9	80,000	90,057	2031/ 3/20
第128回	利付国債(20年)	1.9	100,000	112,780	2031/ 6/20
第129回	利付国債(20年)	1.8	100,000	111,979	2031/ 6/20
第130回	利付国債(20年)	1.8	150,000	168,436	2031/ 9/20
第131回	利付国債(20年)	1.7	150,000	167,199	2031/ 9/20
第132回	利付国債(20年)	1.7	200,000	223,400	2031/12/20
第134回	利付国債(20年)	1.8	20,000	22,559	2032/ 3/20
第135回	利付国債(20年)	1.7	130,000	145,501	2032/ 3/20
第136回	利付国債(20年)	1.6	180,000	199,897	2032/ 3/20
第138回	利付国債(20年)	1.5	100,000	110,363	2032/ 6/20
第139回	利付国債(20年)	1.6	90,000	100,130	2032/ 6/20
第140回	利付国債(20年)	1.7	290,000	325,420	2032/ 9/20
第141回	利付国債(20年)	1.7	150,000	168,313	2032/12/20
第142回	利付国債(20年)	1.8	40,000	45,258	2032/12/20
第143回	利付国債(20年)	1.6	230,000	255,948	2033/ 3/20
第144回	利付国債(20年)	1.5	50,000	55,163	2033/ 3/20
第145回	利付国債(20年)	1.7	350,000	393,295	2033/ 6/20
第146回	利付国債(20年)	1.7	330,000	371,042	2033/ 9/20
第147回	利付国債(20年)	1.6	240,000	267,528	2033/12/20
第149回	利付国債(20年)	1.5	380,000	419,679	2034/ 6/20
第150回	利付国債(20年)	1.4	170,000	185,884	2034/ 9/20
第151回	利付国債(20年)	1.2	200,000	214,072	2034/12/20
第152回	利付国債(20年)	1.2	455,000	486,822	2035/ 3/20
第153回	利付国債(20年)	1.3	270,000	292,005	2035/ 6/20
第154回	利付国債(20年)	1.2	80,000	85,516	2035/ 9/20
第155回	利付国債(20年)	1.0	110,000	114,858	2035/12/20
第157回	利付国債(20年)	0.2	240,000	225,758	2036/ 6/20
第158回	利付国債(20年)	0.5	120,000	117,117	2036/ 9/20
第159回	利付国債(20年)	0.6	120,000	118,350	2036/12/20
第160回	利付国債(20年)	0.7	270,000	269,314	2037/ 3/20
第161回	利付国債(20年)	0.6	210,000	206,217	2037/ 6/20
第162回	利付国債(20年)	0.6	80,000	78,331	2037/ 9/20
第163回	利付国債(20年)	0.6	90,000	87,919	2037/12/20
第164回	利付国債(20年)	0.5	200,000	191,982	2038/ 3/20
第165回	利付国債(20年)	0.5	40,000	38,294	2038/ 6/20
第166回	利付国債(20年)	0.7	60,000	59,011	2038/ 9/20
第167回	利付国債(20年)	0.5	320,000	304,470	2038/12/20
第168回	利付国債(20年)	0.4	220,000	205,363	2039/ 3/20
第169回	利付国債(20年)	0.3	280,000	256,228	2039/ 6/20
第170回	利付国債(20年)	0.3	250,000	227,835	2039/ 9/20
第172回	利付国債(20年)	0.4	10,000	9,203	2040/ 3/20
第173回	利付国債(20年)	0.4	230,000	210,815	2040/ 6/20
第174回	利付国債(20年)	0.4	170,000	155,295	2040/ 9/20
第175回	利付国債(20年)	0.5	280,000	259,319	2040/12/20
第176回	利付国債(20年)	0.5	10,000	9,231	2041/ 3/20
第177回	利付国債(20年)	0.4	150,000	135,610	2041/ 6/20
第178回	利付国債(20年)	0.5	230,000	211,250	2041/ 9/20
第179回	利付国債(20年)	0.5	30,000	27,505	2041/12/20
第180回	利付国債(20年)	0.8	280,000	270,426	2042/ 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181回 利付国債(20年)	0.9	60,000	58,890	2042/ 6/20
第182回 利付国債(20年)	1.1	110,000	111,610	2042/ 9/20
第183回 利付国債(20年)	1.4	80,000	85,269	2042/12/20
小 計	—	42,825,000	44,172,388	—
(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	119,433	2039/ 9/20
第 31回 東京都公募公債(20年)	1.238	100,000	105,150	2034/ 9/20
第741回 東京都公募公債	0.435	100,000	100,766	2025/ 3/19
平成26年度第 15回 北海道公募公債	0.434	100,000	100,731	2025/ 2/27
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	101,046	2025/10/30
第 20回 神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	109,552	2032/ 6/18
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	100,763	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	111,045	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	100,767	2024/10/30
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	99,841	2027/10/29
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	112,089	2029/11/19
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	104,452	2028/11/20
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	101,051	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	108,400	2034/ 5/15
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	110,839	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	100,779	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	100,758	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	109,909	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	108,365	2034/ 5/26
第 5回 千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	110,800	2028/ 9/21
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	95,784	2038/ 8/20
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	100,777	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	100,775	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,787	2026/10/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	98,067	2030/ 6/25
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	105,096	2025/ 9/19
第 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	110,139	2033/ 1/28
第 4回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	110,847	2028/ 6/20
平成23年度第 4回 福岡市公募公債(20年)	1.89	100,000	110,883	2031/ 8/19
平成25年度第 1回 福岡市公募公債(20年)	1.808	100,000	110,568	2033/ 7/19
平成26年度第 2回 福岡市公募公債(20年)	1.49	100,000	107,816	2034/ 6/20
平成26年度第 2回 千葉市公募公債	0.505	300,000	302,340	2024/11/27
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	99,977	2027/ 9/17
小 計	—	3,500,000	3,669,392	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	122,180	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	111,876	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	100,714	2024/ 6/20
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	110,363	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	105,053	2035/ 2/28
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	112,268	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	112,290	2031/ 1/28
第 23回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	217,998	2027/ 9/24
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	109,933	2028/ 4/25
第 76回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	100,980	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	99,802	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	98,691	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	103,561	2027/10/29
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	122,170	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	108,543	2034/ 4/28
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	100,933	2025/11/28
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	99,589	2028/ 7/31
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	107,263	2026/ 3/20
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	9,665	9,670	2023/ 4/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	110,168	2028/ 3/17

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 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	11,095	11,272	2043/ 8/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	28,692	29,965	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	16,294	17,141	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	15,250	15,919	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	20,536	21,562	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	19,045	19,892	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	19,813	20,669	2045/ 6/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	10,617	10,788	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	19,007	19,721	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	110,878	2030/ 7/16
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	41,826	42,551	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	42,884	43,454	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	48,223	48,080	2050/ 2/10
第 99回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.584	100,000	105,385	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	71,180	69,643	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	72,047	70,641	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	71,656	70,337	2052/ 3/10
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	78,780	76,369	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	80,780	77,905	2054/ 5/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	86,946	83,335	2055/ 3/10
第185回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.58	98,534	95,668	2057/10/10
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	99,870	2026/12/18
小 計	—	3,162,870	3,325,098	—
(金融債券)	%	千円	千円	
い第853号 商工債	0.09	100,000	99,565	2026/ 6/26
い第857号 商工債	0.09	100,000	99,415	2026/10/27
小 計	—	200,000	198,980	—
(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	98,917	2028/ 9/20
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,038	2024/10/25
第321回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.365	100,000	99,581	2027/ 4/23
第451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	99,675	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	111,740	2030/12/13
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	99,905	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	0.08	100,000	99,445	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	0.13	100,000	99,943	2025/ 9/12
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	99,340	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	0.08	100,000	99,505	2026/ 3/13
第 41回 株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債(社債	0.33	100,000	95,135	2031/ 6/ 3
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	99,893	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	98,978	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	0.09	100,000	99,407	2026/ 9/15
第 17回 株式会社日立製作所無担保社債(社債間限定同順位特約付	1.371	100,000	105,063	2028/12/13
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	100,000	99,322	2026/ 9/ 1
第 26回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付	0.05	100,000	99,540	2026/ 3/18
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	109,321	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	100,183	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	100,000	99,697	2025/ 7/15
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	0.09	100,000	99,414	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	97,205	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	97,494	2030/ 4/16
第 91回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順	1.751	100,000	108,526	2032/12/27
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	98,929	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	108,521	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	107,360	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	99,251	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	99,100	2027/12/15
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	99,810	2026/ 7/14
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	95,620	2031/ 1/20
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	99,902	2025/ 7/16

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 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	198,030	2026/ 4/22
クレディ・アグリコル・エス・エー第6回 円貨社債	0.865	100,000	100,259	2024/11/28
小 計	—	3,500,000	3,524,049	—
合 計	—	53,187,870	54,889,908	—

(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 (2023年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 54,889,908	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	602,197	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	55,492,105	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

2023年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	55,492,105,983円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	411,224,972
公 社 債(評価額)	54,889,908,433
未 収 入 金	120,188,400
未 収 利 息	69,588,334
前 払 費 用	1,195,844
(B) 負 債	171,761,705
未 払 金	152,760,500
未 払 解 約 金	19,000,000
未 払 利 息	1,205
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	55,320,344,278
元 本	40,417,051,526
次 期 繰 越 損 益 金	14,903,292,752
(D) 受 益 権 総 口 数	40,417,051,526口
1万口当たり基準価額 (C / D)	13,687円

(注1) 当ファンドの期首元本額は58,133,569,260円、期中追加設定元本額は2,758,057,884円、期中一部解約元本額は20,474,575,618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) 14,759,313,605円
日立国内債券インデックスファンド 9,676,910,215円
日立バランスファンド(株式50) 7,453,613,220円
日立バランスファンド(株式70) 4,623,096,811円
日立バランスファンド(株式30) 3,904,117,675円

(注3) 1口当たり純資産額は1,3687円です。

■損益の状況

当期(自2022年4月1日 至2023年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	663,277,479円
受 取 利 息	663,912,440
支 払 利 息	△634,961
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,512,441,818
売 買 益	46,453,181
売 買 損	△2,558,894,999
(C) 信 託 報 酬 等	△3,800
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△1,849,168,139
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	22,785,199,305
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,032,848,471
(G) 解 約 差 損 益 金	△7,065,586,885
(H) 計 (D + E + F + G)	14,903,292,752
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	14,903,292,752

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

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

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

(注4) 損益の状況の中で (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。