

オーロラⅡ (マネープールファンド)

償還運用報告書(全体版)

第29期（償還日2024年10月1日）

作成対象期間（2024年7月12日～2024年10月1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ない、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	1996年7月12日から2024年10月1日までです。
運用方針	本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、利息等収益の確保を図ります。
主な投資対象	本邦通貨表示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	毎決算時に、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から基準価額の水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行ないます。

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

●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
<https://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		税 分	込 配					
	円 銭		円		%		%	百万円
25期(2021年7月12日)	10,041		0		△0.0		72.2	152
26期(2022年7月11日)	10,040		0		△0.0		67.4	133
27期(2023年7月11日)	10,038		0		△0.0		67.1	119
28期(2024年7月11日)	10,038		0		0.0		61.9	113
(償還時)	(償還価額)							
29期(2024年10月1日)	10,041.22		—		0.0		—	105

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、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

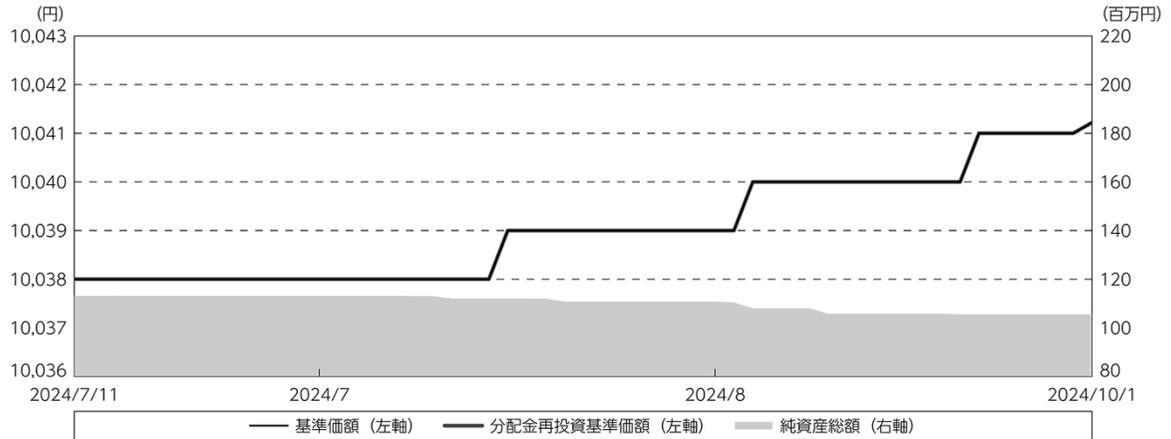
年 月 日	基準 円 銭	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		騰	落				
(期首)					%		%
2024年7月11日	10,038				—		61.9
7月末	10,038				0.0		8.8
8月末	10,039				0.0		63.2
9月末	10,041				0.0		—
(償還時)	(償還価額)						
2024年10月1日	10,041.22				0.0		—

*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： 10,038円

期末(償還日)：10,041円22銭 (既払分配金(税込み)：-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(2024年7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。

○基準価額の変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローン等からのインカムゲイン(利子収入)等。

○投資環境

国内経済は、緩やかな回復が続きました。このような中、日銀は2024年7月に無担保コール翌日物レートの誘導目標を、それまでの0～0.1%程度から0.25%程度への引き上げを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、概ね0～0.2%程度で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は、期首より0.08%程度で推移しましたが、上記の環境のもとで、8月以降は0.23%程度で推移しました。

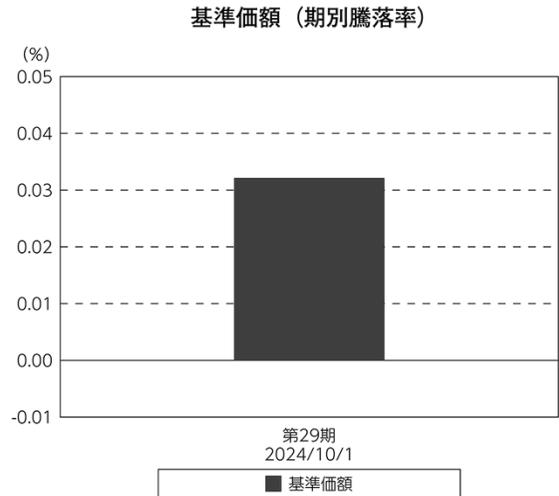
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、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。

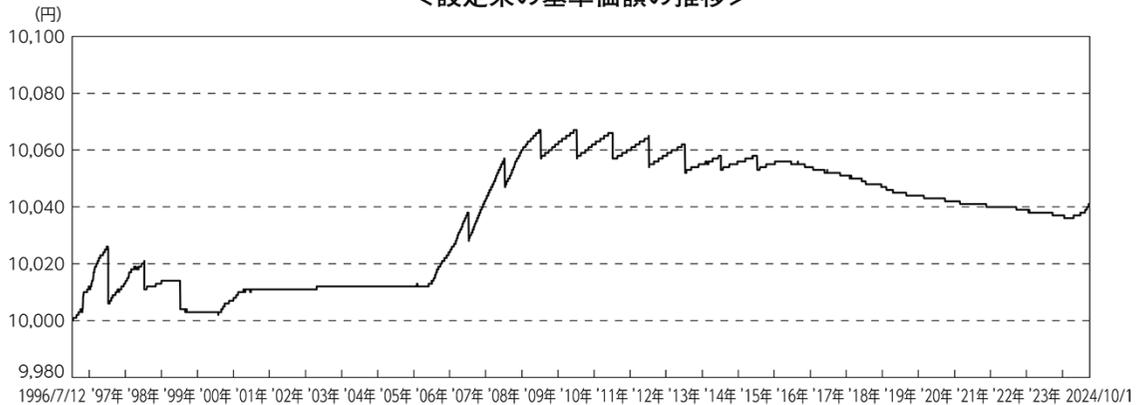


◎分配金

償還のため分配は行ないませんでした。

◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時の10,000円が償還時10,041.22円となりました。
設定来お支払した分配金は1万口当たり120円となりました。

第1期-第29期

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

設定から2016年5月まで、および2024年4月以降は投資している短期有価証券等やコール・ローン等からのインカムゲインが上昇要因となりました。また2016年6月から2024年3月までの期間は投資している短期有価証券やコール・ローン等のマイナス金利環境を要因とする支払利息等がマイナス要因となりました。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2024年7月12日～2024年10月1日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 0	% 0.005	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(0)	(0.002)	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)	(0.002)	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	0.005	
期中の平均基準価額は、10,039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。

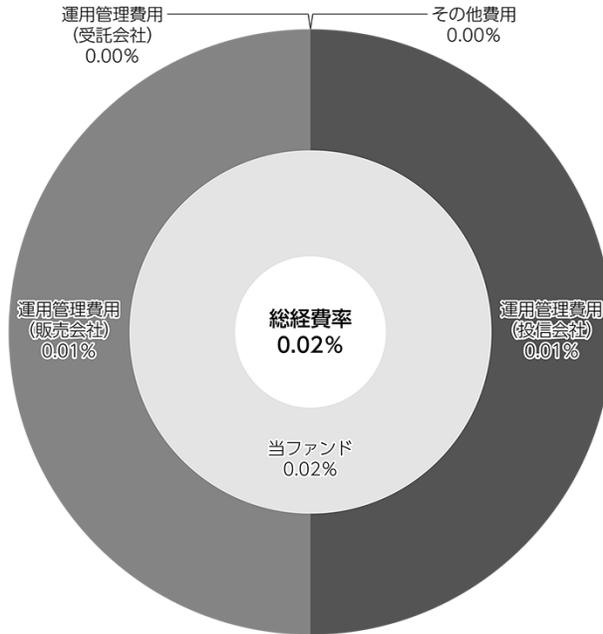
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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。

（参考情報）

○総経費率

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、売買委託手数料及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）は0.02%です。



(注) 当ファンドの費用は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す。

(注) 各費用は、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。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

(2024年7月12日～2024年10月1日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 2,590,000	千円 2,600,021
	特殊債券	—	— (60,000)

*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

(2024年7月12日～2024年10月1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。

○組入資産の明細

(2024年10月1日現在)

2024年10月1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

(2024年10月1日現在)

項目	償還時	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	千円 105,553	% 100.0
投資信託財産総額	105,553	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（2024年10月1日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	105,553,797
コール・ローン等	105,553,111
未収利息	686
(B) 負債	5,496
未払信託報酬	5,486
その他未払費用	10
(C) 純資産総額(A－B)	105,548,301
元本	105,115,053
償還差益金	433,248
(D) 受益権総口数	105,115,053口
1万口当たり償還価額(C/D)	10,041円22銭

(注) 期首元本額は112,724,467円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は7,609,414円、1口当たり純資産額は1.004122円です。

○損益の状況（2024年7月12日～2024年10月1日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	52,442
受取利息	52,442
(B) 有価証券売買損益	△ 10,205
売買益	2,000
売買損	△ 12,205
(C) 信託報酬等	△ 5,496
(D) 当期損益金(A+B+C)	36,741
(E) 前期繰越損益金	△ 27,852
(F) 追加信託差損益金	424,359
(配当等相当額)	(4,482,498)
(売買損益相当額)	(△4,058,139)
償還差益金(D+E+F)	433,248

*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	1996年7月12日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年10月1日		資産総額	105,553,797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	5,496円
受益権口数	10,000,000口	105,115,053口	95,115,053口	純資産総額	105,548,301円
元本額	10,000,000円	105,115,053円	95,115,053円	受益権口数	105,115,053口
				1万円当たり償還金	10,041円22銭
最近10期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第18期	502,753,131円	505,414,150円	10,053円	5円	0.05%
第19期	612,124,488	615,376,452	10,053	5	0.05
第20期	180,717,998	181,715,213	10,055	0	0.00
第21期	165,342,621	166,198,988	10,052	0	0.00
第22期	156,736,499	157,497,148	10,049	0	0.00
第23期	165,244,061	165,981,425	10,045	0	0.00
第24期	132,875,762	133,444,849	10,043	0	0.00
第25期	151,730,958	152,353,037	10,041	0	0.00
第26期	133,164,356	133,691,021	10,040	0	0.00
第27期	118,908,700	119,357,809	10,038	0	0.00
第28期	112,724,467	113,149,677	10,038	0	0.00

○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金（税込み）	10,041円22銭
----------------	------------

○お知らせ

該当事項はございません。