

| 第2期末（償還日2018年8月30日） | |
|---------------------|------------|
| 償還価額 | 12,556.98円 |
| 純資産総額 | 106百万円 |
| 騰落率 | 0.9% |
| 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。

近未来世界ファンド (愛称：ザ・フューチャー・エイト)

追加型投信／内外／株式

償還 交付運用報告書

作成対象期間：2017年12月12日～2018年8月30日
第2期《償還日：2018年8月30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。さて、「近未来世界ファンド（愛称：ザ・フューチャー・エイト）」は、投資信託約款の規定に基づき2018年8月30日をもちまして償還いたしました。当ファンドは、「ザ・フューチャー8指数」（以下、「参照指数」といいます。）の投資成果獲得を目的とする円建て債券（以下、「パフォーマンス連動債」といいます。）への投資を通じて、世界各国の上場企業の中から近未来の世界を新技術で形作る革新的な企業の株式に投資を行う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。

- 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。

リクソー投信株式会社

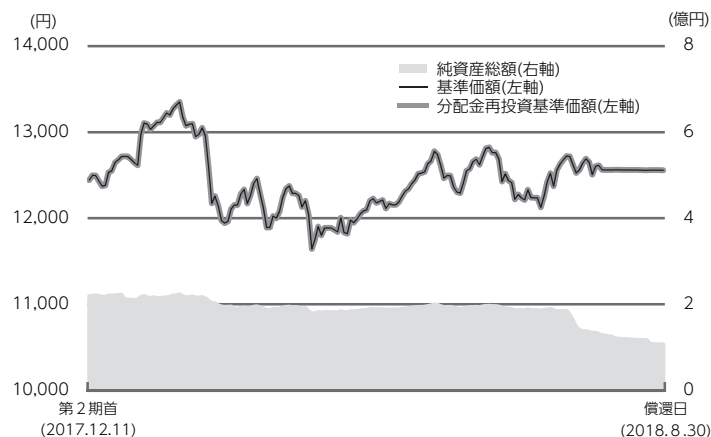
東京都千代田区丸の内一丁目1番1号
パレスビル

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12月12日から2018年8月30日まで)

■基準価額等の推移について



| | |
|--------------------|------------|
| 第2期首 | 12,443円 |
| 第2期末(償還日) | 12,556.98円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 (分配金再投資ベース) | 0.9% |

- ※ 分配金再投資基準価額の推移は、第2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

上昇要因：

- ・世界的に株式相場が底堅く推移するなか、特に参照指数における配分比率の高い米国の株式市場が堅調であったことから、参照指数が上昇したこと。
- ・当期の前半においては為替市場（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：

- ・当期の前半においては為替市場（日本円／米ドル）が大きく円高に振れたこと。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-----------|--------------------------|---------|--|
| | (2017年12月12日~2018年8月30日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 53円 | 0.426% | (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12,391円です。 |
| （投信会社） | (24) | (0.194) | ・委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (24) | (0.194) | ・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） | (5) | (0.039) | ・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 | 18 | 0.147 | (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） | (8) | (0.062) | ・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） | (1) | (0.008) | ・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 |
| （印刷） | (10) | (0.077) | ・印刷は、当期に計上された法定書類（有価証券報告書、目論見書、運用報告書等）の作成、印刷等に要する費用 |
| （その他） | (0) | (0.000) | ・その他は、無利息金銭信託の手数料 |
| 合計 | 71 | 0.573 | |

(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、2017年4月18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 | 2017年4月18日 設定日 | 2017年12月11日 決算日 | 2018年8月30日 償還日 |
|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|
| 基準価額（分配落）（円） | 10,000 | 12,443 | 12,556.98 |
| 期間分配金合計（税込み）（円） | — | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率（%） | — | 24.4% | 0.9% |
| 純資産総額(百万円) | 71 | 218 | 106 |

※ 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

当期の株式市場は世界的に底堅く推移しました。

期初（2017年12月11日）から1月中旬にかけての株式市場は、世界景気拡大への楽観的な見方や企業決算への期待感などを背景に堅調に推移しました。

1月下旬から3月中旬にかけては、米国の長期金利上昇への警戒感や欧州での金融政策正常化観測の高まりなどを背景に世界的に株式市場は調整色を強めました。また、米中間での貿易摩擦問題も、相場の重石となりました。

しかしその後、5月中旬にかけては、中東における地政学的リスクの高まりを下支えに原油価格が堅調に推移したことなどから株式市場も上昇基調となりました。

5月下旬以降は、米朝首脳会談による北朝鮮情勢をめぐる思惑や米中貿易摩擦の先行き不透明感、難民・移民問題で対立したドイツの連立政権への懸念などが相場の重石となる一方で、第2四半期の企業決算への期待感などは好材料となり、米国株式は堅調に推移する一方で、国内株式は底堅い動きながらもレンジ内での動きとなりました。

■ポートフォリオについて

当初の運用方針に基づき、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。なお、2018年7月31日の書面決議により8月30日での繰上償還が決定したため、8月1日に保有するパフォーマンス連動債をすべて売却し、その後はコール・ローン等による安定運用を行いました。

■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

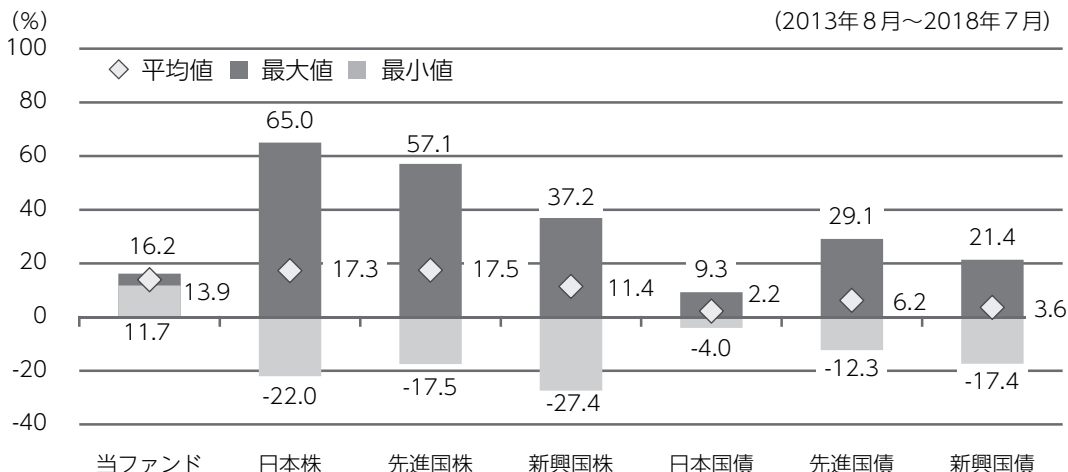
該当事項はございません。

当ファンドの概要

| | |
|--------|---|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／株式 |
| 信託期間 | 2017年4月18日から2018年8月30日（当初2027年12月10日）まで |
| 運用方針 | 投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 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。 |
| 運用方法 | <p>① 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（以下「協会規則」といいます。）に則り、以下の方針に基づいて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ります。</p> <p>イ.パフォーマンス連動債への投資比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>ロ.パフォーマンス連動債への投資は、協会規則の規定に基づき計算される一の者に係るエクスポージャーが10%を超えないことを条件とします。</p> <p>② パフォーマンス連動債への投資を通じて実質的に投資している、参照指数を構成する外貨建て表示の株式（外貨建資産）等に対する為替ヘッジは行いません。</p> <p>③ 資金動向、市況動向等によっては暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります、この場合には上記の投資目的が達成されない場合があります。</p> |
| 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。 |

(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2017年4月から2018年7月までの期間、代表的な資産クラスにおいては2013年8月から2018年7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。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。

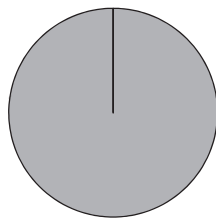
ファンドデータ

■当ファンドの組入資産の内容 (2018年8月30日現在)

◇組入上位銘柄

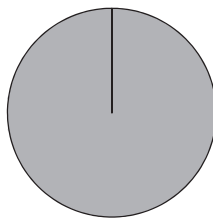
該当事項はありません。

◇資産別配分



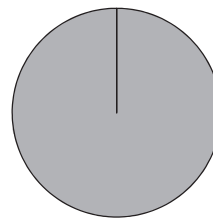
コールローン等、その他
100.0%

◇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 | 償還時 |
|------------|--------------|
| | 2018年8月30日 |
| 純資産総額 | 106,809,742円 |
| 受益権総口数 | 85,060,044口 |
| 1万口当たり償還価額 | 12,556円98銭 |

※ 当期中における追加設定元本額は40,411,857円、同解約元本額は131,346,693円です。