

# 野村ハイパーストック・ベア9 (マネー ポートフォリオ9)

## 償還運用報告書(全体版)

第2期(償還日2024年6月12日)

作成対象期間(2023年6月13日～2024年6月12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	2022年6月30日から2024年6月12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ないます。
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ないません。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。外貨建資産への投資は行ないません。
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ないます。

## 野村アセットマネジメント

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 <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○設定以来の運用実績

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								
(設定日) 2022年6月30日	円 銭 10,000		円			%			%		百万円 11
1期(2023年6月12日)	9,992		0			△0.1			78.5		6,370
(償還時) 2期(2024年6月12日)	(償還価額) 9,985.63		—			△0.1			—		637

\*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

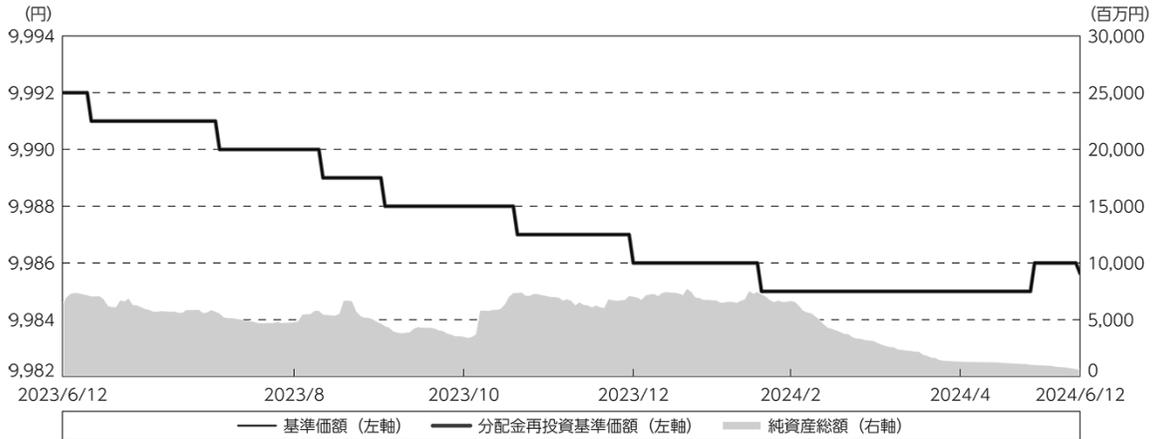
年 月 日	基 準	価 額		債 組	入 比	券 率	債 先	物 比	券 率
		騰	落						
(期首) 2023年6月12日	円 銭 9,992		%			%			%
6月末	9,991		—			78.5			—
7月末	9,991		△0.0			70.6			—
8月末	9,990		△0.0			79.9			—
9月末	9,989		△0.0			77.3			—
10月末	9,988		△0.0			—			—
11月末	9,987		△0.1			78.7			—
12月末	9,986		△0.1			78.9			—
2024年1月末	9,986		△0.1			78.5			—
2月末	9,985		△0.1			77.3			—
3月末	9,985		△0.1			47.8			—
4月末	9,985		△0.1			—			—
5月末	9,986		△0.1			—			—
(償還時) 2024年6月12日	(償還価額) 9,985.63		△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： 9,992円

期末(償還日)： 9,985円63銭 (既払分配金(税込み)：-円)

騰落率：  $\Delta 0.1\%$  (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(2023年6月12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

無担保コール翌日物金利水準

## ○投資環境

無担保コール翌日物金利は、期首よりマイナス圏で推移しましたが、2024年3月の日銀の金融政策決定会合におけるマイナス金利解除を受けて上昇し、その後プラス圏で推移しました。期中平均して、概ね-0.01%近辺の水準で推移しました。

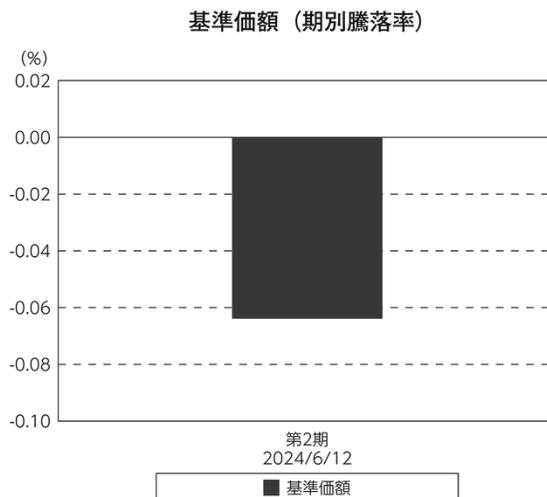
## ○当ファンドのポートフォリオ

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。

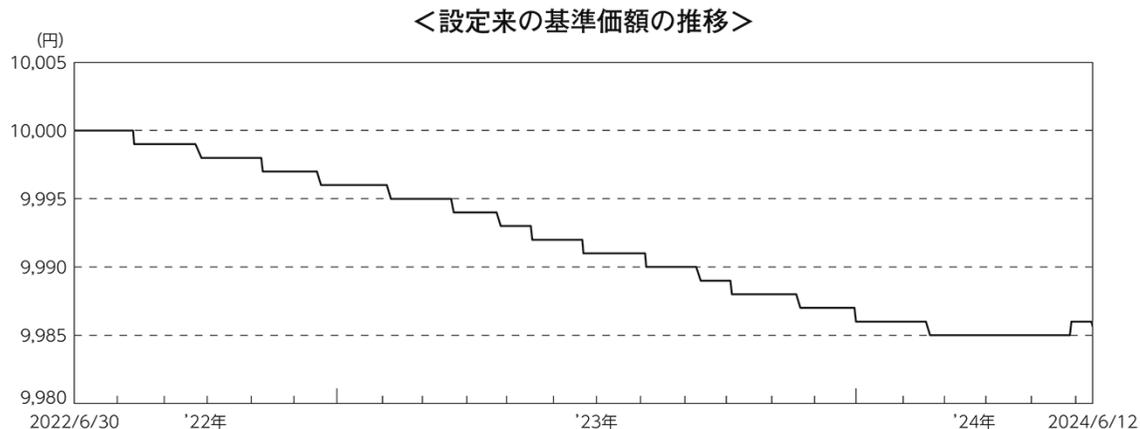
グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎分配金

償還のため分配は行ないませんでした。

## ◎設定来の運用経過



### ○基準価額の推移

基準価額は、設定時10,000円が償還時9,985.63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

#### 1期

無担保コール翌日物金利は概ね-0.04%近辺の水準で推移し、基準価額は下落しました。

#### 2期

無担保コール翌日物金利は、期首よりマイナス圏で推移しましたが、2024年3月の日銀の金融政策決定会合におけるマイナス金利解除を受けて上昇し、その後プラス圏で推移しました。期中平均して、概ね-0.01%近辺の水準で推移し、基準価額は下落しました。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2023年6月13日～2024年6月12日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(1)	(0.010)	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、9,987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。

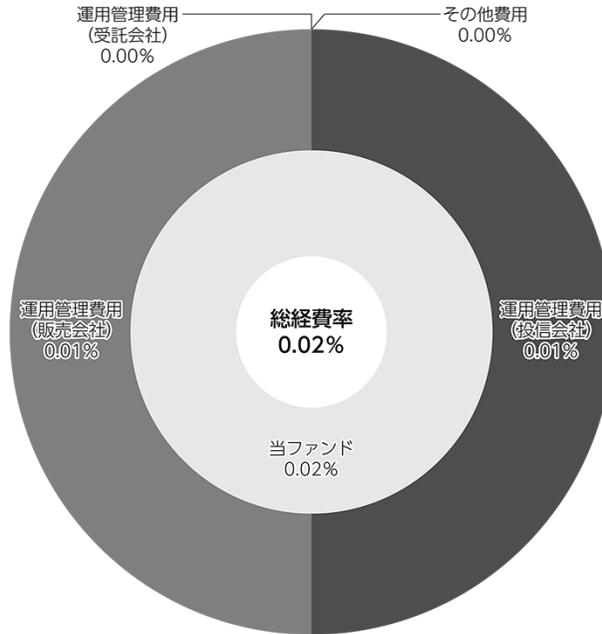
\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 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

(2023年6月13日～2024年6月12日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 892,110,000	千円 897,106,098

\*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

(2023年6月13日～2024年6月12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

(2023年6月13日～2024年6月12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

(2024年6月12日現在)

2024年6月12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6月12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 710,821	% 100.0
投資信託財産総額	710,821	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6月12日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	710,821,899
コール・ローン等	710,820,293
未収利息	1,606
(B) 負債	73,549,187
未払解約金	73,516,932
未払信託報酬	32,046
その他未払費用	209
(C) 純資産総額(A-B)	637,272,712
元本	638,190,000
償還差損金	△ 917,288
(D) 受益権総口数	638,190,000口
1万円当たり償還価額(C/D)	9,985円63銭

(注) 期首元本額は6,376,300,000円、期中追加設定元本額は21,818,820,000円、期中一部解約元本額は27,556,930,000円、1口当たり純資産額は0.998563円です。

## ○損益の状況 (2023年6月13日～2024年6月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 36,023
受取利息	△ 30,049
支払利息	△ 5,974
(B) 有価証券売買損益	25,348
売買益	△326,730
売買損	352,078
(C) 信託報酬等	△ 66,118
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 76,793
(E) 前期繰越損益金	△ 3,726
(F) 追加信託差損益金	△836,769
(配当等相当額)	(△741,122)
(売買損益相当額)	(△ 95,647)
償還差損金(D+E+F)	△917,288

\*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	2022年6月30日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年6月12日		資 産 総 額	710,821,899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	73,549,187円
				純 資 産 総 額	637,272,712円
受益権口数	11,000,000口	638,190,000口	627,190,000口	受 益 権 口 数	638,190,000口
元 本 額	11,000,000円	638,190,000円	627,190,000円	1万円当たり償還金	9,985円63銭
毎計算期末の状況					
計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第1期	6,376,300,000円	6,370,998,379円	9,992円	0円	0%

## ○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金(税込み)	9,985円63銭
----------------	-----------

## ○お知らせ

該当事項はございません。