

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

追加型投信／国内／債券

第6期末 (2015年11月5日)	
基準価額	10,014円
純資産総額	53百万円
騰落率	0.0%
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。

交付運用報告書

作成対象期間：2014年11月6日～2015年11月5日
第6期《決算日：2015年11月5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」から「ファンド一覧」へ進み、当ファンドのファンド名称を選択し、当ファンドのページにおいて運用報告書(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・セレクションマネープール・ファンド」は、このたび第6期の決算を行いました。

当ファンドは、マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、安定的な収益の確保を目指して運用を行っております。なお、公社債等に直接投資する場合があります。当期につきましてもそれに沿った運用を行いました。ここに、運用状況につきご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、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

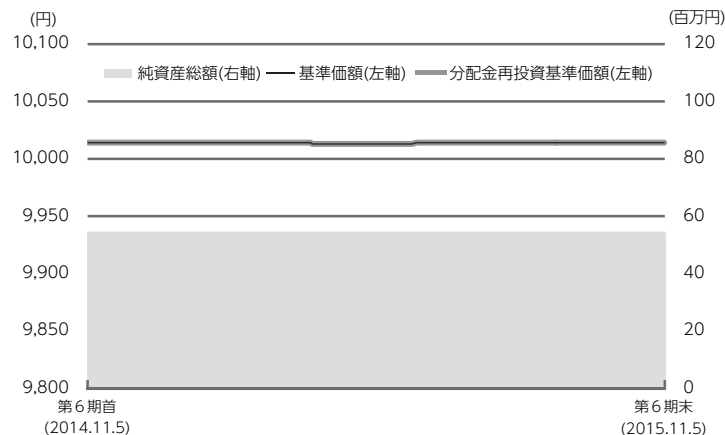
お問い合わせ窓口：運用・企画部
電話番号：03-6777-6900

(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>

運用経過 (2014年11月6日から2015年11月5日まで)

■基準価額等の推移について



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の推移は、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標を定めておりません。

◇基準価額の主な変動要因

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。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年11月6日~2015年11月5日)		
	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。
（投信会社）	(0)	(0.004)	・委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(0)	(0.003)	・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）	(0)	(0.003)	・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	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）	(0)	(0.005)	・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	1	0.016	

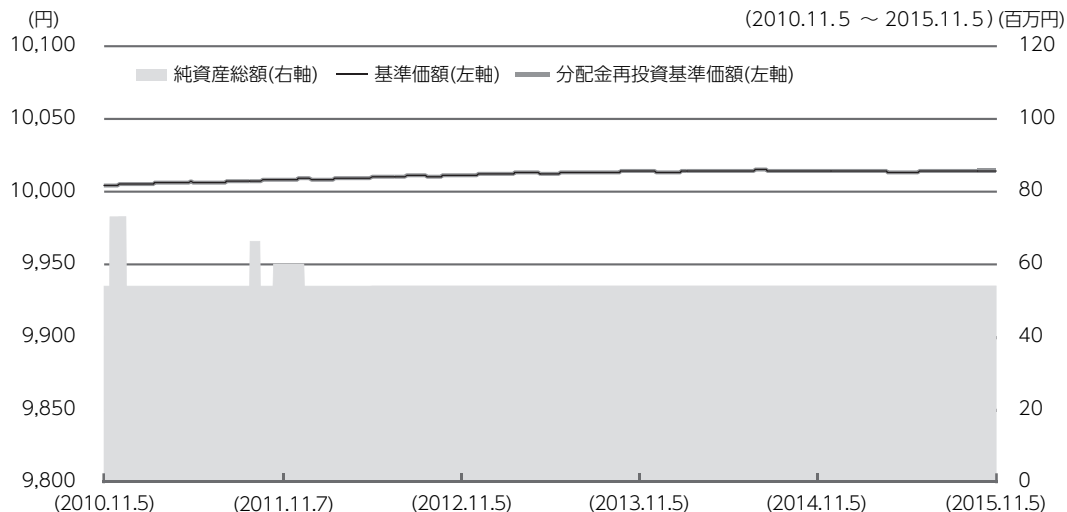
(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(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）を作成期間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、2010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標を定めておりません。

決算日	2010年11月5日 決算日	2011年11月7日 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
基準価額（分配落）（円）	10,004	10,008	10,011	10,014	10,014	10,014
期間分配金合計（税込み）（円）	0	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額の騰落率（%）	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
純資産総額(百万円)	53	60	53	53	53	53

※ 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標を定めておりません。

■投資環境について

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。

■ポートフォリオについて

<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。

■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標を定めておりません。

■分配金について

収益分配金につきましては、当ファンドの商品性格および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>

引き続き、当初の運用方針に基づき、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して運用を行います。

<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。

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」（本報告書）と「運用報告書（全体版）」に二段階化されることになりました。

「交付運用報告書」（本報告書）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）」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

<当ファンド>

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

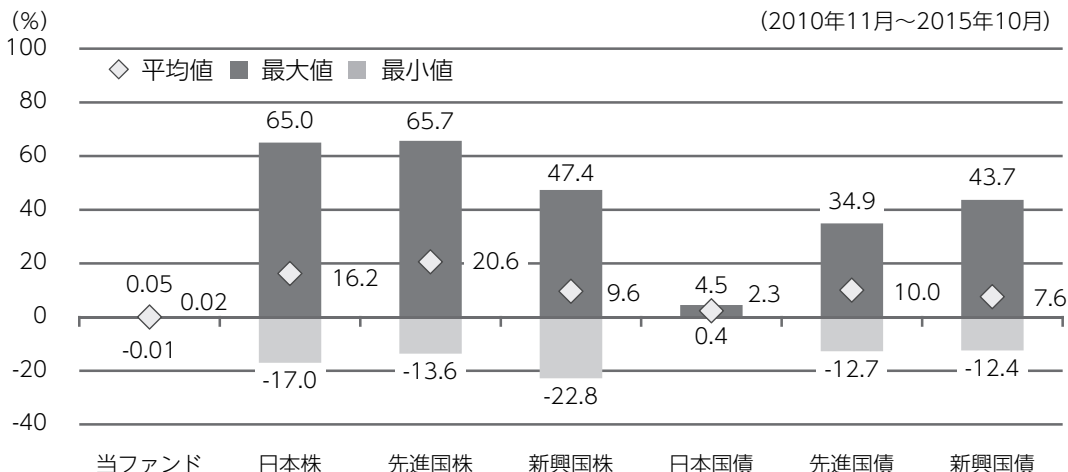
●追加信託金および一部解約金を計算する際、リクソー・マネー・マザーファンドの申込日の前営業日の純資産総額を使用するための所用の変更を行いました。 (2015年7月17日)

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／債券	
信託期間	2009年12月10日から2019年11月5日まで	
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。	
主要投資対象	当ファンド	リクソー・マネー・マザーファンド(以下「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。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	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。
運用方法	マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、安定的な収益の確保を目指して運用を行います。なお、公社債等に直接投資する場合があります。	
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。
- 当ファンドにおいては2010年12月から2015年10月までの期間、他の代表的な資産クラスについては2010年11月から2015年10月までの5年間の各月末における年間騰落率の平均・最大・最小を表示しています。
- 上記の騰落率は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 シティ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。

シティ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、Citigroup Index 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 (2015年11月5日現在)

◇組入上位銘柄

銘柄名	第6期末
リクソー・マネー・マザーファンド	94.7%
組入銘柄数	1銘柄

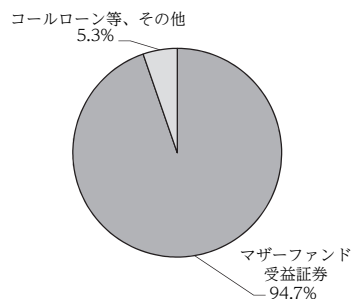
※ 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

◇純資産等

項目	第6期末
	2015年11月5日
純資産総額	53,957,241円
受益権総口数	53,884,423口
1万円当たり基準価額	10,014円

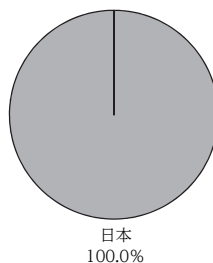
※ 当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

◇資産別配分

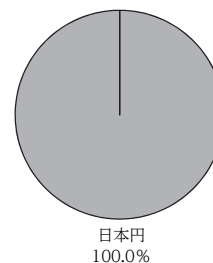


※ 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

◇国別配分



◇通貨別配分

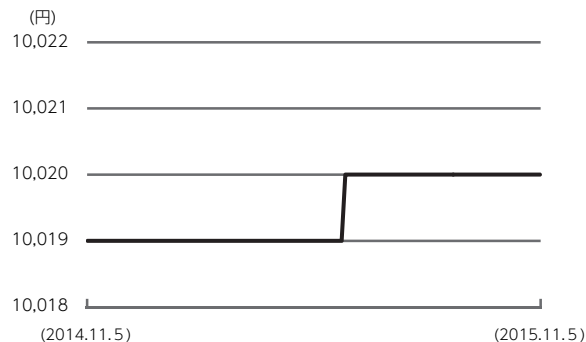


■組入ファンドの概要

<リクソー・マネー・マザーファンド>

(計算期間：2014年11月6日～2015年11月5日)

◇基準価額の推移



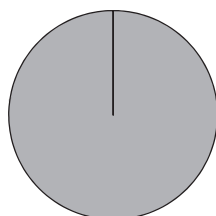
◇組入上位銘柄

該当事項はありません。

◇1万口当たりの費用明細

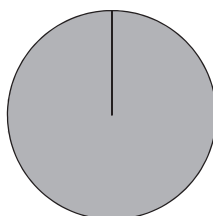
該当事項はありません。

◇資産別配分



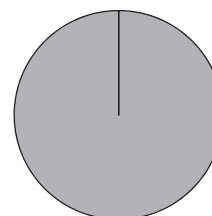
コール・ローン等、その他
100.0%

◇国別配分



日本
100.0%

◇通貨別配分



日本円
100.0%

※ 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細はリクソー・マネー・マザーファンドの直近の計算期間のものであります。

※ 組入上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは2015年11月5日現在のものです。

※ 比率はリクソー・マネー・マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

※ 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、「運用報告書（全体版）」に記載されています。