

リクソー・ヘッジファンド・セレクション マネープール・ファンド

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	
信託期間とクローズド期間	信託期間は2009年12月10日から2019年11月5日までです。クローズド期間はありません。	
運用方針	投資信託財産の安定的な収益の確保を目指して運用を行います。	
主要運用対象	リクソー・ヘッジファンド・セレクション マネープール・ファンド	リクソー・マネー・マザーファンド（「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
	リクソー・マネー・マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
組入制限	リクソー・ヘッジファンド・セレクション マネープール・ファンド	外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）への投資は行いません。株式への実質投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	リクソー・マネー・マザーファンド	外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）への投資は行いません。株式への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、収益の分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。収益分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。収益分配にあてず投資信託財産内に留保した利益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、運用の基本方針に基づき運用を行います。	

第6期 運用報告書(全体版)

《決算日 2015年11月5日》

平素は格別のご高配を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「リクソー・ヘッジファンド・セレクション マネープール・ファンド」は、2015年11月5日に第6期の決算を行いましたので、期中の運用状況につきご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

リクソー投信株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目1番1号
パレスビル

お問い合わせ窓口：運用・企画部
電話番号：03-6777-6900

（オフィス移転に伴い、2015年4月6日付で住所と電話番号が変更されました。）

※土日祝・年末年始を除く9時～17時
ホームページ <http://www.lyxor.co.jp>

■最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額 (分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	債券組入 比 率	債券先物 比 率	純資産 総 額
		円	%			
2期(2011年11月7日)	円 10,008	円 0	% 0.0	% —	% —	百万円 60
3期(2012年11月5日)	10,011	0	0.0	—	—	53
4期(2013年11月5日)	10,014	0	0.0	—	—	53
5期(2014年11月5日)	10,014	0	0.0	55.1	—	53
6期(2015年11月5日)	10,014	0	0.0	—	—	53

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」および「債券先物比率」は実質を記載しております。以下同じ。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注3) 当ファンドは、投資資金を一時待機させておくことを目的としたファンドであるため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。以下同じ。

■当期中の基準価額と市況等の推移

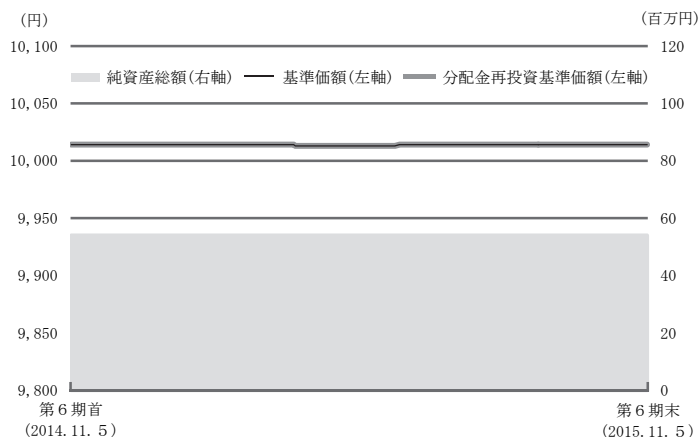
年 月 日	基準価額	騰 落 率	債 券 組入比率	債 券 先物比率
		%		
(期 首) 2014年11月5日	円 10,014	% —	% 55.1	% —
11月末	10,014	0.0	55.1	—
12月末	10,014	0.0	55.1	—
2015年1月末	10,014	0.0	55.1	—
2月末	10,014	0.0	54.7	—
3月末	10,013	△ 0.0	54.7	—
4月末	10,013	△ 0.0	55.6	—
5月末	10,013	△ 0.0	55.6	—
6月末	10,014	0.0	55.6	—
7月末	10,014	0.0	55.6	—
8月末	10,014	0.0	55.6	—
9月末	10,014	0.0	—	—
10月末	10,014	0.0	55.6	—
(期 末) 2015年11月5日	10,014	0.0	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

■当期中の運用経過 (2014年11月6日から2015年11月5日まで)

《基準価額の推移》



第6期首	10,014 円
第6期末	10,014 円
既払分配金	0 円
騰落率 (分配金再投資ベース)	0.0%

※ 分配金再投資基準価額は、第6期首の基準価額をもとに委託会社で指数化したものを使用しております。

※ 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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はありません。

※ 分配金を再投資するかどうかについてはお客様が利用する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。

※ 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

《基準価額の変動要因と投資環境》

期首（2014年11月5日）10,014円でスタートした当ファンドの基準価額は、10,014円で今期末（2015年11月5日）を迎えました。

当ファンドは、リクソー・マネー・マザーファンド受益証券を組入れることにより実質的な運用を当該マザーファンドにおいて行っています。

国内投資家の根強い需要が続く一方、日銀による買入れなどから需給ひっ迫状態が続いたことなどを背景に、当期の3ヵ月国庫短期証券の利回りは概ね0%近辺のレンジで推移しました。

日銀による追加緩和効果などを背景に国庫短期証券の利回りが低下傾向で推移したことなどから、主要投資対象であるリクソー・マネー・マザーファンドの基準価額の上昇も限られ、当ファンドの基準価額への寄与も限定的なものとなりました。

《運用経過》

<当ファンド>

当初の運用方針に基づき、期中、リクソー・マネー・マザーファンド受益証券への投資を通じて、安定的な収益の確保を目指す運用を行いました。

<リクソー・マネー・マザーファンド>

国庫短期証券を原則として償還まで保有する運用を行い、また、余剰資金についてはコール・ローンによる運用を行いました。

■収益分配金について

基準価額水準等を勘案し、当期の分配は見送りといたしました。なお、収益分配にあてず投資信託財産内に留保した利益につきましては、元本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、税引前)

項 目	第 6 期	
	自 2014年11月 6 日	至 2015年11月 5 日
当期分配金		—
(対基準価額比率)		—
当期の収益		—
当期の収益以外		—
翌期繰越分配対象額		13

(注1) 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2) 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

<当ファンド>

今後も当初の運用方針に基づいた運用を行います。

<リクソー・マネー・マザーファンド>

今後も当初の運用方針に基づく運用を基本としますが、純資産額の規模等によっては、安全性および資金の確保等を考慮し、引き続きコール・ローンなどの短期金融商品への投資を通じて、安定的な収益の確保を目指した運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期 (2014年11月6日～2015年11月5日)		項 目 の 概 要
	金額	比率	
(a) 信 託 報 酬	1円	0.011%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額（月末値の平均値）は 10,013 円です。 ・委託した資金の運用の対価 ・交付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、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
（投 信 会 社）	(0)	(0.004)	
（販 売 会 社）	(0)	(0.003)	
（受 託 会 社）	(0)	(0.003)	
(b) そ の 他 費 用	0	0.005	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（監 査 費 用）	(0)	(0.005)	
合 計	1	0.016	

- (注1) 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2) 消費税は報告日の税率を採用しています。
(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注4) 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。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（2014年11月6日から2015年11月5日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
リクソー・マネー・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 —	千円 —

(注) 単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況（2014年11月6日から2015年11月5日まで）

当期中の利害関係人との取引はありません。

■ 組入資産の明細（2015年11月5日現在）

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
リクソー・マネー・マザーファンド	千口 50,985	千口 50,985	千円 51,086

- (注1) 口数・評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 親投資信託合計の受益権口数は50,985千口です。

■投資信託財産の構成

(2015年11月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
リクソー・マネー・マザーファンド	51,086	94.7
コール・ローン等、その他	2,875	5.3
投資信託財産総額	53,961	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2015年11月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	53,961,407円
コール・ローン等	2,874,432
リクソー・マネー・マザー フ ァ ン ド (評 価 額)	51,086,975
(B) 負 債	4,166
未 払 信 託 報 酬	2,819
そ の 他 未 払 費 用	1,347
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	53,957,241
元 本	53,884,423
次 期 繰 越 損 益 金	72,818
(D) 受 益 権 総 口 数	53,884,423口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,014円

<注記事項>

期首元本額	53,884,423円
期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	0円

■損益の状況

当期 (自2014年11月6日 至2015年11月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	104円
受 取 利 息	104
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,099
売 買 益	5,099
(C) 信 託 報 酬 等	△ 8,270
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 3,067
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	55,285
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	20,600
(配 当 等 相 当 額)	(7,324)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,276)
(G) 計 (D + E + F)	72,818
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	72,818
追 加 信 託 差 損 益 金	20,600
(配 当 等 相 当 額)	(7,324)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,276)
分 配 準 備 積 立 金	59,568
繰 越 損 益 金	△ 7,350

(注1) 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。

(注2) 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。

(注3) 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4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(13,250円)および分配準備積立金(59,568円)より分配対象収益は72,818円(10,000口当たり13円)ですが、当期に分配した金額はありません。

【お知らせ】

2014年12月1日以降に作成基準日を迎える運用報告書は、「交付運用報告書」と「運用報告書（全体版）」（本報告書）に二段階化されることになりました。

「交付運用報告書」は作成の都度、従来の運用報告書と同様に販売会社を通じて受益者のみなさまにお届けいたします。「運用報告書（全体版）」（本報告書）は電磁的方法によりご提供する旨を定めておりますが、書面での交付をご希望の場合は、販売会社までお問い合わせください。

■約款変更のお知らせ

<リクソー・ヘッジファンド・セレクション マネープール・ファンド>

法令改正に伴い、投資信託約款に以下の変更を行いました。（2014年12月1日）

- ・デリバティブ取引等に係るリスク管理方法についての条項を新設
- ・投資信託契約の解約および重大な約款変更等に係る書面決議手続きに関する所要の変更
- ・運用報告書に記載すべき事項の提供に関する条項を新設

<リクソー・マネー・マザーファンド>

●法令改正に伴い、投資信託約款に以下の変更を行いました。（2014年12月1日）

- ・デリバティブ取引等に係るリスク管理方法についての条項を新設
- ・投資信託契約の解約および重大な約款変更等に係る書面決議手続きに関する所要の変更
- ・反対受益者の受益権の買取請求の規定を適用除外とする所用の変更
- ・運用報告書に記載すべき事項の提供に関する条項を新設

●追加信託金および一部解約金を計算する際、リクソー・マネー・マザーファンドの申込日の前営業日の純資産総額を使用するための所用の変更を行いました。（2015年7月17日）

リクソー・マネー・マザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2015年11月5日）

「リクソー・マネー・マザーファンド」は、「リクソー・ヘッジファンド・セレクション マネープール・ファンド」が投資対象とする親投資信託で、投資信託財産の実質的な運用を行っています。ここに、当マザーファンドの第6期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2009年12月10日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）への投資は行いません。 株式への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

リクソー投信株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目1番1号 パレスビル

<http://www.lyxor.co.jp>

■最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中	債券組入 比 率	債券先物 比 率	純資産 総 額
		騰 落 率			
2期(2011年11月7日)	円 10,008	% 0.0	% —	% —	百万円 51
3期(2012年11月5日)	10,013	0.0	—	—	51
4期(2013年11月5日)	10,017	0.0	—	—	51
5期(2014年11月5日)	10,019	0.0	58.2	—	51
6期(2015年11月5日)	10,020	0.0	—	—	51

(注1) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注2) 当ファンドは、投資資金を一時待機させておくことを目的としたファンドであるため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。以下同じ。

■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 券 組入比率	債 券 先物比率
(期 首) 2014年11月5日	円 10,019	% —	% 58.2	% —
11月末	10,019	0.0	58.2	—
12月末	10,019	0.0	58.2	—
2015年1月末	10,019	0.0	58.2	—
2月末	10,019	0.0	57.8	—
3月末	10,019	0.0	57.8	—
4月末	10,019	0.0	58.7	—
5月末	10,019	0.0	58.7	—
6月末	10,020	0.0	58.7	—
7月末	10,020	0.0	58.7	—
8月末	10,020	0.0	58.7	—
9月末	10,020	0.0	—	—
10月末	10,020	0.0	58.7	—
(期 末) 2015年11月5日	10,020	0.0	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

■当期中の運用経過

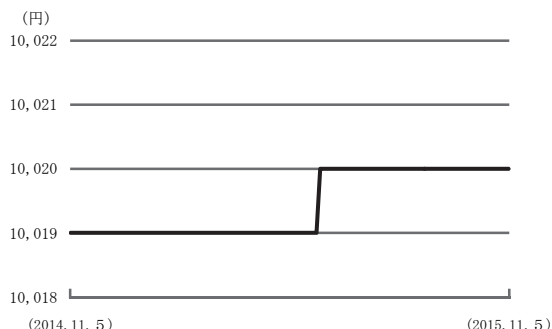
《運用の経過および基準価額の変動要因》

当期は国庫短期証券を原則として償還まで保有する運用を行い、また、余剰資金についてはコール・ローンによる運用を行いました。この結果、期首（2014年11月5日）10,019円でスタートした当ファンドの基準価額は、10,020円で今期末（2015年11月5日）を迎えました。

《今後の運用方針》

マネープール・ファンドの「当期中の運用経過」（2頁）をご参照ください。

《基準価額の推移》



■1万口（元本1万円）当たりの費用の明細

該当ありません。

■期中の売買及び取引の状況（2014年11月6日から2015年11月5日まで）

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 119,999	千円 — (150,000)

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) () 内は償還等による増減分です。

■主要な売買銘柄（2014年11月6日から2015年11月5日まで）

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
第541回国庫短期証券	千円 30,000	—	千円 —
第548回国庫短期証券	30,000		
第502回国庫短期証券	29,999		
第521回国庫短期証券	29,999		

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況（2014年11月6日から2015年11月5日まで）

当期中における利害関係人との取引はありません。

（注）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をいいます。

■ 組入資産の明細（2015年11月5日現在）

公社債

債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 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
国 債 証 券	千円 —	千円 —	% —	% —	% —	% —	% —
合 計	—	—	—	—	—	—	—

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注2）単位未満は切捨て。

（注3）—印は組み入れなし。

（注4）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。

■投資信託財産の構成

(2015年11月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	51,085	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	51,085	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2015年11月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	51,085,680円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	51,085,667
未 収 利 息	13
(B) 純 資 産 総 額 (A)	51,085,680
元 本	50,985,005
次 期 繰 越 損 益 金	100,675
(C) 受 益 権 総 口 数	50,985,005口
1万口当たり基準価額 (B/C)	10,020円

<注記事項>

- (注1) 期首元本額 51,418,300円
 期中追加設定元本額 798,483円
 期中一部解約元本額 1,231,778円
- (注2) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、リクソー・マネーパール・ファンド50,985,005円です。

■損益の状況

当期 (自2014年11月6日 至2015年11月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,246円
受 取 利 息	3,246
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	82
売 買 益	82
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	3,328
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	98,169
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,517
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 2,339
(G) 計 (C+D+E+F)	100,675
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	100,675

- (注1) 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。
- (注2) 損益の状況の中で(E)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3) 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。