

■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（評価益を含みません。）等の金額とします。 ■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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">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。)</div> |

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)】

(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

第 **21** 期

決算日 2022年6月20日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

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。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<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

コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

三井住友・日本債券インデックス・ファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | (ベンチマーク) NOMURA-BPI | | 公社債 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 |
| 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 |
| 19期(2020年6月22日) | 13,080 | 0 | △1.9 | 387.27 | △1.7 | 99.7 | 77,709 |
| 20期(2021年6月21日) | 13,056 | 0 | △0.2 | 387.33 | 0.0 | 99.6 | 77,986 |
| 21期(2022年6月20日) | 12,636 | 0 | △3.2 | 375.58 | △3.0 | 99.6 | 73,917 |

※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 | | 公社債 組入比率 |
|------------|--------|------|------------------------|------|-------------|
| | | 騰落率 | (総合) | 騰落率 | |
| (期首) | 円 | % | | % | % |
| 2021年6月21日 | 13,056 | — | 387.33 | — | 99.6 |
| 6月末 | 13,040 | △0.1 | 386.90 | △0.1 | 99.5 |
| 7月末 | 13,102 | 0.4 | 388.81 | 0.4 | 99.5 |
| 8月末 | 13,090 | 0.3 | 388.46 | 0.3 | 99.5 |
| 9月末 | 13,043 | △0.1 | 387.12 | △0.1 | 99.6 |
| 10月末 | 13,026 | △0.2 | 386.72 | △0.2 | 99.6 |
| 11月末 | 13,056 | 0.0 | 387.65 | 0.1 | 99.5 |
| 12月末 | 13,025 | △0.2 | 386.84 | △0.1 | 99.5 |
| 2022年1月末 | 12,931 | △1.0 | 384.06 | △0.8 | 99.5 |
| 2月末 | 12,863 | △1.5 | 382.13 | △1.3 | 99.5 |
| 3月末 | 12,825 | △1.8 | 381.04 | △1.6 | 99.6 |
| 4月末 | 12,792 | △2.0 | 380.12 | △1.9 | 99.6 |
| 5月末 | 12,771 | △2.2 | 379.54 | △2.0 | 99.5 |
| (期末) | | | | | |
| 2022年6月20日 | 12,636 | △3.2 | 375.58 | △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(2021年6月22日から2022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 | 13,056円 |
| 期末 | 12,636円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | -3.2% (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(2021年6月22日から2022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)の動きに連動する投資成果を目指しました。

下落要因

- 欧米の中央銀行のタカ派(インフレ抑制を重視する立場)姿勢が強まったことによる海外金利の上昇に追随し、国内金利が上昇(債券価格は下落)したこと
- 商品市況の高騰や円安による物価上昇を受け、日銀による緩和政策が修正されるとの思惑から金利が上昇したこと

投資環境について(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

日本の長期金利の代表とされる10年国債利回りは上昇(債券価格は下落)しました。

長期金利は期初からしばらくは低水準で推移しました。9月には自民党の総裁選に向けて新政権に対する政策期待の高まりから株価の上昇が進んだことに加え、欧米債券市場で中央銀行による金融政策の正常化を見込んだ金利上昇が続いたことから、長期金利は上昇しました。

11月から12月にかけては、新たな変異ウイルス(オミクロン型)の感染拡大による景気への悪影響が懸念され、金利は低下する局面もありました。しかし、インフレの長期化懸念を背景に欧米中央銀行のタカ派姿勢が強まる中、欧米の長期金利が上昇基調で推移したことや、日銀が緩和修正を検討しているとの観測報道を受け、長期金利は上昇しました。

2月に日銀が指値オペ(日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れるオペ)の実

施を通じて長期金利の上昇を止める姿勢を示したことや、ロシアによるウクライナ侵攻が景気の先行き不透明感を高めたことから、長期金利は低下しました。しかし、地政学リスクの高まりを受け商品市況が上昇しインフレ懸念が強まる中、欧米の中央銀行による利上げペースが速まるとの観測や日銀による緩和政策の修正が意識され、長期金利は上昇しました。

4月の日銀金融政策決定会合では、緩和政策維持と共に指値オペの原則毎営業日実施が決定されたことから、長期金利の上昇は一服しました。その後も欧米中央銀行の利上げペース加速を受け金利上昇圧力がかかりましたが、日銀が金利上昇抑制姿勢を強めたことから、期末にかけて長期金利は横ばい圏で推移しました。

ポートフォリオについて(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

当ファンド

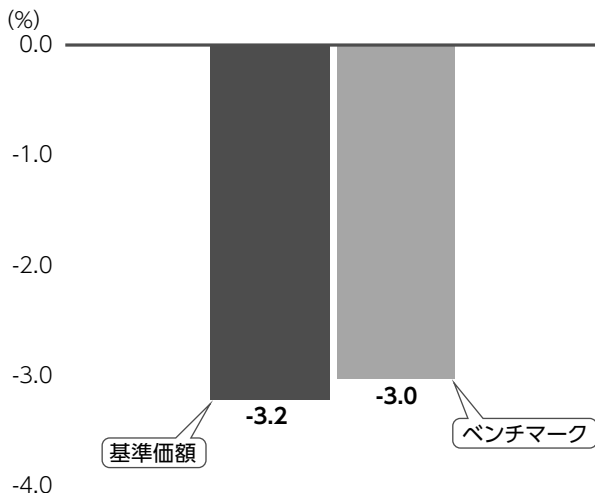
期を通じて主要投資対象である「国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド」を高位に組み入れました。

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 (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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。

※基準価額は分配金再投資ベース

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は-3.2% (分配金再投資ベース) となり、ベンチマークの騰落率-3.0%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬の支払い

分配金について(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目 | 第21期 |
|-----------|---------|
| 当期分配金 | 0 |
| (対基準価額比率) | (0.00%) |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,399 |

※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。

期間の分配は、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、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。

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

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・日本債券インデックス・ファンド

1万口当たりの費用明細(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|---|
| (a) 信託報酬 | 23円 | 0.175% | 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) 期中の平均基準価額は12,954円です。 |
| (投 信 会 社) | (9) | (0.066) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| (販 売 会 社) | (10) | (0.077) | 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) | (4) | (0.033) | 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 |
| (b) 売買委託手数料 | － | － | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 |
| (株 式) | (－) | (－) | 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先物・オプション) | (－) | (－) | |
| (投資信託証券) | (－) | (－) | |
| (c) 有価証券取引税 | － | － | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 |
| (株 式) | (－) | (－) | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (公 社 債) | (－) | (－) | |
| (投資信託証券) | (－) | (－) | |
| (d) その他費用 | 0 | 0.002 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (－) | (－) | 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.002) | 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| (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 | 23 | 0.178 | |

※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。

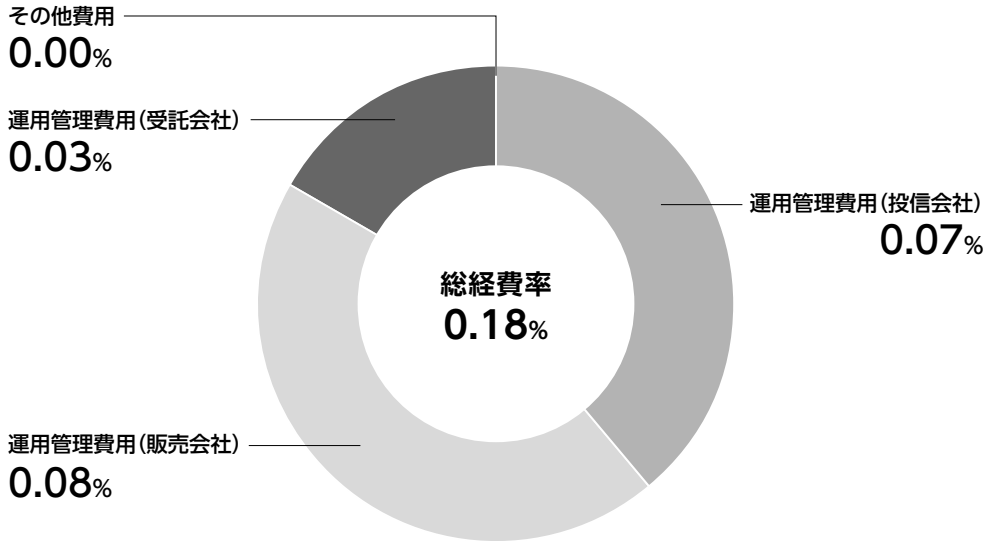
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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2位未満を四捨五入)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 (2021年6月22日から2022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 |
| 国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド | 千口 3,833,722 | 千円 5,386,978 | 千口 5,076,017 | 千円 7,127,077 |

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年6月22日から2022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 | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| 公 社 債 | 百万円 42,831 | 百万円 583 | % 1.4 | 百万円 38,508 | 百万円 2,230 | % 5.8 |

※平均保有割合 63.3%

※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 |
|-------|----------|----------|------------|
| 公 社 債 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 100 |

三井住友・日本債券インデックス・ファンド

(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 |
|-------|------------|
| 公 社 債 | 百万円 500 |

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、SMB C日興証券株式会社、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

■ 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 (2021年6月22日から2022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 (2022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 |
| 国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド | 千口 55,225,948 | 千口 53,983,654 | 千円 73,984,597 |

※国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンドの期末の受益権総口数は89,046,647,330口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年6月20日現在)

| 項 目 | 期 | 末 |
|---------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド | 千円 73,984,597 | % 99.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 126,084 | 0.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 74,110,682 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年6月20日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 74,110,682,651円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 69,863,460 |
| 国内債券 (NOMURA-BPI) | 73,984,597,867 |
| マザーファンド (評価額) | |
| 未 収 入 金 | 56,221,324 |
| (B) 負 債 | 192,944,041 |
| 未 払 解 約 金 | 126,070,658 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 66,047,724 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 825,659 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 73,917,738,610 |
| 元 本 | 58,495,931,316 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 15,421,807,294 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 58,495,931,316口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 12,636円 |

※当期における期首元本額59,732,792,349円、期中追加設定元本額10,796,044,176円、期中一部解約元本額12,032,905,209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2021年6月22日 至2022年6月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 29,890円 |
| 受 取 利 息 | 4,534 |
| 支 払 利 息 | △ 34,424 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 2,222,645,877 |
| 売 買 損 益 | 110,600,908 |
| 売 買 損 益 | △ 2,333,246,785 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 136,398,239 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 2,359,074,006 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,262,461,699 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 16,518,419,601 |
| (配 当 等 相 当 額) | (16,405,384,171) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (113,035,430) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 15,421,807,294 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 15,421,807,294 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 16,518,419,601 |
| (配 当 等 相 当 額) | (16,413,757,040) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (104,662,561) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 3,474,283,052 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 4,570,895,359 |

※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。
※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|---------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 440,050,545円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 16,413,757,040 |
| (d) 分配準備積立金 | 3,034,232,507 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 19,888,040,092 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 3,399.90 |
| (f) 分配金 | 0 |
| 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

■ 分配金のお知らせ

| | 当 期 |
|---------------------------|-----|
| 1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前) | 0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22期(2021年6月22日から2022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。 |

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (ベンチマーク)NOMURA-BPI | | 公社債組入比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------|-------|---------|---------|
| | | 期中騰落率 | (総合) | 期中騰落率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 20期(2020年6月22日) | 14,134 | △1.7 | 387.27 | △1.7 | 99.6 | 125,640 |
| 21期(2021年6月21日) | 14,134 | 0.0 | 387.33 | 0.0 | 99.5 | 122,582 |
| 22期(2022年6月20日) | 13,705 | △3.0 | 375.58 | △3.0 | 99.5 | 122,039 |

※NOMURA-BPI(総合)は、野村証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証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証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、野村証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

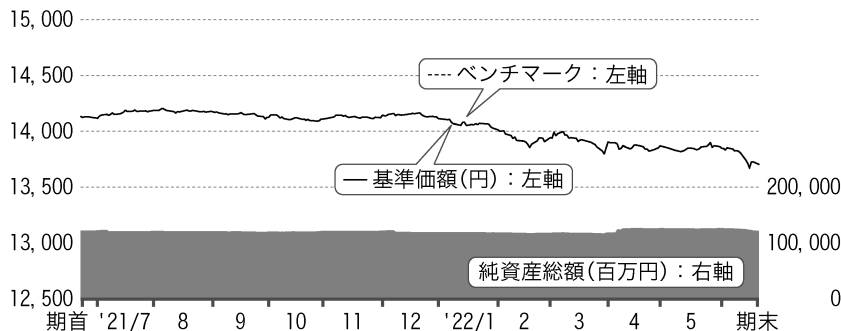
| 年月日 | 基準価額 | | (ベンチマーク)NOMURA-BPI | | 公社債組入比率 |
|------------|--------|------|--------------------|------|---------|
| | | 騰落率 | (総合) | 騰落率 | |
| (期首) | 円 | % | | % | % |
| 2021年6月21日 | 14,134 | - | 387.33 | - | 99.5 |
| 6月末 | 14,117 | △0.1 | 386.90 | △0.1 | 99.5 |
| 7月末 | 14,187 | 0.4 | 388.81 | 0.4 | 99.5 |
| 8月末 | 14,176 | 0.3 | 388.46 | 0.3 | 99.4 |
| 9月末 | 14,127 | △0.0 | 387.12 | △0.1 | 99.5 |
| 10月末 | 14,111 | △0.2 | 386.72 | △0.2 | 99.5 |
| 11月末 | 14,146 | 0.1 | 387.65 | 0.1 | 99.4 |
| 12月末 | 14,114 | △0.1 | 386.84 | △0.1 | 99.5 |
| 2022年1月末 | 14,014 | △0.8 | 384.06 | △0.8 | 99.5 |
| 2月末 | 13,943 | △1.4 | 382.13 | △1.3 | 99.4 |
| 3月末 | 13,904 | △1.6 | 381.04 | △1.6 | 99.6 |
| 4月末 | 13,870 | △1.9 | 380.12 | △1.9 | 99.5 |
| 5月末 | 13,849 | △2.0 | 379.54 | △2.0 | 99.5 |
| (期末) | | | | | |
| 2022年6月20日 | 13,705 | △3.0 | 375.58 | △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 (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 14,134円 |
| 期末 | 13,705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、野村証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証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証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、野村証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 (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

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

下落要因

- ・ 欧米の中央銀行のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢が強まったことによる海外金利の上昇に追随し、国内金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- ・ 商品市況の高騰や円安による物価上昇を受け、日銀による緩和政策が修正されるとの思惑から金利が上昇したこと

▶ 投資環境について (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

日本の長期金利の代表とされる10年国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。

長期金利は期初からしばらくは低水準で推移しました。9月には自民党の総裁選に向けて新政権に対する政策期待の高まりから株価の上昇が進んだことに加え、欧米債券市場で中央銀行による金融政策の正常化を見込んだ金利上昇が続いたことから、長期金利は上昇しました。

11月から12月にかけては、新たな変異ウイルス（オミクロン型）の感染拡大による景気への悪影響が懸念され、金利は低下する局面もありました。しかし、インフレの長期化懸念を背景に欧米中央銀行のタカ派姿勢が強まる中、欧米の長期金利が上昇基調で推移したことや、日銀が緩和修正を検討しているとの観測報道を受け、長期金利は上昇しました。

2月に日銀が指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れるオペ）の実施を通じて長期金利の上昇を止める姿勢を示したことや、ロシアによるウクライナ侵攻が景気の先行き不透明感を高めたことから、長期金利は低下しました。しかし、地政学リスクの高まりを受け商品市況が上昇しインフレ懸念が強まる中、欧米の中央銀行による利上げペースが速まるとの観測や日銀による緩和政策の修正が意識され、長期金利は上昇しました。

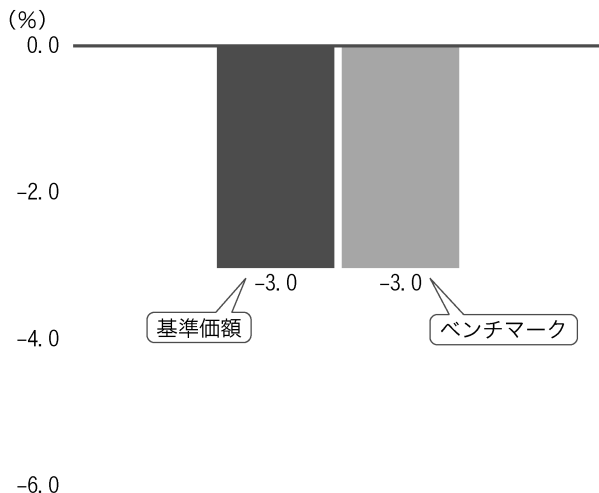
4月の日銀金融政策決定会合では、緩和政策維持と共に指値オペの原則毎営業日実施が決定されたことから、長期金利の上昇は一服しました。その後も欧米中央銀行の利上げペース加速を受け金利上昇圧力がかかりましたが、日銀が金利上昇抑制姿勢を強めたことから、期末にかけて長期金利は横ばい圏で推移しました。

▶ ポートフォリオについて (2021年6月22日から2022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 (2021年6月22日から2022年6月20日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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】

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。

2 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。

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 0円 (0) | 0.000% (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：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14,036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(2021年6月22日から2022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 | 35,854,805 | 35,494,837 |
| | 地方債証券 | 4,264,771 | 1,104,108 |
| | 特殊債証券 | — | 1,003,842 (176,061) |
| | 社債証券 | 2,712,170 | 905,321 |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※()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。

※社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年6月22日から2022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 | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| 公社債 | 百万円 42,831 | 百万円 583 | % 1.4 | 百万円 38,508 | 百万円 2,230 | % 5.8 |

(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 |
|-----|----------|----------|------------|
| 公社債 | 百万円 — | 百万円 — | 百万円 100 |

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

(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 |
|-------|------------|
| 公 社 債 | 百万円 500 |

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、SMB C日興証券株式会社、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

■ 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 (2021年6月22日から2022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(2022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 | 92,181,000 (40,945,000) | 94,318,389 (39,637,507) | 77.3 (32.5) | — (—) | 52.9 (18.9) | 18.2 (8.4) | 6.2 (5.1) |
| 地 方 債 証 券 | 11,550,000 (11,550,000) | 11,776,847 (11,776,847) | 9.7 (9.7) | — (—) | 3.3 (3.3) | 4.6 (4.6) | 1.8 (1.8) |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 8,630,510 (8,630,510) | 9,048,950 (9,048,950) | 7.4 (7.4) | — (—) | 4.5 (4.5) | 1.8 (1.8) | 1.2 (1.2) |
| 金 融 債 券 | 100,000 (100,000) | 100,049 (100,049) | 0.1 (0.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 0.1 (0.1) |
| 普 通 社 債 券 | 6,200,000 (6,200,000) | 6,201,871 (6,201,871) | 5.1 (5.1) | — (—) | 2.5 (2.5) | 2.4 (2.4) | 0.2 (0.2) |
| 合 計 | 118,661,510 (67,425,510) | 121,446,108 (66,765,226) | 99.5 (54.7) | — (—) | 63.1 (29.1) | 26.9 (17.1) | 9.5 (8.4) |

※()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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

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 | 433 2年国債 | 0.0050 | 100,000 | 100,121 | 2024/02/01 |
| | 434 2年国債 | 0.0050 | 230,000 | 230,292 | 2024/03/01 |
| | 139 5年国債 | 0.1000 | 760,000 | 762,257 | 2024/03/20 |
| | 333 10年国債 | 0.6000 | 330,000 | 333,861 | 2024/03/20 |
| | 69 20年国債 | 2.1000 | 200,000 | 207,582 | 2024/03/20 |
| | 435 2年国債 | 0.0050 | 5,940,000 | 5,947,900 | 2024/04/01 |
| | 140 5年国債 | 0.1000 | 640,000 | 642,105 | 2024/06/20 |
| | 334 10年国債 | 0.6000 | 345,000 | 349,585 | 2024/06/20 |
| | 70 20年国債 | 2.4000 | 380,000 | 398,730 | 2024/06/20 |
| | 141 5年国債 | 0.1000 | 1,090,000 | 1,093,804 | 2024/09/20 |
| | 335 10年国債 | 0.5000 | 95,000 | 96,186 | 2024/09/20 |
| | 72 20年国債 | 2.1000 | 300,000 | 314,559 | 2024/09/20 |
| | 142 5年国債 | 0.1000 | 530,000 | 531,987 | 2024/12/20 |
| | 336 10年国債 | 0.5000 | 115,000 | 116,581 | 2024/12/20 |
| | 337 10年国債 | 0.3000 | 305,000 | 307,668 | 2024/12/20 |
| | 74 20年国債 | 2.1000 | 278,000 | 292,950 | 2024/12/20 |
| | 143 5年国債 | 0.1000 | 440,000 | 441,689 | 2025/03/20 |
| | 338 10年国債 | 0.4000 | 607,000 | 614,338 | 2025/03/20 |
| | 75 20年国債 | 2.1000 | 230,000 | 243,526 | 2025/03/20 |
| | 144 5年国債 | 0.1000 | 1,220,000 | 1,224,745 | 2025/06/20 |
| | 339 10年国債 | 0.4000 | 615,000 | 622,927 | 2025/06/20 |
| | 78 20年国債 | 1.9000 | 340,000 | 359,682 | 2025/06/20 |
| | 145 5年国債 | 0.1000 | 810,000 | 813,159 | 2025/09/20 |
| | 340 10年国債 | 0.4000 | 883,000 | 895,052 | 2025/09/20 |
| | 82 20年国債 | 2.1000 | 288,000 | 307,851 | 2025/09/20 |
| | 146 5年国債 | 0.1000 | 1,280,000 | 1,284,915 | 2025/12/20 |
| | 341 10年国債 | 0.3000 | 365,000 | 368,956 | 2025/12/20 |
| | 84 20年国債 | 2.0000 | 424,000 | 453,824 | 2025/12/20 |
| | 147 5年国債 | 0.0050 | 790,000 | 790,000 | 2026/03/20 |
| | 342 10年国債 | 0.1000 | 900,000 | 903,195 | 2026/03/20 |
| | 85 20年国債 | 2.1000 | 332,000 | 358,042 | 2026/03/20 |
| | 148 5年国債 | 0.0050 | 480,000 | 479,712 | 2026/06/20 |
| | 343 10年国債 | 0.1000 | 577,000 | 578,840 | 2026/06/20 |
| | 88 20年国債 | 2.3000 | 329,000 | 358,958 | 2026/06/20 |
| | 149 5年国債 | 0.0050 | 1,500,000 | 1,498,080 | 2026/09/20 |
| | 344 10年国債 | 0.1000 | 1,150,000 | 1,153,162 | 2026/09/20 |
| | 90 20年国債 | 2.2000 | 418,000 | 456,397 | 2026/09/20 |
| | 150 5年国債 | 0.0050 | 1,470,000 | 1,467,030 | 2026/12/20 |
| | 345 10年国債 | 0.1000 | 725,000 | 726,624 | 2026/12/20 |
| | 92 20年国債 | 2.1000 | 295,000 | 322,142 | 2026/12/20 |
| | 151 5年国債 | 0.0050 | 640,000 | 638,182 | 2027/03/20 |
| | 346 10年国債 | 0.1000 | 460,000 | 460,759 | 2027/03/20 |
| | 93 20年国債 | 2.0000 | 242,000 | 264,150 | 2027/03/20 |
| | 347 10年国債 | 0.1000 | 105,000 | 105,103 | 2027/06/20 |
| | 95 20年国債 | 2.3000 | 186,000 | 206,603 | 2027/06/20 |

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 |
| | 348 10年国債 | 0.1000 | 305,000 | 305,000 | 2027/09/20 |
| | 97 20年国債 | 2.2000 | 270,000 | 299,683 | 2027/09/20 |
| | 349 10年国債 | 0.1000 | 305,000 | 304,749 | 2027/12/20 |
| | 99 20年国債 | 2.1000 | 177,000 | 196,250 | 2027/12/20 |
| | 350 10年国債 | 0.1000 | 335,000 | 334,423 | 2028/03/20 |
| | 100 20年国債 | 2.2000 | 130,000 | 145,386 | 2028/03/20 |
| | 351 10年国債 | 0.1000 | 290,000 | 289,135 | 2028/06/20 |
| | 102 20年国債 | 2.4000 | 285,000 | 323,304 | 2028/06/20 |
| | 352 10年国債 | 0.1000 | 565,000 | 562,723 | 2028/09/20 |
| | 105 20年国債 | 2.1000 | 237,000 | 265,530 | 2028/09/20 |
| | 353 10年国債 | 0.1000 | 600,000 | 596,916 | 2028/12/20 |
| | 107 20年国債 | 2.1000 | 248,000 | 278,764 | 2028/12/20 |
| | 354 10年国債 | 0.1000 | 350,000 | 347,784 | 2029/03/20 |
| | 109 20年国債 | 1.9000 | 315,000 | 350,988 | 2029/03/20 |
| | 355 10年国債 | 0.1000 | 840,000 | 833,624 | 2029/06/20 |
| | 111 20年国債 | 2.2000 | 393,000 | 447,391 | 2029/06/20 |
| | 356 10年国債 | 0.1000 | 1,005,000 | 995,683 | 2029/09/20 |
| | 113 20年国債 | 2.1000 | 395,000 | 447,665 | 2029/09/20 |
| | 357 10年国債 | 0.1000 | 1,210,000 | 1,196,193 | 2029/12/20 |
| | 114 20年国債 | 2.1000 | 323,000 | 367,251 | 2029/12/20 |
| | 2 30年国債 | 2.4000 | 150,000 | 174,396 | 2030/02/20 |
| | 358 10年国債 | 0.1000 | 1,180,000 | 1,165,663 | 2030/03/20 |
| | 116 20年国債 | 2.2000 | 320,000 | 367,548 | 2030/03/20 |
| | 359 10年国債 | 0.1000 | 1,110,000 | 1,096,080 | 2030/06/20 |
| | 118 20年国債 | 2.0000 | 245,000 | 278,724 | 2030/06/20 |
| | 119 20年国債 | 1.8000 | 160,000 | 179,513 | 2030/06/20 |
| | 360 10年国債 | 0.1000 | 1,470,000 | 1,450,992 | 2030/09/20 |
| | 121 20年国債 | 1.9000 | 200,000 | 226,764 | 2030/09/20 |
| | 122 20年国債 | 1.8000 | 225,000 | 253,289 | 2030/09/20 |
| | 4 30年国債 | 2.9000 | 160,000 | 195,190 | 2030/11/20 |
| | 361 10年国債 | 0.1000 | 1,200,000 | 1,184,028 | 2030/12/20 |
| | 123 20年国債 | 2.1000 | 205,000 | 236,756 | 2030/12/20 |
| | 124 20年国債 | 2.0000 | 230,000 | 263,713 | 2030/12/20 |
| | 362 10年国債 | 0.1000 | 1,080,000 | 1,064,761 | 2031/03/20 |
| | 125 20年国債 | 2.2000 | 175,000 | 204,204 | 2031/03/20 |
| | 126 20年国債 | 2.0000 | 185,000 | 212,705 | 2031/03/20 |
| | 127 20年国債 | 1.9000 | 190,000 | 216,828 | 2031/03/20 |
| | 5 30年国債 | 2.2000 | 100,000 | 117,000 | 2031/05/20 |
| | 363 10年国債 | 0.1000 | 910,000 | 896,404 | 2031/06/20 |
| | 129 20年国債 | 1.8000 | 40,000 | 45,415 | 2031/06/20 |
| | 364 10年国債 | 0.1000 | 750,000 | 740,497 | 2031/09/20 |
| | 130 20年国債 | 1.8000 | 300,000 | 341,727 | 2031/09/20 |
| | 131 20年国債 | 1.7000 | 225,000 | 254,263 | 2031/09/20 |
| | 365 10年国債 | 0.1000 | 1,150,000 | 1,136,096 | 2031/12/20 |
| | 132 20年国債 | 1.7000 | 270,000 | 305,896 | 2031/12/20 |
| | 133 20年国債 | 1.8000 | 235,000 | 268,421 | 2031/12/20 |
| | 366 10年国債 | 0.2000 | 890,000 | 887,454 | 2032/03/20 |
| | 134 20年国債 | 1.8000 | 163,000 | 186,590 | 2032/03/20 |
| | 135 20年国債 | 1.7000 | 285,000 | 323,543 | 2032/03/20 |

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 |
| | 136 20年国債 | 1. 6000 | 205, 000 | 230, 778 | 2032/03/20 |
| | 7 30年国債 | 2. 3000 | 180, 000 | 215, 379 | 2032/05/20 |
| | 137 20年国債 | 1. 7000 | 190, 000 | 216, 237 | 2032/06/20 |
| | 139 20年国債 | 1. 6000 | 200, 000 | 225, 674 | 2032/06/20 |
| | 140 20年国債 | 1. 7000 | 430, 000 | 490, 101 | 2032/09/20 |
| | 141 20年国債 | 1. 7000 | 290, 000 | 330, 817 | 2032/12/20 |
| | 142 20年国債 | 1. 8000 | 150, 000 | 172, 636 | 2032/12/20 |
| | 10 30年国債 | 1. 1000 | 230, 000 | 248, 119 | 2033/03/20 |
| | 143 20年国債 | 1. 6000 | 100, 000 | 113, 120 | 2033/03/20 |
| | 144 20年国債 | 1. 5000 | 285, 000 | 319, 436 | 2033/03/20 |
| | 11 30年国債 | 1. 7000 | 150, 000 | 171, 444 | 2033/06/20 |
| | 145 20年国債 | 1. 7000 | 352, 000 | 402, 321 | 2033/06/20 |
| | 12 30年国債 | 2. 1000 | 230, 000 | 273, 118 | 2033/09/20 |
| | 146 20年国債 | 1. 7000 | 350, 000 | 400, 270 | 2033/09/20 |
| | 147 20年国債 | 1. 6000 | 390, 000 | 441, 932 | 2033/12/20 |
| | 14 30年国債 | 2. 4000 | 220, 000 | 269, 511 | 2034/03/20 |
| | 148 20年国債 | 1. 5000 | 332, 000 | 372, 550 | 2034/03/20 |
| | 15 30年国債 | 2. 5000 | 250, 000 | 309, 745 | 2034/06/20 |
| | 149 20年国債 | 1. 5000 | 357, 000 | 400, 578 | 2034/06/20 |
| | 16 30年国債 | 2. 5000 | 195, 000 | 241, 969 | 2034/09/20 |
| | 150 20年国債 | 1. 4000 | 665, 000 | 738, 336 | 2034/09/20 |
| | 151 20年国債 | 1. 2000 | 500, 000 | 542, 765 | 2034/12/20 |
| | 18 30年国債 | 2. 3000 | 160, 000 | 195, 324 | 2035/03/20 |
| | 152 20年国債 | 1. 2000 | 450, 000 | 488, 326 | 2035/03/20 |
| | 19 30年国債 | 2. 3000 | 150, 000 | 183, 397 | 2035/06/20 |
| | 153 20年国債 | 1. 3000 | 502, 000 | 550, 673 | 2035/06/20 |
| | 154 20年国債 | 1. 2000 | 455, 000 | 493, 042 | 2035/09/20 |
| | 21 30年国債 | 2. 3000 | 122, 000 | 149, 579 | 2035/12/20 |
| | 155 20年国債 | 1. 0000 | 680, 000 | 718, 896 | 2035/12/20 |
| | 22 30年国債 | 2. 5000 | 149, 000 | 186, 846 | 2036/03/20 |
| | 156 20年国債 | 0. 4000 | 480, 000 | 468, 700 | 2036/03/20 |
| | 23 30年国債 | 2. 5000 | 151, 000 | 189, 637 | 2036/06/20 |
| | 157 20年国債 | 0. 2000 | 483, 000 | 457, 458 | 2036/06/20 |
| | 24 30年国債 | 2. 5000 | 135, 000 | 169, 672 | 2036/09/20 |
| | 158 20年国債 | 0. 5000 | 565, 000 | 556, 118 | 2036/09/20 |
| | 25 30年国債 | 2. 3000 | 175, 000 | 215, 255 | 2036/12/20 |
| | 159 20年国債 | 0. 6000 | 458, 000 | 455, 870 | 2036/12/20 |
| | 26 30年国債 | 2. 4000 | 219, 000 | 272, 768 | 2037/03/20 |
| | 160 20年国債 | 0. 7000 | 450, 000 | 453, 024 | 2037/03/20 |
| | 161 20年国債 | 0. 6000 | 515, 000 | 510, 086 | 2037/06/20 |
| | 27 30年国債 | 2. 5000 | 206, 000 | 259, 955 | 2037/09/20 |
| | 162 20年国債 | 0. 6000 | 485, 000 | 478, 976 | 2037/09/20 |
| | 163 20年国債 | 0. 6000 | 465, 000 | 457, 857 | 2037/12/20 |
| | 28 30年国債 | 2. 5000 | 251, 000 | 317, 324 | 2038/03/20 |
| | 164 20年国債 | 0. 5000 | 465, 000 | 449, 892 | 2038/03/20 |
| | 165 20年国債 | 0. 5000 | 485, 000 | 468, 015 | 2038/06/20 |
| | 29 30年国債 | 2. 4000 | 190, 000 | 237, 992 | 2038/09/20 |
| | 166 20年国債 | 0. 7000 | 420, 000 | 416, 955 | 2038/09/20 |
| | 167 20年国債 | 0. 5000 | 465, 000 | 445, 967 | 2038/12/20 |

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 |
| | 30 30年国債 | 2.3000 | 270,000 | 334,497 | 2039/03/20 |
| | 168 20年国債 | 0.4000 | 555,000 | 522,216 | 2039/03/20 |
| | 169 20年国債 | 0.3000 | 415,000 | 382,804 | 2039/06/20 |
| | 31 30年国債 | 2.2000 | 277,000 | 339,120 | 2039/09/20 |
| | 170 20年国債 | 0.3000 | 420,000 | 386,118 | 2039/09/20 |
| | 171 20年国債 | 0.3000 | 425,000 | 389,389 | 2039/12/20 |
| | 32 30年国債 | 2.3000 | 377,000 | 468,147 | 2040/03/20 |
| | 172 20年国債 | 0.4000 | 390,000 | 362,376 | 2040/03/20 |
| | 173 20年国債 | 0.4000 | 500,000 | 463,070 | 2040/06/20 |
| | 33 30年国債 | 2.0000 | 380,000 | 453,336 | 2040/09/20 |
| | 174 20年国債 | 0.4000 | 475,000 | 438,458 | 2040/09/20 |
| | 175 20年国債 | 0.5000 | 480,000 | 449,904 | 2040/12/20 |
| | 34 30年国債 | 2.2000 | 379,000 | 465,108 | 2041/03/20 |
| | 176 20年国債 | 0.5000 | 480,000 | 448,483 | 2041/03/20 |
| | 177 20年国債 | 0.4000 | 480,000 | 439,281 | 2041/06/20 |
| | 35 30年国債 | 2.0000 | 335,000 | 400,053 | 2041/09/20 |
| | 178 20年国債 | 0.5000 | 480,000 | 446,299 | 2041/09/20 |
| | 179 20年国債 | 0.5000 | 460,000 | 426,999 | 2041/12/20 |
| | 36 30年国債 | 2.0000 | 315,000 | 377,203 | 2042/03/20 |
| | 180 20年国債 | 0.8000 | 420,000 | 411,919 | 2042/03/20 |
| | 37 30年国債 | 1.9000 | 345,000 | 406,527 | 2042/09/20 |
| | 38 30年国債 | 1.8000 | 385,000 | 446,742 | 2043/03/20 |
| | 39 30年国債 | 1.9000 | 240,000 | 282,883 | 2043/06/20 |
| | 40 30年国債 | 1.8000 | 220,000 | 255,090 | 2043/09/20 |
| | 41 30年国債 | 1.7000 | 200,000 | 227,998 | 2043/12/20 |
| | 42 30年国債 | 1.7000 | 250,000 | 285,075 | 2044/03/20 |
| | 43 30年国債 | 1.7000 | 260,000 | 296,288 | 2044/06/20 |
| | 44 30年国債 | 1.7000 | 327,000 | 372,384 | 2044/09/20 |
| | 45 30年国債 | 1.5000 | 302,000 | 331,864 | 2044/12/20 |
| | 46 30年国債 | 1.5000 | 315,000 | 346,109 | 2045/03/20 |
| | 47 30年国債 | 1.6000 | 315,000 | 352,311 | 2045/06/20 |
| | 48 30年国債 | 1.4000 | 335,000 | 360,614 | 2045/09/20 |
| | 49 30年国債 | 1.4000 | 315,000 | 338,971 | 2045/12/20 |
| | 50 30年国債 | 0.8000 | 410,000 | 389,405 | 2046/03/20 |
| | 51 30年国債 | 0.3000 | 317,000 | 266,825 | 2046/06/20 |
| | 52 30年国債 | 0.5000 | 317,000 | 279,251 | 2046/09/20 |
| | 53 30年国債 | 0.6000 | 312,000 | 280,541 | 2046/12/20 |
| | 54 30年国債 | 0.8000 | 170,000 | 159,767 | 2047/03/20 |
| | 55 30年国債 | 0.8000 | 270,000 | 253,125 | 2047/06/20 |
| | 56 30年国債 | 0.8000 | 525,000 | 490,964 | 2047/09/20 |
| | 57 30年国債 | 0.8000 | 295,000 | 275,181 | 2047/12/20 |
| | 58 30年国債 | 0.8000 | 370,000 | 344,273 | 2048/03/20 |
| | 59 30年国債 | 0.7000 | 310,000 | 280,956 | 2048/06/20 |
| | 60 30年国債 | 0.9000 | 310,000 | 293,780 | 2048/09/20 |
| | 61 30年国債 | 0.7000 | 330,000 | 296,825 | 2048/12/20 |
| | 2 40年国債 | 2.2000 | 132,000 | 164,039 | 2049/03/20 |
| | 62 30年国債 | 0.5000 | 235,000 | 200,274 | 2049/03/20 |
| | 63 30年国債 | 0.4000 | 215,000 | 177,929 | 2049/06/20 |
| | 64 30年国債 | 0.4000 | 315,000 | 260,048 | 2049/09/20 |

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 |
| | 65 30年国債 | 0.4000 | 275,000 | 226,930 | 2049/12/20 |
| | 3 40年国債 | 2.2000 | 150,000 | 187,869 | 2050/03/20 |
| | 66 30年国債 | 0.4000 | 285,000 | 235,093 | 2050/03/20 |
| | 67 30年国債 | 0.6000 | 320,000 | 277,148 | 2050/06/20 |
| | 68 30年国債 | 0.6000 | 360,000 | 311,472 | 2050/09/20 |
| | 69 30年国債 | 0.7000 | 320,000 | 284,211 | 2050/12/20 |
| | 4 40年国債 | 2.2000 | 215,000 | 268,999 | 2051/03/20 |
| | 70 30年国債 | 0.7000 | 430,000 | 381,195 | 2051/03/20 |
| | 71 30年国債 | 0.7000 | 300,000 | 265,731 | 2051/06/20 |
| | 72 30年国債 | 0.7000 | 310,000 | 274,362 | 2051/09/20 |
| | 73 30年国債 | 0.7000 | 330,000 | 291,825 | 2051/12/20 |
| | 5 40年国債 | 2.0000 | 222,000 | 267,376 | 2052/03/20 |
| | 74 30年国債 | 1.0000 | 300,000 | 286,218 | 2052/03/20 |
| | 6 40年国債 | 1.9000 | 220,000 | 260,136 | 2053/03/20 |
| | 7 40年国債 | 1.7000 | 263,000 | 298,373 | 2054/03/20 |
| | 8 40年国債 | 1.4000 | 285,000 | 300,874 | 2055/03/20 |
| | 9 40年国債 | 0.4000 | 451,000 | 351,667 | 2056/03/20 |
| | 10 40年国債 | 0.9000 | 438,000 | 400,861 | 2057/03/20 |
| | 11 40年国債 | 0.8000 | 345,000 | 305,135 | 2058/03/20 |
| | 12 40年国債 | 0.5000 | 350,000 | 277,270 | 2059/03/20 |
| | 13 40年国債 | 0.5000 | 440,000 | 346,918 | 2060/03/20 |
| | 14 40年国債 | 0.7000 | 485,000 | 408,961 | 2061/03/20 |
| | 15 40年国債 | 1.0000 | 30,000 | 27,714 | 2062/03/20 |
| | 小 計 | - | 92,181,000 | 94,318,389 | - |
| 地方債証券 | 24-9 埼玉県公債 | 0.8440 | 100,000 | 100,508 | 2023/01/31 |
| | 147 大阪府5年 | 0.0010 | 100,000 | 99,984 | 2023/02/27 |
| | 29-11 福岡市5年 | 0.0400 | 300,000 | 300,066 | 2023/03/16 |
| | 482 名古屋市債 | 0.6390 | 200,000 | 200,934 | 2023/03/20 |
| | 1 東京都20年 | 1.5400 | 200,000 | 203,073 | 2023/06/20 |
| | 30-6 京都府5年 | 0.0300 | 200,000 | 199,987 | 2023/09/20 |
| | 30-7 福岡県5年 | 0.0200 | 100,000 | 99,939 | 2024/01/22 |
| | 25-11 福岡県公債 | 0.6940 | 100,000 | 101,066 | 2024/02/26 |
| | 30-12 京都府5年 | 0.0200 | 300,000 | 299,769 | 2024/03/19 |
| | 1-1 大阪市5年 | 0.0100 | 400,000 | 399,596 | 2024/05/21 |
| | 1-2 千葉県5年 | 0.0100 | 100,000 | 99,889 | 2024/05/24 |
| | 26-1 広島県公債 | 0.6700 | 100,000 | 101,164 | 2024/05/27 |
| | 78 神奈川県5年 | 0.0050 | 100,000 | 99,882 | 2024/06/20 |
| | 487 名古屋市債 | 0.6590 | 300,000 | 303,559 | 2024/06/20 |
| | 26-4 埼玉県公債 | 0.6540 | 100,000 | 101,186 | 2024/06/26 |
| | 26-3 千葉県公債 | 0.6110 | 300,000 | 303,409 | 2024/07/25 |
| | 26-3 横浜市公債 | 0.5710 | 300,000 | 303,228 | 2024/08/19 |
| | 137 共同発行地方 | 0.5660 | 100,000 | 101,075 | 2024/08/23 |
| | 138 共同発行地方 | 0.5540 | 100,000 | 101,085 | 2024/09/25 |
| | 1-2 北九州市5年 | 0.0010 | 100,000 | 99,829 | 2024/09/26 |
| | 26-5 福岡県公債 | 0.5250 | 200,000 | 202,102 | 2024/10/28 |
| | 26-5 福岡市公債 | 0.5390 | 200,000 | 202,163 | 2024/10/28 |
| | 26-10 静岡県公債 | 0.5150 | 100,000 | 101,057 | 2024/11/25 |
| | 11 群馬県公債 | 0.5050 | 100,000 | 101,025 | 2024/11/25 |
| | 140 共同発行地方 | 0.5050 | 100,000 | 101,025 | 2024/11/25 |

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 |
| | 26-14 愛知県公債 | 0.5350 | 100,000 | 101,106 | 2024/11/28 |
| | 26-5 千葉県公債 | 0.4760 | 200,000 | 201,967 | 2024/12/25 |
| | 26-13 北海道公債 | 0.4610 | 100,000 | 100,931 | 2024/12/26 |
| | 6 東京都20年 | 2.0000 | 400,000 | 420,910 | 2025/03/19 |
| | 26-18 愛知県公債 | 0.4400 | 100,000 | 100,959 | 2025/03/27 |
| | 3 兵庫県公債12年 | 0.5600 | 100,000 | 101,296 | 2025/04/16 |
| | 395 大阪府公債 | 0.4350 | 200,000 | 201,906 | 2025/04/28 |
| | 170 大阪府5年 | 0.0010 | 100,000 | 99,717 | 2025/04/28 |
| | 397 大阪府公債 | 0.5660 | 100,000 | 101,381 | 2025/06/27 |
| | 149 共同発行地方 | 0.5000 | 100,000 | 101,249 | 2025/08/25 |
| | 7 東京都20年 | 2.1600 | 100,000 | 106,644 | 2025/09/19 |
| | 1 静岡県20年 | 2.1800 | 100,000 | 106,712 | 2025/09/19 |
| | 27-5 福岡市公債 | 0.4760 | 100,000 | 101,217 | 2025/10/28 |
| | 27-11 京都府公債 | 0.4690 | 200,000 | 202,451 | 2025/12/18 |
| | 494 名古屋市債 | 0.4640 | 200,000 | 202,411 | 2025/12/19 |
| | 27-16 愛知県公債 | 0.4540 | 200,000 | 202,350 | 2025/12/25 |
| | 27-1 三重県公債 | 0.4640 | 100,000 | 101,203 | 2025/12/25 |
| | 154 共同発行地方 | 0.4050 | 150,000 | 151,498 | 2026/01/23 |
| | 407 大阪府公債 | 0.0900 | 100,000 | 99,785 | 2026/04/27 |
| | 9 横浜市20年 | 2.3500 | 100,000 | 108,776 | 2026/06/19 |
| | 1 兵庫県公債15年 | 1.6600 | 200,000 | 212,328 | 2026/07/29 |
| | 11 東京都20年 | 2.2200 | 100,000 | 109,645 | 2027/03/19 |
| | 7 神奈川県20年 | 2.2200 | 200,000 | 219,259 | 2027/03/19 |
| | 29-5 北海道公債 | 0.1800 | 100,000 | 99,900 | 2027/06/30 |
| | 175 共同発行地方 | 0.2150 | 200,000 | 199,957 | 2027/10/25 |
| | 425 大阪府公債 | 0.1950 | 200,000 | 199,618 | 2027/10/29 |
| | 176 共同発行地方 | 0.1850 | 100,000 | 99,774 | 2027/11/25 |
| | 29-16 愛知県公債 | 0.2600 | 100,000 | 100,107 | 2028/02/14 |
| | 179 共同発行地方 | 0.2400 | 100,000 | 99,982 | 2028/02/25 |
| | 233 神奈川県公債 | 0.1950 | 100,000 | 99,705 | 2028/03/17 |
| | 5 兵庫県公債15年 | 1.3100 | 100,000 | 106,059 | 2028/05/26 |
| | 183 共同発行地方 | 0.2050 | 600,000 | 597,619 | 2028/06/23 |
| | 30-2 広島県公債 | 0.1800 | 200,000 | 198,802 | 2028/07/25 |
| | 185 共同発行地方 | 0.2450 | 200,000 | 199,508 | 2028/08/25 |
| | 91 川崎市公債 | 0.1850 | 100,000 | 99,330 | 2028/09/20 |
| | 6 埼玉県20年 | 2.2600 | 100,000 | 112,179 | 2028/09/21 |
| | 16 横浜市20年 | 2.3500 | 100,000 | 112,739 | 2028/09/21 |
| | 30-6 福岡県公債 | 0.2000 | 100,000 | 99,317 | 2028/12/21 |
| | 30-2 岡山県公債 | 0.1550 | 100,000 | 98,950 | 2029/01/31 |
| | 30-18 北海道公債 | 0.1460 | 200,000 | 197,357 | 2029/02/28 |
| | 792 東京都公債 | 0.0500 | 300,000 | 294,534 | 2029/03/19 |
| | 793 東京都公債 | 0.0500 | 200,000 | 196,074 | 2029/06/20 |
| | 9 兵庫県公債20年 | 2.2500 | 100,000 | 113,533 | 2029/11/19 |
| | 13 埼玉県20年 | 1.5990 | 100,000 | 112,339 | 2033/05/20 |
| | 8 東京都30年 | 2.2300 | 100,000 | 121,627 | 2038/09/17 |
| | 13 東京都30年 | 1.9300 | 200,000 | 235,010 | 2042/03/19 |
| | 7 静岡県30年 | 1.9880 | 100,000 | 118,382 | 2043/06/19 |
| | 1-3 福岡県30年 | 0.4320 | 100,000 | 82,113 | 2049/06/18 |
| 小 | 計 | - | 11,550,000 | 11,776,847 | - |

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 |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 104 道路機構 | 0.7150 | 400,000 | 402,108 | 2023/03/20 |
| | 22 政保政策投資B | 2.2000 | 100,000 | 102,259 | 2023/06/19 |
| | 4 公営企業20年 | 2.0900 | 200,000 | 205,133 | 2023/09/20 |
| | 207 政保道路機構 | 0.6930 | 200,000 | 202,162 | 2023/12/28 |
| | 209 政保道路機構 | 0.7470 | 100,000 | 101,232 | 2024/01/31 |
| | 122 道路機構 | 0.7040 | 200,000 | 202,256 | 2024/03/19 |
| | 27 道路債券 | 2.4200 | 100,000 | 104,122 | 2024/03/20 |
| | 59 地方公共団体 | 0.7240 | 100,000 | 101,230 | 2024/04/26 |
| | 220 政保道路機構 | 0.6440 | 300,000 | 303,998 | 2024/06/28 |
| | 61 地方公共団体 | 0.6900 | 100,000 | 101,266 | 2024/06/28 |
| | 62 地方公共団体 | 0.6310 | 300,000 | 303,558 | 2024/07/26 |
| | 32 道路債券 | 2.4400 | 100,000 | 105,319 | 2024/09/20 |
| | 227 政保道路機構 | 0.5440 | 300,000 | 303,758 | 2024/09/30 |
| | 6 福祉医療機構 | 2.1100 | 100,000 | 105,517 | 2025/03/19 |
| | 42 道路債券 | 2.2200 | 100,000 | 105,824 | 2025/03/21 |
| | 85 中日本高速道 | 0.0700 | 100,000 | 99,790 | 2025/10/21 |
| | 16 公営企業20年 | 2.1000 | 100,000 | 106,909 | 2025/12/19 |
| | 66日本政策投資CO | 0.0900 | 100,000 | 99,794 | 2026/04/17 |
| | 18 公営企業20年 | 2.5800 | 100,000 | 109,672 | 2026/06/19 |
| | 190 住宅支援機構 | 0.0800 | 100,000 | 99,702 | 2026/06/19 |
| | 60 政保政策投資C | 0.0010 | 100,000 | 99,503 | 2027/01/29 |
| | 22 公営企業20年 | 2.3200 | 200,000 | 221,053 | 2027/06/18 |
| | 117 住宅支援機構 | 1.4380 | 100,000 | 106,264 | 2027/09/17 |
| | 27 道路機構 | 2.3400 | 100,000 | 111,089 | 2027/10/20 |
| | 222 住宅支援機構 | 0.2100 | 200,000 | 199,529 | 2027/11/19 |
| | 102 地方公共団体 | 0.2000 | 100,000 | 99,763 | 2027/11/26 |
| | 42 政保政策投資C | 0.1550 | 100,000 | 99,923 | 2027/12/15 |
| | 226 住宅支援機構 | 0.2400 | 200,000 | 199,772 | 2027/12/20 |
| | 333 政保道路機構 | 0.1550 | 100,000 | 99,915 | 2027/12/28 |
| | 339 政保道路機構 | 0.1950 | 100,000 | 100,090 | 2028/02/29 |
| | 106 地方公共団体 | 0.2150 | 300,000 | 299,096 | 2028/03/28 |
| | 37 道路機構 | 2.4200 | 700,000 | 788,022 | 2028/06/20 |
| | 79 政保道路機構 | 2.1000 | 100,000 | 112,532 | 2029/04/27 |
| | 92 政保道路機構 | 2.1000 | 100,000 | 113,160 | 2029/10/31 |
| | 99 政保道路機構 | 2.2000 | 100,000 | 114,227 | 2030/01/31 |
| 130 住宅支援機構 | 1.7630 | 100,000 | 113,564 | 2032/12/20 | |
| 185 政保道路機構 | 1.7570 | 100,000 | 114,137 | 2033/02/28 | |
| F281地方公共団体 | 0.9990 | 100,000 | 105,418 | 2033/09/21 | |
| 210 政保道路機構 | 1.5470 | 400,000 | 448,539 | 2034/01/31 | |
| 221 政保道路機構 | 1.4660 | 100,000 | 111,211 | 2034/06/30 | |
| 246 政保道路機構 | 1.1780 | 100,000 | 107,538 | 2035/05/31 | |
| 4 道路機構 | 2.5900 | 100,000 | 124,636 | 2035/12/20 | |
| 48 地方公共団体20 | 1.1210 | 100,000 | 105,815 | 2035/12/28 | |
| S9 住宅金融RMBS | 2.1900 | 10,104 | 10,163 | 2037/05/10 | |
| S10住宅金融RMBS | 2.1500 | 10,406 | 10,462 | 2037/05/10 | |
| S1 住宅機構RMBS | 2.0800 | 10,546 | 10,680 | 2037/11/10 | |
| S3 住宅機構RMBS | 2.0900 | 10,930 | 11,078 | 2037/11/10 | |
| 32 住宅金融RMBS | 1.6900 | 10,919 | 11,030 | 2040/07/10 | |
| 35 住宅金融RMBS | 1.7900 | 11,605 | 11,802 | 2040/10/10 | |

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 |
| | 37 住宅金融RMBS | 1.8800 | 11,023 | 11,222 | 2040/12/10 |
| | 40 住宅金融RMBS | 1.9300 | 12,094 | 12,402 | 2041/03/10 |
| | 42 住宅金融RMBS | 2.3400 | 10,214 | 10,274 | 2041/05/10 |
| | 48 住宅金融RMBS | 2.3300 | 10,501 | 10,657 | 2041/11/10 |
| | 2 住宅機構RMBS | 2.1900 | 11,444 | 11,702 | 2042/06/10 |
| | 29 住宅機構RMBS | 1.9500 | 21,614 | 22,921 | 2044/10/10 |
| | 32 住宅機構RMBS | 1.8200 | 21,102 | 22,228 | 2045/01/10 |
| | 37 住宅機構RMBS | 1.7100 | 21,374 | 22,417 | 2045/06/10 |
| | 49 住宅機構RMBS | 1.7600 | 19,947 | 20,868 | 2046/06/10 |
| | 51 住宅機構RMBS | 1.6400 | 22,014 | 23,015 | 2046/08/10 |
| | 55 住宅機構RMBS | 1.4100 | 29,180 | 30,455 | 2046/12/10 |
| | 57 住宅機構RMBS | 1.4400 | 28,172 | 29,403 | 2047/02/10 |
| | 22 道路機構 | 2.6700 | 200,000 | 262,940 | 2047/03/20 |
| | 59 住宅機構RMBS | 1.4400 | 30,115 | 31,479 | 2047/04/10 |
| | 67 住宅機構RMBS | 1.0900 | 38,803 | 40,040 | 2047/12/10 |
| | 69 住宅機構RMBS | 1.2800 | 39,710 | 41,322 | 2048/02/10 |
| | 70 住宅機構RMBS | 1.2500 | 34,718 | 36,033 | 2048/03/10 |
| | 73 住宅機構RMBS | 1.3000 | 39,584 | 41,230 | 2048/06/10 |
| | 88 住宅機構RMBS | 0.9300 | 43,421 | 44,476 | 2049/09/10 |
| | 113 住宅機構RMBS | 0.3700 | 74,716 | 73,640 | 2051/10/10 |
| | 123 住宅機構RMBS | 0.4600 | 77,855 | 76,850 | 2052/08/10 |
| | 124 住宅機構RMBS | 0.4200 | 77,784 | 76,547 | 2052/09/10 |
| | 125 住宅機構RMBS | 0.4200 | 77,770 | 76,541 | 2052/10/10 |
| | 132 住宅機構RMBS | 0.4000 | 79,955 | 78,451 | 2053/05/10 |
| | 138 住宅機構RMBS | 0.5000 | 82,452 | 81,314 | 2053/11/10 |
| | 146 住宅機構RMBS | 0.2100 | 87,173 | 83,869 | 2054/07/10 |
| | 151 住宅機構RMBS | 0.2600 | 89,717 | 86,648 | 2054/12/10 |
| | 157 住宅機構RMBS | 0.3400 | 91,011 | 88,362 | 2055/06/10 |
| | 160 住宅機構RMBS | 0.3700 | 92,883 | 90,375 | 2055/09/10 |
| | 166 住宅機構RMBS | 0.4100 | 189,654 | 185,614 | 2056/03/10 |
| | 小計 | — | 8,630,510 | 9,048,950 | — |
| 金融債券 | 350 信金中金 | 0.0800 | 100,000 | 100,049 | 2024/01/26 |
| | 小計 | — | 100,000 | 100,049 | — |
| 普通社債券 | 57 東京三菱銀行 | 2.2200 | 100,000 | 100,760 | 2022/10/27 |
| | 2 BPCE S. A. | 0.6450 | 100,000 | 100,214 | 2023/07/12 |
| | 1 野村ホールディングス | 0.3000 | 100,000 | 99,957 | 2023/09/04 |
| | 50 西日本高速道 | 0.0400 | 100,000 | 99,952 | 2024/06/20 |
| | 1 みずほFG劣後 | 0.9500 | 100,000 | 100,687 | 2024/07/16 |
| | 1 明治安田2019基 | 0.2900 | 200,000 | 197,809 | 2024/08/02 |
| | 1 三井住友FG劣後 | 0.8490 | 100,000 | 100,907 | 2024/09/12 |
| | 38 東京電力パワー | 0.5800 | 100,000 | 100,126 | 2025/07/16 |
| | 163東日本旅客鉄 | 0.0500 | 300,000 | 297,775 | 2026/04/15 |
| | 90 中日本高速道 | 0.0500 | 300,000 | 298,498 | 2026/07/27 |
| | 64 阪急阪神HLDG | 0.1000 | 100,000 | 99,217 | 2026/12/08 |
| | 73 ホンダファイナンス | 0.1000 | 200,000 | 198,209 | 2026/12/18 |
| | 13 西日本旅客鉄 | 2.3400 | 100,000 | 109,370 | 2027/02/19 |
| | 553 中部電力 | 0.2500 | 100,000 | 99,147 | 2027/02/25 |
| | 2 三菱HCキャピタル | 0.1900 | 200,000 | 197,373 | 2027/03/01 |
| | 11 プリチストン | 0.2950 | 200,000 | 199,560 | 2027/04/21 |

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 |
| | 550 関西電力 | 0.3900 | 300,000 | 299,689 | 2027/05/25 |
| | 13 大和ハウス | 0.2850 | 100,000 | 99,751 | 2027/06/01 |
| | 17 アサヒグループHD | 0.2900 | 100,000 | 99,897 | 2027/06/01 |
| | 9 サントリーホールディング | 0.3000 | 100,000 | 99,899 | 2027/06/08 |
| | 207 オリックス | 0.3500 | 200,000 | 199,802 | 2027/06/15 |
| | 30 東レ | 0.3750 | 100,000 | 100,084 | 2027/07/16 |
| | 56 住友化学 | 0.3800 | 100,000 | 99,682 | 2027/09/13 |
| | 32 東海旅客鉄道 | 2.3100 | 100,000 | 110,115 | 2027/09/17 |
| | 38 京王電鉄 | 0.2950 | 100,000 | 99,754 | 2027/11/29 |
| | 17 NTTファイナンス | 0.2800 | 200,000 | 198,334 | 2027/12/20 |
| | 126東日本旅客鉄 | 0.2750 | 200,000 | 198,750 | 2028/01/26 |
| | 24三菱ケミカルホールデイ | 0.3700 | 100,000 | 99,505 | 2028/02/25 |
| | 7 ジェイテクト | 0.3450 | 100,000 | 99,146 | 2028/03/08 |
| | 7 ファーストリテイリング | 0.4050 | 100,000 | 99,877 | 2028/06/06 |
| | 9 TDK | 0.2600 | 100,000 | 97,864 | 2028/12/01 |
| | 51 住友商事 | 1.2410 | 100,000 | 104,774 | 2029/04/23 |
| | 508 東北電力 | 0.4650 | 200,000 | 198,016 | 2029/04/25 |
| | 547 東北電力 | 0.5000 | 100,000 | 100,001 | 2029/06/25 |
| | 52 東海旅客鉄道 | 2.1110 | 100,000 | 112,474 | 2030/06/21 |
| | 45 東京地下鉄 | 0.2150 | 200,000 | 195,145 | 2030/09/18 |
| | 41 大阪瓦斯 | 0.2200 | 300,000 | 292,175 | 2031/06/03 |
| | 135 三菱地所 | 0.2600 | 200,000 | 195,411 | 2031/06/20 |
| | 546 中部電力 | 0.2800 | 200,000 | 193,570 | 2031/09/25 |
| | 496 九州電力 | 0.3300 | 200,000 | 193,931 | 2031/10/24 |
| | 11 東急 | 0.4790 | 100,000 | 99,910 | 2032/06/01 |
| | 65 三菱地所 | 2.0400 | 100,000 | 114,735 | 2032/12/20 |
| | 小 計 | — | 6,200,000 | 6,201,871 | — |
| | 合 計 | — | 118,661,510 | 121,446,108 | — |

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2022年6月20日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 121,446,108 | 98.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,962,471 | 1.6 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 123,408,580 | 100.0 |

国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年6月20日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 123,408,580,241円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 557,346,612 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 121,446,108,855 |
| 未 収 入 金 | 1,243,113,900 |
| 未 収 利 息 | 156,454,366 |
| 前 払 費 用 | 5,556,508 |
| (B) 負 債 | 1,369,168,082 |
| 未 払 金 | 78,485,800 |
| 未 払 解 約 金 | 1,290,681,320 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 962 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 122,039,412,159 |
| 元 本 | 89,046,647,330 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 32,992,764,829 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 89,046,647,330口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 13,705円 |

※当期における期首元本額86,729,456,752円、期中追加設定元本額16,766,114,392円、期中一部解約元本額14,448,923,814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 | 53,983,654,044円 |
| 三井住友DS・国内債券インデックス年金ファンド | 727,951,005円 |
| 日興FWS・日本債インデックス | 2,435,165,994円 |
| SMAM・国内債券インデックス・ファンド | 2,620,838,506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> | 30,104,919円 |
| SMAM・年金国内債券バップファンド<適格機関投資家限定> | 29,248,932,862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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2021年6月22日 至2022年6月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------------|------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 925,393,548円 |
| 受 取 利 息 | 925,648,056 |
| 支 払 利 息 | △ 254,508 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 4,669,038,739 |
| 売 買 損 益 | 19,084,810 |
| 売 買 損 益 | △ 4,688,123,549 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 38,455 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 3,743,683,646 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 35,853,102,320 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △ 5,824,541,893 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,707,888,048 |
| (H) 合 計 (D + E + F + G) | 32,992,764,829 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 32,992,764,829 |

※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。

※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。