

# オーロラファンド (マネープールファンド)

## 運用報告書(全体版)

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)

### 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日を信託期間終了の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。

●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   | 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。 |
| 主な投資対象 | 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。        |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合は信託財産の純資産総額の50%未満とします。                  |
| 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。                    |

## 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/>

## ○最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額<br>(分配落) | 騰 落 率 |     |               | 純 資 産 額 |     |
|------------------|------------------|-------|-----|---------------|---------|-----|
|                  |                  | 税 分   | 込 配 | み 金 期 騰 落 中 率 |         |     |
|                  | 円                |       |     |               | 百万円     |     |
| 25期(2011年10月31日) | 10,070           |       |     | 0             | 0.1     | 502 |
| 26期(2012年10月30日) | 10,078           |       |     | 0             | 0.1     | 450 |
| 27期(2013年10月30日) | 10,084           |       |     | 0             | 0.1     | 463 |
| 28期(2014年10月30日) | 10,085           |       |     | 5             | 0.1     | 448 |
| 29期(2015年10月30日) | 10,084           |       |     | 5             | 0.0     | 468 |

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

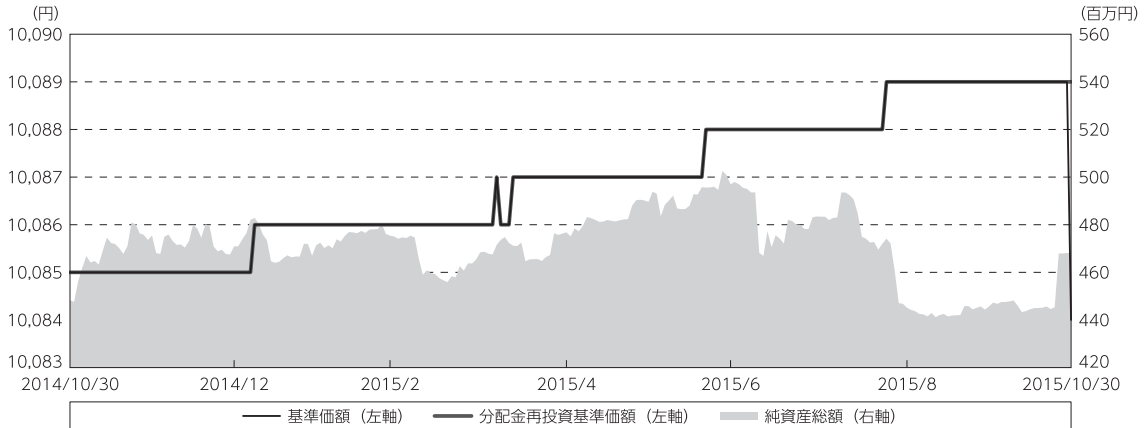
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日       | 基 準 価 額 | 騰 落 率 |     |
|-------------|---------|-------|-----|
|             |         | 騰 落   | 率   |
| (期 首)       | 円       |       | %   |
| 2014年10月30日 | 10,085  |       | —   |
| 10月末        | 10,085  |       | 0.0 |
| 11月末        | 10,085  |       | 0.0 |
| 12月末        | 10,085  |       | 0.0 |
| 2015年1月末    | 10,086  |       | 0.0 |
| 2月末         | 10,086  |       | 0.0 |
| 3月末         | 10,086  |       | 0.0 |
| 4月末         | 10,087  |       | 0.0 |
| 5月末         | 10,087  |       | 0.0 |
| 6月末         | 10,088  |       | 0.0 |
| 7月末         | 10,088  |       | 0.0 |
| 8月末         | 10,089  |       | 0.0 |
| 9月末         | 10,089  |       | 0.0 |
| (期 末)       |         |       |     |
| 2015年10月30日 | 10,089  |       | 0.0 |

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



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）。

## ○投資環境

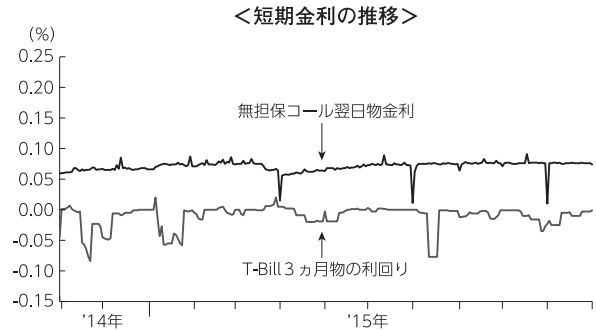
国内経済は、企業収益や雇用・所得環境が改善する中で緩やかな回復を続けてきましたが、2015年夏以降は、中国をはじめとする海外経済の減速に伴い輸出や生産が弱含んだほか、個人消費も伸び悩むなど、回復の動きに一服感が出始めました。このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続しました。

### <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。



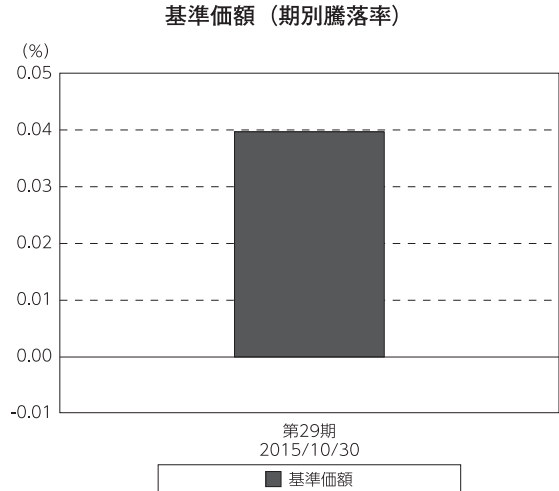
## ○当ファンドのポートフォリオ

- (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

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

- (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～<br>2015年10月30日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 5<br>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。

## ○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<br>2 | %<br>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。 |        |            |  |

\* 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

(2014年10月31日～2015年10月30日)

## 公社債

|    |       | 買付額              | 売付額                            |
|----|-------|------------------|--------------------------------|
| 国内 | 国債証券  | 千円<br>10,310,419 | 千円<br>8,970,467<br>(1,520,000) |
|    | 地方債証券 | 187,854          | —<br>( 40,000)                 |
|    | 特殊債券  | 511,099          | —<br>( 543,000)                |

\*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。

\*( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2014年10月31日～2015年10月30日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分  | 買付額等<br>A          |               |  | 売付額等<br>C          |               |        |
|-----|--------------------|---------------|--|--------------------|---------------|--------|
|     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |  | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |        |
| 公社債 | 百万円<br>150         | %<br>7.4      |  | 百万円<br>—           | 百万円<br>—      | %<br>— |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2015年10月30日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分             | 当 期       |           |         | 末                  |           |      |        |
|-----------------|-----------|-----------|---------|--------------------|-----------|------|--------|
|                 | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 組 入 比 率 | うちBB格以下<br>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        | %       | %                  | %         | %    | %      |
| 地方債証券           | 147,200   | 147,605   | 31.5    | —                  | —         | —    | 31.5   |
|                 | (147,200) | (147,605) | (31.5)  | (—)                | (—)       | (—)  | (31.5) |
| 特殊債券<br>(除く金融債) | 109,000   | 109,310   | 23.3    | —                  | —         | —    | 23.3   |
|                 | (109,000) | (109,310) | (23.3)  | (—)                | (—)       | (—)  | (23.3) |
| 金融債券            | 20,000    | 20,060    | 4.3     | —                  | —         | —    | 4.3    |
|                 | (20,000)  | (20,060)  | (4.3)   | (—)                | (—)       | (—)  | (4.3)  |
| 合 計             | 276,200   | 276,976   | 59.2    | —                  | —         | —    | 59.2   |
|                 | (276,200) | (276,976) | (59.2)  | (—)                | (—)       | (—)  | (59.2) |

\* ( )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。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* —印は組み入れなし。

\* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

\* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。



(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄                 | 柄                | 当 期 末 |         |         |            |
|--------------------|------------------|-------|---------|---------|------------|
|                    |                  | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| <b>地方債証券</b>       |                  |       | 千円      | 千円      |            |
| 北海道                | 公募（5年）平成22年度第13回 | 0.72  | 11,400  | 11,421  | 2016/2/25  |
| 宮城県                | 公募第6回2号          | 0.6   | 20,000  | 20,039  | 2016/3/25  |
| 神奈川県               | 公募第139回          | 1.94  | 18,000  | 18,123  | 2016/3/18  |
| 大阪府                | 公募第284回          | 1.6   | 3,100   | 3,103   | 2015/11/27 |
| 大阪府                | 公募（2年）第15回       | 0.096 | 10,000  | 10,000  | 2015/11/27 |
| 大阪府                | 公募（5年）第70回       | 0.66  | 6,000   | 6,010   | 2016/2/25  |
| 大阪府                | 公募（5年）第73回       | 0.51  | 10,000  | 10,024  | 2016/5/30  |
| 京都府                | 公募平成22年度第4回      | 0.49  | 3,000   | 3,001   | 2015/12/21 |
| 兵庫県                | 公募平成17年度第11回     | 1.5   | 5,700   | 5,719   | 2016/1/29  |
| 群馬県                | 公募第2回            | 1.6   | 7,000   | 7,006   | 2015/11/25 |
| 群馬県                | 公募（5年）第1回        | 0.43  | 11,000  | 11,002  | 2015/11/25 |
| 共同発行市場地方債          | 公募第34回           | 1.4   | 4,000   | 4,011   | 2016/1/25  |
| 共同発行市場地方債          | 公募第35回           | 1.6   | 22,000  | 22,106  | 2016/2/25  |
| 福島県                | 公募平成22年度第2回      | 0.59  | 10,000  | 10,015  | 2016/2/22  |
| 大阪市                | 公募平成17年度第10回     | 1.5   | 6,000   | 6,019   | 2016/1/26  |
| 小                  | 計                |       | 147,200 | 147,605 |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b> |                  |       |         |         |            |
| 公営企業債券             | 政府保証第859回        | 1.5   | 20,000  | 20,069  | 2016/1/25  |
| 公営企業債券             | 政府保証第860回        | 1.6   | 8,000   | 8,035   | 2016/2/19  |
| 中小企業債券             | 政府保証第187回        | 1.5   | 6,000   | 6,009   | 2015/12/15 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第14回        | 1.9   | 10,000  | 10,118  | 2016/6/22  |
| 東日本高速道路債券          | 政府保証第1回          | 1.6   | 20,000  | 20,021  | 2015/11/25 |
| 西日本高速道路債券          | 政府保証第1回          | 1.6   | 5,000   | 5,004   | 2015/11/25 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第6回         | 1.65  | 20,000  | 20,041  | 2015/12/18 |
| 中日本高速道路社債          | 第40回             | 0.298 | 10,000  | 10,008  | 2016/3/18  |
| 西日本高速道路            | 第17回             | 0.196 | 10,000  | 10,001  | 2015/12/18 |
| 小                  | 計                |       | 109,000 | 109,310 |            |
| <b>金融債券</b>        |                  |       |         |         |            |
| 農林債券               | 利付第732回い号        | 0.6   | 10,000  | 10,029  | 2016/5/27  |
| 農林債券               | 利付第733回い号        | 0.55  | 10,000  | 10,030  | 2016/6/27  |
| 小                  | 計                |       | 20,000  | 20,060  |            |
| 合                  | 計                |       | 276,200 | 276,976 |            |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年10月30日現在)

| 項 目          | 当 期 末   |       |
|--------------|---------|-------|
|              | 評 価 額   | 比 率   |
|              | 千円      | %     |
| 公社債          | 276,976 | 58.9  |
| コール・ローン等、その他 | 193,628 | 41.1  |
| 投資信託財産総額     | 470,604 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2015年10月30日現在）

○損益の状況（2014年10月31日～2015年10月30日）

| 項 目             | 当 期 末        |
|-----------------|--------------|
|                 | 円            |
| (A) 資産          | 470,604,871  |
| コール・ローン等        | 193,015,556  |
| 公社債（評価額）        | 276,976,393  |
| 未収利息            | 364,550      |
| 前払費用            | 248,372      |
| (B) 負債          | 2,408,432    |
| 未払収益分配金         | 232,140      |
| 未払解約金           | 2,125,201    |
| 未払信託報酬          | 50,888       |
| その他未払費用         | 203          |
| (C) 純資産総額（A－B）  | 468,196,439  |
| 元本              | 464,281,721  |
| 次期繰越損益金         | 3,914,718    |
| (D) 受益権総口数      | 464,281,721口 |
| 1万口当たり基準価額（C／D） | 10,084円      |

（注）期首元本額444百万円、期中追加設定元本額474百万円、期中一部解約元本額454百万円、計算口数当たり純資産額10,084円。

| 項 目              | 当 期          |
|------------------|--------------|
|                  | 円            |
| (A) 配当等収益        | 1,993,234    |
| 受取利息             | 1,993,234    |
| (B) 有価証券売買損益     | △1,744,561   |
| 売買益              | 296          |
| 売買損              | △1,744,857   |
| (C) 信託報酬等        | △ 101,886    |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C） | 146,787      |
| (E) 前期繰越損益金      | 4,425        |
| (F) 追加信託差損益金     | 3,995,646    |
| （配当等相当額）         | （ 6,048,023） |
| （売買損益相当額）        | （△2,052,377） |
| (G) 計（D＋E＋F）     | 4,146,858    |
| (H) 収益分配金        | △ 232,140    |
| 次期繰越損益金（G＋H）     | 3,914,718    |
| 追加信託差損益金         | 3,995,646    |
| （配当等相当額）         | （ 6,048,023） |
| （売買損益相当額）        | （△2,052,377） |
| 分配準備積立金          | 2,068,821    |
| 繰越損益金            | △2,149,749   |

\* 損益の状況の中で(B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

\* 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。

（注）分配金の計算過程（2014年10月31日～2015年10月30日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 第29期                        |
|------------------------------|-----------------------------|
|                              | 2014年10月31日～<br>2015年10月30日 |
| a. 配当等収益（経費控除後）              | 1,891,348円                  |
| b. 有価証券売買等損益（経費控除後・繰越欠損金補填後） | 0円                          |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 6,048,023円                  |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 409,613円                    |
| e. 分配対象収益（a＋b＋c＋d）           | 8,348,984円                  |
| f. 分配対象収益（1万口当たり）            | 179円                        |
| g. 分配金                       | 232,140円                    |
| h. 分配金（1万口当たり）               | 5円                          |

## ○分配金のお知らせ

---

|                 |    |
|-----------------|----|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|-----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合  
分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合  
分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合  
分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○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＞

## <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。