

野村ハイパーブル・ベア6 (マネー ポートフォリオ6)

償還運用報告書(全体版)

第2期 (償還日2019年6月11日)

作成対象期間 (2018年6月12日～2019年6月11日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行い、償還価額が決定いたしました。
ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し
厚く御礼申し上げます。

●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
信託期間	2017年6月29日から2019年6月11日までです。
運用方針	円建ての公社債等を主要投資対象とし、主として流動性の確保を図ることを目的として安定運用を行います。
主な投資対象	円建ての公社債等を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への直接投資は行いません。株式への投資は転換社債の転換等に限り、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 外貨建て資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等を中心に基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税分		騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		込	配	み	期			
(設定日)	円 銭			円		%		百万円
2017年6月29日	10,000			—		—	—	11
1期(2018年6月11日)	9,991			0		△0.1	80.6	16,590
(償還時)	(償還価額)							
2期(2019年6月11日)	9,979.13			—		△0.1	—	827

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドは、円建ての公社債等を主要投資対象とし、主として流動性の確保を図ることを目的として安定運用を行なうため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

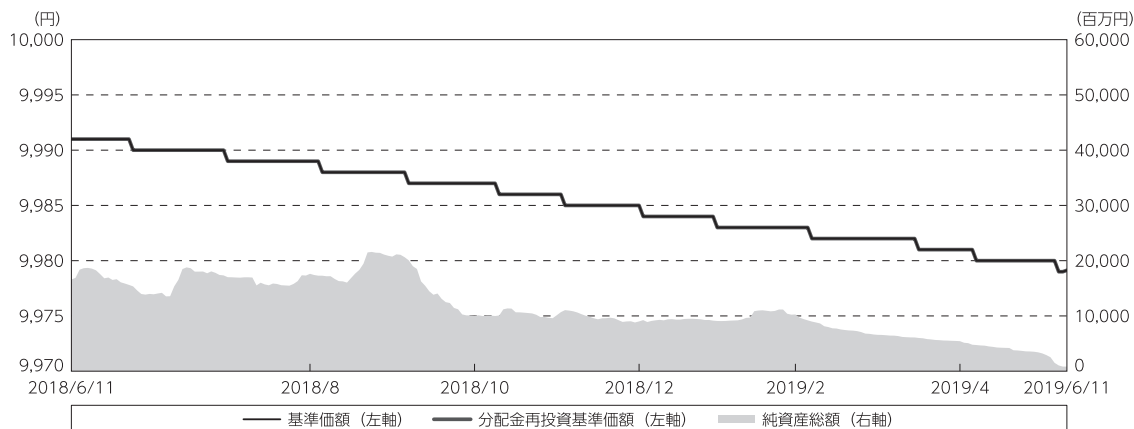
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰	落			
(期首)	円 銭			%		%
2018年6月11日	9,991			—	80.6	—
6月末	9,991			0.0	81.2	—
7月末	9,990			△0.0	77.0	—
8月末	9,989			△0.0	78.6	—
9月末	9,988			△0.0	81.2	—
10月末	9,987			△0.0	80.6	—
11月末	9,986			△0.1	75.8	—
12月末	9,985			△0.1	78.4	—
2019年1月末	9,983			△0.1	80.5	—
2月末	9,983			△0.1	79.7	—
3月末	9,982			△0.1	29.2	—
4月末	9,981			△0.1	80.5	—
5月末	9,980			△0.1	82.4	—
(償還時)	(償還価額)					
2019年6月11日	9,979.13			△0.1	—	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首： 9,991円
 期末(償還日)： 9,979円13銭 (既払分配金(税込み)：-円)
 騰 落 率： △0.1% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみな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すものです。作成期首(2018年6月11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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (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。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,991円から償還時9,979.13円に11.87円の値下がりとなりました。

マイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入以降、無担保コール翌日物金利は概ね-0.05%近辺の水準で推移し、基準価額は下落しました。

○投資環境

マイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入以降、無担保コール翌日物金利は概ね-0.05%近辺の水準で推移しました。

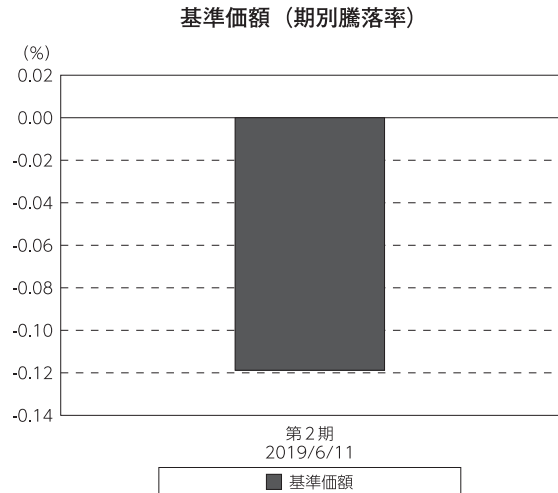
○当ファンドのポートフォリオ

資金増減（追加・解約）に応じて、短期の公社債やコール・ローンなど、短期金融商品（債券現先を含む）で運用し流動性の確保に努めました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、円建ての公社債等を主要投資対象とし、主として流動性の確保を図ることを目的として安定運用を行なうため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。

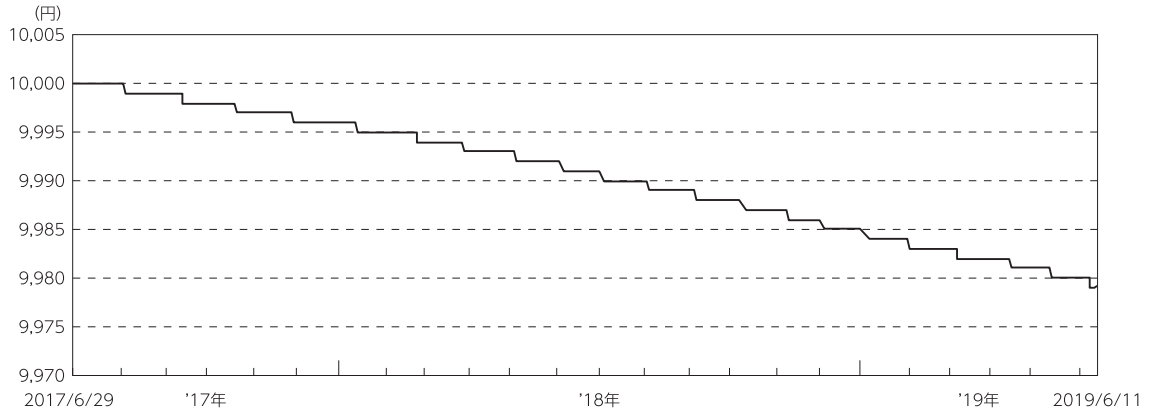


◎分配金

償還のため分配は行いませんでした。

◎設定来の運用経過

<設定来の基準価額の推移>



○基準価額の推移

基準価額は、設定時10,000円が償還時9,979.13円となりました。設定来お支払いした分配金は1万口当たり0円となりました。

○基準価額の主な変動要因

第1期

2016年1月28、29日の金融政策決定会合において、2月16日からのマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入が決定され、導入以降無担保コール翌日物金利は概ねマイナス圏で推移しました。設定以後、各金融機関の需給により-0.05%近辺の水準で推移しました。

第2期

マイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入以降、無担保コール翌日物金利は概ね-0.05%近辺の水準で推移しました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年6月12日～2019年6月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 0	% 0.001	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(0)	(0.001)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(0)	(0.001)	購入後の情報提供、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および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(0)	(0.000)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.000	(b) 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 ）	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、9,985円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売買及び取引の状況

(2018年6月12日～2019年6月11日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円	千円
		2,198,140,441	2,211,503,302

* 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

* 単位未満は切り捨て。

○ 利害関係人との取引状況等

(2018年6月12日～2019年6月11日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2018年6月12日～2019年6月11日)

期首残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 11	百万円 -	百万円 -	百万円 11	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2019年6月11日現在)

2019年6月11日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2019年6月11日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	1,041,375	100.0
投資信託財産総額	1,041,375	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2019年6月11日現在)

項 目	償 還 時 円
(A) 資産	1,041,375,558
コール・ローン等	1,041,375,558
(B) 負債	213,376,886
未払解約金	213,331,062
未払信託報酬	43,729
未払利息	1,762
その他未払費用	333
(C) 純資産総額(A-B)	827,998,672
元本	829,730,000
償還差損金	△ 1,731,328
(D) 受益権総口数	829,730,000口
1万口当たり償還価額(C/D)	9,979円13銭

(注) 期首元本額は16,605,460,000円、期中追加設定元本額は51,297,670,000円、期中一部解約元本額は67,073,400,000円、1口当たり純資産額は0.997913円です。

○損益の状況 (2018年6月12日～2019年6月11日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	△ 469,590
受取利息	△ 391,273
支払利息	△ 78,317
(B) 有価証券売買損益	110,046
売買益	△ 851,683
売買損	961,729
(C) 信託報酬等	△ 135,883
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 495,427
(E) 前期繰越損益金	△ 3,611
(F) 追加信託差損益金	△1,232,290
(配当等相当額)	(△1,088,727)
(売買損益相当額)	(△ 143,563)
償還差損金(D+E+F)	△1,731,328

*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。

*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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2017年6月29日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2019年6月11日		資産総額	1,041,375,558円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	213,376,886円
				純資産総額	827,998,672円
受益権口数	11,000,000口	829,730,000口	818,730,000口	受益権口数	829,730,000口
元本額	11,000,000円	829,730,000円	818,730,000円	1万口当たり償還金	9,979円13銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	16,605,460,000円	16,590,873,969円	9,991円	0円	0%

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金 (税込み)	9,979円13銭
-----------------	-----------

○お知らせ

該当事項はございません。