

オーロラファンド (マネープールファンド)

追加型投信／国内／債券

交付運用報告書

第29期(決算日2015年10月30日)

作成対象期間(2014年10月31日～2015年10月30日)

第29期末(2015年10月30日)	
基準価額	10,084円
純資産総額	468百万円
第29期	
騰落率	0.0%
分配金(税込み)合計	5円

(注) 騰落率は分配金(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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

- 交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書(全体版)に記載しております。
- 当ファンドは、投資信託約款において運用報告書(全体版)に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供することができる旨を定めております。運用報告書(全体版)は、野村アセットマネジメントのホームページで閲覧・ダウンロードしていただけます。
- 運用報告書(全体版)は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

<運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法>

右記ホームページを開く

⇒「ファンド検索」にファンド名を入力しファンドを選択

⇒ファンド詳細ページから「運用報告書(全体版)」を選択

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。

当ファンドは、本邦通貨表示の公社債およびわが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、安定した収益の確保をはかることを目的として、安定運用を行います。

ここに、当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

当ファンドは運用開始以来、オーロラファンドを構成するファンドとして永らくご愛顧いただきましたが、2016年10月30日に信託期間満了を迎えます。

なお、オーロラファンドを構成するファンドのうち、オーロラファンド(タイ投資ファンド)については、2015年7月23日に信託期間を延長する約款変更を行い、2021年11月1日を信託期間終了日といたしましたので、ご留意下さい。

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。

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

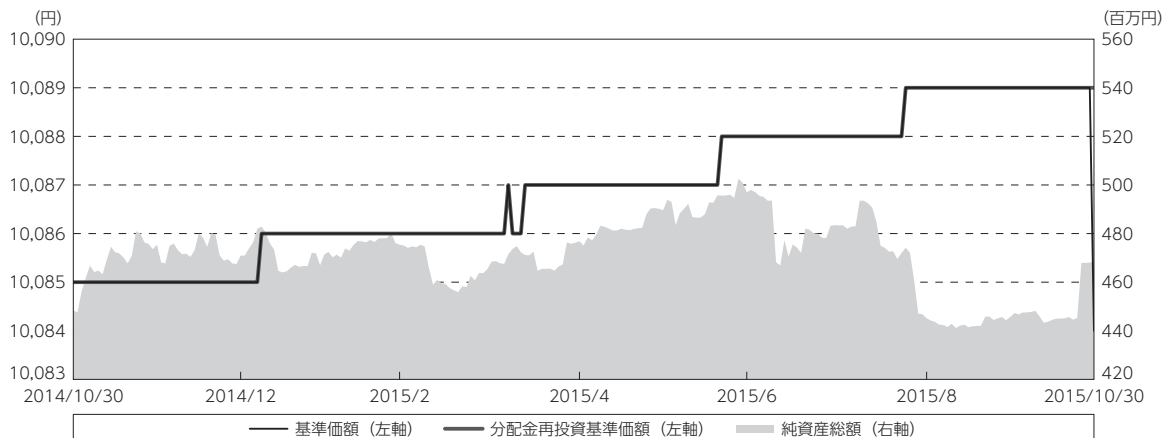


ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2014年10月31日～2015年10月30日)



期 首：10,085円

期 末：10,084円 (既払分配金(税込み):5円)

騰落率： 0.0% (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(2014年10月30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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン(利息収入)。

1 万口当たりの費用明細

(2014年10月31日～2015年10月30日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 2	% 0.022	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率
(投信会社)	(1)	(0.009)	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)	(1)	(0.010)	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)	(0.002)	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	2	0.022	
期中の平均基準価額は、10,086円です。			

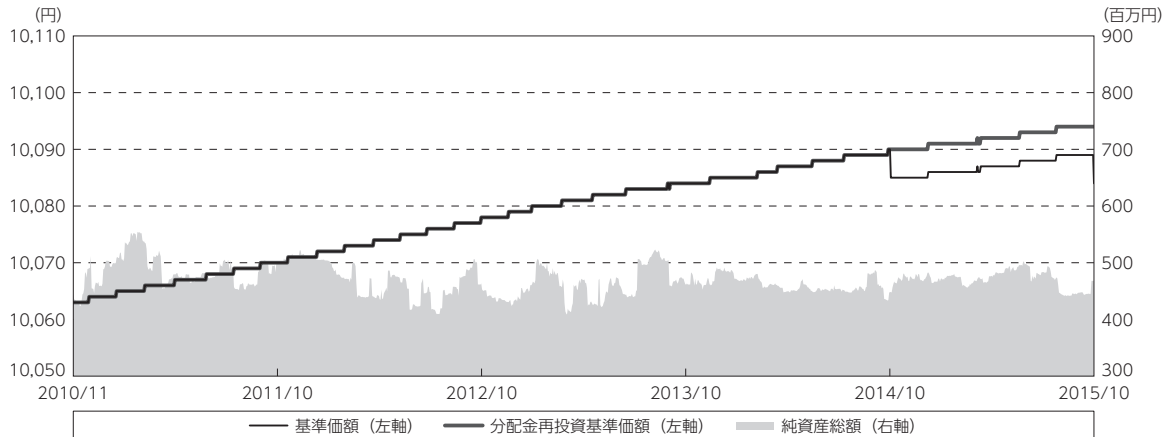
(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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。

最近5年間の基準価額等の推移

(2010年11月1日～2015年10月30日)



(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。2010年11月1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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

	2010年11月1日 決算日	2011年10月31日 決算日	2012年10月30日 決算日	2013年10月30日 決算日	2014年10月30日 決算日	2015年10月30日 決算日
基準価額 (円)	10,063	10,070	10,078	10,084	10,085	10,084
期間分配金合計(税込み) (円)	-	0	0	0	5	5
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	-	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
純資産総額 (百万円)	444	502	450	463	448	468

(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) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

(注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。

(注) 当ファンドは一時的に待機資金をプールしておくことを目的としたファンドであり、該当するベンチマーク等はありません。

投資環境

(2014年10月31日～2015年10月30日)

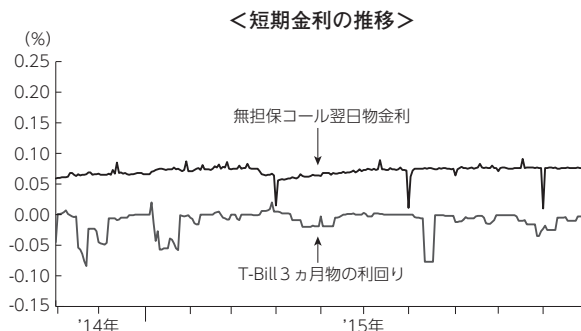
国内経済は、企業収益や雇用・所得環境が改善する中で緩やかな回復を続けてきましたが、2015年夏以降は、中国をはじめとする海外経済の減速に伴い輸出や生産が弱含んだほか、個人消費も伸び悩むなど、回復の動きに一服感が出始めました。このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続しました。

<無担保コール翌日物金利の推移>

期を通じて概ね0.06%台から0.07%台で推移しました。

<T-Bill (国庫短期証券) 3ヵ月物の利回りの推移>

国内投資家の恒常的な国債需要に加え、日本銀行による買入や海外からの資金流入に伴う需給ひっ迫により、利回りは概ねマイナス圏で推移しました。



当ファンドのポートフォリオ

(2014年10月31日～2015年10月30日)

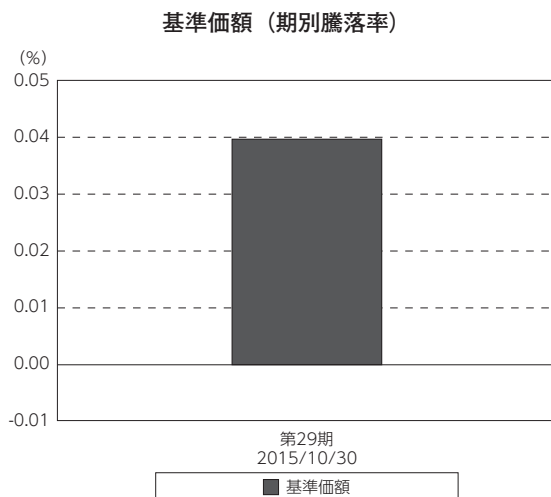
- (1) 当ファンドは、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図るという方針に基づき運用してまいりました。
- (2) 今期の運用につきましては、残存期間の短い高格付けの公社債等によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローンなどにより運用してまいりました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2014年10月31日～2015年10月30日)

当ファンドは一時的に待機資金をプールしておくことを目的としたファンドであり、該当する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。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

(2014年10月31日～2015年10月30日)

- (1) 収益分配金は、経費控除後の配当等収益等から1万口当たり5円とさせていただきます。
- (2) 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。

○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税込み)

項 目	第29期	
	2014年10月31日～2015年10月30日	
当期分配金	5	
(対基準価額比率)	0.050%	
当期の収益	5	
当期の収益以外	-	
翌期繰越分配対象額	174	

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

今後も、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図って運用してまいります。引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

お知らせ

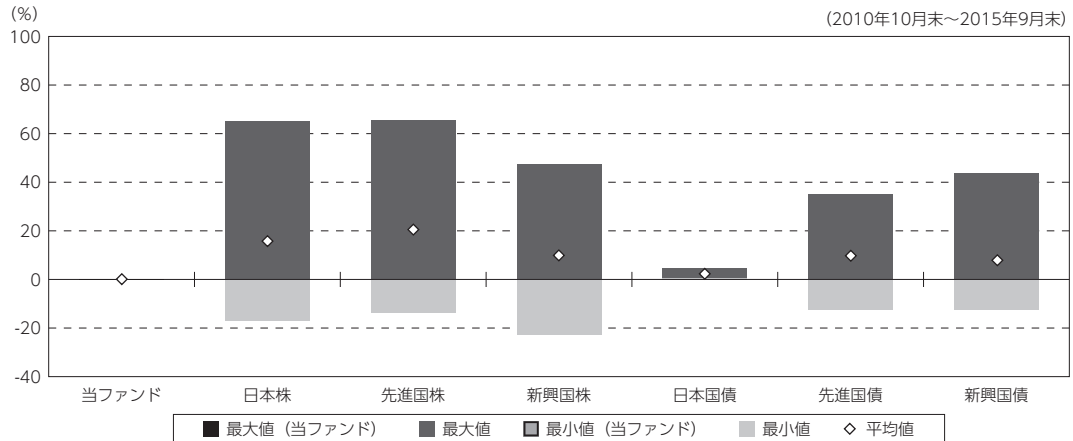
- ①運用報告書（全体版）について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2014年12月1日>
- ②デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2015年1月22日>

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／債券
信託期間	1986年10月31日から2016年10月30日（当初、2001年10月30日）までです。
運用方針	公社債および株式への投資により、安定した収益の確保をはかることを目的として安定運用を行います。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債およびわが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
運用方法	本邦通貨表示の公社債およびわが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、安定した収益の確保をはかることを目的として、安定運用を行います。
分配方針	原則として配当等収益を全額分配し、売買益等は留保します。

(参考情報)

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位:%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	0.1	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値	0.0	△ 17.0	△ 13.6	△ 22.8	0.4	△ 12.7	△ 12.4
平均値	0.1	15.8	20.5	9.9	2.3	9.7	7.9

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2010年10月から2015年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

(注) 決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《代表的な資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)

新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債：NOMURA-BPI 国債

先進国債：シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

※各指数についての説明は、P9の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドのデータ

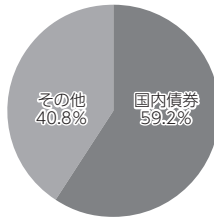
組入資産の内容

(2015年10月30日現在)

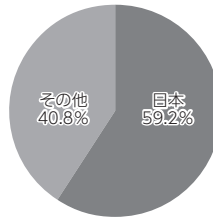
○組入上位10銘柄

	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
					%
1	共同発行市場地方債 公募第35回	地方債証券	円	日本	4.7
2	公営企業債券 政府保証第859回	特殊債券(除く金融債)	円	日本	4.3
3	日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第6回	特殊債券(除く金融債)	円	日本	4.3
4	宮城県 公募第6回2号	地方債証券	円	日本	4.3
5	東日本高速道路債券 政府保証第1回	特殊債券(除く金融債)	円	日本	4.3
6	神奈川県 公募第139回	地方債証券	円	日本	3.9
7	北海道 公募(5年)平成22年度第13回	地方債証券	円	日本	2.4
8	群馬県 公募(5年)第1回	地方債証券	円	日本	2.4
9	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第14回	特殊債券(除く金融債)	円	日本	2.2
10	農林債券 利付第733回い号	金融債券	円	日本	2.1
	組入銘柄数		26銘柄		

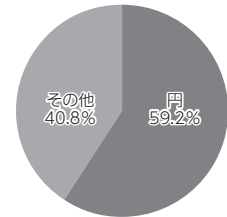
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。
(注) 国(地域)および国別配分は、原則として発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等は、運用報告書(全体版)に記載しております。
(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

純資産等

項目	第29期末
	2015年10月30日
純資産総額	468,196,439円
受益権総口数	464,281,721口
1万円当たり基準価額	10,084円

(注) 期中における追加設定元本額は474,569,519円、同解約元本額は454,814,702円です。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

○東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) は、株式会社東京証券取引所 (㈱東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(㈱東京証券取引所) が有しています。なお、本商品は、(㈱東京証券取引所) により提供、保証又は販売されるものではなく、(㈱東京証券取引所) は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)

○MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

○NOMURA-BPI 国債

NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。

○シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

「シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLC が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLC が有しています。

○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)

「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ち、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受入、プレースメント、エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。

米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」) は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。

JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、Citigroup Index LLC 他)

<お申し込み時の留意点>

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

(2015年10月30日現在)

年 月 \ ファンド名	韓国投資ファンド	香港投資ファンド	タイ投資ファンド
2015年10月	－	－	－
11月	－	－	－
12月	24、25	24、25	4、7、9、10

※2015年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。