■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（設定日：2002年１月４日）
運用方針	マザーファンドを組み入れることにより、実質的に日本の公社債に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 **国内債券（NOMURA－BPI）マザーファンド** 日本の公社債および短期金融資産
当ファンドの運用方法	■マザーファンドを主要投資対象とし、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ■マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
組入制限	**当ファンド** ■株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。 **国内債券（NOMURA－BPI）マザーファンド** ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	■年１回（原則として毎年６月20日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 （基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

三井住友・日本債券インデックス・ファンド

【運用報告書（全体版）】

(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

第 18 期

決算日 2019年６月20日

受益者の皆さまへ

当ファンドはマザーファンドを組み入れることにより、実質的に日本の公社債に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

三井住友DSアセットマネジメント
（旧:三井住友アセットマネジメント）
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
https://www.smd-am.co.jp

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

フリーダイヤル　0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

最近５期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) NOMURA－BPI		債券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(総合)	期中騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
14期 (2015年６月22日)	12,357	0	2.2	363.07	2.4	99.2	39,836
15期 (2016年６月20日)	13,213	0	6.9	388.79	7.1	99.3	50,533
16期 (2017年６月20日)	12,881	0	△2.5	379.60	△2.4	99.3	56,163
17期 (2018年６月20日)	12,961	0	0.6	382.52	0.8	99.3	61,429
18期 (2019年６月20日)	13,328	0	2.8	393.94	3.0	99.6	73,772

※基準価額の騰落率は分配金込み。
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。
※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA－BPI		債券組入比率
		騰落率	(総合)	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2018年６月20日	12,961	－	382.52	－	99.3
６月末	12,965	0.0	382.67	0.0	98.9
７月末	12,940	△0.2	381.98	△0.1	99.3
８月末	12,868	△0.7	379.89	△0.7	99.3
９月末	12,835	△1.0	378.99	△0.9	99.5
10月末	12,856	△0.8	379.64	△0.8	99.4
11月末	12,908	△0.4	381.24	△0.3	99.4
12月末	13,001	0.3	384.13	0.4	99.4
2019年１月末	13,052	0.7	385.58	0.8	99.4
２月末	13,078	0.9	386.43	1.0	99.2
３月末	13,168	1.6	389.14	1.7	99.5
４月末	13,125	1.3	387.94	1.4	99.5
５月末	13,205	1.9	390.32	2.0	99.5
(期末)					
2019年６月20日	13,328	2.8	393.94	3.0	99.6

※騰落率は期首比です。
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

基準価額等の推移

※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期　首	12,961円
期　末	13,328円 （分配金0円（税引前）込み）
騰 落 率	+2.8% （分配金再投資ベース）

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金（税引前）を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。（以下、同じ）

※当ファンドのベンチマークは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）です。

※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ(総合)に連動する投資成果を目指しました。

上昇要因

●10月以降、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界的な景気減速懸念を背景に、国内金利が低下(債券価格は上昇)したこと

●景気下振れリスクへの警戒感から欧米で利下げ観測が高まるなか、海外金利の低下に追随し、期末にかけて国内金利の低下が進行したこと

下落要因

●７月、日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度としたことから国内金利が上昇(債券価格は下落)したこと

組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	騰落率	期末組入比率
国内債券(ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ)マザーファンド	国内債券	+3.0%	100.1%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。

長期金利は、期首からしばらくは0.0％台の狭い範囲で推移しましたが、７月末に日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の変動幅を従来の倍程度とすると、８月上旬には0.1％台半ばへと上昇しました。しかし、急速な金利上昇に対して日銀が臨時の国債買入れオペを実施したため、長期金利は低下に転じました。

10月には米国での利上げ観測を背景に海外金利が上昇していたこともあり、長期金利は再度0.1％台半ばへと上昇する場面もありました。しかしその後は、米中貿易摩擦問題や英国のＥＵ（欧州連合）離脱問題が警戒されるなか、株価の下落とともに長期金利は低下基調で推移しました。

期末にかけても、米中貿易摩擦問題や世界的に景気減速への警戒感が高まるなかで、欧米中央銀行がハト派（景気を重視する立場）化姿勢を示したことから、海外金利の低下とともに、国内長期金利は－0.1％台後半へ低下しました。

当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首の0.039％から期末には－0.165％へ低下しました。

ポートフォリオについて（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

当ファンド

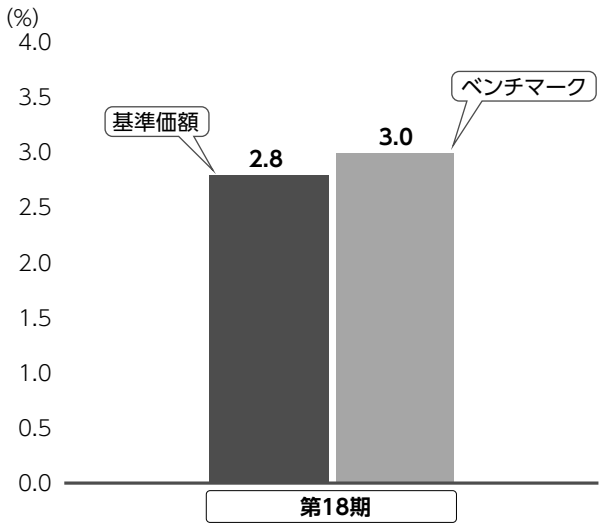
期を通じて主要投資対象である「国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド」を高位に組み入れました。

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

デュレーション（投資資金の平均回収期間）、残存期間別配分、種別配分ともに概ねベンチマークに合わせた運用を継続しました。

ベンチマークとの差異について（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

当期における基準価額の騰落率は＋2.8％（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの騰落率＋3.0％から0.2％下方乖離しました。

下方乖離要因

●信託報酬の支払いが、下方乖離要因となりました。

分配金について(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

(単位：円、１万口当たり、税引前)

項　目	第18期
当期分配金	－
(対基準価額比率)	(－%)
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	3,328

当期の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。

なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

主要投資対象である「国内債券(NOMURA－BPI)マザーファンド」を高位に組み入れます。

国内債券(NOMURA－BPI)マザーファンド

債券組入比率を高位に保ち、デュレーション、残存期間別配分、種別配分、流動性などを考慮した債券に分散投資することで、NOMURA―BPI(総合)との連動をできる限り高めるように運用を行います。

3 お知らせ

合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年４月１日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

約款変更について

委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。（適用日：2019年４月１日）

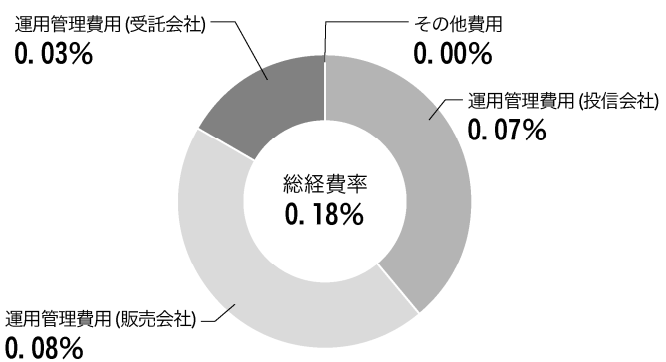
1万口当たりの費用明細(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

項　目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	22円	0.173%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(投信会社)	(8)	(0.065)	
(販売会社)	(10)	(0.076)	
(受託会社)	(4)	(0.032)	
(b) その他費用	0	0.003	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合　計	22	0.176	

期中の平均基準価額は13,000円です。

※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ています。
※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。
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。
※その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

参考情報 総経費率（年率換算）



※各費用は、前掲「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、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
※各比率は、年率換算した値（小数点以下第３位を四捨五入）です。
※上記の前提条件で算出しているため、「１万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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、売買委託手数料およ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（年率換算）は0.18%です。

当期中の売買及び取引の状況(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド	8,572,870	12,039,799	1,271,301	1,773,451

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

利害関係人との取引状況等(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

（１）利害関係人との取引状況

三井住友・日本債券インデックス・ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	26,583	4,179	15.7	19,429	1,905	9.8

※平均保有割合　61.8%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

（２）利害関係人の発行する有価証券等

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	－	－	202

(3)利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券
国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種　　類	買　付　額
	百万円
公　　社　　債	800

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、ＳＭＢＣ日興証券株式会社です。

第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

組入れ資産の明細(2019年６月20日現在)

親投資信託残高

種　　類	期首(前期末)	期末	
	口　数	口　数	評　価　額
	千口	千口	千円
国内債券（NOMURA－BPI）マザーファンド	44,056,986	51,358,555	73,833,058

※国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンドの期末の受益権総口数は80,135,880千口です。
※単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成

（2019年６月20日現在）

項　　目	期末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
国内債券（NOMURA－BPI）マザーファンド	73,833,058	99.9
コール・ローン等、その他	64,372	0.1
投資信託財産総額	73,897,430	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年６月20日現在）

項目	期末
(A) 資産	73,897,430,941円
コール・ローン等	64,055,522
国内債券（NOMURA-BPI）	73,833,058,801
マザーファンド（評価額）	
未収入金	316,618
(B) 負債	124,602,042
未払解約金	64,331,404
未払信託報酬	59,525,238
未払利息	136
その他未払費用	745,264
(C) 純資産総額（A－B）	73,772,828,899
元本	55,350,527,881
次期繰越損益金	18,422,301,018
(D) 受益権総口数	55,350,527,881口
１万口当たり基準価額(C/D)	13,328円

※当期における期首元本額47,394,976,812円、期中追加設定元本額15,801,587,570円、期中一部解約元本額7,846,036,501円です。
※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
※上記表中の受益権総口数および１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第７号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

損益の状況

（自2018年６月21日　至2019年６月20日）

項目	当期
(A) 配当等収益	△34,834円
支払利息	△34,834
(B) 有価証券売買損益	2,057,139,180
売買益	2,224,632,423
売買損	△167,493,243
(C) 信託報酬等	△115,902,738
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	1,941,201,608
(E) 前期繰越損益金	2,203,271,291
(F) 追加信託差損益金	14,277,828,119
（配当等相当額）	(13,220,624,604)
（売買損益相当額）	(1,057,203,515)
(G) 計（D＋E＋F）	18,422,301,018
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（G＋H）	18,422,301,018
追加信託差損益金	14,277,828,119
（配当等相当額）	(13,236,005,055)
（売買損益相当額）	(1,041,823,064)
分配準備積立金	4,195,854,461
繰越損益金	△51,381,562

※**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。
※**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。
※**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。
※期末における、費用控除後の配当等収益(621,940,563円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(14,226,446,557円)および分配準備積立金(3,573,913,898円)より分配可能額は18,422,301,018円（１万口当たり3,328円）ですが、分配は行っておりません。

分配金のお知らせ

１万口当たり分配金(税引前)	当期
	－円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第１項各号に該当する事項はありません。

国内債券（NOMURA−BPI）マザーファンド

第19期（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

信託期間	無期限（設定日：2000年６月21日）
運用方針	主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。

最近５期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク)NOMURA−BPI		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	(総合)	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
15期(2015年６月22日)	13,233	2.4	363.07	2.4	99.1	125,905
16期(2016年６月20日)	14,175	7.1	388.79	7.1	99.3	115,394
17期(2017年６月20日)	13,844	△2.3	379.60	△2.4	99.2	111,362
18期(2018年６月20日)	13,955	0.8	382.52	0.8	99.2	107,741
19期(2019年６月20日)	14,376	3.0	393.94	3.0	99.5	115,199

※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

当期中の基準価額と市況等の推移

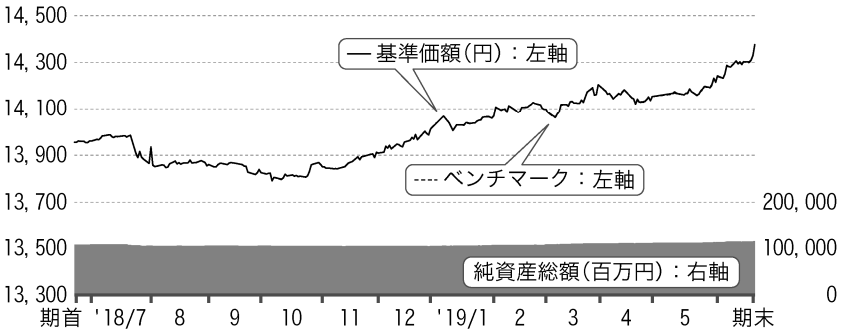
年月日	基準価額		(ベンチマーク)NOMURA−BPI		債券組入比率
		騰落率	(総合)	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2018年６月20日	13,955	−	382.52	−	99.2
６月末	13,960	0.0	382.67	0.0	98.9
７月末	13,935	△0.1	381.98	△0.1	99.3
８月末	13,860	△0.7	379.89	△0.7	99.3
９月末	13,826	△0.9	378.99	△0.9	99.4
10月末	13,851	△0.7	379.64	△0.8	99.4
11月末	13,909	△0.3	381.24	△0.3	99.3
12月末	14,011	0.4	384.13	0.4	99.4
2019年１月末	14,068	0.8	385.58	0.8	99.4
２月末	14,098	1.0	386.43	1.0	99.2
３月末	14,197	1.7	389.14	1.7	99.5
４月末	14,153	1.4	387.94	1.4	99.5
５月末	14,242	2.1	390.32	2.0	99.4
(期末)					
2019年６月20日	14,376	3.0	393.94	3.0	99.5

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

基準価額等の推移



期　首	13, 955円
期　末	14, 376円
騰 落 率	＋3. 0%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）です。
※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

当ファンドは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）に連動する投資成果を目指しました。

上昇要因	・10月以降、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界的な景気減速懸念を背景に、国内金利が低下（債券価格は上昇）したこと ・景気下振れリスクへの警戒感から欧米で利下げ観測が高まるなか、海外金利の低下に追随し、期末にかけて国内金利の低下が進行したこと
下落要因	・７月、日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度としたことから国内金利が上昇（債券価格は下落）したこと

▶投資環境について(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。

長期金利は、期首からしばらくは0.0%台の狭い範囲で推移しましたが、７月末に日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の変動幅を従来の倍程度とすると、８月上旬には0.1%台半ばへと上昇しました。しかし、急速な金利上昇に対して日銀が臨時の国債買入れオペを実施したため、長期金利は低下に転じました。

10月には米国での利上げ観測を背景に海外金利が上昇していたこともあり、長期金利は再度0.1%台半ばへと上昇する場面もありました。しかしその後は、米中貿易摩擦問題や英国のＥＵ（欧州連合）離脱問題が警戒されるなか、株価の下落とともに長期金利は低下基調で推移しました。

期末にかけても、米中貿易摩擦問題や世界的に景気減速への警戒感が高まるなかで、欧米中央銀行がハト派（景気を重視する立場）化姿勢を示したことから、海外金利の低下とともに、国内長期金利は－0.1%台後半へ低下しました。

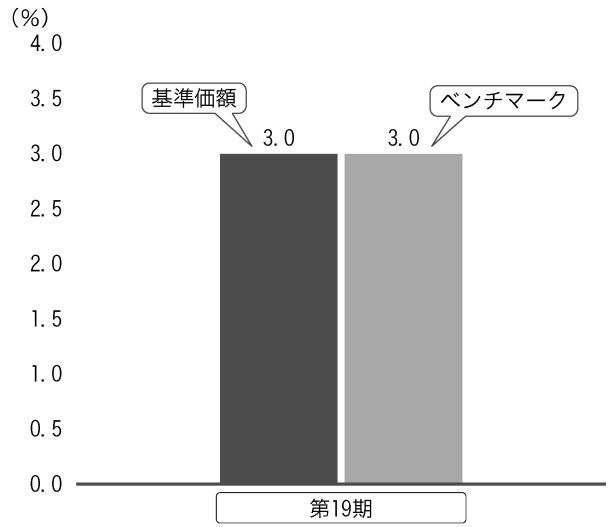
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首の0.039%から期末には－0.165%へ低下しました。

▶ポートフォリオについて(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間）、残存期間別配分、種別配分ともに概ねベンチマークに合わせた運用を継続しました。

▶ ベンチマークとの差異について(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）をベンチマークとしています。
左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】
当期における基準価額の騰落率は＋3.0％となり、ベンチマークの騰落率＋3.0％に概ね連動した運用成果となりました。

❷ 今後の運用方針

債券組入比率を高位に保ち、デュレーション、残存期間別配分、種別配分、流動性などを考慮した債券に分散投資することで、ＮＯＭＵＲＡ―ＢＰＩ（総合）との連動をできる限り高めるように運用を行います。

１万口当たりの費用明細(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

項　目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用	0円	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)	そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合　計	0	0.000	

期中の平均基準価額は14,009円です。

※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ています。
※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。
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

当期中の売買及び取引の状況(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

公社債

		買　付　額	売　付　額
		千円	千円
国内	国債証券	20,295,971	15,306,951
	地方債証券	2,758,624	2,212,530 (246,000)
	特殊債券	2,080,870	1,709,431 (941,587)
	社債券 (投資法人債券を含む)	1,448,243	200,682 (400,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)
※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。
※( )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。
※社債券(投資法人債券を含む)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(2018年６月21日から2019年６月20日まで)

(１)利害関係人との取引状況

区　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	26,583	4,179	15.7	19,429	1,905	9.8

(２)利害関係人の発行する有価証券等

種　類	買　付　額	売　付　額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	－	－	202

（３）利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
公　　社　　債	800

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、ＳＭＢＣ日興証券株式会社です。

第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2018年６月21日から2019年６月20日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

組入れ資産の明細（2019年６月20日現在）

公社債

Ａ　債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区　　分	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	79,723,000	89,776,323	77.9	－	55.4	17.3	5.2
	(10,957,000)	(12,463,939)	(10.8)	(－)	(9.4)	(1.4)	(－)
地方債証券	8,150,000	8,553,989	7.4	－	3.6	1.9	1.9
	(8,150,000)	(8,553,989)	(7.4)	(－)	(3.6)	(1.9)	(1.9)
特殊債券（除く金融債）	9,308,992	9,922,576	8.6	－	4.6	2.2	1.8
	(9,308,992)	(9,922,576)	(8.6)	(－)	(4.6)	(2.2)	(1.8)
金融債券	600,000	600,820	0.5	－	－	0.1	0.4
	(600,000)	(600,820)	(0.5)	(－)	(－)	(0.1)	(0.4)
普通社債券(含む投資法人債券)	5,600,000	5,774,324	5.0	－	2.2	2.1	0.8
	(5,400,000)	(5,566,643)	(4.8)	(－)	(2.1)	(2.0)	(0.8)
合　　計	103,381,992	114,628,033	99.5	－	65.9	23.6	10.1
	(34,415,992)	(37,107,968)	(32.2)	(－)	(19.8)	(7.6)	(4.9)

※（ ）内は非上場債で内書きです。
※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。
※－印は組入れなし。

Ｂ　個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	第395回　利付国債(２年)	0.1	600,000	602,826	2020/12/1
	第396回　利付国債(２年)	0.1	500,000	502,495	2021/1/1
	第400回　利付国債(２年)	0.1	570,000	573,511	2021/5/1
	第125回　利付国債(５年)	0.1	20,000	20,078	2020/9/20
	第126回　利付国債(５年)	0.1	340,000	341,659	2020/12/20
	第127回　利付国債(５年)	0.1	1,225,000	1,232,080	2021/3/20
	第128回　利付国債(５年)	0.1	655,000	659,401	2021/6/20
	第129回　利付国債(５年)	0.1	405,000	408,065	2021/9/20
	第130回　利付国債(５年)	0.1	440,000	443,700	2021/12/20
	第131回　利付国債(５年)	0.1	955,000	963,967	2022/3/20
	第132回　利付国債(５年)	0.1	275,000	277,862	2022/6/20
	第133回　利付国債(５年)	0.1	450,000	455,157	2022/9/20
	第134回　利付国債(５年)	0.1	830,000	840,399	2022/12/20
	第135回　利付国債(５年)	0.1	750,000	760,207	2023/3/20
	第136回　利付国債(５年)	0.1	850,000	862,529	2023/6/20
	第137回　利付国債(５年)	0.1	200,000	203,136	2023/9/20
	第138回　利付国債(５年)	0.1	850,000	864,118	2023/12/20
	第139回　利付国債(５年)	0.1	350,000	356,139	2024/3/20
	第２回　利付国債(40年)	2.2	132,000	203,545	2049/3/20
	第３回　利付国債(40年)	2.2	160,000	249,076	2050/3/20
	第４回　利付国債(40年)	2.2	200,000	314,702	2051/3/20
	第５回　利付国債(40年)	2.0	212,000	323,800	2052/3/20
	第６回　利付国債(40年)	1.9	215,000	324,387	2053/3/20
	第７回　利付国債(40年)	1.7	243,000	353,941	2054/3/20
	第８回　利付国債(40年)	1.4	260,000	355,196	2055/3/20
	第９回　利付国債(40年)	0.4	376,000	385,888	2056/3/20
	第10回　利付国債(40年)	0.9	383,000	460,913	2057/3/20
	第11回　利付国債(40年)	0.8	320,000	374,883	2058/3/20
	第12回　利付国債(40年)	0.5	35,000	37,155	2059/3/20
	第312回　利付国債(10年)	1.2	985,000	1,006,098	2020/12/20
	第313回　利付国債(10年)	1.3	1,020,000	1,047,336	2021/3/20
	第315回　利付国債(10年)	1.2	1,165,000	1,198,540	2021/6/20
	第317回　利付国債(10年)	1.1	1,100,000	1,133,077	2021/9/20
	第319回　利付国債(10年)	1.1	590,000	609,717	2021/12/20
	第320回　利付国債(10年)	1.0	575,000	592,773	2021/12/20
	第321回　利付国債(10年)	1.0	395,000	408,477	2022/3/20
	第322回　利付国債(10年)	0.9	460,000	474,425	2022/3/20
	第323回　利付国債(10年)	0.9	295,000	305,150	2022/6/20
	第324回　利付国債(10年)	0.8	545,000	562,107	2022/6/20
	第325回　利付国債(10年)	0.8	345,000	356,805	2022/9/20
	第326回　利付国債(10年)	0.7	620,000	640,788	2022/12/20
	第327回　利付国債(10年)	0.8	570,000	591,118	2022/12/20
	第328回　利付国債(10年)	0.6	900,000	929,097	2023/3/20
	第329回　利付国債(10年)	0.8	850,000	886,388	2023/6/20
	第330回　利付国債(10年)	0.8	560,000	585,502	2023/9/20

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種　類	銘　　柄	期　末			
		利　率	額面金額	評　価　額	償還年月日
	第332回　利付国債(10年)	0.6	595,000	618,431	2023/12/20
	第333回　利付国債(10年)	0.6	330,000	343,714	2024/３/20
	第334回　利付国債(10年)	0.6	345,000	360,111	2024/６/20
	第335回　利付国債(10年)	0.5	95,000	98,868	2024/９/20
	第336回　利付国債(10年)	0.5	115,000	119,908	2024/12/20
	第337回　利付国債(10年)	0.3	355,000	366,189	2024/12/20
	第338回　利付国債(10年)	0.4	607,000	630,545	2025/３/20
	第339回　利付国債(10年)	0.4	615,000	639,919	2025/６/20
	第340回　利付国債(10年)	0.4	883,000	920,306	2025/９/20
	第341回　利付国債(10年)	0.3	615,000	637,976	2025/12/20
	第342回　利付国債(10年)	0.1	960,000	984,057	2026/３/20
	第343回　利付国債(10年)	0.1	1,057,000	1,084,503	2026/６/20
	第344回　利付国債(10年)	0.1	970,000	996,160	2026/９/20
	第345回　利付国債(10年)	0.1	945,000	971,015	2026/12/20
	第346回　利付国債(10年)	0.1	640,000	657,945	2027/３/20
	第347回　利付国債(10年)	0.1	955,000	981,873	2027/６/20
	第348回　利付国債(10年)	0.1	595,000	611,767	2027/９/20
	第349回　利付国債(10年)	0.1	635,000	652,875	2027/12/20
	第350回　利付国債(10年)	0.1	765,000	786,473	2028/３/20
	第351回　利付国債(10年)	0.1	720,000	740,124	2028/６/20
	第352回　利付国債(10年)	0.1	905,000	929,706	2028/９/20
	第353回　利付国債(10年)	0.1	920,000	944,886	2028/12/20
	第354回　利付国債(10年)	0.1	910,000	934,342	2029/３/20
	第２回　利付国債(30年)	2.4	150,000	190,953	2030/２/20
	第４回　利付国債(30年)	2.9	160,000	215,307	2030/11/20
	第５回　利付国債(30年)	2.2	100,000	127,421	2031/５/20
	第７回　利付国債(30年)	2.3	180,000	234,973	2032/５/20
	第10回　利付国債(30年)	1.1	230,000	265,505	2033/３/20
	第11回　利付国債(30年)	1.7	150,000	186,082	2033/６/20
	第12回　利付国債(30年)	2.1	230,000	299,036	2033/９/20
	第14回　利付国債(30年)	2.4	220,000	297,195	2034/３/20
	第15回　利付国債(30年)	2.5	250,000	342,702	2034/６/20
	第16回　利付国債(30年)	2.5	175,000	240,614	2034/９/20
	第18回　利付国債(30年)	2.3	190,000	256,783	2035/３/20
	第19回　利付国債(30年)	2.3	160,000	216,960	2035/６/20
	第21回　利付国債(30年)	2.3	102,000	139,098	2035/12/20
	第22回　利付国債(30年)	2.5	149,000	208,580	2036/３/20
	第23回　利付国債(30年)	2.5	151,000	212,099	2036/６/20
	第24回　利付国債(30年)	2.5	135,000	190,100	2036/９/20
	第25回　利付国債(30年)	2.3	185,000	254,992	2036/12/20
	第26回　利付国債(30年)	2.4	219,000	306,556	2037/３/20
	第27回　利付国債(30年)	2.5	206,000	293,554	2037/９/20
	第28回　利付国債(30年)	2.5	271,000	388,529	2038/３/20
	第29回　利付国債(30年)	2.4	170,000	241,787	2038/９/20
	第30回　利付国債(30年)	2.3	270,000	380,956	2039/３/20
	第31回　利付国債(30年)	2.2	277,000	387,833	2039/９/20
	第32回　利付国債(30年)	2.3	347,000	495,602	2040/３/20
	第33回　利付国債(30年)	2.0	380,000	522,078	2040/９/20
	第34回　利付国債(30年)	2.2	359,000	511,284	2041/３/20

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第35回　利付国債(30年)	2.0	430,000	596,779	2041/9/20
	第36回　利付国債(30年)	2.0	225,000	313,791	2042/3/20
	第37回　利付国債(30年)	1.9	375,000	517,200	2042/9/20
	第38回　利付国債(30年)	1.8	330,000	449,687	2043/3/20
	第39回　利付国債(30年)	1.9	155,000	215,336	2043/6/20
	第40回　利付国債(30年)	1.8	285,000	390,011	2043/9/20
	第41回　利付国債(30年)	1.7	240,000	323,318	2043/12/20
	第42回　利付国債(30年)	1.7	230,000	310,612	2044/3/20
	第43回　利付国債(30年)	1.7	220,000	297,853	2044/6/20
	第44回　利付国債(30年)	1.7	267,000	361,955	2044/9/20
	第45回　利付国債(30年)	1.5	272,000	356,058	2044/12/20
	第46回　利付国債(30年)	1.5	335,000	439,476	2045/3/20
	第47回　利付国債(30年)	1.6	285,000	381,714	2045/6/20
	第48回　利付国債(30年)	1.4	305,000	393,337	2045/9/20
	第49回　利付国債(30年)	1.4	305,000	394,127	2045/12/20
	第50回　利付国債(30年)	0.8	340,000	386,875	2046/3/20
	第51回　利付国債(30年)	0.3	297,000	299,616	2046/6/20
	第52回　利付国債(30年)	0.5	307,000	325,334	2046/9/20
	第53回　利付国債(30年)	0.6	282,000	306,212	2046/12/20
	第54回　利付国債(30年)	0.8	120,000	136,768	2047/3/20
	第55回　利付国債(30年)	0.8	260,000	296,251	2047/6/20
	第56回　利付国債(30年)	0.8	325,000	370,695	2047/9/20
	第57回　利付国債(30年)	0.8	295,000	336,373	2047/12/20
	第58回　利付国債(30年)	0.8	560,000	639,167	2048/3/20
	第59回　利付国債(30年)	0.7	280,000	311,956	2048/6/20
	第60回　利付国債(30年)	0.9	330,000	386,357	2048/9/20
	第61回　利付国債(30年)	0.7	360,000	401,198	2048/12/20
	第62回　利付国債(30年)	0.5	80,000	84,600	2049/3/20
	第48回　利付国債(20年)	2.5	368,000	383,106	2020/12/21
	第50回　利付国債(20年)	1.9	223,000	231,349	2021/3/22
	第52回　利付国債(20年)	2.1	210,000	221,075	2021/9/21
	第54回　利付国債(20年)	2.2	275,000	291,791	2021/12/20
	第56回　利付国債(20年)	2.0	320,000	341,638	2022/6/20
	第58回　利付国債(20年)	1.9	300,000	321,234	2022/9/20
	第59回　利付国債(20年)	1.7	280,000	299,269	2022/12/20
	第61回　利付国債(20年)	1.0	140,000	146,643	2023/3/20
	第63回　利付国債(20年)	1.8	156,000	168,912	2023/6/20
	第64回　利付国債(20年)	1.9	210,000	229,391	2023/9/20
	第65回　利付国債(20年)	1.9	370,000	406,285	2023/12/20
	第69回　利付国債(20年)	2.1	200,000	222,622	2024/3/20
	第70回　利付国債(20年)	2.4	380,000	431,064	2024/6/20
	第72回　利付国債(20年)	2.1	300,000	337,587	2024/9/20
	第74回　利付国債(20年)	2.1	278,000	314,509	2024/12/20
	第75回　利付国債(20年)	2.1	230,000	261,581	2025/3/20
	第78回　利付国債(20年)	1.9	340,000	384,621	2025/6/20
	第82回　利付国債(20年)	2.1	288,000	331,070	2025/9/20
	第84回　利付国債(20年)	2.0	424,000	487,180	2025/12/20
	第85回　利付国債(20年)	2.1	332,000	385,528	2026/3/20
	第88回　利付国債(20年)	2.3	329,000	388,746	2026/6/20

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第90回　利付国債(20年)	2.2	418,000	493,607	2026/９/20
	第92回　利付国債(20年)	2.1	295,000	347,843	2026/12/20
	第93回　利付国債(20年)	2.0	242,000	284,778	2027/３/20
	第95回　利付国債(20年)	2.3	186,000	224,338	2027/６/20
	第97回　利付国債(20年)	2.2	400,000	481,328	2027/９/20
	第99回　利付国債(20年)	2.1	337,000	404,359	2027/12/20
	第100回　利付国債(20年)	2.2	310,000	376,222	2028/３/20
	第102回　利付国債(20年)	2.4	285,000	352,567	2028/６/20
	第105回　利付国債(20年)	2.1	337,000	409,077	2028/９/20
	第107回　利付国債(20年)	2.1	418,000	509,604	2028/12/20
	第109回　利付国債(20年)	1.9	315,000	379,237	2029/３/20
	第111回　利付国債(20年)	2.2	393,000	486,734	2029/６/20
	第113回　利付国債(20年)	2.1	395,000	487,003	2029/９/20
	第114回　利付国債(20年)	2.1	323,000	399,664	2029/12/20
	第116回　利付国債(20年)	2.2	320,000	401,030	2030/３/20
	第118回　利付国債(20年)	2.0	245,000	302,714	2030/６/20
	第119回　利付国債(20年)	1.8	210,000	254,790	2030/６/20
	第121回　利付国債(20年)	1.9	200,000	245,648	2030/９/20
	第122回　利付国債(20年)	1.8	225,000	273,793	2030/９/20
	第123回　利付国債(20年)	2.1	205,000	257,311	2030/12/20
	第124回　利付国債(20年)	2.0	240,000	298,452	2030/12/20
	第125回　利付国債(20年)	2.2	155,000	197,133	2031/３/20
	第126回　利付国債(20年)	2.0	185,000	230,896	2031/３/20
	第127回　利付国債(20年)	1.9	190,000	234,881	2031/３/20
	第128回　利付国債(20年)	1.9	240,000	297,561	2031/６/20
	第129回　利付国債(20年)	1.8	210,000	257,823	2031/６/20
	第130回　利付国債(20年)	1.8	360,000	443,174	2031/９/20
	第131回　利付国債(20年)	1.7	225,000	274,203	2031/９/20
	第132回　利付国債(20年)	1.7	270,000	330,048	2031/12/20
	第133回　利付国債(20年)	1.8	205,000	253,175	2031/12/20
	第134回　利付国債(20年)	1.8	163,000	201,808	2032/３/20
	第135回　利付国債(20年)	1.7	165,000	202,166	2032/３/20
	第136回　利付国債(20年)	1.6	205,000	248,546	2032/３/20
	第137回　利付国債(20年)	1.7	130,000	159,760	2032/６/20
	第138回　利付国債(20年)	1.5	150,000	180,415	2032/６/20
	第139回　利付国債(20年)	1.6	160,000	194,536	2032/６/20
	第140回　利付国債(20年)	1.7	540,000	665,150	2032/９/20
	第141回　利付国債(20年)	1.7	190,000	234,549	2032/12/20
	第142回　利付国債(20年)	1.8	190,000	237,123	2032/12/20
	第143回　利付国債(20年)	1.6	200,000	244,656	2033/３/20
	第144回　利付国債(20年)	1.5	355,000	429,372	2033/３/20
	第145回　利付国債(20年)	1.7	322,000	399,457	2033/６/20
	第146回　利付国債(20年)	1.7	330,000	410,229	2033/９/20
	第147回　利付国債(20年)	1.6	530,000	652,472	2033/12/20
	第148回　利付国債(20年)	1.5	472,000	575,122	2034/３/20
	第149回　利付国債(20年)	1.5	277,000	338,297	2034/６/20
	第150回　利付国債(20年)	1.4	485,000	585,860	2034/９/20
	第151回　利付国債(20年)	1.2	595,000	701,308	2034/12/20
	第152回　利付国債(20年)	1.2	400,000	471,860	2035/３/20

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第153回　利付国債(20年)	1.3	332,000	397,543	2035/6/20
	第154回　利付国債(20年)	1.2	515,000	608,987	2035/9/20
	第155回　利付国債(20年)	1.0	310,000	356,729	2035/12/20
	第156回　利付国債(20年)	0.4	480,000	504,542	2036/3/20
	第157回　利付国債(20年)	0.2	423,000	430,068	2036/6/20
	第158回　利付国債(20年)	0.5	455,000	485,448	2036/9/20
	第159回　利付国債(20年)	0.6	363,000	393,535	2036/12/20
	第160回　利付国債(20年)	0.7	435,000	479,252	2037/3/20
	第161回　利付国債(20年)	0.6	475,000	514,710	2037/6/20
	第162回　利付国債(20年)	0.6	415,000	449,366	2037/9/20
	第163回　利付国債(20年)	0.6	475,000	513,935	2037/12/20
	第164回　利付国債(20年)	0.5	435,000	462,757	2038/3/20
	第165回　利付国債(20年)	0.5	340,000	361,311	2038/6/20
	第166回　利付国債(20年)	0.7	440,000	484,369	2038/9/20
	第167回　利付国債(20年)	0.5	555,000	589,565	2038/12/20
	第168回　利付国債(20年)	0.4	305,000	318,096	2039/3/20
小計		－	79,723,000	89,776,323	－
地方債証券	第１回　東京都公募公債(20年)	1.54	200,000	212,400	2023/6/20
	第７回　東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	113,557	2025/9/19
	第８回　東京都公募公債(30年)	2.23	100,000	135,400	2038/9/17
	第13回　東京都公募公債(30年)	1.93	200,000	267,194	2042/3/19
	第681回　東京都公募公債	1.4	200,000	202,106	2020/3/19
	平成21年度第16回　北海道公募公債	1.44	100,000	101,094	2020/3/25
	平成26年度第13回　北海道公募公債	0.461	100,000	102,514	2024/12/26
	平成29年度第５回　北海道公募公債	0.18	100,000	101,411	2027/6/30
	平成29年度第６回　北海道公募公債(５年)	0.01	200,000	199,972	2022/7/28
	第７回　神奈川県公募公債(20年)	2.22	200,000	234,290	2027/3/19
	第192回　神奈川県公募公債	0.805	100,000	102,635	2022/9/20
	第147回　大阪府公募公債(５年)	0.001	100,000	100,022	2023/2/27
	第333回　大阪府公募公債(10年)	1.47	100,000	100,746	2019/12/25
	第337回　大阪府公募公債(10年)	1.44	100,000	101,242	2020/4/28
	第361回　大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	102,795	2022/6/28
	第395回　大阪府公募公債(10年)	0.435	200,000	205,038	2025/4/28
	平成27年度第11回　京都府公募公債	0.469	200,000	206,300	2025/12/18
	平成30年度第６回　京都府公募公債	0.03	200,000	200,386	2023/9/20
	第５回　兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	111,685	2028/5/26
	第９回　兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	122,928	2029/11/19
	平成21年度第25回　兵庫県公募公債	1.54	200,000	201,292	2019/11/20
	平成22年度第１回　兵庫県公募公債	1.46	100,000	101,212	2020/4/16
	第７回　静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	136,135	2043/6/19
	平成20年度第１回　静岡県公募公債	2.18	100,000	113,719	2025/9/19
	平成21年度第10回　静岡県公募公債	1.4	100,000	101,050	2020/3/18
	平成26年度第10回　静岡県公募公債	0.515	100,000	102,879	2024/11/25
	平成21年度第８回　愛知県公募公債(10年)	1.39	100,000	100,388	2019/9/30
	平成26年度第14回　愛知県公募公債(10年)	0.535	100,000	102,992	2024/11/28
	平成26年度第18回　愛知県公募公債(10年)	0.44	100,000	102,629	2025/3/27
	平成29年度第16回　愛知県公募公債(10年)	0.26	100,000	102,204	2028/2/14
	平成26年度第１回　広島県公募公債	0.67	100,000	103,380	2024/5/27
	第13回　埼玉県公募公債(20年)	1.599	100,000	119,996	2033/5/20

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	平成26年度第４回　埼玉県公募公債	0.654	100,000	103,356	2024/６/26
	平成27年度第２回　埼玉県公募公債(５年)	0.137	100,000	100,121	2020/４/16
	平成29年度第２回　埼玉県公募公債(５年)	0.01	200,000	200,086	2022/４/19
	平成25年度第11回　福岡県公募公債	0.694	100,000	103,324	2024/２/26
	平成26年度第５回　福岡県公募公債	0.525	200,000	205,784	2024/10/28
	平成21年度第11回　千葉県公募公債	1.42	200,000	201,698	2020/１/24
	平成26年度第３回　千葉県公募公債	0.611	300,000	309,570	2024/７/25
	平成26年度第５回　千葉県公募公債	0.476	200,000	205,416	2024/12/25
	令和元年度第２回　千葉県公募公債	0.01	100,000	100,123	2024/５/24
	第11回　群馬県公募公債(10年)	0.505	100,000	102,825	2024/11/25
	第79回　共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	200,934	2019/10/25
	第82回　共同発行市場公募地方債	1.42	200,000	201,698	2020/１/24
	第84回　共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	101,061	2020/３/25
	第91回　共同発行市場公募地方債	0.9	300,000	303,666	2020/10/23
	第115回　共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	308,088	2022/10/25
	第137回　共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	103,007	2024/８/23
	第140回　共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,825	2024/11/25
	第149回　共同発行市場公募地方債	0.5	100,000	103,183	2025/８/25
	第154回　共同発行市場公募地方債	0.405	150,000	153,958	2026/１/23
	第175回　共同発行市場公募地方債	0.215	200,000	203,512	2027/10/25
	平成23年度第４回　京都市公募公債	1.067	100,000	102,685	2021/12/22
	第16回　横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	121,681	2028/９/21
	平成27年度第５回　福岡市公募公債	0.476	100,000	103,124	2025/10/28
	平成27年度第７回　福岡市公募公債(５年)	0.101	100,000	100,169	2020/12/24
	平成29年度第11回　福岡市公募公債(５年)	0.04	300,000	300,504	2023/３/16
小計		－	8,150,000	8,553,989	－
特殊債券(除く金融債)	第14回　政府保証地方公共団体金融機構債券(６年)	0.199	200,000	200,536	2020/６/18
	第１回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.51	12,628	12,921	2036/５/10
	第１回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.08	14,910	15,660	2037/11/10
	第２回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.61	12,909	13,254	2036/５/10
	第５回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.76	13,270	13,676	2036/11/10
	第９回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	9,983	10,015	2037/12/10
	第９回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.19	14,364	15,084	2037/５/10
	第10回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	10,719	10,805	2038/２/10
	第10回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.15	14,847	15,603	2037/５/10
	第12回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	11,515	11,720	2038/９/10
	第14回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.7	15,674	16,017	2032/５/10
	第18回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	11,447	11,673	2039/５/10
	第29回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	30,552	33,122	2044/10/10
	第30回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	13,125	13,484	2040/５/10
	第32回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	15,594	16,221	2040/７/10
	第32回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	29,777	31,995	2045/１/10
	第35回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	16,500	17,282	2040/10/10
	第37回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	15,476	16,221	2040/12/10
	第37回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	32,756	34,930	2045/６/10
	第40回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	16,940	17,946	2041/３/10
	第42回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	14,639	15,431	2041/５/10
	第48回　貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.33	14,625	15,468	2041/11/10
	第49回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	33,082	35,368	2046/６/10

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第51回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	36,453	38,942	2046/8/10
	第55回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	47,650	50,766	2046/12/10
	第57回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	45,359	48,339	2047/2/10
	第59回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	46,450	49,545	2047/4/10
	第67回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	52,593	55,339	2047/12/10
	第69回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	53,577	56,877	2048/2/10
	第70回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	47,351	50,046	2048/3/10
	第73回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	53,090	56,478	2048/6/10
	第88回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	57,683	60,278	2049/9/10
	第113回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	88,871	90,355	2051/10/10
	第123回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	92,621	94,727	2052/8/10
	第124回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	92,787	94,669	2052/9/10
	第125回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,091	95,013	2052/10/10
	第130回　一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	100,000	121,581	2032/12/20
	第132回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	95,483	97,344	2053/5/10
	第138回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	98,028	100,721	2053/11/10
	第146回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	100,000	100,292	2054/7/10
	第２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	15,876	16,728	2042/6/10
	第３回　貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.09	15,697	16,566	2037/11/10
	第27回　道路債券	2.42	100,000	111,488	2024/3/20
	第32回　道路債券	2.44	100,000	112,542	2024/9/20
	第42回　道路債券	2.22	100,000	112,505	2025/3/21
	第12回　地方公共団体金融機構債券	1.38	100,000	101,306	2020/5/28
	第61回　地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	103,333	2024/6/28
	第９回　政府保証日本政策投資銀行社債	1.0	101,000	102,336	2020/9/14
	第15回　政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	105,184	2021/12/22
	第22回　政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	109,095	2023/6/19
	第29回　政府保証日本政策投資銀行社債	0.165	300,000	301,413	2021/6/22
	第34回　政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	500,000	501,005	2022/6/30
	第42回　政府保証日本政策投資銀行社債	0.155	100,000	101,745	2027/12/15
	第６回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	206,656	2021/2/26
	第79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	121,074	2029/4/27
	第92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	122,145	2029/10/31
	第99回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	123,588	2030/1/31
	第100回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	101,017	2020/2/28
	第104回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	202,538	2020/4/30
	第112回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	101,302	2020/7/31
	第120回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	101,322	2020/10/30
	第173回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	300,000	308,721	2022/9/30
	第207回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	200,000	206,974	2023/12/28
	第209回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	100,000	103,808	2024/1/31
	第220回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	300,000	310,788	2024/6/28
	第221回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.466	100,000	119,625	2034/6/30
	第227回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	300,000	309,753	2024/9/30
	第246回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	100,000	116,022	2035/5/31
	第333回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	101,752	2027/12/28
	第339回　政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	100,000	102,136	2028/2/29
	第203回　政府保証預金保険機構債	0.1	200,000	200,188	2020/1/17
	第208回　政府保証預金保険機構債	0.1	400,000	400,880	2020/10/6

国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）マザーファンド

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第66回　日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位	0.09	100,000	100,240	2026/4/17
	第４回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	100,000	137,797	2035/12/20
	第22回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	314,208	2047/3/20
	第37回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	121,544	2028/6/20
	第122回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.704	200,000	206,824	2024/3/19
	第１回　政府保証地方公共団体金融機構債券(８年)	0.576	200,000	202,904	2021/9/24
	第４回　公営企業債券(20年)	2.09	200,000	217,906	2023/9/20
	第９回　地方公共団体金融機構債券	1.476	200,000	202,054	2020/2/28
	第16回　地方公共団体金融機構債券(５年)	0.175	100,000	100,059	2019/10/28
	第18回　公営企業債券(20年)	2.58	100,000	117,676	2026/6/19
	第22回　公営企業債券(20年)	2.32	200,000	236,606	2027/6/18
	第39回　地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	102,611	2022/8/26
	第48回　地方公共団体金融機構債券(20年)	1.121	100,000	114,098	2035/12/28
	第59回　地方公共団体金融機構債券(10年)	0.724	100,000	103,583	2024/4/26
	第62回　地方公共団体金融機構債券	0.631	300,000	309,252	2024/7/26
	第281回　地方公共団体金融機構債券	0.999	100,000	111,639	2033/9/21
	第６回　独立行政法人福祉医療機構債券	2.11	100,000	112,024	2025/3/19
	第190回　一般担保住宅金融支援機構債券	0.08	100,000	100,251	2026/6/19
小計		－	9,308,992	9,922,576	－
金融債券	い第776号　商工債	0.17	100,000	100,099	2020/1/27
	第298回　信金中金債(５年)	0.2	200,000	200,096	2019/9/27
	第304回　信金中金債(５年)	0.225	200,000	200,370	2020/3/27
	第350回　信金中金債(５年)	0.08	100,000	100,255	2024/1/26
小計		－	600,000	600,820	－
普通社債券(含む投資法人債券)	第499回　中部電力	1.194	100,000	104,325	2023/6/23
	第507回　中部電力	0.605	100,000	102,973	2026/1/23
	第527回　関西電力	0.28	200,000	201,202	2024/4/25
	第476回　東北電力	0.57	100,000	102,275	2025/1/24
	第508回　東北電力	0.465	200,000	203,254	2029/4/25
	第253回　四国電力	1.0	100,000	103,633	2023/6/23
	第328回　北海道電力	0.42	100,000	100,894	2023/1/25
	第13回　大和ハウス工業	0.285	100,000	101,058	2027/6/1
	第10回　アサヒグループホールディングス	0.17	100,000	100,252	2022/6/13
	第30回　東レ	0.375	100,000	101,358	2027/7/16
	第７回　クラレ	0.19	100,000	100,653	2025/4/25
	第56回　住友化学	0.38	100,000	101,334	2027/9/13
	第47回　三井化学	0.26	100,000	100,609	2025/6/19
	第24回　三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	101,540	2028/2/25
	第11回　ブリヂストン	0.295	200,000	201,850	2027/4/21
	第３回　新日鐵住金	0.22	100,000	100,493	2024/5/20
	第７回　ジェイテクト	0.345	100,000	101,115	2028/3/8
	第12回　パナソニック	0.387	100,000	100,255	2020/3/19
	第13回　パナソニック	0.568	100,000	101,361	2022/3/18
	第１回　明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	0.51	100,000	100,031	2019/8/7
	第１回　ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.14	100,000	100,319	2022/2/22
	第51回　住友商事	1.241	100,000	109,311	2029/4/23
	第69回　クレディセゾン	0.18	100,000	100,182	2023/6/19
	第25回　三菱東京ＵＦＪ銀行	1.31	100,000	101,717	2020/11/12
	第57回　東京三菱銀行	2.22	100,000	107,211	2022/10/27

種類	銘柄	期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
	第１回　三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	102,701	2024/９/12
	第９回　三菱ＵＦＪ信託銀行	1.68	100,000	102,901	2021/４/28
	第１回　みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	102,867	2024/７/16
	第20回　三井住友銀行	2.21	100,000	100,195	2019/７/24
	第49回　日産フィナンシャルサービス	0.2	200,000	199,670	2023/３/20
	第１回　野村ホールディングス	0.3	100,000	100,358	2023/９/４
	第65回　三菱地所	2.04	100,000	122,480	2032/12/20
	第73回　東京急行電鉄	1.422	100,000	102,116	2020/12/16
	第38回　京王電鉄	0.295	100,000	101,717	2027/11/29
	第24回　東日本旅客鉄道	1.71	100,000	105,529	2022/９/20
	第32回　東日本旅客鉄道	2.26	100,000	110,483	2024/３/19
	第69回　東日本旅客鉄道	1.222	100,000	101,329	2020/７/22
	第126回　東日本旅客鉄道	0.275	200,000	203,156	2028/１/26
	第10回　西日本旅客鉄道	2.04	100,000	108,557	2023/９/20
	第13回　西日本旅客鉄道	2.34	100,000	116,863	2027/２/19
	第７回　東海旅客鉄道	2.2	100,000	106,323	2022/５/10
	第13回　東海旅客鉄道	2.015	100,000	108,899	2023/12/20
	第32回　東海旅客鉄道	2.31	100,000	117,678	2027/９/17
	第63回　日本電信電話	0.69	100,000	102,623	2023/３/20
	第27回　ＫＤＤＩ	0.23	100,000	100,636	2026/４/24
	第38回　電源開発	0.978	100,000	103,636	2023/12/20
	第24回　東京電力パワーグリッド	0.61	100,000	100,787	2024/４/24
	第19回　大阪瓦斯	1.83	100,000	101,321	2020/３/19
	第７回　ファーストリテイリング	0.405	100,000	101,496	2028/６/６
	第２回　ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20	0.645	100,000	100,494	2023/７/12
	第11回　ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,304	2021/１/22
小計		－	5,600,000	5,774,324	－
合計		－	103,381,992	114,628,033	－

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

投資信託財産の構成

（2019年６月20日現在）

項目	期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	114,628,033	99.1
コール・ローン等、その他	1,018,011	0.9
投資信託財産総額	115,646,044	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年６月20日現在）

項目	期末
(A) 資産	115,646,044,557円
コール・ローン等	643,152,553
公社債（評価額）	114,628,033,462
未収入金	203,016,000
未収利息	168,365,591
前払費用	3,476,951
(B) 負債	446,299,321
未払金	380,113,300
未払解約金	66,171,967
未払利息	1,373
その他未払費用	12,681
(C) 純資産総額（A－B）	115,199,745,236
元本	80,135,880,996
次期繰越損益金	35,063,864,240
(D) 受益権総口数	80,135,880,996口
１万口当たり基準価額(C/D)	14,376円

※当期における期首元本額77,206,605,986円、期中追加設定元本額14,411,029,736円、期中一部解約元本額11,481,754,726円です。
※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本債券インデックス・ファンド	51,358,555,093円
ＳＭＡＭ・国内債券インデックス・ファンド	6,464,912,583円
国内債券インデックスファンドＶＡ<適格機関投資家限定>	183,803,285円
ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	22,128,610,035円

※上記表中の受益権総口数および１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第７号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

損益の状況

（自2018年６月21日　至2019年６月20日）

項目	当期
(A) 配当等収益	1,063,086,913円
受取利息	1,063,468,235
支払利息	△381,322
(B) 有価証券売買損益	2,196,854,630
売買益	2,566,114,512
売買損	△369,259,882
(C) 信託報酬等	△370,473
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	3,259,571,070
(E) 前期繰越損益金	30,535,280,643
(F) 追加信託差損益金	5,827,965,696
(G) 解約差損益金	△4,558,953,169
(H) 計 (D+E+F+G)	35,063,864,240
次期繰越損益金（H）	35,063,864,240

※**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。
※**信託報酬等**には、保管費用等を含めて表示しています。
※**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。
※**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

＜約款変更について＞

委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。（適用日：2019年４月１日）