

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25期

(決算日 2026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25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〉

管理グループ TEL : (03) 6626-5691

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/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 指 数		債 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
	円	%		%	%	百万円
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
24期(2025年 5 月15日)	11,555	△3.7	346.76	△3.6	99.0	10,518
25期(2026年 5 月15日)	10,807	△6.5	324.72	△6.4	99.0	9,238

(注) 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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 指 数		債 組 入 比 率
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率	
(期 首)	円	%		%	%
2025年 5 月15日	11,555	—	346.76	—	99.0
5 月末	11,550	△0.0	346.68	△0.0	99.2
6 月末	11,611	0.5	348.51	0.5	99.3
7 月末	11,492	△0.5	344.96	△0.5	99.2
8 月末	11,456	△0.9	343.89	△0.8	99.2
9 月末	11,444	△1.0	343.62	△0.9	99.4
10月末	11,463	△0.8	344.19	△0.7	99.3
11月末	11,330	△1.9	340.28	△1.9	99.2
12月末	11,188	△3.2	336.03	△3.1	99.3
2026年 1 月末	11,046	△4.4	331.79	△4.3	99.2
2 月末	11,203	△3.0	336.58	△2.9	99.2
3 月末	10,997	△4.8	330.41	△4.7	99.3
4 月末	10,927	△5.4	328.33	△5.3	99.3
(期 末)					
2026年 5 月15日	10,807	△6.5	324.72	△6.4	99.0

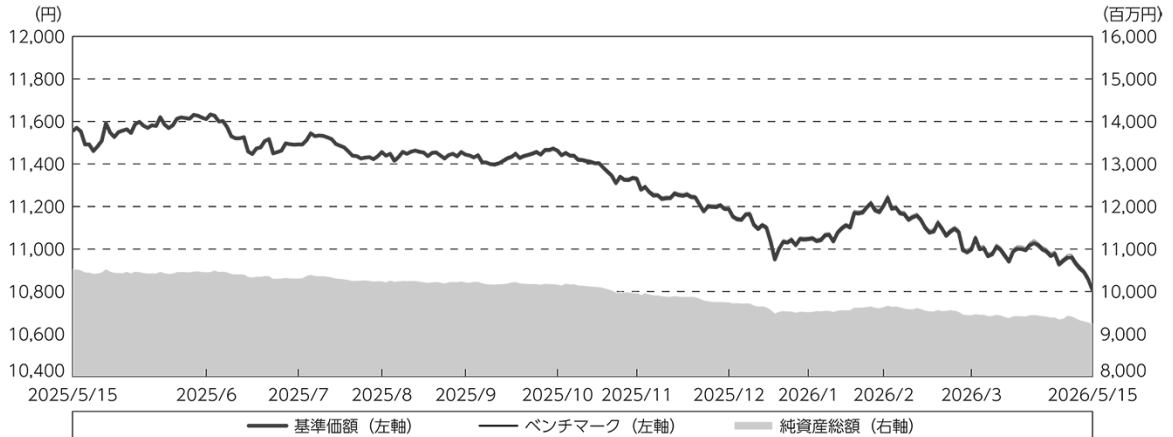
(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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。

○運用経過

(2025年5月16日～2026年5月15日)

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、期首（2025年5月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI 総合指数です。

基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

26年2月、衆議院選挙で自民党が大勝すると、政権基盤安定への期待が高まるとともに、過度な財政拡張に対する警戒感が後退し、金利低下したことがプラスに影響しました。

<下落要因>

25年10月に高市政権が発足し財政拡張懸念が高まったこと、12月に日銀が利上げを実施したこと、26年3月以降は中東情勢の緊迫化を受けてインフレ懸念が高まり金利上昇したことがマイナスに影響しました。

投資環境

当期の国内長期金利は大幅に上昇しました。25年7月に日米の関税交渉で合意が成立したことに加え、10月には高市政権の発足により財政拡張リスクが高まり、12月には日銀が政策金利を0.75%へ引き上げたことなどを背景に、長期金利は12月下旬に2%を上回りました。26年1月には、高市首相による衆議院解散の表明や、与野党各党による消費税減税の主張を受け、財政拡張リスクが一段と高まり、一時2.3%を上回りました。その後、自民党が衆議院選挙で大勝すると、政権基盤の安定期待が高まるとともに、過度な財政拡張への警戒感が後退し、2.05%程度まで低下しました。しかし3月以降は、中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の高止まりを背景に、インフレ懸念や日銀の追加利上げへの警戒感、中長期的な国債需給の悪化懸念などから、29年ぶりの水準となる2.7%を上回りました。

年限別では、残存15年前後を中心に金利上昇が顕著となり、イールドカーブはスティープ化しました。スプレッド市場では、堅調な企業業績を背景に、本邦社債スプレッドは底堅く推移しました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで-6.4%となりました。

当該投資信託のポートフォリオ

<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。

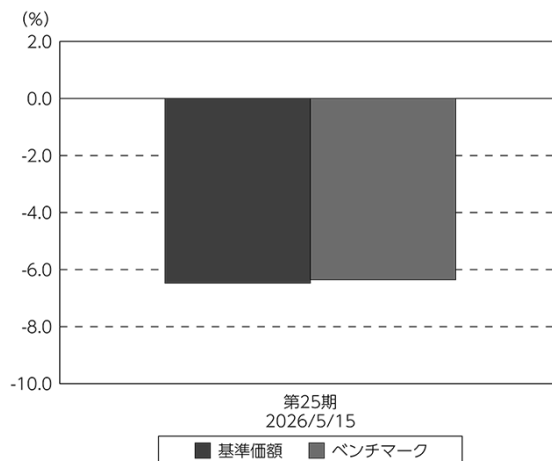
<日立国内債券インデックスマザーファンド>

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。

基準価額とベンチマークの差異について

当ファンドの基準価額は前期末の11,555円からNOMURA-BPI総合指数とほぼリンクして動き、10,807円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は-6.5%となり、ベンチマーク騰落率-6.4%にほぼ追随したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となりました。

基準価額とベンチマークの対比（当期騰落率）



（注）ベンチマークは、NOMURA-BPI 総合指数です。

分配金について

運用による収益は、投資信託財産内に留保し、期中には分配を行いません。

○今後の運用方針

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

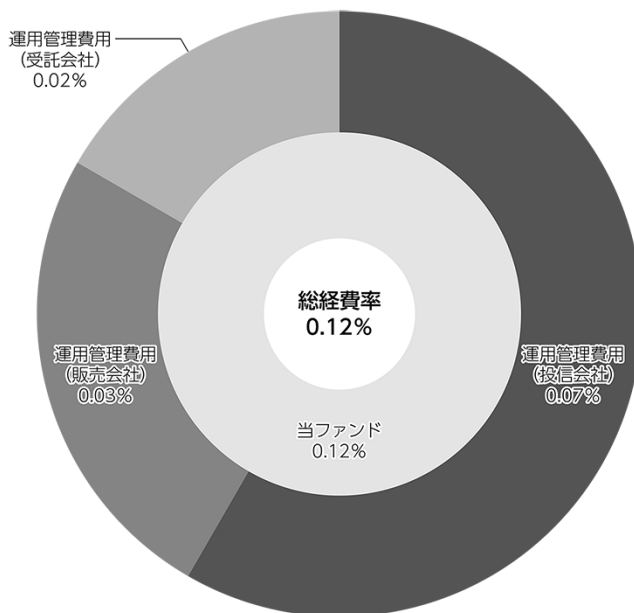
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 14	% 0.121	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(7)	(0.066)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(4)	(0.033)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
合 計	14	0.121	
期中の平均基準価額は、11,308円です。			

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

○売買及び取引の状況

(2025年5月16日～2026年5月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日立国内債券インデックスマザーファンド	549,895	681,200	1,064,377	1,318,300

(注) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2025年5月16日～2026年5月15日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

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	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
公社債	—	—	98

(注) 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。

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あり、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

(2026年5月15日現在)

親投資信託残高

銘 柄	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	8,291,742	7,777,260	9,228,497

(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

(2026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 9,228,497	% 99.7
コール・ローン等、その他	29,704	0.3
投資信託財産総額	9,258,201	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 (2026年5月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,258,201,712
コール・ローン等	29,704,054
日立国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	9,228,497,170
未収利息	488
(B) 負債	19,489,672
未払解約金	13,714,731
未払信託報酬	5,774,941
(C) 純資産総額(A－B)	9,238,712,040
元本	8,548,612,960
次期繰越損益金	690,099,080
(D) 受益権総口数	8,548,612,960口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,807円

(注) 当ファンドの期首元本額は9,103,581,747円、期中追加設定元本額は1,803,122,527円、期中一部解約元本額は2,358,091,314円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.0807円です。

○損益の状況 (2025年5月16日～2026年5月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	90,748
受取利息	90,748
(B) 有価証券売買損益	△ 587,119,551
売買益	49,527,887
売買損	△ 636,647,438
(C) 信託報酬等	△ 12,063,604
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 599,092,407
(E) 前期繰越損益金	△ 628,012,824
(F) 追加信託差損益金	1,917,204,311
(配当等相当額)	(2,229,238,467)
(売買損益相当額)	(△ 312,034,156)
(G) 計(D＋E＋F)	690,099,080
次期繰越損益金(G)	690,099,080
追加信託差損益金	1,917,204,311
(配当等相当額)	(2,229,238,467)
(売買損益相当額)	(△ 312,034,156)
分配準備積立金	137,021,906
繰越損益金	△1,364,127,137

(注) 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) 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) 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。

○お知らせ

一般社団法人資産運用業協会設立準備法人を吸収合併存続法人、一般社団法人日本投資顧問業協会と一般社団法人投資信託協会を吸収合併消滅法人として2026年4月1日付で合併し、「一般社団法人資産運用業協会」に名称を変更することとなったため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2026年5月15日現在)

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

下記は、日立国内債券インデックスマザーファンド全体(50,264,431千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	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	59,016,000 (620,000)	49,895,954 (622,498)	83.7 (1.0)	— (—)	49.5 (0.1)	26.3 (0.9)	7.8 (—)
地方債証券	3,500,000 (3,500,000)	3,151,996 (3,151,996)	5.3 (5.3)	— (—)	2.8 (2.8)	2.0 (2.0)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	3,136,431 (3,136,431)	2,728,775 (2,728,775)	4.6 (4.6)	— (—)	2.4 (2.4)	1.3 (1.3)	0.8 (0.8)
金融債券	100,000 (100,000)	88,317 (88,317)	0.1 (0.1)	— (—)	0.1 (0.1)	— (—)	— (—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,600,000 (3,600,000)	3,240,810 (3,240,810)	5.4 (5.4)	— (—)	1.5 (1.5)	3.1 (3.1)	0.8 (0.8)
合 計	69,352,431 (10,956,431)	59,105,852 (9,832,396)	99.1 (16.5)	— (—)	56.4 (7.0)	32.7 (7.3)	10.0 (2.2)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 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) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) —印は組み入れなし。

(注) 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) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第474回利付国債（2年）		0.7	270,000	268,639	2027/7/1
第475回利付国債（2年）		0.9	470,000	468,406	2027/8/1
第476回利付国債（2年）		0.9	490,000	488,035	2027/9/1
第477回利付国債（2年）		1.0	70,000	69,773	2027/10/1
第478回利付国債（2年）		1.0	120,000	119,535	2027/11/1
第479回利付国債（2年）		1.0	170,000	169,241	2027/12/1
第482回利付国債（2年）		1.3	40,000	39,958	2028/3/1
第483回利付国債（2年）		1.4	40,000	40,010	2028/4/1
第154回利付国債（5年）		0.1	190,000	187,201	2027/9/20
第155回利付国債（5年）		0.3	100,000	98,432	2027/12/20
第156回利付国債（5年）		0.2	230,000	226,034	2027/12/20
第157回利付国債（5年）		0.2	480,000	469,843	2028/3/20
第158回利付国債（5年）		0.1	460,000	449,443	2028/3/20
第159回利付国債（5年）		0.1	200,000	194,580	2028/6/20
第160回利付国債（5年）		0.2	250,000	243,732	2028/6/20
第161回利付国債（5年）		0.3	330,000	322,396	2028/6/20
第162回利付国債（5年）		0.3	400,000	389,224	2028/9/20
第163回利付国債（5年）		0.4	520,000	507,166	2028/9/20
第164回利付国債（5年）		0.2	300,000	289,908	2028/12/20
第167回利付国債（5年）		0.4	430,000	415,986	2029/3/20
第168回利付国債（5年）		0.6	460,000	447,570	2029/3/20
第169回利付国債（5年）		0.5	30,000	29,103	2029/3/20
第170回利付国債（5年）		0.6	550,000	532,862	2029/6/20
第172回利付国債（5年）		0.5	240,000	231,780	2029/6/20
第173回利付国債（5年）		0.6	240,000	231,501	2029/9/20
第174回利付国債（5年）		0.7	470,000	454,847	2029/9/20
第175回利付国債（5年）		0.9	330,000	320,195	2029/12/20
第176回利付国債（5年）		1.0	250,000	243,457	2029/12/20
第177回利付国債（5年）		1.1	570,000	557,004	2029/12/20
第178回利付国債（5年）		1.0	490,000	475,412	2030/3/20
第179回利付国債（5年）		1.0	500,000	483,195	2030/6/20
第180回利付国債（5年）		1.1	140,000	135,851	2030/6/20
第181回利付国債（5年）		1.3	460,000	448,564	2030/9/20
第182回利付国債（5年）		1.4	460,000	450,501	2030/9/20
第183回利付国債（5年）		1.6	270,000	266,014	2030/12/20
第184回利付国債（5年）		1.8	120,000	119,019	2031/3/20
第1回クライメート・トランジション利付国債（5年）		0.3	230,000	222,973	2028/12/20
第2回クライメート・トランジション利付国債（5年）		0.5	319,000	308,211	2029/6/20
第120回利付国債（20年）		1.6	100,000	99,011	2030/6/20
第121回利付国債（20年）		1.9	140,000	140,056	2030/9/20
第122回利付国債（20年）		1.8	60,000	59,770	2030/9/20
第133回利付国債（20年）		1.8	100,000	98,523	2031/12/20
第148回利付国債（20年）		1.5	240,000	224,563	2034/3/20
第1回利付国債（40年）		2.4	180,000	145,076	2048/3/20
第2回利付国債（40年）		2.2	160,000	121,704	2049/3/20
第3回利付国債（40年）		2.2	130,000	97,346	2050/3/20
第4回利付国債（40年）		2.2	130,000	94,985	2051/3/20
第5回利付国債（40年）		2.0	100,000	68,575	2052/3/20
第6回利付国債（40年）		1.9	90,000	59,456	2053/3/20
第7回利付国債（40年）		1.7	125,000	78,081	2054/3/20
第8回利付国債（40年）		1.4	165,000	93,852	2055/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第9回利付国債 (40年)		0.4	193,000	74,899	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)		0.9	190,000	89,011	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)		0.8	142,000	62,728	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)		0.5	131,000	49,483	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)		0.5	207,000	77,028	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)		0.7	210,000	84,052	2061/3/20
第15回利付国債 (40年)		1.0	270,000	121,032	2062/3/20
第16回利付国債 (40年)		1.3	280,000	138,611	2063/3/20
第17回利付国債 (40年)		2.2	310,000	204,175	2064/3/20
第18回利付国債 (40年)		3.1	200,000	167,156	2065/3/20
第1回クライメート・トランジション利付国債 (10年)		0.7	180,000	158,970	2033/12/20
第2回クライメート・トランジション利付国債 (10年)		1.0	360,000	323,863	2034/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	80,000	79,112	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	220,000	216,759	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	230,000	225,676	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	340,000	332,197	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	180,000	175,140	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	230,000	222,787	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)		0.1	360,000	347,036	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	460,000	441,264	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)		0.1	410,000	391,140	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	430,000	407,915	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	390,000	367,692	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	390,000	365,539	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	360,000	335,340	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)		0.1	590,000	546,192	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)		0.1	420,000	386,437	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)		0.1	380,000	347,380	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)		0.1	350,000	317,807	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)		0.1	340,000	306,669	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)		0.1	360,000	322,516	2031/12/20
第366回利付国債 (10年)		0.2	380,000	340,149	2032/3/20
第367回利付国債 (10年)		0.2	560,000	497,705	2032/6/20
第368回利付国債 (10年)		0.2	560,000	494,082	2032/9/20
第369回利付国債 (10年)		0.5	480,000	429,312	2032/12/20
第370回利付国債 (10年)		0.5	430,000	382,231	2033/3/20
第371回利付国債 (10年)		0.4	720,000	631,022	2033/6/20
第372回利付国債 (10年)		0.8	680,000	609,987	2033/9/20
第373回利付国債 (10年)		0.6	640,000	561,689	2033/12/20
第374回利付国債 (10年)		0.8	540,000	478,418	2034/3/20
第375回利付国債 (10年)		1.1	530,000	478,134	2034/6/20
第376回利付国債 (10年)		0.9	470,000	414,511	2034/9/20
第377回利付国債 (10年)		1.2	520,000	467,719	2034/12/20
第378回利付国債 (10年)		1.4	500,000	455,080	2035/3/20
第379回利付国債 (10年)		1.5	250,000	228,435	2035/6/20
第380回利付国債 (10年)		1.7	260,000	240,601	2035/9/20
第381回利付国債 (10年)		2.1	110,000	105,011	2035/12/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	40,000	41,430	2029/9/20
第5回利付国債 (30年)		2.2	5,000	5,047	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)		2.4	70,000	71,194	2031/11/20
第8回利付国債 (30年)		1.8	45,000	43,861	2032/11/22
第11回利付国債 (30年)		1.7	135,000	129,744	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	90,000	88,590	2033/9/20

銘柄	利 率	当 期		期 末	
		額 面	金 額	評 価	額
国債証券	%	千円	千円		
第13回利付国債 (30年)	2.0	70,000	68,201	2033/12/20	
第14回利付国債 (30年)	2.4	120,000	119,960	2034/3/20	
第16回利付国債 (30年)	2.5	50,000	50,086	2034/9/20	
第17回利付国債 (30年)	2.4	160,000	158,643	2034/12/20	
第18回利付国債 (30年)	2.3	155,000	152,039	2035/3/20	
第19回利付国債 (30年)	2.3	110,000	107,613	2035/6/20	
第20回利付国債 (30年)	2.5	50,000	49,568	2035/9/20	
第21回利付国債 (30年)	2.3	100,000	97,137	2035/12/20	
第24回利付国債 (30年)	2.5	50,000	48,914	2036/9/20	
第25回利付国債 (30年)	2.3	220,000	210,412	2036/12/20	
第26回利付国債 (30年)	2.4	180,000	173,149	2037/3/20	
第27回利付国債 (30年)	2.5	70,000	67,494	2037/9/20	
第28回利付国債 (30年)	2.5	300,000	287,523	2038/3/20	
第29回利付国債 (30年)	2.4	290,000	272,484	2038/9/20	
第30回利付国債 (30年)	2.3	230,000	211,933	2039/3/20	
第31回利付国債 (30年)	2.2	220,000	198,499	2039/9/20	
第32回利付国債 (30年)	2.3	215,000	194,572	2040/3/20	
第33回利付国債 (30年)	2.0	70,000	60,405	2040/9/20	
第34回利付国債 (30年)	2.2	220,000	193,105	2041/3/20	
第35回利付国債 (30年)	2.0	80,000	67,683	2041/9/20	
第36回利付国債 (30年)	2.0	170,000	142,490	2042/3/20	
第37回利付国債 (30年)	1.9	90,000	73,538	2042/9/20	
第38回利付国債 (30年)	1.8	180,000	143,328	2043/3/20	
第39回利付国債 (30年)	1.9	110,000	88,528	2043/6/20	
第40回利付国債 (30年)	1.8	150,000	118,083	2043/9/20	
第41回利付国債 (30年)	1.7	20,000	15,401	2043/12/20	
第42回利付国債 (30年)	1.7	20,000	15,306	2044/3/20	
第43回利付国債 (30年)	1.7	30,000	22,817	2044/6/20	
第44回利付国債 (30年)	1.7	130,000	98,365	2044/9/20	
第45回利付国債 (30年)	1.5	250,000	181,327	2044/12/20	
第46回利付国債 (30年)	1.5	320,000	230,707	2045/3/20	
第47回利付国債 (30年)	1.6	140,000	102,354	2045/6/20	
第48回利付国債 (30年)	1.4	200,000	139,786	2045/9/20	
第49回利付国債 (30年)	1.4	220,000	152,807	2045/12/20	
第50回利付国債 (30年)	0.8	150,000	90,874	2046/3/20	
第51回利付国債 (30年)	0.3	127,000	67,310	2046/6/20	
第52回利付国債 (30年)	0.5	150,000	82,972	2046/9/20	
第53回利付国債 (30年)	0.6	160,000	89,988	2046/12/20	
第54回利付国債 (30年)	0.8	170,000	99,625	2047/3/20	
第55回利付国債 (30年)	0.8	150,000	87,162	2047/6/20	
第56回利付国債 (30年)	0.8	160,000	92,187	2047/9/20	
第57回利付国債 (30年)	0.8	160,000	91,414	2047/12/20	
第58回利付国債 (30年)	0.8	200,000	113,254	2048/3/20	
第59回利付国債 (30年)	0.7	210,000	114,792	2048/6/20	
第60回利付国債 (30年)	0.9	190,000	108,592	2048/9/20	
第61回利付国債 (30年)	0.7	190,000	101,921	2048/12/20	
第62回利付国債 (30年)	0.5	210,000	105,254	2049/3/20	
第63回利付国債 (30年)	0.4	220,000	105,760	2049/6/20	
第64回利付国債 (30年)	0.4	230,000	109,383	2049/9/20	
第65回利付国債 (30年)	0.4	150,000	70,578	2049/12/20	
第66回利付国債 (30年)	0.4	140,000	65,175	2050/3/20	
第67回利付国債 (30年)	0.6	170,000	83,556	2050/6/20	
第68回利付国債 (30年)	0.6	240,000	116,810	2050/9/20	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第69回利付国債 (30年)		0.7	180,000	89,589	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)		0.7	160,000	78,881	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)		0.7	165,000	80,569	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)		0.7	150,000	72,585	2051/9/20
第73回利付国債 (30年)		0.7	200,000	95,964	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)		1.0	190,000	99,710	2052/3/20
第75回利付国債 (30年)		1.3	180,000	102,623	2052/6/20
第76回利付国債 (30年)		1.4	170,000	99,239	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)		1.6	140,000	85,909	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)		1.4	220,000	127,267	2053/3/20
第79回利付国債 (30年)		1.2	200,000	108,680	2053/6/20
第80回利付国債 (30年)		1.8	170,000	108,924	2053/9/20
第81回利付国債 (30年)		1.6	170,000	102,919	2053/12/20
第82回利付国債 (30年)		1.8	146,000	93,031	2054/3/20
第83回利付国債 (30年)		2.2	200,000	140,572	2054/6/20
第84回利付国債 (30年)		2.1	140,000	95,820	2054/9/20
第85回利付国債 (30年)		2.3	170,000	121,862	2054/12/20
第86回利付国債 (30年)		2.4	130,000	95,257	2055/3/20
第87回利付国債 (30年)		2.8	118,000	94,513	2055/6/20
第88回利付国債 (30年)		3.2	110,000	95,729	2055/9/20
第89回利付国債 (30年)		3.4	90,000	81,522	2055/12/20
第90回利付国債 (30年)		3.7	20,000	19,183	2056/3/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	90,000	90,945	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	210,000	212,759	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	220,000	222,600	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	70,000	70,884	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	100,000	101,506	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)		2.4	180,000	183,618	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)		2.3	50,000	50,903	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	20,000	20,278	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	190,000	192,732	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)		2.2	120,000	121,996	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)		2.1	170,000	172,458	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	160,000	161,494	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	90,000	90,793	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)		2.1	150,000	152,160	2029/3/20
第112回利付国債 (20年)		2.1	320,000	324,422	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	210,000	212,757	2029/9/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	120,000	121,866	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	100,000	101,472	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)		2.1	220,000	222,409	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	10,000	10,058	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)		1.8	100,000	99,809	2030/6/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	70,000	70,516	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	120,000	120,354	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	80,000	80,848	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	120,000	120,158	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	80,000	79,734	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	100,000	99,469	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	100,000	98,984	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	150,000	148,158	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	150,000	147,400	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	80,000	78,417	2031/12/20

銘柄	利 率	当 期		期 末	
		額 面	金 額	評 価	額
国債証券	%	千円	千円		
第134回利付国債 (20年)	1.8	20,000	19,657	2032/3/20	
第135回利付国債 (20年)	1.7	130,000	127,030	2032/3/20	
第136回利付国債 (20年)	1.6	80,000	77,737	2032/3/20	
第138回利付国債 (20年)	1.5	100,000	96,266	2032/6/20	
第139回利付国債 (20年)	1.6	90,000	87,146	2032/6/20	
第140回利付国債 (20年)	1.7	220,000	213,521	2032/9/20	
第141回利付国債 (20年)	1.7	150,000	145,138	2032/12/20	
第142回利付国債 (20年)	1.8	40,000	38,955	2032/12/20	
第143回利付国債 (20年)	1.6	130,000	124,549	2033/3/20	
第144回利付国債 (20年)	1.5	50,000	47,594	2033/3/20	
第145回利付国債 (20年)	1.7	220,000	211,435	2033/6/20	
第146回利付国債 (20年)	1.7	330,000	315,971	2033/9/20	
第147回利付国債 (20年)	1.6	240,000	227,232	2033/12/20	
第149回利付国債 (20年)	1.5	280,000	260,806	2034/6/20	
第150回利付国債 (20年)	1.4	160,000	147,088	2034/9/20	
第151回利付国債 (20年)	1.2	200,000	179,892	2034/12/20	
第152回利付国債 (20年)	1.2	355,000	317,568	2035/3/20	
第153回利付国債 (20年)	1.3	155,000	139,160	2035/6/20	
第154回利付国債 (20年)	1.2	130,000	114,979	2035/9/20	
第155回利付国債 (20年)	1.0	210,000	181,007	2035/12/20	
第156回利付国債 (20年)	0.4	80,000	64,370	2036/3/20	
第157回利付国債 (20年)	0.2	160,000	124,814	2036/6/20	
第158回利付国債 (20年)	0.5	280,000	223,862	2036/9/20	
第159回利付国債 (20年)	0.6	240,000	192,386	2036/12/20	
第160回利付国債 (20年)	0.7	270,000	217,163	2037/3/20	
第161回利付国債 (20年)	0.6	260,000	204,916	2037/6/20	
第162回利付国債 (20年)	0.6	372,000	290,662	2037/9/20	
第163回利付国債 (20年)	0.6	350,000	271,106	2037/12/20	
第164回利付国債 (20年)	0.5	340,000	257,750	2038/3/20	
第165回利付国債 (20年)	0.5	338,000	254,013	2038/6/20	
第166回利付国債 (20年)	0.7	570,000	436,198	2038/9/20	
第167回利付国債 (20年)	0.5	370,000	273,104	2038/12/20	
第168回利付国債 (20年)	0.4	600,000	432,558	2039/3/20	
第169回利付国債 (20年)	0.3	257,000	180,735	2039/6/20	
第170回利付国債 (20年)	0.3	210,000	146,218	2039/9/20	
第171回利付国債 (20年)	0.3	210,000	144,771	2039/12/20	
第172回利付国債 (20年)	0.4	200,000	138,706	2040/3/20	
第173回利付国債 (20年)	0.4	326,000	223,870	2040/6/20	
第174回利付国債 (20年)	0.4	250,000	170,067	2040/9/20	
第175回利付国債 (20年)	0.5	230,000	157,568	2040/12/20	
第176回利付国債 (20年)	0.5	180,000	122,189	2041/3/20	
第177回利付国債 (20年)	0.4	200,000	132,184	2041/6/20	
第178回利付国債 (20年)	0.5	230,000	153,315	2041/9/20	
第179回利付国債 (20年)	0.5	210,000	138,751	2041/12/20	
第180回利付国債 (20年)	0.8	230,000	159,024	2042/3/20	
第181回利付国債 (20年)	0.9	170,000	118,639	2042/6/20	
第182回利付国債 (20年)	1.1	130,000	93,249	2042/9/20	
第183回利付国債 (20年)	1.4	260,000	194,914	2042/12/20	
第184回利付国債 (20年)	1.1	170,000	120,213	2043/3/20	
第185回利付国債 (20年)	1.1	190,000	133,389	2043/6/20	
第186回利付国債 (20年)	1.5	180,000	134,749	2043/9/20	
第187回利付国債 (20年)	1.3	190,000	136,393	2043/12/20	
第188回利付国債 (20年)	1.6	250,000	188,027	2044/3/20	

銘柄	利 率	当 期		末 期	
		額 面	金 額	評 価	額
償 還 年 月 日					
国債証券	%	千円	千円		
第189回利付国債 (20年)	1.9	110,000	86,572	2044/6/20	
第190回利付国債 (20年)	1.8	70,000	53,906	2044/9/20	
第191回利付国債 (20年)	2.0	130,000	103,101	2044/12/20	
第192回利付国債 (20年)	2.4	170,000	143,474	2045/3/20	
第193回利付国債 (20年)	2.5	140,000	119,663	2045/6/20	
第194回利付国債 (20年)	2.7	140,000	123,104	2045/9/20	
第195回利付国債 (20年)	3.2	110,000	104,107	2045/12/20	
小 計		59,016,000	49,895,954		
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	89,479	2039/9/20	
第31回東京都公募公債 (20年)	1.238	100,000	89,513	2034/9/20	
令和5年度第9回北海道公募公債 (5年)	0.507	100,000	97,173	2028/11/30	
第20回神奈川県公募公債 (20年)	1.706	100,000	96,575	2032/6/18	
第425回大阪府公募公債 (10年)	0.195	100,000	98,292	2027/10/29	
第9回兵庫県公募公債 (20年)	2.25	100,000	101,278	2029/11/19	
第38回兵庫県公募公債 (20年)	0.352	100,000	69,172	2039/6/20	
第42回兵庫県公募公債 (20年)	0.481	100,000	65,139	2041/6/21	
第2回静岡県公募公債 (グリーンボンド・5年)	0.324	100,000	97,487	2028/6/20	
第5回静岡県公募公債 (15年)	1.087	100,000	98,641	2028/11/20	
第9回静岡県公募公債 (15年)	0.739	100,000	94,647	2030/9/20	
平成21年度第16回愛知県公募公債 (20年)	2.218	100,000	101,123	2029/12/20	
平成26年度第4回愛知県公募公債 (20年)	1.542	100,000	92,385	2034/5/15	
令和2年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.315	100,000	66,477	2040/4/17	
第10回埼玉県公募公債 (20年)	1.94	100,000	99,531	2030/11/12	
平成20年度第2回福岡県公募公債 (20年)	2.05	100,000	100,996	2028/12/20	
平成26年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.542	100,000	92,330	2034/5/26	
第5回千葉県公募公債 (20年)	2.26	100,000	101,519	2028/9/21	
第22回千葉県公募公債 (20年)	0.698	100,000	78,719	2037/4/15	
平成30年度第1回新潟県公募公債	0.653	100,000	74,687	2038/8/20	
第3回群馬県公募公債 (20年)	1.687	100,000	96,437	2032/6/25	
第204回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	92,975	2030/3/25	
第207回共同発行市場公募地方債	0.15	100,000	92,755	2030/6/25	
第272回共同発行市場公募地方債	1.811	100,000	91,761	2035/11/22	
第13回京都市公募公債 (20年)	1.359	100,000	90,074	2034/11/24	
令和2年度第9回神戸市公募公債 (30年)	0.674	100,000	47,567	2050/6/20	
令和4年度第3回神戸市公募公債 (5年)	0.2	100,000	98,204	2027/11/19	
第26回横浜市公募公債 (20年)	1.776	100,000	96,088	2033/1/28	
第4回川崎市公募公債 (20年)	2.35	100,000	101,656	2028/6/20	
第19回北九州市公募公債 (20年)	1.312	100,000	88,526	2035/6/19	
平成23年度第4回福岡市公募公債 (20年)	1.89	100,000	98,522	2031/8/19	
平成25年度第1回福岡市公募公債 (20年)	1.808	100,000	95,599	2033/7/19	
平成26年度第2回福岡市公募公債 (20年)	1.49	100,000	91,838	2034/6/20	
平成29年度第1回相模原市公募公債	0.2	100,000	98,483	2027/9/17	
第160回福岡北九州高速道路債券	0.573	100,000	66,348	2041/3/22	
小 計		3,500,000	3,151,996		
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	101,929	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	100,845	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	74,120	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	88,138	2035/2/28	
第6回地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	100,907	2030/3/28	
第13回地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	99,993	2031/1/28	
第23回公営企業債券 (20年)	2.29	200,000	202,418	2027/9/24	

銘	柄	当 期 末			
		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24回公営企業債券 (20年)		2.29	100,000	101,387	2028/4/25
第113回地方公共団体金融機構債券		0.299	100,000	96,718	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	95,271	2029/4/13
F197回地方公共団体金融機構債券		1.052	100,000	99,467	2027/10/29
第53回政府保証日本政策金融公庫債券		0.209	100,000	96,855	2028/9/15
第34回日本政策投資銀行債券		2.67	100,000	96,697	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	100,779	2029/12/28
第208回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.577	100,000	93,500	2033/12/28
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	92,277	2034/4/28
第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.149	100,000	75,944	2036/7/31
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	96,907	2028/7/31
第153回都市再生債券		1.09	100,000	47,924	2053/12/19
第188回都市再生債券		1.12	100,000	68,078	2043/6/19
第15回一般担保住宅金融支援機構債券		2.38	100,000	101,510	2028/3/17
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.34	20,184	20,244	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.28	11,568	11,632	2044/6/10
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.14	10,891	10,934	2044/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	14,821	14,709	2045/2/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	13,522	13,489	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	14,263	14,150	2045/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	13,946	13,812	2046/7/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	25,881	23,773	2047/11/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	31,691	27,928	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	32,905	28,435	2049/11/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	37,945	31,608	2050/2/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	57,765	44,678	2051/12/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	58,301	44,966	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	58,009	44,880	2052/3/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.38	63,898	47,117	2054/1/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	65,103	47,665	2054/5/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.3	71,959	51,860	2055/3/10
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	74,860	53,664	2055/11/10
第167回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	75,844	54,503	2056/4/10
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.58	83,075	59,460	2057/10/10
第299回一般担保住宅金融支援機構債券		0.767	100,000	37,591	2060/3/19
小 計			3,136,431	2,728,775	
金融債券					
第41号商工債 (10年)		0.4	100,000	88,317	2032/3/19
小 計			100,000	88,317	
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	96,933	2028/9/20	
第527回東北電力株式会社社債 (一般担保付)	0.32	100,000	90,682	2031/2/25	
第338回北海道電力株式会社社債 (一般担保付)	0.84	100,000	77,425	2036/11/25	
第6回国際協力機構債券	2.098	100,000	99,893	2030/12/13	
第81回東日本高速道路株式会社社債 (一般担保付、独立行政法人)	0.23	100,000	90,788	2031/4/23	
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	89,349	2033/11/28	
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	96,798	2028/9/14	
第25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)	0.854	100,000	96,185	2029/10/17	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債 (社)	0.687	100,000	96,965	2028/11/2	
第59回住友化学株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付)	0.355	100,000	97,258	2028/4/17	
第55回三井化学株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付)	0.68	100,000	62,076	2041/12/3	
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	89,712	2031/6/3	
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	98,868	2028/12/13	

銘	柄	当 期 末			
		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	0.709	100,000	97,284	2028/9/14
第31回トヨタ自動車株式会社	無担保社債(特定社債間限定同等特	0.735	100,000	88,262	2033/6/1
第85回丸紅株式会社	無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.2	100,000	100,751	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	99,400	2028/9/8
第61回株式会社三井住友銀行	無担保社債(社債間限定同順位特約	2.113	100,000	99,261	2031/4/24
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	0.648	100,000	93,645	2030/6/20
第97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	1.703	100,000	96,714	2030/11/29
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	93,672	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	93,022	2030/4/16
第19回ダイビル株式会社	無担保社債(特定社債間限定同順位特約	0.96	100,000	70,123	2039/7/19
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	95,237	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	96,676	2028/9/27
第155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	0.763	100,000	47,022	2050/7/20
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	101,116	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	74,679	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	98,734	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	97,956	2027/12/15
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	91,095	2031/1/20
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	90,330	2033/10/13
第72回東京電力パワーグリッド株式会社	社債(一般担保付)	1.568	100,000	87,756	2034/4/18
第51回東京瓦斯株式会社	無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.693	100,000	48,298	2049/5/21
第37回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2023		1.214	100,000	97,773	2028/12/14
第12回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(202		0.793	100,000	99,072	2027/9/17
小	計		3,600,000	3,240,810	
合	計		69,352,431	59,105,852	

(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

運用報告書

<第26期>

決算日 2026年3月31日

(計算期間 2025年4月1日～2026年3月31日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組 入 制 限	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。

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		N O M U R A - B P I 総 合 指 数		債 組 入 比	純 資 産 額
		期 騰	落 中 率	期 騰	落 中 率		
	円		%		%	%	百万円
22期(2022年３月31日)	13,919		△1.2	381.04	△1.2	99.6	80,918
23期(2023年３月31日)	13,687		△1.7	374.74	△1.7	99.2	55,320
24期(2024年４月１日)	13,372		△2.3	365.95	△2.3	99.3	58,924
25期(2025年３月31日)	12,759		△4.6	349.16	△4.6	99.4	62,305
26期(2026年３月31日)	12,073		△5.4	330.41	△5.4	99.3	60,133

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		N O M U R A - B P I 総 合 指 数		債 組 入 比
		騰 落	率	騰 落	率	
(期 首)	円		%		%	%
2025年３月31日	12,759		－	349.16	－	99.4
４月末	12,832		0.6	351.19	0.6	99.5
５月末	12,667		△0.7	346.68	△0.7	99.3
６月末	12,736		△0.2	348.51	△0.2	99.4
７月末	12,606		△1.2	344.96	△1.2	99.3
８月末	12,568		△1.5	343.89	△1.5	99.2
９月末	12,556		△1.6	343.62	△1.6	99.4
10月末	12,578		△1.4	344.19	△1.4	99.3
11月末	12,434		△2.5	340.28	△2.5	99.3
12月末	12,279		△3.8	336.03	△3.8	99.4
2026年１月末	12,124		△5.0	331.79	△5.0	99.2
２月末	12,298		△3.6	336.58	△3.6	99.2
(期 末)						
2026年３月31日	12,073		△5.4	330.41	△5.4	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2025 年 4 月 1 日～2026 年 3 月31 日)

該当事項はございません。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2025 年 4 月 1 日～2026 年 3 月31 日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国債証券	18,327,499	16,067,113
	地方債証券	246,685	292,013
	特殊債券	239,502	598,307
	社債券（投資法人債券を含む）	489,868	(55,814)
			694,472

(注) 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) 単位未満は切り捨て。
(注) ()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) 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。

○ 利害関係人との取引状況等

(2025 年 4 月 1 日～2026 年 3 月31 日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 —	百万円 —	百万円 98

(注) 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。

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あり、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

(2026年3月31日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	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	58,476,000 (620,000)	50,374,866 (627,181)	83.8 (1.0)	— (—)	50.6 (0.1)	25.6 (0.9)	7.6 (—)
地方債証券	3,400,000 (3,400,000)	3,129,800 (3,129,800)	5.2 (5.2)	— (—)	2.7 (2.7)	2.0 (2.0)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	3,246,911 (3,246,911)	2,875,447 (2,875,447)	4.8 (4.8)	— (—)	2.5 (2.5)	1.5 (1.5)	0.8 (0.8)
金融債券	100,000 (100,000)	89,211 (89,211)	0.1 (0.1)	— (—)	0.1 (0.1)	— (—)	— (—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,600,000 (3,600,000)	3,270,248 (3,270,248)	5.4 (5.4)	— (—)	1.7 (1.7)	2.9 (2.9)	0.8 (0.8)
合 計	68,822,911 (10,966,911)	59,739,572 (9,991,887)	99.3 (16.6)	— (—)	57.7 (7.2)	31.9 (7.3)	9.8 (2.1)

(注) ()内は非上場債で内書きです。
(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注) 単位未満は切り捨て。
(注) —印は組み入れなし。
(注) 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) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第474回利付国債 (2年)		0.7	270,000	268,385	2027/7/1
第475回利付国債 (2年)		0.9	470,000	468,115	2027/8/1
第476回利付国債 (2年)		0.9	490,000	487,741	2027/9/1
第477回利付国債 (2年)		1.0	60,000	59,774	2027/10/1
第478回利付国債 (2年)		1.0	120,000	119,486	2027/11/1
第479回利付国債 (2年)		1.0	170,000	169,180	2027/12/1
第154回利付国債 (5年)		0.1	190,000	186,882	2027/9/20
第155回利付国債 (5年)		0.3	100,000	98,308	2027/12/20
第156回利付国債 (5年)		0.2	230,000	225,722	2027/12/20
第157回利付国債 (5年)		0.2	480,000	469,329	2028/3/20
第158回利付国債 (5年)		0.1	460,000	448,895	2028/3/20
第159回利付国債 (5年)		0.1	200,000	194,382	2028/6/20
第160回利付国債 (5年)		0.2	250,000	243,515	2028/6/20
第161回利付国債 (5年)		0.3	330,000	322,149	2028/6/20
第162回利付国債 (5年)		0.3	400,000	389,116	2028/9/20
第163回利付国債 (5年)		0.4	520,000	507,093	2028/9/20
第164回利付国債 (5年)		0.2	300,000	289,956	2028/12/20
第167回利付国債 (5年)		0.4	430,000	416,326	2029/3/20
第168回利付国債 (5年)		0.6	460,000	448,044	2029/3/20
第169回利付国債 (5年)		0.5	30,000	29,131	2029/3/20
第170回利付国債 (5年)		0.6	550,000	533,813	2029/6/20
第172回利付国債 (5年)		0.5	240,000	232,166	2029/6/20
第173回利付国債 (5年)		0.6	240,000	231,991	2029/9/20
第174回利付国債 (5年)		0.7	470,000	455,862	2029/9/20
第175回利付国債 (5年)		0.9	330,000	321,264	2029/12/20
第176回利付国債 (5年)		1.0	250,000	244,302	2029/12/20
第177回利付国債 (5年)		1.1	570,000	559,010	2029/12/20
第178回利付国債 (5年)		1.0	490,000	477,426	2030/3/20
第179回利付国債 (5年)		1.0	360,000	349,596	2030/6/20
第180回利付国債 (5年)		1.1	140,000	136,530	2030/6/20
第181回利付国債 (5年)		1.3	430,000	421,799	2030/9/20
第182回利付国債 (5年)		1.4	460,000	453,228	2030/9/20
第183回利付国債 (5年)		1.6	180,000	178,588	2030/12/20
第1回クライメート・トランジション利付国債 (5年)		0.3	230,000	223,017	2028/12/20
第2回クライメート・トランジション利付国債 (5年)		0.5	319,000	308,587	2029/6/20
第120回利付国債 (20年)		1.6	100,000	99,547	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)		1.9	140,000	140,928	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)		1.8	60,000	60,148	2030/9/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	100,000	99,561	2031/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	240,000	228,842	2034/3/20
第1回利付国債 (40年)		2.4	180,000	152,011	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)		2.2	160,000	128,368	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)		2.2	130,000	102,494	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)		2.2	130,000	100,454	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)		2.0	100,000	72,674	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)		1.9	90,000	63,185	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	125,000	82,942	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)		1.4	165,000	99,242	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)		0.4	193,000	79,720	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)		0.9	190,000	94,192	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)		0.8	142,000	66,578	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)		0.5	131,000	52,878	2059/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第13回利付国債 (40年)		0.5	207,000	82,617	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)		0.7	210,000	89,959	2061/3/20
第15回利付国債 (40年)		1.0	270,000	128,544	2062/3/20
第16回利付国債 (40年)		1.3	280,000	146,493	2063/3/20
第17回利付国債 (40年)		2.2	310,000	214,870	2064/3/20
第18回利付国債 (40年)		3.1	180,000	157,365	2065/3/20
第1回クライメート・トランジション利付国債 (10年)		0.7	180,000	161,753	2033/12/20
第2回クライメート・トランジション利付国債 (10年)		1.0	360,000	330,040	2034/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	110,000	108,584	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	220,000	216,389	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	230,000	225,335	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	340,000	331,792	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	180,000	174,943	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	230,000	222,617	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)		0.1	360,000	347,004	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	460,000	441,388	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)		0.1	410,000	391,529	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	430,000	408,383	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	390,000	368,550	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	390,000	366,603	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	360,000	336,528	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)		0.1	590,000	548,493	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)		0.1	420,000	388,340	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)		0.1	380,000	349,508	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)		0.1	350,000	320,085	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)		0.1	340,000	309,131	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)		0.1	360,000	325,389	2031/12/20
第366回利付国債 (10年)		0.2	380,000	343,535	2032/3/20
第367回利付国債 (10年)		0.2	560,000	503,132	2032/6/20
第368回利付国債 (10年)		0.2	640,000	571,532	2032/9/20
第369回利付国債 (10年)		0.5	480,000	435,153	2032/12/20
第370回利付国債 (10年)		0.5	430,000	387,829	2033/3/20
第371回利付国債 (10年)		0.4	720,000	641,059	2033/6/20
第372回利付国債 (10年)		0.8	680,000	620,302	2033/9/20
第373回利付国債 (10年)		0.6	640,000	571,660	2033/12/20
第374回利付国債 (10年)		0.8	540,000	487,425	2034/3/20
第375回利付国債 (10年)		1.1	530,000	487,721	2034/6/20
第376回利付国債 (10年)		0.9	470,000	423,197	2034/9/20
第377回利付国債 (10年)		1.2	520,000	477,926	2034/12/20
第378回利付国債 (10年)		1.4	500,000	465,505	2035/3/20
第379回利付国債 (10年)		1.5	250,000	233,897	2035/6/20
第380回利付国債 (10年)		1.7	260,000	246,620	2035/9/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	40,000	41,626	2029/9/20
第5回利付国債 (30年)		2.2	5,000	5,093	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)		2.4	70,000	71,965	2031/11/20
第8回利付国債 (30年)		1.8	45,000	44,485	2032/11/22
第11回利付国債 (30年)		1.7	135,000	131,903	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	90,000	90,144	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	70,000	69,488	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	120,000	122,289	2034/3/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	50,000	51,180	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	160,000	162,222	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	155,000	155,578	2035/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第19回利付国債 (30年)		2.3	110,000	110,209	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	50,000	50,817	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	100,000	99,722	2035/12/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	50,000	50,334	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	220,000	216,645	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	180,000	178,372	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	70,000	69,565	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	300,000	296,178	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	290,000	281,358	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	230,000	219,162	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	220,000	205,579	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	215,000	201,775	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	70,000	62,746	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	220,000	200,783	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	80,000	70,466	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	170,000	148,362	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	90,000	76,595	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	180,000	149,331	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	110,000	92,329	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	150,000	123,222	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	20,000	16,080	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	20,000	16,002	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	30,000	23,886	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	130,000	103,226	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	250,000	190,222	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	320,000	242,073	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	140,000	107,339	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	200,000	146,858	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	220,000	160,569	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	150,000	95,706	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	97,000	54,242	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	200,000	116,620	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	160,000	94,819	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	170,000	104,971	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	150,000	91,900	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)		0.8	160,000	97,264	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)		0.8	160,000	96,508	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	200,000	119,706	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)		0.7	210,000	121,472	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)		0.9	190,000	114,923	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)		0.7	210,000	119,542	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	210,000	111,965	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)		0.4	220,000	112,714	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)		0.4	230,000	116,695	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)		0.4	150,000	75,373	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	130,000	64,662	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)		0.6	170,000	89,185	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)		0.6	240,000	124,742	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)		0.7	180,000	95,644	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)		0.7	160,000	84,254	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)		0.7	165,000	86,100	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)		0.7	150,000	77,565	2051/9/20
第73回利付国債 (30年)		0.7	200,000	102,490	2051/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第74回利付国債 (30年)		1.0	190,000	106,295	2052/3/20
第75回利付国債 (30年)		1.3	180,000	109,272	2052/6/20
第76回利付国債 (30年)		1.4	170,000	105,632	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)		1.6	140,000	91,407	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)		1.4	220,000	135,671	2053/3/20
第79回利付国債 (30年)		1.2	200,000	115,990	2053/6/20
第80回利付国債 (30年)		1.8	170,000	115,744	2053/9/20
第81回利付国債 (30年)		1.6	170,000	109,461	2053/12/20
第82回利付国債 (30年)		1.8	146,000	98,776	2054/3/20
第83回利付国債 (30年)		2.2	200,000	148,920	2054/6/20
第84回利付国債 (30年)		2.1	140,000	101,549	2054/9/20
第85回利付国債 (30年)		2.3	170,000	129,043	2054/12/20
第86回利付国債 (30年)		2.4	130,000	100,869	2055/3/20
第87回利付国債 (30年)		2.8	118,000	100,000	2055/6/20
第88回利付国債 (30年)		3.2	110,000	101,105	2055/9/20
第89回利付国債 (30年)		3.4	80,000	76,440	2055/12/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	90,000	91,017	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	210,000	212,958	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	220,000	222,780	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	70,000	70,954	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	100,000	101,648	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)		2.4	180,000	183,952	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)		2.3	50,000	50,990	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	20,000	20,307	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	190,000	193,106	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)		2.2	120,000	122,248	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)		2.1	170,000	172,891	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	160,000	161,883	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	90,000	91,035	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)		2.1	150,000	152,599	2029/3/20
第112回利付国債 (20年)		2.1	320,000	325,593	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	210,000	213,593	2029/9/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	120,000	122,463	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	100,000	102,028	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)		2.1	220,000	223,643	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	10,000	10,118	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)		1.8	100,000	100,373	2030/6/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	70,000	71,036	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	120,000	121,228	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	80,000	81,532	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	120,000	121,176	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	80,000	80,400	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	100,000	100,381	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	100,000	99,880	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	150,000	149,589	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	150,000	148,807	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	80,000	79,215	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	20,000	19,876	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	130,000	128,468	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	80,000	78,608	2032/3/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	100,000	97,423	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	90,000	88,276	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	220,000	216,403	2032/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第141回利付国債	(20年)	1.7	150,000	147,246	2032/12/20
第142回利付国債	(20年)	1.8	40,000	39,514	2032/12/20
第143回利付国債	(20年)	1.6	130,000	126,509	2033/3/20
第144回利付国債	(20年)	1.5	50,000	48,338	2033/3/20
第145回利付国債	(20年)	1.7	220,000	214,953	2033/6/20
第146回利付国債	(20年)	1.7	330,000	321,472	2033/9/20
第147回利付国債	(20年)	1.6	240,000	231,412	2033/12/20
第149回利付国債	(20年)	1.5	280,000	266,078	2034/6/20
第150回利付国債	(20年)	1.4	160,000	150,216	2034/9/20
第151回利付国債	(20年)	1.2	200,000	183,818	2034/12/20
第152回利付国債	(20年)	1.2	355,000	324,761	2035/3/20
第153回利付国債	(20年)	1.3	155,000	142,451	2035/6/20
第154回利付国債	(20年)	1.2	130,000	117,869	2035/9/20
第155回利付国債	(20年)	1.0	210,000	185,801	2035/12/20
第156回利付国債	(20年)	0.4	80,000	66,146	2036/3/20
第157回利付国債	(20年)	0.2	160,000	128,321	2036/6/20
第158回利付国債	(20年)	0.5	280,000	230,370	2036/9/20
第159回利付国債	(20年)	0.6	240,000	198,096	2036/12/20
第160回利付国債	(20年)	0.7	270,000	223,738	2037/3/20
第161回利付国債	(20年)	0.6	260,000	211,255	2037/6/20
第162回利付国債	(20年)	0.6	372,000	299,898	2037/9/20
第163回利付国債	(20年)	0.6	350,000	279,828	2037/12/20
第164回利付国債	(20年)	0.5	340,000	266,203	2038/3/20
第165回利付国債	(20年)	0.5	338,000	262,325	2038/6/20
第166回利付国債	(20年)	0.7	570,000	450,813	2038/9/20
第167回利付国債	(20年)	0.5	370,000	282,491	2038/12/20
第168回利付国債	(20年)	0.4	640,000	477,740	2039/3/20
第169回利付国債	(20年)	0.3	257,000	187,327	2039/6/20
第170回利付国債	(20年)	0.3	210,000	151,672	2039/9/20
第171回利付国債	(20年)	0.3	210,000	150,286	2039/12/20
第172回利付国債	(20年)	0.4	200,000	144,134	2040/3/20
第173回利付国債	(20年)	0.4	236,000	168,539	2040/6/20
第174回利付国債	(20年)	0.4	250,000	176,997	2040/9/20
第175回利付国債	(20年)	0.5	230,000	164,160	2040/12/20
第176回利付国債	(20年)	0.5	180,000	127,398	2041/3/20
第177回利付国債	(20年)	0.4	200,000	137,886	2041/6/20
第178回利付国債	(20年)	0.5	230,000	159,944	2041/9/20
第179回利付国債	(20年)	0.5	210,000	144,790	2041/12/20
第180回利付国債	(20年)	0.8	230,000	165,880	2042/3/20
第181回利付国債	(20年)	0.9	170,000	123,821	2042/6/20
第182回利付国債	(20年)	1.1	130,000	97,299	2042/9/20
第183回利付国債	(20年)	1.4	260,000	203,265	2042/12/20
第184回利付国債	(20年)	1.1	170,000	125,497	2043/3/20
第185回利付国債	(20年)	1.1	190,000	139,285	2043/6/20
第186回利付国債	(20年)	1.5	180,000	140,664	2043/9/20
第187回利付国債	(20年)	1.3	190,000	142,566	2043/12/20
第188回利付国債	(20年)	1.6	250,000	196,627	2044/3/20
第189回利付国債	(20年)	1.9	110,000	90,570	2044/6/20
第190回利付国債	(20年)	1.8	70,000	56,459	2044/9/20
第191回利付国債	(20年)	2.0	130,000	108,005	2044/12/20
第192回利付国債	(20年)	2.4	170,000	150,223	2045/3/20
第193回利付国債	(20年)	2.5	140,000	125,280	2045/6/20
第194回利付国債	(20年)	2.7	140,000	128,895	2045/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第195回利付国債（20年）		3.2	110,000	108,946	2045/12/20
小 計			58,476,000	50,374,866	
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	92,844	2039/9/20
第31回東京都公募公債（20年）		1.238	100,000	91,430	2034/9/20
令和5年度第9回北海道公募公債（5年）		0.507	100,000	97,215	2028/11/30
第20回神奈川県公募公債（20年）		1.706	100,000	97,751	2032/6/18
第425回大阪府公募公債（10年）		0.195	100,000	98,131	2027/10/29
第9回兵庫県公募公債（20年）		2.25	100,000	101,739	2029/11/19
第38回兵庫県公募公債（20年）		0.352	100,000	71,901	2039/6/20
第42回兵庫県公募公債（20年）		0.481	100,000	68,148	2041/6/21
第2回静岡県公募公債（グリーンボンド・5年）		0.324	100,000	97,408	2028/6/20
第5回静岡県公募公債（15年）		1.087	100,000	98,750	2028/11/20
第9回静岡県公募公債（15年）		0.739	100,000	95,153	2030/9/20
平成21年度第16回愛知県公募公債（20年）		2.218	100,000	101,618	2029/12/20
平成26年度第4回愛知県公募公債（20年）		1.542	100,000	94,295	2034/5/15
令和2年度第1回広島県公募公債（20年）		0.315	100,000	69,279	2040/4/17
第10回埼玉県公募公債（20年）		1.94	100,000	100,212	2030/11/12
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）		2.05	100,000	101,227	2028/12/20
平成26年度第1回福岡県公募公債（20年）		1.542	100,000	94,245	2034/5/26
第5回千葉県公募公債（20年）		2.26	100,000	101,741	2028/9/21
第22回千葉県公募公債（20年）		0.698	100,000	81,311	2037/4/15
平成30年度第1回新潟県公募公債		0.653	100,000	77,334	2038/8/20
第3回群馬県公募公債（20年）		1.687	100,000	97,613	2032/6/25
第204回共同発行市場公募地方債		0.05	100,000	93,269	2030/3/25
第207回共同発行市場公募地方債		0.15	100,000	93,103	2030/6/25
第272回共同発行市場公募地方債		1.811	100,000	94,205	2035/11/22
第13回京都市公募公債（20年）		1.359	100,000	92,047	2034/11/24
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）		0.674	100,000	50,781	2050/6/20
令和4年度第3回神戸市公募公債（5年）		0.2	100,000	98,051	2027/11/19
第26回横浜市公募公債（20年）		1.776	100,000	97,598	2033/1/28
第4回川崎市公募公債（20年）		2.35	100,000	101,816	2028/6/20
第19回北九州市公募公債（20年）		1.312	100,000	90,724	2035/6/19
平成23年度第4回福岡市公募公債（20年）		1.89	100,000	99,537	2031/8/19
平成25年度第1回福岡市公募公債（20年）		1.808	100,000	97,256	2033/7/19
平成26年度第2回福岡市公募公債（20年）		1.49	100,000	93,750	2034/6/20
平成29年度第1回相模原市公募公債		0.2	100,000	98,318	2027/9/17
小 計			3,400,000	3,129,800	
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	104,038	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	101,369	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	77,747	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	90,159	2035/2/28
第6回地方公共団体金融機構債券		2.242	100,000	101,457	2030/3/28
第13回地方公共団体金融機構債券		2.132	100,000	100,758	2031/1/28
第23回公営企業債券（20年）		2.29	200,000	202,588	2027/9/24
第24回公営企業債券（20年）		2.29	100,000	101,513	2028/4/25
第113回地方公共団体金融機構債券		0.299	100,000	96,710	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	95,303	2029/4/13
F197回地方公共団体金融機構債券		1.052	100,000	99,411	2027/10/29
第53回政府保証日本政策金融公庫債券		0.209	100,000	96,822	2028/9/15
第34回日本政策投資銀行債券		2.67	100,000	99,610	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	101,247	2029/12/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)					
第208回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.577	100,000	95,309	2033/12/28
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	94,082	2034/4/28
第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.149	100,000	78,406	2036/7/31
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	96,829	2028/7/31
第153回都市再生債券		1.09	100,000	51,049	2053/12/19
第101回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.205	100,000	98,722	2027/5/28
第188回都市再生債券		1.12	100,000	71,137	2043/6/19
第15回一般担保住宅金融支援機構債券		2.38	100,000	101,638	2028/3/17
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.34	20,780	20,867	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.28	11,739	11,813	2044/6/10
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.14	11,018	11,070	2044/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	15,087	15,034	2045/2/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	13,763	13,761	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	14,462	14,392	2045/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	14,162	14,086	2046/7/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	26,247	24,582	2047/11/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	32,092	28,849	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	33,335	29,535	2049/11/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	38,347	32,746	2050/2/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	58,486	45,923	2051/12/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	59,065	46,273	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	58,640	46,038	2052/3/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.38	64,699	48,713	2054/1/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	65,903	49,279	2054/5/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.3	72,944	53,750	2055/3/10
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	75,639	55,246	2055/11/10
第167回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	76,571	56,074	2056/4/10
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.58	83,932	61,223	2057/10/10
第299回一般担保住宅金融支援機構債券		0.767	100,000	40,279	2060/3/19
小 計			3,246,911	2,875,447	
金融債券					
第41号商工債(10年)		0.4	100,000	89,211	2032/3/19
小 計			100,000	89,211	
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	96,907	2028/9/20
第527回東北電力株式会社社債(一般担保付)		0.32	100,000	91,229	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	98,864	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	79,697	2036/11/25
第6回国際協力機構債券		2.098	100,000	100,594	2030/12/13
第81回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)		0.23	100,000	91,399	2031/4/23
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	90,948	2033/11/28
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	96,796	2028/9/14
第25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)		0.854	100,000	96,448	2029/10/17
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社)		0.687	100,000	97,004	2028/11/2
第59回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)		0.355	100,000	97,145	2028/4/17
第55回三井化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)		0.68	100,000	64,765	2041/12/3
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	90,394	2031/6/3
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	98,995	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)		0.709	100,000	97,306	2028/9/14
第31回トヨタ自動車株式会社無担保社債(特定社債間限定同等特)		0.735	100,000	89,647	2033/6/1
第85回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)		2.2	100,000	101,135	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	99,531	2028/9/8
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)		0.648	100,000	94,047	2030/6/20

銘	柄	当 期 末			
		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97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		1.703	100,000	97,367	2030/11/29
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	93,943	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	93,351	2030/ 4 /16
第19回ダイビル株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約		0.96	100,000	72,681	2039/ 7 /19
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	96,596	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	96,650	2028/ 9 /27
第155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		0.763	100,000	49,622	2050/ 7 /20
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	101,200	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	78,191	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	98,561	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	97,801	2027/12/15
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	91,643	2031/ 1 /20
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	91,927	2033/10/13
第72回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）		1.568	100,000	89,554	2034/ 4 /18
第51回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）		0.693	100,000	51,448	2049/ 5 /21
第37回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債（2023		1.214	100,000	97,875	2028/12/14
第12回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債（202		0.793	100,000	98,987	2027/ 9 /17
小	計		3,600,000	3,270,248	
合	計		68,822,911	59,739,572	

(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

(2026年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	59,739,572	98.7
コール・ローン等、その他	781,021	1.3
投資信託財産総額	60,520,593	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 (2026年3月31日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	60,520,593,929
コール・ローン等	327,112,642
公社債(評価額)	59,739,572,357
未収入金	355,446,600
未収利息	94,322,514
前払費用	4,139,816
(B) 負債	387,058,500
未払金	370,258,500
未払解約金	16,800,000
(C) 純資産総額(A－B)	60,133,535,429
元本	49,808,277,785
次期繰越損益金	10,325,257,644
(D) 受益権総口数	49,808,277,785口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,073円

- (注) 当ファンドの期首元本額は48,832,193,919円、期中追加設定元本額は8,229,328,421円、期中一部解約元本額は7,253,244,555円です。
- (注) 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) | 20,049,864,400円 |
| 日立バランスファンド(株式50) | 9,905,943,221円 |
| 日立国内債券インデックスファンド | 7,817,422,779円 |
| 日立バランスファンド(株式70) | 7,746,132,702円 |
| 日立バランスファンド(株式30) | 4,288,914,683円 |
- (注) 1口当たり純資産額は1.2073円です。

○損益の状況 (2025年4月1日～2026年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	636,363,476
受取利息	636,363,476
(B) 有価証券売買損益	△ 3,809,056,389
売買益	79,121,538
売買損	△ 3,888,177,927
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 3,172,692,913
(D) 前期繰越損益金	13,473,115,423
(E) 追加信託差損益金	1,973,190,579
(F) 解約差損益金	△ 1,948,355,445
(G) 計(C＋D＋E＋F)	10,325,257,644
次期繰越損益金(G)	10,325,257,644

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

○お知らせ

2025年4月1日に「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。