

近未来世界ファンド (愛称:ザ・フューチャー・エイト)

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／内外／株式
信託期間とクローズド期間	信託期間は2017年4月18日から2027年12月10日までです。クローズド期間はありません。
運用方針	「ザ・フューチャー8指数」(以下「参照指数」といいます。)のパフォーマンスにより価格および償還価額が変動する性質を有する円建て債券(以下「パフォーマンス連動債」といいます。)へ投資を行うことにより、参照指数の投資成果を獲得することを目的とします。
主要運用対象	参照指数のパフォーマンスにより価格および償還価額が変動する性質を有するパフォーマンス連動債を主要投資対象とします。
主な組入制限	①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。)への直接投資は行いません。 ②株式への直接投資は行いません。
分配方針	原則として、毎決算時に分配を行います。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1期 運用報告書(全体版)

《決算日 2017年12月11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、「近未来世界ファンド(愛称:ザ・フューチャー・エイト)」は、2017年12月11日に第1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

※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>

■設定以来の運用実績

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
(設 定 日) 2017年4月18日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 71
1期(2017年12月11日)	12,443	0	24.4	99.1	—	218

(注1) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注2) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。以下同じ。

(注3) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注4) 当ファンドの商品性に適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数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
(設 定 日) 2017年4月18日	円 10,000	% —	% —	% —
4月末	10,474	4.7	98.5	—
5月末	10,673	6.7	98.9	—
6月末	10,928	9.3	99.1	—
7月末	11,136	11.4	98.4	—
8月末	11,208	12.1	99.6	—
9月末	11,933	19.3	99.4	—
10月末	12,516	25.2	98.6	—
11月末	12,510	25.1	99.2	—
(期 末) 2017年12月11日	12,443	24.4	99.1	—

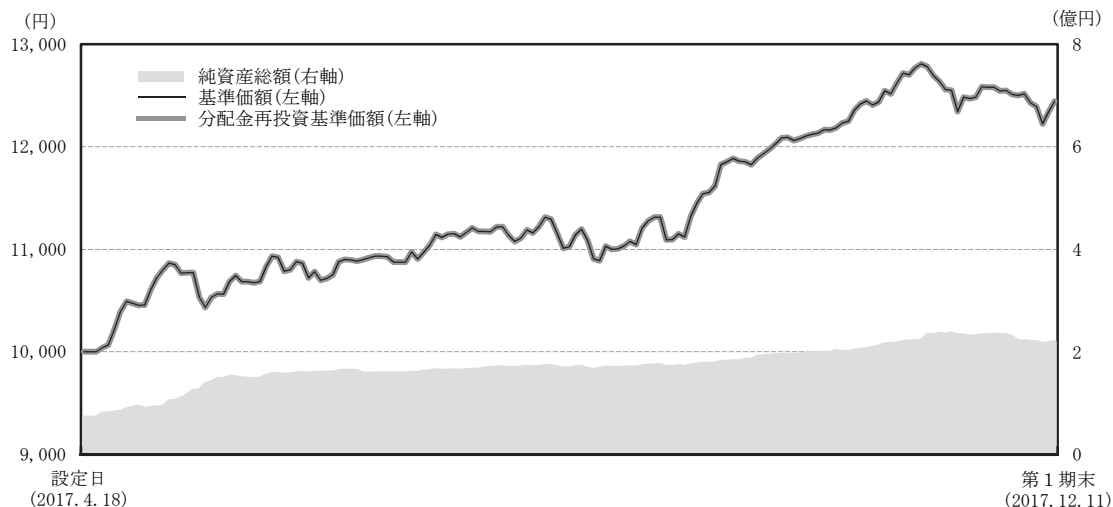
(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

■当期における運用経過

●第1期（2017年4月18日（設定日）から2017年12月11日まで）

《基準価額の推移》



※分配金再投資基準価額の推移は、設定日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す。

※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。

※当ファンドの商品性に適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

（円）

設定日	期中高値	期中安値	期末
2017/4/18	2017/11/8	2017/4/18	2017/12/11
10,000	12,808	10,000	12,443

《基準価額の変動要因》

上昇要因：

- ・世界的に株式相場が堅調であったことに加えて、特に参照指数における配分比率の高い日本および米国の株式市場の上昇により、参照指数が上昇したこと。
- ・為替市場（日本円／米ドル）で米ドルが対円で底堅く推移したこと。

下落要因：

- ・為替市場（日本円／米ドル）が特定の局面で円高に振れたこと。

《運用経過》

当初の運用方針に基づき、当期中、パフォーマンス連動債の組入れを高位に保つ運用を行いました。パフォーマンス連動債への投資にあたっては、一般社団法人投資信託協会規則に則り、信用リスクを適正に管理することにより、信用リスクの分散を図った投資を行いました。

■収益分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準および資産の状況等を勘案した結果、当期（第1期）につきましては見送りとさせていただきます。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1期	
	自 2017年4月18日	至 2017年12月11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		2,443

(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

今後も当初の運用方針に基づき、原則としてパフォーマンス連動債への投資比率を高位に維持することにより、当初目標の投資成果を獲得することを目的とした運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期 (2017年4月18日～2017年12月11日)		項 目 の 概 要
	金額	比率	
(a) 信 託 報 酬	44円	0.387%	(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11,422円です。
（投 信 会 社）	(20)	(0.176)	<ul style="list-style-type: none"> ・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
（販 売 会 社）	(20)	(0.176)	
（受 託 会 社）	(4)	(0.035)	
(b) そ の 他 費 用	16	0.141	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(7)	(0.064)	<ul style="list-style-type: none"> ・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・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 ・その他は、法定書類（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、印刷等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.007)	
（そ の 他）	(8)	(0.070)	
合 計	60	0.528	

(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。

■ 期中の売買及び取引の状況（2017年4月18日から2017年12月11日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	社 債 券（ 投 資 法 人 債 券 を 含 む ）	217,269	33,191

(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) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■ 主要な売買銘柄（2017年4月18日から2017年12月11日まで）

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
CODEIS SGI THE FUTURE8 INDEX	217,269	CODEIS SGI THE FUTURE8 INDEX	33,191

(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（2017年4月18日から2017年12月11日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 217	百万円 217	% 100	百万円 33	百万円 33	% 100

(注1) 公社債には現先などによるものを含まません。

(注2) 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、ソシエテ・ジェネラルです。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	一千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	一千円
(B) / (A)	-%

(注1) 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、ソシエテ・ジェネラルです。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産の明細（2017年12月11日現在）

公社債

(A) 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
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	千円 172,800 (172,800)	千円 217,105 (217,105)	% 99.1 (99.1)	% — (—)	% 99.1 (99.1)	% — (—)	% — (—)
合 計	172,800 (172,800)	217,105 (217,105)	99.1 (99.1)	— (—)	99.1 (99.1)	— (—)	— (—)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) —印は組み入れなし。

(注5) 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。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄 名	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券) CODEIS SGI THE FUTURE8 INDEX	% 0	千円 172,800	千円 217,105	2027/12/2
合計	—	172,800	217,105	—

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

(2017年12月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 217,105	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,647	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	220,752	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

(2017年12月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	220,752,721円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,646,801
公 社 債 (評価額)	217,105,920
(B) 負 債	1,760,658
未 払 解 約 金	1,523,691
未 払 信 託 報 酬	197,497
未 払 利 息	7
そ の 他 未 払 費 用	39,463
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	218,992,063
元 本	175,994,880
次 期 繰 越 損 益 金	42,997,183
(D) 受 益 権 総 口 数	175,994,880口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,443円

< 注記事項 >

期首元本額	71,652,461円
期中追加設定元本額	174,293,917円
期中一部解約元本額	69,951,498円

■損益の状況

当期 (自2017年4月18日 至2017年12月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,959円
支 払 利 息	△ 1,959
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	25,598,268
売 買 益	33,270,353
売 買 損	△ 7,672,085
(C) 信 託 報 酬 等	△ 897,804
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	24,698,505
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	18,298,678
(配 当 等 相 当 額)	(△ 1,704)
(売 買 損 益 相 当 額)	(18,300,382)
(F) 計 (D + E)	42,997,183
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	42,997,183
追 加 信 託 差 損 益 金	18,298,678
(配 当 等 相 当 額)	(△ 1,704)
(売 買 損 益 相 当 額)	(18,300,382)
分 配 準 備 積 立 金	24,700,464
繰 越 損 益 金	△ 1,959

(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(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(24,700,464円)、および信託約款に規定する収益調整金(18,298,423円)より分配対象収益は42,998,887円(10,000口当たり2,443円)ですが、当期に分配した金額はありません。