

# 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2018年8月30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2期 償還運用報告書(全体版)

《償還日 2018年8月30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、信託約款の規定に基づき、2018年8月30日に繰上償還となりました。ここに謹んで運用状況と償還の内容を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て、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>

## ■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
(償 還 時) 2期(2018年8月30日)	(償還価額) 12,556.98		0.9	—	—	106

(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
(期 首) 2017年12月11日	円 12,443	% —	% 99.1	% —
12月末	12,642	1.6	97.2	—
2018年1月末	12,949	4.1	98.8	—
2月末	12,460	0.1	98.6	—
3月末	11,888	△ 4.5	99.1	—
4月末	12,170	△ 2.2	98.3	—
5月末	12,303	△ 1.1	99.9	—
6月末	12,212	△ 1.9	98.1	—
7月末	12,506	0.5	99.5	—
(償 還 時) 2018年8月30日	(償還価額) 12,556.98	0.9	—	—

(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。

## ■設定以来の運用経過等

### ●設定来の運用経過等（2017年4月18日から2018年8月30日まで）

#### 《基準価額の推移》

設定来の基準価額の推移



(注) 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。

#### 《設定来の投資環境》

当ファンドの設定時（2017年4月18日）から2018年1月中旬にかけては、米連邦準備制度理事会（FRB）が金融政策の正常化を緩やかに進めると示唆したことやトランプ政権による税制改革、世界的に堅調な企業決算や世界的景気拡大への楽観的な見方などが相場の上昇の下支えとなり、株式市場は上昇基調で推移しました。また、10月に行われた衆議院選挙で与党自民党が大勝すると、安倍政権によるリフレ政策継続への期待感も日本株の上昇を後押ししました。

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。

その後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ったものの、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。

為替市場の米ドル/日本円相場は、前期を通じて105～114円程度のレンジ内に納まる、穏やかな動きとなりました。

## 設定来の当ファンド、為替（円／米ドル）および参照指数の動き



※ 当ファンドの基準価額および為替（円／米ドル）は、設定日を10,000として指数化しています。また、参照指数の数値については、当ファンドの基準価額に反映している時点の数値を、設定日を10,000として指数化しています。

### （主な変動要因）

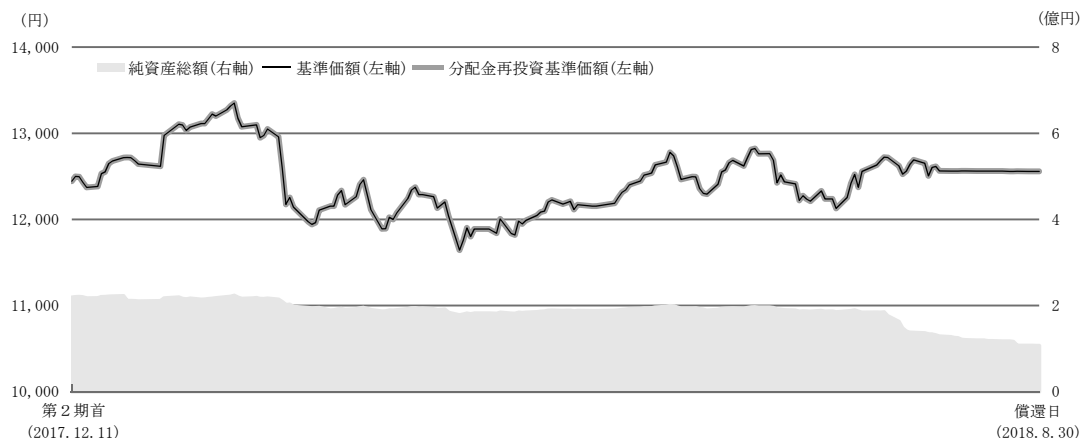
- （上昇）：①世界的に株式相場が堅調であるなか、特に参照指数における配分比率の高い日本および米国の株式市場の上昇が参照指数の上昇に寄与。
- （下落）：②米中貿易摩擦問題や米国の長期金利上昇への警戒感。為替の円高進行。
- （上昇）：③企業の好決算への期待感。為替の円安進行。

### 《分配金》

第1期から償還時まで、当ファンドの商品性格および基準価額水準等を考慮し、無分配とさせていただきます。

## ●当期中の運用経過（2017年12月12日から2018年8月30日まで）

### 《基準価額の推移》



- ※ 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。

(円)

期首	期中高値	期中安値	期末
2017/12/11	2018/1/24	2018/3/26	2018/8/30
12,443	13,351	11,644	12,556.98

### 《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。

### 《運用経過》

当初の運用方針に基づき、当期中も引き続き、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。

### 《収益分配》

該当事項はありません。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期 (2017年12月12日～2018年8月30日)		項 目 の 概 要
	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)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・委託した資金の運用の対価</li> <li>・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</li> <li>・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価</li> </ul>
（販売会社）	(24)	(0.194)	
（受託会社）	(5)	(0.039)	
(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)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・その他は、無利息金銭信託の手数料</li> </ul>
（監査費用）	(1)	(0.008)	
（印刷）	(10)	(0.077)	
（その他）	(0)	(0.000)	
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。

## ■ 期中の売買及び取引の状況（2017年12月12日から2018年8月30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）	11,017	230,617

(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12月12日から2018年8月30日まで）

### 公社債

買付			売付		
銘柄	柄	金額	銘柄	柄	金額
		千円			千円
CODEIS SGI THE FUTURE8 INDEX		11,017	CODEIS SGI THE FUTURE8 INDEX		230,617

(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12月12日から2018年8月30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 11	百万円 11	% 100.0	百万円 230	百万円 230	% 100.0

(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)	－千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	－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（2018年8月30日現在）

償還時における組入れはありません。

## ■投資信託財産の構成

(2018年8月30日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 107,371	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	107,371	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2018年8月30日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	107,371,459円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	107,371,459
(B) 負 債	561,717
未 払 解 約 金	313,025
未 払 信 託 報 酬	206,739
未 払 利 息	308
そ の 他 未 払 費 用	41,645
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	106,809,742
元 本	85,060,044
償 還 差 益 金	21,749,698
(D) 受 益 権 総 口 数	85,060,044口
1万口当たり償還価額 (C/D)	12,556円98銭

<注記事項>

期首元本額	175,994,880円
期中追加設定元本額	40,411,857円
期中一部解約元本額	131,346,693円

## ■損益の状況

当期 (自2017年12月12日 至2018年8月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	30,200円
そ の 他 収 益 金	39,705
支 払 利 息	△ 9,505
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,297,321
売 買 益	3,512,216
売 買 損	△ 2,214,895
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,069,253
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	258,268
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,496,913
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,994,517
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,703,390)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 9,291,127)
(G) 償 還 差 益 金 (D+E+F)	21,749,698

(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。



■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2017年4月18日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年8月30日			
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	資産総額	107,371,459円
受益権口数	71,652,461口	85,060,044口	13,407,583口	負債総額	561,717円
				純資産総額	106,809,742円
元本額	71,652,461円	85,060,044円	13,407,583円	受益権口数	85,060,044口
				1万口当たり償還金	12,556.98円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	175,994,880円	218,992,063円	12,443円	0円	0.0000%

償 還 金 の お 知 ら せ	
1万口当たり償還金（税込み）	12,556円98銭