



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23期

(決算日 2024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23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) 5539-2578

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
	円	騰落率		騰落率			
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
23期(2024年5月15日)	12,004	△4.2	359.86	△4.1	99.3	—	12,014

(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
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2023年 5月15日	12,530	—	375.21	—	99.0	—
5月末	12,534	0.0	375.27	0.0	99.1	—
6月末	12,564	0.3	376.29	0.3	99.1	—
7月末	12,368	△1.3	370.43	△1.3	99.2	—
8月末	12,278	△2.0	367.76	△2.0	99.2	—
9月末	12,190	△2.7	365.13	△2.7	99.0	—
10月末	11,994	△4.3	359.31	△4.2	99.1	—
11月末	12,246	△2.3	366.88	△2.2	99.1	—
12月末	12,295	△1.9	368.38	△1.8	99.1	—
2024年 1月末	12,205	△2.6	365.75	△2.5	98.9	—
2月末	12,242	△2.3	366.90	△2.2	99.1	—
3月末	12,227	△2.4	366.50	△2.3	99.3	—
4月末	12,087	△3.5	362.35	△3.4	99.3	—
(期末) 2024年 5月15日	12,004	△4.2	359.86	△4.1	99.3	—

(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＞

23年末にかけて、海外に連動して金利低下したことやクレジットスプレッドの縮小がプラスに影響しました。

＜下落要因＞

日銀がイールドカーブ・コントロール政策やマイナス金利政策を撤廃し、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	2023年5月15日	2023年6月26日	2023年11月1日	2024年5月15日
基準価額	12,530円	12,615円	11,986円	12,004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12,530円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、12,004円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲4.2%となり、ベンチマーク騰落率▲4.1%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。日銀は7月と10月の金融政策決定会合において、イールドカーブ・コントロール運用の柔軟化を決定したことで、10月末にかけて長期金利は一時0.9%台半ばまで上昇しました。11月以降は、FRBの将来的な利下げが意識される中、米国債券利回りの低下に連動する形で金利低下しましたが、1月以降は日銀による利上げ期待が高まる中、再び金利上昇基調となりました。3月の金融政策決定会合において、日銀は物価安定の目標が持続的・安定的に実現していくことが見通せる状況に至ったと判断し、マイナス金利政策やイールドカーブ・コントロール政策を撤廃しました。

年限別にみると、超長期金利の上昇幅が大きく、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、グローバルにリスク資産が堅調推移する中で、本邦社債スプレッドについても円建外債や事業債を中心にクレジットスプレッドの縮小がみられました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで▲4.1%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

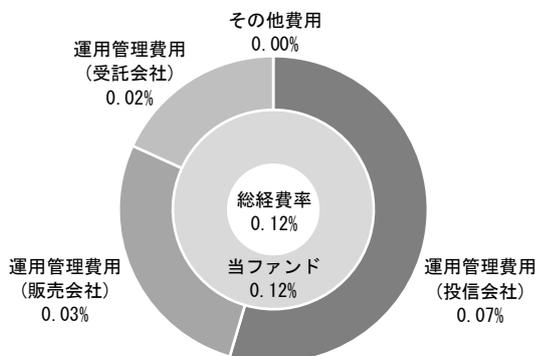
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2023.5.16~2024.5.15)		
	金 額	比 率	
(a)信 託 報 酬	15円	0.121%	信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,269円です。 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
（投 信 会 社）	（ 8）	（0.066）	
（販 売 会 社）	（ 4）	（0.033）	
（受 託 会 社）	（ 3）	（0.022）	
(b)そ の 他 費 用	0	0.000	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕
（そ の 他）	（ 0）	（0.000）	
合 計	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(2023年5月16日から2024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 560,687	千円 754,700	千口 1,125,273	千円 1,511,500

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2023年5月16日から2024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459回 利付国債(2年)	559,270	第144回 利付国債(5年)	520,033
第153回 利付国債(5年)	528,870	第451回 利付国債(2年)	429,509
第453回 利付国債(2年)	498,845	第443回 利付国債(2年)	370,144
第361回 利付国債(10年)	490,482	第338回 利付国債(10年)	361,402
第158回 利付国債(5年)	456,923	平成26年度第2回千葉県公募公債	301,488
第452回 利付国債(2年)	449,306	第441回 利付国債(2年)	290,206
第372回 利付国債(10年)	434,830	第440回 利付国債(2年)	280,237
第451回 利付国債(2年)	430,009	第337回 利付国債(10年)	250,845
第373回 利付国債(10年)	405,365	第143回 利付国債(5年)	250,277
第364回 利付国債(10年)	393,427	第335回 利付国債(10年)	201,180

(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(2023年5月16日から2024年5月15日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	千円 0	千円 0	千円 102,477

(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(2024年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日立国内債券インデックスマザーファンド	千口 9,691,480	千口 9,126,894	千円 12,000,953

(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(2024年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日立国内債券インデックスマザーファンド	千円 12,000,953	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	49,660	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	12,050,613	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

2024年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	12,050,613,154円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	35,059,169
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	12,000,953,976
未 収 入 金	14,600,000
未 収 利 息	9
(B) 負 債	36,583,797
未 払 解 約 金	29,097,509
未 払 信 託 報 酬	7,486,288
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	12,014,029,357
元 本	10,008,540,503
次 期 繰 越 損 益 金	2,005,488,854
(D) 受 益 権 総 口 数	10,008,540,503口
1万口当たり基準価額 (C / D)	12,004円

(注1) 当ファンドの期首元本額は10,615,046,141円、期中追加設定元本額は1,896,092,466円、期中一部解約元本額は2,502,598,104円です。
 (注2) 1口当たり純資産額は1,2004円です。

■損益の状況

当期(自2023年5月16日 至2024年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△18,297円
受 取 利 息	236
支 払 利 息	△18,533
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△472,110,786
売 買 益	51,424,311
売 買 損	△523,535,097
(C) 信 託 報 酬 等	△15,335,286
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△487,464,369
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△81,821,829
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,574,775,052
(配 当 等 相 当 額)	(2,533,684,422)
(売 買 損 益 相 当 額)	(41,090,630)
(G) 計 (D + E + F)	2,005,488,854
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,005,488,854
追 加 信 託 差 損 益 金	2,574,775,052
(配 当 等 相 当 額)	(2,533,684,422)
(売 買 損 益 相 当 額)	(41,090,630)
分 配 準 備 積 立 金	236,691,864
繰 越 損 益 金	△805,978,062

(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(2,533,684,422円)および分配準備積立金(236,691,864円)より分配対象収益は2,770,376,286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(2024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(45,618,504千口)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	2024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	50,155,000 (720,000)	48,438,365 (774,442)	80.7 (1.3)	— (—)	54.0 (1.1)	19.0 (0.2)	7.8 (—)
地 方 債 証 券	3,200,000 (3,200,000)	3,292,576 (3,292,576)	5.5 (5.5)	— (—)	3.3 (3.3)	1.7 (1.7)	0.5 (0.5)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	3,557,916 (3,557,916)	3,605,798 (3,605,798)	6.0 (6.0)	— (—)	3.3 (3.3)	2.0 (2.0)	0.7 (0.7)
金 融 債 券	300,000 (300,000)	291,742 (291,742)	0.5 (0.5)	— (—)	0.2 (0.2)	0.3 (0.3)	— (—)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	4,000,000 (4,000,000)	3,972,448 (3,972,448)	6.6 (6.6)	— (—)	2.1 (2.1)	3.0 (3.0)	1.5 (1.5)
合 計	61,212,916 (11,777,916)	59,600,930 (11,937,007)	99.4 (19.9)	— (—)	62.9 (10.0)	26.1 (7.2)	10.4 (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450回 利付国債(2年)	0.005	200,000	199,616	2025/ 7/ 1
第452回 利付国債(2年)	0.005	450,000	448,807	2025/ 9/ 1
第453回 利付国債(2年)	0.005	500,000	498,485	2025/10/ 1
第454回 利付国債(2年)	0.1	230,000	229,512	2025/11/ 1
第455回 利付国債(2年)	0.005	250,000	248,997	2025/12/ 1
第456回 利付国債(2年)	0.1	150,000	149,560	2026/ 1/ 1
第458回 利付国債(2年)	0.2	30,000	29,943	2026/ 3/ 1
第459回 利付国債(2年)	0.2	560,000	558,745	2026/ 4/ 1
第144回 利付国債(5年)	0.1	20,000	19,980	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	380,000	379,437	2025/ 9/20
第146回 利付国債(5年)	0.1	120,000	119,684	2025/12/20
第147回 利付国債(5年)	0.005	100,000	99,440	2026/ 3/20
第148回 利付国債(5年)	0.005	220,000	218,420	2026/ 6/20
第149回 利付国債(5年)	0.005	660,000	654,541	2026/ 9/20
第150回 利付国債(5年)	0.005	490,000	485,398	2026/12/20
第151回 利付国債(5年)	0.005	270,000	267,113	2027/ 3/20
第152回 利付国債(5年)	0.1	100,000	99,198	2027/ 3/20
第153回 利付国債(5年)	0.005	530,000	523,597	2027/ 6/20
第154回 利付国債(5年)	0.1	370,000	366,148	2027/ 9/20
第155回 利付国債(5年)	0.3	100,000	99,539	2027/12/20
第156回 利付国債(5年)	0.2	230,000	228,125	2027/12/20
第157回 利付国債(5年)	0.2	210,000	207,975	2028/ 3/20
第158回 利付国債(5年)	0.1	460,000	453,826	2028/ 3/20
第159回 利付国債(5年)	0.1	50,000	49,246	2028/ 6/20
第160回 利付国債(5年)	0.2	210,000	207,679	2028/ 6/20
第161回 利付国債(5年)	0.3	40,000	39,718	2028/ 6/20
第163回 利付国債(5年)	0.4	100,000	99,553	2028/ 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164回 利付国債(5年)	0.2	140,000	137,925	2028/12/20
第167回 利付国債(5年)	0.4	30,000	29,787	2029/ 3/20
第 1回 クライメート・トランジション利付国債(5年)	0.3	50,000	49,494	2028/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	106,036	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	140,000	151,221	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	64,441	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	100,000	107,857	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	252,564	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	198,181	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	169,531	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	137,234	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	130,000	136,810	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	100,000	100,629	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	80,000	78,321	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	116,467	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	141,655	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	60,000	37,134	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	159,977	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	100,000	69,471	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	125,000	76,451	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	200,000	120,400	2060/ 3/20
第14回 利付国債(40年)	0.7	210,000	134,790	2061/ 3/20
第15回 利付国債(40年)	1.0	240,000	169,663	2062/ 3/20
第16回 利付国債(40年)	1.3	360,000	278,431	2063/ 3/20
第 1回 クライメート・トランジション利付国債(10年)	0.7	100,000	98,103	2033/12/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	50,114	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	120,306	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	270,000	270,148	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	230,000	229,112	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	220,000	218,853	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	490,000	487,030	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	260,000	258,193	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	450,000	446,391	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	430,000	426,052	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	310,000	306,772	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	230,000	227,309	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	340,000	335,437	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	180,000	177,287	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	200,000	196,552	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	360,000	353,052	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	460,000	450,335	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	410,000	400,852	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	330,000	322,116	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	390,000	380,055	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	390,000	379,310	2030/ 3/20
第359回 利付国債(10年)	0.1	520,000	504,706	2030/ 6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1	650,000	629,356	2030/ 9/20
第361回 利付国債(10年)	0.1	700,000	675,857	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1	550,000	529,485	2031/ 3/20
第363回 利付国債(10年)	0.1	500,000	479,880	2031/ 6/20
第364回 利付国債(10年)	0.1	530,000	506,886	2031/ 9/20
第365回 利付国債(10年)	0.1	350,000	333,644	2031/12/20
第366回 利付国債(10年)	0.2	230,000	220,300	2032/ 3/20
第367回 利付国債(10年)	0.2	230,000	219,590	2032/ 6/20
第368回 利付国債(10年)	0.2	440,000	418,682	2032/ 9/20
第369回 利付国債(10年)	0.5	410,000	399,139	2032/12/20
第370回 利付国債(10年)	0.5	400,000	388,324	2033/ 3/20
第371回 利付国債(10年)	0.4	390,000	374,232	2033/ 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372回 利付国債(10年)	0.8	430,000	426,474	2033/ 9/20
第373回 利付国債(10年)	0.6	390,000	378,658	2033/12/20
第374回 利付国債(10年)	0.8	200,000	197,298	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	44,722	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	5,519	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	78,523	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	48,647	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	144,871	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	99,741	2033/ 9/20
第13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	76,937	2033/12/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	136,399	2034/ 3/20
第16回 利付国債(30年)	2.5	50,000	57,382	2034/ 9/20
第17回 利付国債(30年)	2.4	160,000	182,160	2034/12/20
第18回 利付国債(30年)	2.3	155,000	174,883	2035/ 3/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	124,219	2035/ 6/20
第20回 利付国債(30年)	2.5	50,000	57,555	2035/ 9/20
第21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	112,981	2035/12/20
第24回 利付国債(30年)	2.5	50,000	57,641	2036/ 9/20
第25回 利付国債(30年)	2.3	220,000	248,520	2036/12/20
第26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	205,293	2037/ 3/20
第27回 利付国債(30年)	2.5	70,000	80,654	2037/ 9/20
第28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	345,477	2038/ 3/20
第29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	329,770	2038/ 9/20
第30回 利付国債(30年)	2.3	230,000	258,135	2039/ 3/20
第31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	243,155	2039/ 9/20
第32回 利付国債(30年)	2.3	215,000	240,090	2040/ 3/20
第33回 利付国債(30年)	2.0	70,000	74,939	2040/ 9/20
第34回 利付国債(30年)	2.2	220,000	241,192	2041/ 3/20
第35回 利付国債(30年)	2.0	30,000	31,889	2041/ 9/20
第36回 利付国債(30年)	2.0	170,000	180,188	2042/ 3/20
第37回 利付国債(30年)	1.9	70,000	72,823	2042/ 9/20
第38回 利付国債(30年)	1.8	180,000	183,747	2043/ 3/20
第39回 利付国債(30年)	1.9	110,000	113,744	2043/ 6/20
第40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	152,404	2043/ 9/20
第41回 利付国債(30年)	1.7	20,000	19,941	2043/12/20
第42回 利付国債(30年)	1.7	20,000	19,881	2044/ 3/20
第43回 利付国債(30年)	1.7	30,000	29,776	2044/ 6/20
第44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	128,831	2044/ 9/20
第45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	238,730	2044/12/20
第46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	304,985	2045/ 3/20
第47回 利付国債(30年)	1.6	140,000	135,613	2045/ 6/20
第48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	186,368	2045/ 9/20
第49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	204,564	2045/12/20
第50回 利付国債(30年)	0.8	20,000	16,388	2046/ 3/20
第51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	174,141	2046/ 6/20
第52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	197,176	2046/ 9/20
第53回 利付国債(30年)	0.6	230,000	177,808	2046/12/20
第54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	258,166	2047/ 3/20
第55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	120,609	2047/ 6/20
第56回 利付国債(30年)	0.8	100,000	80,135	2047/ 9/20
第57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	207,485	2047/12/20
第58回 利付国債(30年)	0.8	30,000	23,841	2048/ 3/20
第59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	193,227	2048/ 6/20
第60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	129,379	2048/ 9/20
第61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	161,009	2048/12/20
第62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	152,040	2049/ 3/20
第63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	182,265	2049/ 6/20
第64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	160,408	2049/ 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 65回 利付国債(30年)	0.4	20,000	13,888	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	10,000	6,909	2050/ 3/20
第 67回 利付国債(30年)	0.6	140,000	101,935	2050/ 6/20
第 68回 利付国債(30年)	0.6	140,000	101,536	2050/ 9/20
第 69回 利付国債(30年)	0.7	100,000	74,270	2050/12/20
第 70回 利付国債(30年)	0.7	30,000	22,199	2051/ 3/20
第 71回 利付国債(30年)	0.7	30,000	22,116	2051/ 6/20
第 72回 利付国債(30年)	0.7	130,000	95,481	2051/ 9/20
第 73回 利付国債(30年)	0.7	200,000	146,348	2051/12/20
第 74回 利付国債(30年)	1.0	190,000	150,630	2052/ 3/20
第 75回 利付国債(30年)	1.3	180,000	153,874	2052/ 6/20
第 76回 利付国債(30年)	1.4	170,000	148,588	2052/ 9/20
第 77回 利付国債(30年)	1.6	150,000	137,335	2052/12/20
第 78回 利付国債(30年)	1.4	220,000	191,474	2053/ 3/20
第 79回 利付国債(30年)	1.2	230,000	190,039	2053/ 6/20
第 80回 利付国債(30年)	1.8	220,000	210,306	2053/ 9/20
第 81回 利付国債(30年)	1.6	170,000	154,766	2053/12/20
第 82回 利付国債(30年)	1.8	130,000	123,982	2054/ 3/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	101,979	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	183,758	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	184,330	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	60,000	61,524	2025/ 9/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	140,000	143,862	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	206,582	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	120,000	124,168	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	260,170	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	207,718	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	281,599	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	62,717	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	146,248	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	209,144	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	90,000	94,367	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	94,707	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	210,000	222,450	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	220,000	232,315	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	70,000	74,167	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	100,000	106,652	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	194,038	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	50,000	53,698	2028/ 6/20
第104回 利付国債(20年)	2.1	20,000	21,318	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	203,022	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	120,000	128,734	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	182,141	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	160,000	169,988	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	90,000	95,799	2029/ 3/20
第110回 利付国債(20年)	2.1	150,000	161,083	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	320,000	345,011	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	227,085	2029/ 9/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	130,786	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	109,311	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	220,000	239,239	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	10,000	10,842	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	107,246	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	70,000	76,614	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	120,000	130,578	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	80,000	88,240	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	120,000	130,742	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	80,000	86,636	2031/ 3/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第128回 利付国債(20年)	1.9	100,000	108,405	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	107,727	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	150,000	161,643	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	160,594	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	80,000	85,708	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	20,000	21,587	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	130,000	139,354	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	80,000	85,132	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	105,684	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	95,801	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	220,000	235,954	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	150,000	160,987	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	40,000	43,252	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	130,000	138,360	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	50,000	52,781	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	220,000	236,086	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	330,000	353,981	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	240,000	254,952	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	280,000	294,322	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	170,000	176,789	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	200,000	203,636	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	355,000	360,708	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	270,000	276,706	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	80,000	81,011	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	110,000	108,755	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	200,000	183,980	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	240,000	214,420	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	120,000	110,786	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	120,000	111,753	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	270,000	253,565	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	210,000	193,874	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	130,000	119,512	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	90,000	82,386	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	200,000	179,750	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	190,000	169,867	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	170,000	155,687	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	283,376	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	280,000	243,048	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	237,910	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	211,122	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	250,000	209,955	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	230,000	195,237	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	300,000	253,272	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	320,000	268,672	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	280,000	237,890	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5	10,000	8,450	2041/ 3/20
第177回 利付国債(20年)	0.4	150,000	123,841	2041/ 6/20
第178回 利付国債(20年)	0.5	230,000	192,378	2041/ 9/20
第179回 利付国債(20年)	0.5	30,000	24,971	2041/12/20
第180回 利付国債(20年)	0.8	280,000	244,826	2042/ 3/20
第181回 利付国債(20年)	0.9	60,000	53,173	2042/ 6/20
第182回 利付国債(20年)	1.1	110,000	100,557	2042/ 9/20
第183回 利付国債(20年)	1.4	110,000	105,485	2042/12/20
第184回 利付国債(20年)	1.1	170,000	154,339	2043/ 3/20
第185回 利付国債(20年)	1.1	190,000	171,830	2043/ 6/20
第186回 利付国債(20年)	1.5	180,000	173,997	2043/ 9/20
第187回 利付国債(20年)	1.3	190,000	176,876	2043/12/20
第188回 利付国債(20年)	1.6	180,000	175,892	2044/ 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16回 ポーランド共和国円貨債券(2023)	0.93	100,000	99,786	2026/11/20
小計	—	50,155,000	48,438,365	—
(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	110,417	2039/9/20
第31回 東京都公募公債(20年)	1.238	100,000	101,286	2034/9/20
平成27年度第9回 北海道公募公債	0.486	100,000	100,215	2025/10/30
令和5年度第9回 北海道公募公債(5年)	0.507	100,000	99,522	2028/11/30
第20回 神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	106,441	2032/6/18
第6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	107,792	2030/9/13
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	98,918	2027/10/29
第9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	108,604	2029/11/19
第2回 静岡県公募公債(グリーンボンド・5年)	0.324	100,000	99,034	2028/6/20
第5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	102,119	2028/11/20
第9回 静岡県公募公債(15年)	0.739	100,000	100,176	2030/9/20
平成27年度第8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	100,229	2025/9/19
平成21年度第16回 愛知県公募公債(20年)	2.218	100,000	108,530	2029/12/20
平成26年度第4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	104,492	2034/5/15
第10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	107,637	2030/11/12
平成20年度第2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	106,490	2028/12/20
平成26年度第1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	104,457	2034/5/26
令和元年度第2回 福岡県公募公債(15年)	0.269	100,000	91,525	2034/12/13
第5回 千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	107,133	2028/9/21
平成30年度第1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	89,677	2038/8/20
第3回 群馬県公募公債(20年)	1.687	100,000	106,271	2032/6/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,046	2026/10/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	96,805	2030/6/25
第2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	102,429	2025/9/19
第13回 京都市公募公債(20年)	1.359	100,000	102,302	2034/11/24
令和4年度第3回 神戸市公募公債(5年)	0.2	100,000	98,904	2027/11/19
第26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	107,069	2033/1/28
第4回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	107,171	2028/6/20
平成23年度第4回 福岡市公募公債(20年)	1.89	100,000	107,661	2031/8/19
平成25年度第1回 福岡市公募公債(20年)	1.808	100,000	107,328	2033/7/19
平成26年度第2回 福岡市公募公債(20年)	1.49	100,000	103,915	2034/6/20
平成29年度第1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	98,981	2027/9/17
小計	—	3,200,000	3,292,576	—
(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	116,491	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	108,412	2030/2/8
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	98,228	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	100,390	2035/2/28
第6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	108,722	2030/3/28
第13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	108,720	2031/1/28
第23回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	211,522	2027/9/24
第24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	106,574	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	100,197	2025/9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	98,481	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	97,301	2029/4/13
F197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	101,674	2027/10/29
第53回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	100,000	98,514	2028/9/15
第34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	114,499	2037/3/19
第97回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	108,069	2029/12/28
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	104,223	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	100,099	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	98,271	2028/7/31
第86回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.19	100,000	99,546	2026/2/26
第101回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.205	100,000	98,984	2027/5/28
第188回 都市再生債券	1.12	100,000	88,895	2043/6/19

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	103,880	2026/ 3/20
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	106,758	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	9,891	9,949	2043/ 8/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	25,446	26,195	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	14,253	14,762	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	13,179	13,521	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	18,136	18,785	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	16,781	17,326	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	17,423	17,961	2045/ 6/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	16,890	17,370	2046/ 7/10
第 52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	107,429	2030/ 7/16
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	37,773	37,546	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	38,874	38,454	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	44,215	42,839	2050/ 2/10
第 99回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.584	100,000	102,967	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	65,970	62,186	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	66,667	63,011	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	66,216	62,691	2052/ 3/10
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	72,747	67,599	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	74,786	69,073	2054/ 5/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	81,435	74,660	2055/ 3/10
第162回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	84,442	77,569	2055/11/10
第185回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.58	92,792	86,383	2057/10/10
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	99,065	2026/12/18
小 計	—	3,557,916	3,605,798	—
(金融債券)	%	千円	千円	
い第853号 商工債	0.09	100,000	98,883	2026/ 6/26
い第857号 商工債	0.09	100,000	98,660	2026/10/27
第 41号 商工債(10年)	0.4	100,000	94,199	2032/ 3/19
小 計	—	300,000	291,742	—
(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	98,261	2028/ 9/20
第321回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.365	100,000	98,992	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	95,137	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	99,170	2027/ 5/25
第338回 北海道電力株式会社社債(一般担保付)	0.84	100,000	90,650	2036/11/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	108,249	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	99,319	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)	0.08	100,000	99,088	2026/ 3/16
第 34回 清水建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.302	100,000	98,840	2033/11/28
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	99,599	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	98,038	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(特約)	0.08	100,000	99,182	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	94,287	2031/ 6/ 3
第 16回 株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位)	0.15	100,000	99,608	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	98,486	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	98,687	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	102,477	2028/12/13
第 24回 パナソニックホールディングス株式会社無担保社債(社債)	0.709	100,000	99,080	2028/ 9/14
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	98,731	2026/ 9/ 1
第 26回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.05	100,000	99,077	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	106,815	2029/ 7/13
第 80回 三菱商事株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約)	1.485	100,000	103,139	2028/ 9/ 8
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	99,688	2025/ 7/15
第 25回 NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.648	100,000	98,509	2030/ 6/20
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	100,000	98,891	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	96,441	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	96,378	2030/ 4/16

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 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	105,250	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	98,013	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	105,603	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	97,949	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	98,662	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	98,438	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	99,090	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	95,478	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	99,931	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	198,506	2026/ 4/22
第 69回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	1.724	100,000	100,970	2033/10/13
第 37回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2023)	1.214	100,000	99,739	2028/12/14
小 計	—	4,000,000	3,972,448	—
合 計	—	61,212,916	59,600,930	—

(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			
20期(2020年3月31日)	円 14,183	% △0.0	% 100.2	% —	百万円 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
24期(2024年4月1日)	13,372	△2.3	99.3	—	58,924

(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) 2023年 3月31日	円 13,687	% —	374.74	% —	% 99.2	% —
4月末	13,727	0.3	375.61	0.2	99.1	—
5月末	13,714	0.2	375.27	0.1	99.2	—
6月末	13,748	0.4	376.29	0.4	99.2	—
7月末	13,535	△1.1	370.43	△1.2	99.2	—
8月末	13,438	△1.8	367.76	△1.9	99.2	—
9月末	13,343	△2.5	365.13	△2.6	99.1	—
10月末	13,130	△4.1	359.31	△4.1	99.1	—
11月末	13,407	△2.0	366.88	△2.1	99.2	—
12月末	13,462	△1.6	368.38	△1.7	99.2	—
2024年 1月末	13,365	△2.4	365.75	△2.4	99.0	—
2月末	13,407	△2.0	366.90	△2.1	99.2	—
3月末	13,392	△2.2	366.50	△2.2	99.3	—
(期末) 2024年 4月1日	13,372	△2.3	365.95	△2.3	99.3	—

(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
	(2023.4.1～2024.4.1)
	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(2023年4月1日から2024年4月1日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	11,662,605	6,690,551
	地方債証券	821,243	1,105,317
	特殊債証券	679,764	100,634 (70,061)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	590,801	301,100

(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(2023年4月1日から2024年4月1日まで)

公社債

買付		金額	売付		金額
銘柄			銘柄		
		千円			千円
第153回	利付国債(5年)	578,792	第451回	利付国債(2年)	429,509
第453回	利付国債(2年)	498,845	第443回	利付国債(2年)	370,144
第361回	利付国債(10年)	490,482	第338回	利付国債(10年)	361,402
第370回	利付国債(10年)	464,183	平成26年度第2回千葉市公募公債		301,488
第158回	利付国債(5年)	456,923	第441回	利付国債(2年)	290,206
第452回	利付国債(2年)	449,306	第144回	利付国債(5年)	290,033
第372回	利付国債(10年)	434,830	第440回	利付国債(2年)	280,237
第451回	利付国債(2年)	430,009	第337回	利付国債(10年)	250,845
第368回	利付国債(10年)	423,868	第143回	利付国債(5年)	250,277
第360回	利付国債(10年)	391,494	第140回	利付国債(5年)	240,543

(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(2023年4月1日から2024年4月1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
公社債	千円 0	千円 0	千円 103,336

(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(2024年4月1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	48,125,000 (720,000)	47,439,278 (783,026)	80.5 (1.3)	— (—)	54.2 (1.2)	19.0 (0.2)	7.3 (—)
地 方 債 証 券	3,200,000 (3,200,000)	3,332,128 (3,332,128)	5.7 (5.7)	— (—)	3.4 (3.4)	1.7 (1.7)	0.5 (0.5)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	3,578,343 (3,578,343)	3,668,967 (3,668,967)	6.2 (6.2)	— (—)	3.6 (3.6)	1.9 (1.9)	0.7 (0.7)
金 融 債 券	300,000 (300,000)	293,696 (293,696)	0.5 (0.5)	— (—)	0.2 (0.2)	0.3 (0.3)	— (—)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	3,800,000 (3,800,000)	3,799,918 (3,799,918)	6.4 (6.4)	— (—)	1.9 (1.9)	3.4 (3.4)	1.2 (1.2)
合 計	59,003,343 (11,598,343)	58,533,988 (11,877,735)	99.3 (20.2)	— (—)	63.2 (10.2)	26.4 (7.6)	9.7 (2.4)

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

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債銘柄別

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	
(国債証券)				
第450回 利付国債(2年)	0.005	200,000	199,862	2025/ 7/ 1
第452回 利付国債(2年)	0.005	450,000	449,518	2025/ 9/ 1
第453回 利付国債(2年)	0.005	500,000	499,360	2025/10/ 1
第454回 利付国債(2年)	0.1	230,000	230,000	2025/11/ 1
第455回 利付国債(2年)	0.005	250,000	249,437	2025/12/ 1
第456回 利付国債(2年)	0.1	150,000	149,842	2026/ 1/ 1
第144回 利付国債(5年)	0.1	250,000	250,150	2025/ 6/20
第145回 利付国債(5年)	0.1	380,000	380,079	2025/ 9/20
第146回 利付国債(5年)	0.1	120,000	119,906	2025/12/20
第147回 利付国債(5年)	0.005	100,000	99,667	2026/ 3/20
第148回 利付国債(5年)	0.005	220,000	219,124	2026/ 6/20
第149回 利付国債(5年)	0.005	660,000	656,997	2026/ 9/20
第150回 利付国債(5年)	0.005	490,000	487,481	2026/12/20
第151回 利付国債(5年)	0.005	270,000	268,407	2027/ 3/20
第152回 利付国債(5年)	0.1	100,000	99,690	2027/ 3/20
第153回 利付国債(5年)	0.005	530,000	526,358	2027/ 6/20
第154回 利付国債(5年)	0.1	370,000	368,216	2027/ 9/20
第155回 利付国債(5年)	0.3	100,000	100,147	2027/12/20
第156回 利付国債(5年)	0.2	230,000	229,491	2027/12/20
第157回 利付国債(5年)	0.2	210,000	209,298	2028/ 3/20
第158回 利付国債(5年)	0.1	460,000	456,660	2028/ 3/20
第159回 利付国債(5年)	0.1	50,000	49,583	2028/ 6/20
第163回 利付国債(5年)	0.4	100,000	100,264	2028/ 9/20
第164回 利付国債(5年)	0.2	140,000	138,927	2028/12/20
第 1回 クライメート・トランジション利付国債(5年)	0.3	50,000	49,860	2028/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	107,213	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	140,000	152,999	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	65,193	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	100,000	109,375	2031/12/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
(国債証券)				
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	257,044	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	206,915	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	177,283	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	143,517	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	130,000	143,075	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	100,000	105,386	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	80,000	82,306	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	125,000	122,208	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	165,000	149,353	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	60,000	39,582	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	220,000	170,064	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	100,000	74,081	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	125,000	82,031	2059/ 3/20
第13回 利付国債(40年)	0.5	200,000	129,522	2060/ 3/20
第14回 利付国債(40年)	0.7	210,000	144,750	2061/ 3/20
第15回 利付国債(40年)	1.0	240,000	181,927	2062/ 3/20
第16回 利付国債(40年)	1.3	240,000	198,854	2063/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	50,000	50,212	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	120,000	120,553	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	270,000	270,715	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	230,000	229,661	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	220,000	219,586	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	490,000	488,912	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	260,000	259,331	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	450,000	448,605	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	430,000	428,348	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	310,000	308,505	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	230,000	228,643	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	340,000	337,531	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	180,000	178,500	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	200,000	197,930	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	360,000	355,654	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	460,000	453,721	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	410,000	403,919	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	330,000	324,786	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	390,000	383,459	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	390,000	382,960	2030/ 3/20
第359回 利付国債(10年)	0.1	520,000	509,761	2030/ 6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1	650,000	635,895	2030/ 9/20
第361回 利付国債(10年)	0.1	700,000	683,354	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1	550,000	535,551	2031/ 3/20
第363回 利付国債(10年)	0.1	500,000	485,560	2031/ 6/20
第364回 利付国債(10年)	0.1	120,000	116,209	2031/ 9/20
第365回 利付国債(10年)	0.1	350,000	337,963	2031/12/20
第366回 利付国債(10年)	0.2	230,000	223,346	2032/ 3/20
第367回 利付国債(10年)	0.2	230,000	222,794	2032/ 6/20
第368回 利付国債(10年)	0.2	440,000	425,128	2032/ 9/20
第369回 利付国債(10年)	0.5	410,000	405,424	2032/12/20
第370回 利付国債(10年)	0.5	400,000	394,580	2033/ 3/20
第371回 利付国債(10年)	0.4	390,000	380,363	2033/ 6/20
第372回 利付国債(10年)	0.8	430,000	433,814	2033/ 9/20
第373回 利付国債(10年)	0.6	360,000	355,428	2033/12/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	45,209	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	5,594	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	79,664	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	49,436	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	147,325	2033/ 6/20

銘柄名		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
(国債証券)					
第 12回	利付国債(30年)	2.1	90,000	101,503	2033/ 9/20
第 13回	利付国債(30年)	2.0	70,000	78,279	2033/12/20
第 14回	利付国債(30年)	2.4	120,000	138,872	2034/ 3/20
第 16回	利付国債(30年)	2.5	50,000	58,493	2034/ 9/20
第 17回	利付国債(30年)	2.4	160,000	185,820	2034/12/20
第 18回	利付国債(30年)	2.3	155,000	178,525	2035/ 3/20
第 19回	利付国債(30年)	2.3	110,000	126,852	2035/ 6/20
第 20回	利付国債(30年)	2.5	50,000	58,805	2035/ 9/20
第 21回	利付国債(30年)	2.3	100,000	115,451	2035/12/20
第 24回	利付国債(30年)	2.5	50,000	59,001	2036/ 9/20
第 25回	利付国債(30年)	2.3	220,000	254,566	2036/12/20
第 26回	利付国債(30年)	2.4	180,000	210,490	2037/ 3/20
第 27回	利付国債(30年)	2.5	70,000	82,757	2037/ 9/20
第 28回	利付国債(30年)	2.5	300,000	354,705	2038/ 3/20
第 29回	利付国債(30年)	2.4	290,000	338,960	2038/ 9/20
第 30回	利付国債(30年)	2.3	230,000	265,463	2039/ 3/20
第 31回	利付国債(30年)	2.2	220,000	250,498	2039/ 9/20
第 32回	利付国債(30年)	2.3	215,000	247,514	2040/ 3/20
第 33回	利付国債(30年)	2.0	70,000	77,380	2040/ 9/20
第 34回	利付国債(30年)	2.2	220,000	248,903	2041/ 3/20
第 35回	利付国債(30年)	2.0	30,000	32,942	2041/ 9/20
第 36回	利付国債(30年)	2.0	170,000	186,379	2042/ 3/20
第 37回	利付国債(30年)	1.9	70,000	75,412	2042/ 9/20
第 38回	利付国債(30年)	1.8	180,000	190,503	2043/ 3/20
第 39回	利付国債(30年)	1.9	110,000	118,059	2043/ 6/20
第 40回	利付国債(30年)	1.8	150,000	157,969	2043/ 9/20
第 41回	利付国債(30年)	1.7	20,000	20,687	2043/12/20
第 42回	利付国債(30年)	1.7	20,000	20,646	2044/ 3/20
第 43回	利付国債(30年)	1.7	30,000	30,930	2044/ 6/20
第 44回	利付国債(30年)	1.7	130,000	133,861	2044/ 9/20
第 45回	利付国債(30年)	1.5	250,000	248,232	2044/12/20
第 46回	利付国債(30年)	1.5	320,000	317,216	2045/ 3/20
第 47回	利付国債(30年)	1.6	140,000	141,117	2045/ 6/20
第 48回	利付国債(30年)	1.4	200,000	194,072	2045/ 9/20
第 49回	利付国債(30年)	1.4	220,000	213,078	2045/12/20
第 50回	利付国債(30年)	0.8	20,000	17,107	2046/ 3/20
第 51回	利付国債(30年)	0.3	240,000	182,287	2046/ 6/20
第 52回	利付国債(30年)	0.5	260,000	206,255	2046/ 9/20
第 53回	利付国債(30年)	0.6	230,000	186,095	2046/12/20
第 54回	利付国債(30年)	0.8	320,000	270,198	2047/ 3/20
第 55回	利付国債(30年)	0.8	150,000	126,265	2047/ 6/20
第 56回	利付国債(30年)	0.8	100,000	83,916	2047/ 9/20
第 57回	利付国債(30年)	0.8	260,000	217,505	2047/12/20
第 58回	利付国債(30年)	0.8	30,000	25,019	2048/ 3/20
第 59回	利付国債(30年)	0.7	250,000	202,935	2048/ 6/20
第 60回	利付国債(30年)	0.9	160,000	135,884	2048/ 9/20
第 61回	利付国債(30年)	0.7	210,000	169,323	2048/12/20
第 62回	利付国債(30年)	0.5	210,000	160,080	2049/ 3/20
第 63回	利付国債(30年)	0.4	260,000	191,874	2049/ 6/20
第 64回	利付国債(30年)	0.4	230,000	168,900	2049/ 9/20
第 65回	利付国債(30年)	0.4	20,000	14,640	2049/12/20
第 66回	利付国債(30年)	0.4	10,000	7,278	2050/ 3/20
第 67回	利付国債(30年)	0.6	140,000	107,212	2050/ 6/20
第 68回	利付国債(30年)	0.6	140,000	106,817	2050/ 9/20
第 69回	利付国債(30年)	0.7	100,000	78,179	2050/12/20
第 70回	利付国債(30年)	0.7	30,000	23,372	2051/ 3/20
第 71回	利付国債(30年)	0.7	30,000	23,290	2051/ 6/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
(国債証券)				
第 72回 利付国債(30年)	0.7	130,000	100,573	2051/ 9/20
第 73回 利付国債(30年)	0.7	200,000	154,184	2051/12/20
第 74回 利付国債(30年)	1.0	190,000	158,482	2052/ 3/20
第 75回 利付国債(30年)	1.3	180,000	161,645	2052/ 6/20
第 76回 利付国債(30年)	1.4	170,000	156,170	2052/ 9/20
第 77回 利付国債(30年)	1.6	150,000	144,319	2052/12/20
第 78回 利付国債(30年)	1.4	220,000	201,517	2053/ 3/20
第 79回 利付国債(30年)	1.2	230,000	200,504	2053/ 6/20
第 80回 利付国債(30年)	1.8	220,000	220,635	2053/ 9/20
第 81回 利付国債(30年)	1.6	170,000	162,472	2053/12/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	102,370	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	184,485	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	185,054	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	60,000	61,773	2025/ 9/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	140,000	144,449	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	207,556	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	120,000	124,768	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	261,700	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	208,918	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	283,367	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	63,118	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	147,229	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	210,608	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	90,000	95,039	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	95,418	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	210,000	224,196	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	220,000	234,115	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	70,000	74,755	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	100,000	107,549	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	195,820	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	50,000	54,186	2028/ 6/20
第104回 利付国債(20年)	2.1	20,000	21,507	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	204,854	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	120,000	129,909	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	183,763	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	160,000	171,468	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	90,000	96,735	2029/ 3/20
第110回 利付国債(20年)	2.1	150,000	162,688	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	320,000	348,240	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	229,410	2029/ 9/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	132,222	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	110,550	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	220,000	241,927	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	10,000	10,967	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	108,458	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	70,000	77,581	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	120,000	132,213	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	80,000	89,392	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	120,000	132,424	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	80,000	87,744	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	100,000	109,827	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	109,130	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	150,000	163,920	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	162,841	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	80,000	86,907	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	20,000	21,907	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	130,000	141,406	2032/ 3/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
(国債証券)				
第136回 利付国債(20年)	1.6	80,000	86,376	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	107,257	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	97,275	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	220,000	239,694	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	150,000	163,533	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	40,000	43,958	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	130,000	140,639	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	50,000	53,668	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	220,000	240,086	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	330,000	360,102	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	240,000	259,416	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	280,000	299,642	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	170,000	180,113	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	200,000	207,692	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	355,000	368,198	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	270,000	282,584	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	80,000	82,752	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	110,000	111,164	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	200,000	188,182	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	240,000	219,456	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	120,000	113,473	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	120,000	114,519	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	270,000	260,104	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	210,000	199,031	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	130,000	122,734	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	90,000	84,636	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	200,000	184,802	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	190,000	174,801	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	170,000	160,310	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	291,977	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	280,000	250,468	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	245,364	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	217,942	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	250,000	216,805	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	10,000	8,775	2040/ 3/20
第173回 利付国債(20年)	0.4	300,000	261,909	2040/ 6/20
第174回 利付国債(20年)	0.4	320,000	277,916	2040/ 9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5	280,000	246,027	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5	10,000	8,742	2041/ 3/20
第177回 利付国債(20年)	0.4	150,000	128,212	2041/ 6/20
第178回 利付国債(20年)	0.5	230,000	199,127	2041/ 9/20
第179回 利付国債(20年)	0.5	30,000	25,854	2041/12/20
第180回 利付国債(20年)	0.8	280,000	253,699	2042/ 3/20
第181回 利付国債(20年)	0.9	60,000	55,125	2042/ 6/20
第182回 利付国債(20年)	1.1	110,000	104,315	2042/ 9/20
第183回 利付国債(20年)	1.4	110,000	109,351	2042/12/20
第184回 利付国債(20年)	1.1	170,000	160,315	2043/ 3/20
第185回 利付国債(20年)	1.1	190,000	178,529	2043/ 6/20
第186回 利付国債(20年)	1.5	180,000	180,543	2043/ 9/20
第187回 利付国債(20年)	1.3	190,000	183,657	2043/12/20
第 16回 ポーランド共和国円貨債券(2023)	0.93	100,000	100,078	2026/11/20
小 計	—	48,125,000	47,439,278	—
(地方債証券)				
第 10回 東京都公募公債(東京再生都債)	2.31	100,000	113,722	2039/ 9/20
第 31回 東京都公募公債(20年)	1.238	100,000	103,229	2034/ 9/20
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	100,415	2025/10/30

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	
(地方債証券)				
令和5年度第 9回 北海道公募公債(5年)	0.507	100,000	100,236	2028/11/30
第 20回 神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	107,982	2032/ 6/18
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	109,014	2030/ 9/13
第425回 大阪府公募公債(10年)	0.195	100,000	99,451	2027/10/29
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	109,688	2029/11/19
第 2回 静岡県公募公債(グリーンボンド・5年)	0.324	100,000	99,688	2028/ 6/20
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	102,917	2028/11/20
第 9回 静岡県公募公債(15年)	0.739	100,000	101,243	2030/ 9/20
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	100,426	2025/ 9/19
平成21年度第 16回 愛知県公募公債(20年)	2.218	100,000	109,654	2029/12/20
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	106,298	2034/ 5/15
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	108,915	2030/11/12
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	107,422	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	106,315	2034/ 5/26
令和元年度第 2回 福岡県公募公債(15年)	0.269	100,000	93,370	2034/12/13
第 5回 千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	108,058	2028/ 9/21
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	92,321	2038/ 8/20
第 3回 群馬県公募公債(20年)	1.687	100,000	107,852	2032/ 6/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,402	2026/10/23
第207回 共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	97,704	2030/ 6/25
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	102,826	2025/ 9/19
第 13回 京都市公募公債(20年)	1.359	100,000	104,354	2034/11/24
令和4年度第 3回 神戸市公募公債(5年)	0.2	100,000	99,443	2027/11/19
第 26回 横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	108,730	2033/ 1/28
第 4回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	108,096	2028/ 6/20
平成23年度第 4回 福岡市公募公債(20年)	1.89	100,000	109,012	2031/ 8/19
平成25年度第 1回 福岡市公募公債(20年)	1.808	100,000	109,008	2033/ 7/19
平成26年度第 2回 福岡市公募公債(20年)	1.49	100,000	105,816	2034/ 6/20
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	99,521	2027/ 9/17
小 計	—	3,200,000	3,332,128	—
(特殊債券(除く金融債))				
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	118,652	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	109,450	2030/ 2/ 8
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	101,998	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	102,475	2035/ 2/28
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	109,813	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	110,090	2031/ 1/28
第 23回 公営企業債券(20年)	2.29	200,000	213,092	2027/ 9/24
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	107,426	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	100,405	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	99,166	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	98,029	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	102,336	2027/10/29
第 53回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	100,000	99,228	2028/ 9/15
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	117,365	2037/ 3/19
第 97回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	109,244	2029/12/28
第216回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.483	100,000	106,019	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	100,318	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	98,957	2028/ 7/31
第 86回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.19	100,000	99,747	2026/ 2/26
第101回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.205	100,000	99,485	2027/ 5/28
第188回 都市再生債券	1.12	100,000	92,261	2043/ 6/19
第 11回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	104,349	2026/ 3/20
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	107,570	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	10,051	10,126	2043/ 8/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	25,942	26,804	2044/ 5/10

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
(特殊債券(除く金融債))				
第25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	14,560	15,146	2044/ 6/10
第26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	13,346	13,748	2044/ 7/10
第33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	18,374	19,138	2045/ 2/10
第36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	17,064	17,690	2045/ 5/10
第37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	17,734	18,361	2045/ 6/10
第49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	9,561	9,566	2024/ 4/10
第50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	17,148	17,703	2046/ 7/10
第52回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	108,647	2030/ 7/16
第89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	38,474	38,645	2049/10/10
第90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	39,499	39,489	2049/11/10
第93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	44,807	43,951	2050/ 2/10
第99回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.584	100,000	103,605	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	66,602	63,796	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	67,424	64,696	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	66,933	64,320	2052/ 3/10
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	73,706	69,720	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	75,662	71,159	2054/ 5/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	82,300	76,833	2055/ 3/10
第162回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	85,534	80,030	2055/11/10
第185回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.58	93,622	88,847	2057/10/10
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	99,462	2026/12/18
小計	—	3,578,343	3,668,967	—
(金融債券)				
い第853号 商工債	0.09	100,000	99,178	2026/ 6/26
い第857号 商工債	0.09	100,000	99,021	2026/10/27
第41号 商工債(10年)	0.4	100,000	95,497	2032/ 3/19
小計	—	300,000	293,696	—
(普通社債券(含む投資法人債券))				
第522回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.47	100,000	98,872	2028/ 9/20
第321回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.365	100,000	99,502	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	96,070	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	99,644	2027/ 5/25
第338回 北海道電力株式会社社債(一般担保付)	0.84	100,000	92,233	2036/11/25
第6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	109,588	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	99,606	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	99,306	2026/ 3/16
第34回 清水建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.302	100,000	100,410	2033/11/28
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	99,743	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	98,775	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(特約付)	0.08	100,000	99,386	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(社債間限定同順位特約付)	0.33	100,000	95,375	2031/ 6/ 3
第16回 株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.15	100,000	99,755	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	98,792	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	99,031	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	103,336	2028/12/13
第24回 パナソニックホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.709	100,000	99,853	2028/ 9/14
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	99,054	2026/ 9/ 1
第26回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.05	100,000	99,282	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	107,782	2029/ 7/13
第80回 三菱商事株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約付)	1.485	100,000	104,037	2028/ 9/ 8
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	99,812	2025/ 7/15
第69回 株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	100,000	99,203	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	97,339	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	97,313	2030/ 4/16
第91回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	1.751	100,000	106,903	2032/12/27

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
(普通社債券(含む投資法人債券))				
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	98,708	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	106,429	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	101,603	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	99,190	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	98,999	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	99,426	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	96,433	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	100,068	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	198,952	2026/ 4/22
第 37回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2023	1.214	100,000	100,108	2028/12/14
小 計	—	3,800,000	3,799,918	—
合 計	—	59,003,343	58,533,988	—

(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(2024年4月1日現在)

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 58,533,988	% 99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	562,872	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	59,096,860	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

2024年4月1日現在

項目	当 期 末
(A) 資 産	59,096,860,381円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	386,146,870
公 社 債(評価額)	58,533,988,274
未 収 入 金	100,016,200
未 収 利 息	74,753,447
前 払 費 用	1,955,590
(B) 負 債	172,003,100
未 払 金	157,303,100
未 払 解 約 金	14,700,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	58,924,857,281
元 本	44,065,474,807
次 期 繰 越 損 益 金	14,859,382,474
(D) 受 益 権 総 口 数	44,065,474,807口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,372円

(注1) 当ファンドの期首元本額は40,417,051,526円、期中追加設定元本額は5,321,606,975円、期中一部解約元本額は1,673,183,694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)	15,745,686,817円
日立国内債券インデックスファンド	9,238,721,619円
日立バランスファンド(株式50)	8,830,656,141円
日立バランスファンド(株式70)	5,968,310,049円
日立バランスファンド(株式30)	4,282,100,181円

(注3) 1口当たり純資産額は1,3372円です。

■損益の状況

当期(自2023年4月1日 至2024年4月1日)

項目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	532,464,082円
受 取 利 息	532,849,315
支 払 利 息	△385,233
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,842,670,384
売 買 益	11,216,966
売 買 損	△1,853,887,350
(C) 信 託 報 酬 等	△41,083
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△1,310,247,385
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	14,903,292,752
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,845,953,413
(G) 解 約 差 損 益 金	△579,616,306
(H) 計 (D + E + F + G)	14,859,382,474
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	14,859,382,474

(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。