

## リクソー・ヘッジファンド・セレクション トランストレンド・エンハンスト連動ファンド

追加型投信／内外／資産複合

第9期末（償還日2017年12月21日）	
償還価額	13,864.94円
純資産総額	65百万円
騰落率	4.0%
分配金合計	0円

(注) 騰落率は収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものと  
として計算したものです。

### 償還 交付運用報告書

作成対象期間：2017年11月7日～2017年12月21日  
第9期《償還日：2017年12月21日》

受益者のみなさまへ

- 当ファンドは、投資信託約款において運用報告書（全体版）に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書（全体版）は、弊社ホームページの「ファンド情報」→「2015年以降に償還した以下のファンドの運用報告書はこちらです。」→当ファンドのファンド名称を選択→「過去の運用報告書一覧」当ファンドの欄の運用報告書（全体版）を選択することにより、閲覧およびダウンロードすることができます。
- 運用報告書（全体版）は、受益者のご請求により交付されます。運用報告書（全体版）をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

平素は格別のご愛顧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・セレクショントランストレンド・エンハンスト連動ファンド」は、投資信託約款の規定に基づき2017年12月21日をもちまして償還いたしました。当ファンドは、参照ファンド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米ドル建てユーロ・ミディアム・ターム・ノートへの投資を行うことにより、参照ファンドの投資成果の獲得を目的として運用を行ってまいりました。ここに、運用状況と償還内容につきご報告申し上げます。当ファンドをご愛顧いただきましたことに対し、厚く御礼申し上げます。

### リクソー投信株式会社

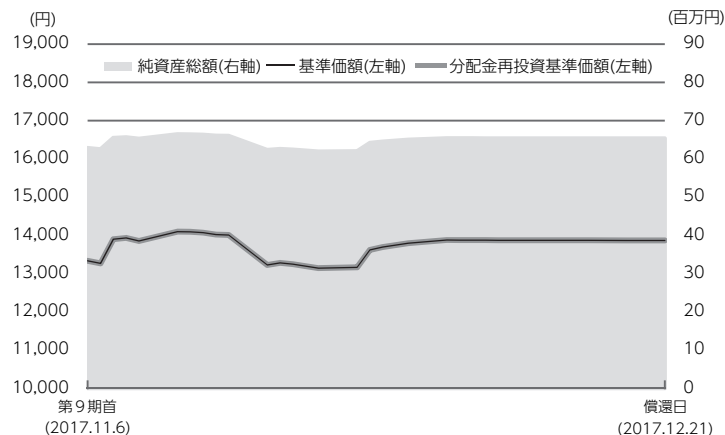
東京都千代田区丸の内一丁目1番1号  
パレスビル

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>

# 運用経過 (2017年11月7日から2017年12月21日まで)

## ■基準価額等の推移について



第9期首	13,333円
第9期末 (償還日)	13,864.94円
既払分配金	0円
騰落率 (分配金再投資ベース)	4.0%

- ※ 分配金再投資基準価額の推移は、第9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。

## ◇基準価額の主な変動要因

当ファンドは、「マネージド・ファンド／トランストレンド・エンハンスト・ファンド・リミテッド（クラスB）」（「参照ファンド」）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米ドル建てユーロ・ミディアム・ターム・ノート（「パフォーマンス連動債」）への投資を行うことにより、参照ファンドの投資成果を獲得することを目的としています。

当期においては、為替が期初比でやや円高に振れたことはマイナスに影響したものの、参照ファンドの価格の上昇がプラスに寄与しました。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2017年11月7日~2017年12月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	16円	0.120%	(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13,744円です。
（投信会社）	(5)	(0.033)	・委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(11)	(0.080)	・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
（受託会社）	(1)	(0.007)	・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	3	0.022	(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）	(1)	(0.007)	・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）	(0)	(0.001)	・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）	(2)	(0.014)	・その他は、法定書類（有価証券報告書、半期報告書、運用報告書等）の作成、印刷等に要する費用
合計	19	0.142	

(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。

## ■最近5年間の基準価額等の推移について



- ※ 分配金再投資基準価額の推移は、2012年11月5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。

決算日	2012年11月5日 決算日	2013年11月5日 決算日	2014年11月5日 決算日	2015年11月5日 決算日	2016年11月7日 決算日	2017年11月6日 決算日	2017年12月21日 償還日
基準価額（分配落）(円)	8,881	10,470	12,783	14,247	12,843	13,333	13,864.94
期間分配金合計（税込み）(円)	0	0	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額の騰落率(%)	—	17.9%	22.1%	11.5%	△9.9%	3.8%	4.0%
純資産総額(百万円)	130	87	60	67	60	62	65

※ 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。

## ■投資環境について

---

第9期首（2017年11月6日）から11月下旬にかけては、次期米連邦準備制度理事会（FRB）議長人事を受けて現行の金融政策運営が継続されるとの見方などを背景に米国金利が低下したことなどから為替市場で円高・米ドル安が進行しました。その後、期末にかけては、税制改革法案成立に向けての期待感などを背景に為替市場では米ドルが上昇に転じる一方で、参照ファンドの価格も堅調に推移しました。

## ■ポートフォリオについて

---

当初の運用方針に基づき、2017年11月までは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。また、当初の運用方針どおり、保有する外貨建資産に対しての為替ヘッジは行いませんでした。

なお、パフォーマンス連動債を2017年12月上旬にすべて売却したことから、その後はキャッシュ代替の金融商品（有担保コール・ローン等）のみで運用を行いました。

## ■ベンチマークとの差異について

---

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。

## ■分配金について

---

該当事項はありません。

# お知らせ

## ■約款変更のお知らせ

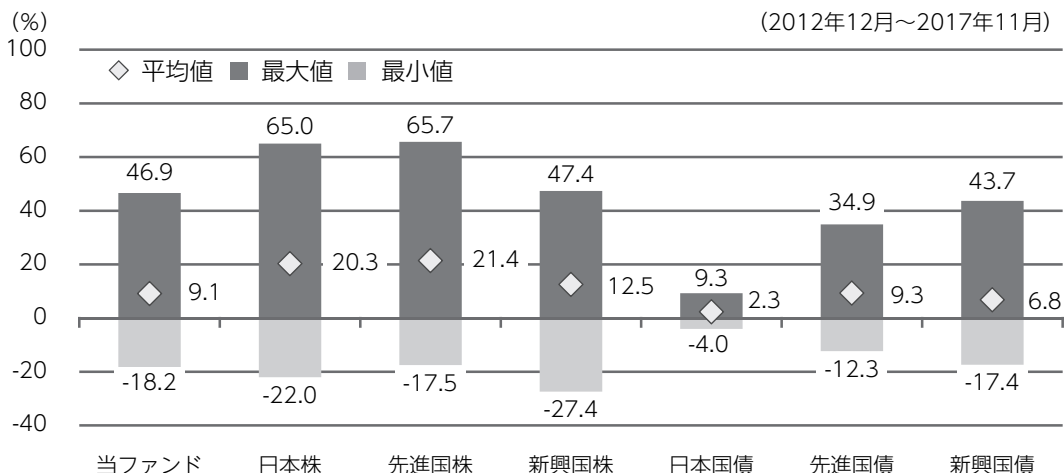
該当事項はありません。

## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	2009年12月10日から2017年12月21日（当初2019年11月5日）まで
運用方針	投資信託財産の積極的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「コデイス・セキュリティーズ・エス・エイ」が発行する米ドル建てユーロ・ミディアム・ターム・ノート（「パフォーマンス連動債」）を主要投資対象とします。
運用方法	「マネージド・ファンド／トランストレンド・エンハンスト・ファンド・リミテッド（クラスB）」（「参照ファンド」）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米ドル建てユーロ・ミディアム・ターム・ノート（「パフォーマンス連動債」）への投資を行うことにより、参照ファンドの投資成果を獲得することを目的とします。
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。

# (参考情報) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較

## ◇代表的な資産クラスとの騰落率の比較



### 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」について

- 当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### 各資産クラスの指数について

日本株 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株 MSCI Kokusai (World ex Japan) Index (配当込み、円ベース)

新興国株 MSCI EM (Emerging Markets) Index (配当込み、円ベース)

日本国債 NOMURA-BPI 国債

先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

新興国債 THE GBI EM Global Diversified Composite unhedged JPY index

TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、東京証券取引所に帰属します。

MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPIに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

FTSE世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

THE GBI EM Global Diversified Composite unhedged JPY indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

各資産クラスの騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

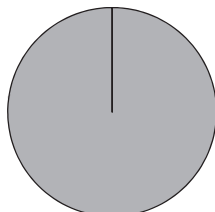
# ファンドデータ

## ■当ファンドの組入資産の内容 (2017年12月21日現在)

### ◇組入上位銘柄

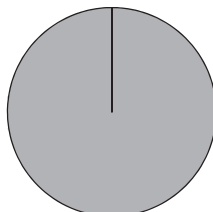
該当事項はありません。

### ◇資産別配分



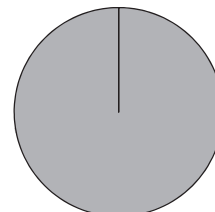
コープローン等、その他  
100.0%

### ◇国別配分



日本  
100.0%

### ◇通貨別配分



円  
100.0%

※ 比率は償還時における純資産総額に対する評価額の割合です。

## ■純資産等

項目	第9期末
	2017年12月21日
純資産総額	65,358,049円
受益権総口数	47,139,064口
1万円当たり基準価額	13,864円94銭

※ 当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。