

# 外国証券内容説明書

楽天証券株式会社  
2009/03/24 更新

## 第一部 証券情報

	ティッカー(証券コード)	02806
(1)	ファンドの名称	リクソーETF FTSE RAFI ヨーロッパ Lyxor ETF FTSE RAFI Europe
(2)	ファンドの形態	株価指数連動型上場投資信託 (EXCHANGE TRADED FUND/ETF) フランス籍契約型投資信託
(3)	発行地	フランス
(4)	発行日	2008年5月20日
(5)	発行数及び発行総額 (2009年2月27日現在)	発行数：2,500,000口 純資産総額：8.94百万米ドル
(6)	売買単位	100口単位
(7)	主たる上場取引所又は登録 証券行協会の名称	香港証券取引所

## 第二部 発行者情報

(1)	ファンドに係る法制度の概要	フランス法に基づき設定された契約型投資信託であり、フランス金融市場庁(AMF)による認可を受けている。	
(2)	ファンドの目的及び基本的性格	FTSE RAFI ヨーロッパ指数のパフォーマンスと本ETFのパフォーマンスとのトラッキングエラーを最小限に抑え、当該指数の値動きに連動する投資成果を提供することを目指す。	
(3)	管理会社又は運用会社の自己資本の額	40,860,895ユーロ (2007年12月31日現在)	
(4)	ファンドの関係法人の概要		
	管理会社	名称	リクソー・インターナショナル・アセット・マネジメント LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT
		関係業務	本ETFの運用
	事務代行会社	名称	ユーロ・ネット・アセット・バリュー EURO NET ASSET VALUE
		関係業務	純資産額の計算を含む計理業務
	受託会社	名称	ソシエテ ジェネラル SOCIÉTÉ GÉNÉRALE
関係業務		カストディ業務他	
(5)	投資の基本方針	①本ETFとFTSE RAFI ヨーロッパ指数との相関を最大限可能にするため、本ETFでは、「シンセティック・リプリケーション」投資戦略を採っている。 ②分配方針：年1回	
(6)	投資制限	UCITS 指令およびフランス金融市場庁の投資規則、香港証券先物委員会の規約による制限を受けると共に、目論見書に記載の投資制限を遵守する義務を負う。(投資制限には、一発行体に純資産総額の10%を超える集中投資の制限、純資産総額の10%を超える借入れの規制等が含まれる。)	
(7)	ファンド資産の管理の概要及びその報酬	管理報酬：純資産総額に対し上限年率0.60% (受託会社、証券代行会社、上場代行会社等への報酬の支払は、管理会社が受領した管理報酬より支払われる。)	

(8)	ファンドの運用状況											
	①	投資状況(2008年8月29日現在)										
		<table border="1" data-bbox="236 331 954 488"> <thead> <tr> <th data-bbox="236 331 603 398">資産の種類</th> <th colspan="2" data-bbox="603 331 954 398">時価合計 (ユーロ)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="236 398 603 443">投資有価証券</td> <td colspan="2" data-bbox="603 398 954 443">37,458,030.42</td> </tr> <tr> <td data-bbox="236 443 603 488">その他の資産</td> <td colspan="2" data-bbox="603 443 954 488">3,533,649.73</td> </tr> </tbody> </table> <p data-bbox="236 488 954 551">注) 他市場上場分を含めた総額の数値です。</p>		資産の種類	時価合計 (ユーロ)		投資有価証券	37,458,030.42		その他の資産	3,533,649.73	
資産の種類	時価合計 (ユーロ)											
投資有価証券	37,458,030.42											
その他の資産	3,533,649.73											
	②	運用実績										
		<p data-bbox="236 595 1469 640">純資産の推移</p> <table border="1" data-bbox="236 663 1230 808"> <thead> <tr> <th data-bbox="236 663 555 707"></th> <th data-bbox="555 663 890 707">2008年8月29日現在</th> <th data-bbox="890 663 1230 707">2007年8月31日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="236 707 555 752">純資産総額</td> <td data-bbox="555 707 890 752">17,773,329.05 米ドル</td> <td data-bbox="890 707 1230 752">—</td> </tr> <tr> <td data-bbox="236 752 555 808">1口当たりの純資産額</td> <td data-bbox="555 752 890 808">7.10 米ドル</td> <td data-bbox="890 752 1230 808">—</td> </tr> </tbody> </table> <p data-bbox="236 808 1469 875">注) 香港証券取引所上場分の数値です。</p>			2008年8月29日現在	2007年8月31日	純資産総額	17,773,329.05 米ドル	—	1口当たりの純資産額	7.10 米ドル	—
	2008年8月29日現在	2007年8月31日										
純資産総額	17,773,329.05 米ドル	—										
1口当たりの純資産額	7.10 米ドル	—										
		<p data-bbox="236 875 1469 920">分配の推移 (1口当たり)</p> <table border="1" data-bbox="236 943 1230 1043"> <thead> <tr> <th data-bbox="236 943 735 987">2008年8月29日現在</th> <th data-bbox="735 943 1230 987">2007年8月31日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="236 987 735 1043">0.22 米ドル</td> <td data-bbox="735 987 1230 1043">—</td> </tr> </tbody> </table> <p data-bbox="236 1043 1469 1111">注) 香港証券取引所上場分の数値です。</p>		2008年8月29日現在	2007年8月31日	0.22 米ドル	—					
2008年8月29日現在	2007年8月31日											
0.22 米ドル	—											
(9)	ファンドの経理状況 (要約) 注) 他市場上場分を含めた総額の数値です。											
	①	直近2計算期間の財務諸表 (単位:ユーロ)										
		<table border="1" data-bbox="236 1256 1206 1379"> <thead> <tr> <th data-bbox="236 1256 507 1301"></th> <th data-bbox="507 1256 858 1301">2008年8月29日</th> <th data-bbox="858 1256 1206 1301">2007年8月31日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="236 1301 507 1346">総資産</td> <td data-bbox="507 1301 858 1346">40,991,680.15</td> <td data-bbox="858 1301 1206 1346">98,568,814.91</td> </tr> <tr> <td data-bbox="236 1346 507 1402">負債</td> <td data-bbox="507 1346 858 1402">105,553.11</td> <td data-bbox="858 1346 1206 1402">3,996,271.43</td> </tr> </tbody> </table>			2008年8月29日	2007年8月31日	総資産	40,991,680.15	98,568,814.91	負債	105,553.11	3,996,271.43
	2008年8月29日	2007年8月31日										
総資産	40,991,680.15	98,568,814.91										
負債	105,553.11	3,996,271.43										
	②	直近2計算期間の損益計算書 (単位:ユーロ)										
		<table border="1" data-bbox="236 1469 1206 1547"> <thead> <tr> <th data-bbox="236 1469 507 1514"></th> <th data-bbox="507 1469 858 1514">2008年8月29日</th> <th data-bbox="858 1469 1206 1514">2007年8月31日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="236 1514 507 1547">当期純利益</td> <td data-bbox="507 1514 858 1547">1,423,410.24</td> <td data-bbox="858 1514 1206 1547">6,038,139.52</td> </tr> </tbody> </table>			2008年8月29日	2007年8月31日	当期純利益	1,423,410.24	6,038,139.52			
	2008年8月29日	2007年8月31日										
当期純利益	1,423,410.24	6,038,139.52										

③直近 2 計算期間の投資有価証券明細表

2008年8月29日現在				2007年8月31日現在			
NO.	銘柄	株式数	価額(ユーロ)	NO.	銘柄	株式数	価額(ユーロ)
1.	PORSCHE VORZ HLDG	28,003	2,686,047.76	1.	CREDIT AGRICOLE	310,337	8,537,370.87
2.	BOUYGUES	45,550	1,874,382.50	2.	CARREFOUR	155,134	8,090,238.10
3.	BELGACOM	66,055	1,773,576.75	3.	UBS AG N	132,976	5,077,861.81
4.	MEDIASET SPA	357,819	1,744,725.44	4.	E.ON AG	41,140	4,943,793.80
5.	SIEMENS AG-NOM	22,775	1,707,214.00	5.	FRANCE TELECOM	215,142	4,694,398.44
6.	ADIDAS AG	39,882	1,570,951.98	6.	AUTOSTRADE	169,037	4,129,573.91
7.	ALCATEL LUCENT	345,819	1,502,583.56	7.	ACCOR	64,301	4,010,453.37
8.	INTESA SANPAOLO SPA	396,235	1,442,295.40	8.	MUENCH. RUECK N	31,572	3,987,859.32
9.	UNILEVER CVA	72,816	1,379,135.04	9.	DAIMLERCHRYSLER DCXGn.DE	56,693	3,614,745.68
10.	RWE AG	18,636	1,365,459.72	10.	LAFARGE	31,924	3,605,815.80
11.	MAN AG	20,299	1,360,033.00	11.	CAP GEMINI	69,740	3,277,780.00
12.	Q-CELLS AG	19,942	1,350,073.40	12.	KLEPIERRE	28,269	3,211,075.71
13.	GECINA	16,104	1,319,400.72	13.	ENI	126,885	3,165,780.75
14.	TOTAL SA	26,882	1,319,368.56	14.	SANOFI-AVENTIS	51,990	3,077,288.10
15.	SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,080	1,252,220.80	15.	UNILEVER CERT	118,417	2,617,015.70
16.	FIAT SPA	115,796	1,241,564.71	16.	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	11,991	2,369,791.71
17.	ASSICURAZIONI GENERALI	54,283	1,234,938.25	17.	AEM	808,200	2,152,236.60
18.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	107,288	1,232,739.12	18.	THYSSEN KRUPP	41,938	1,778,590.58
19.	VOLKSWAGEN AG	5,790	1,187,181.60	19.	SIEMENS N	19,309	1,737,230.73
20.	TELECOM ITALIA SPA	1,007,276	1,088,865.36	20.	NOVARTIS N	44,460	1,712,655.68
21.	CARREFOUR SA	31,924	1,075,838.80	21.	DASSAULT SYSTEM	36,666	1,576,638.00
22.	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	9,904	1,046,852.80	22.	SUEZ	36,724	1,505,684.00
23.	AXA	45,254	978,165.21	23.	DEXIA DEXI.PA	75,086	1,488,955.38
24.	SCHWEIZERISCHE RUCKVERS GESEL-NOM	20,482	860,662.91	24.	AKZO NOBEL	23,448	1,335,832.56
25.	VOLKSWAGEN AG-PFD	6,467	677,806.27	25.	VIVENDI	38,931	1,188,952.74
26.	METRO	14,182	531,399.54	26.	ROYAL DUTCH SHELL PLC	37,726	1,055,573.48
27.	BAYERISCHE MOTORENWERKE	18,513	523,177.38	27.	BANCO POPOLARE SPA	51,385	926,882.63
28.	UBS AG NOM	34,254	506,963.45	28.	TOTAL SA (PARIS)	15,737	854,204.36
29.	BASF SE	12,028	472,099.00	29.	KARSTADT QUELLE	37,536	674,146.56
30.	BNP PARIBAS	3,544	217,654.76	30.	TELECOM ITALIA SPA	260,004	536,388.25
31.	ERICSSON B	25,588	199,683.39	31.	KPN-KON.NV	18,662	213,120.04
32.	VESTAS WIND SYSTEMS	1,961	178,266.75	32.	ENEL	7,475	56,585.75
33.	BANCHE POP UNITE	11,292	175,048.58	合計			87,204,520.41
34.	SWATCH GROUP I	1,045	168,067.86				
35.	BALOISE HOLDING	1,787	106,267.52				
36.	UNICREDITO	14,355	52,553.66				
37.	DEUT-BOERSE	643	40,933.38				
38.	SWEDISH MATCH	507	6,769.15				
39.	TELIASONERA	1,256	6,014.29				
40.	T&D HOLDINGS	11	370.83				
41.	CREDIT SAISON	27	365.43				
42.	TOKAI CARBON	45	311.79				
合計			37,458,030.42				

当該証券については我が国の金融商品取引法に基づいた発行者開示は行われていません。

本説明書は、日本証券業協会による「外国証券の取引に関する規則」に従って作成したものであり、当該証券に関する詳細かつ完全な情報が記載されているものではありません。

株価の下落や発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、損失を被ることがあります。さらに為替相場の変動により、損失を被ることがあります。

本説明書は目論見書、年次報告書などに基づいて作成するため、記載された決算期が直前に終了した決算期より古い場合や、年次報告書などがリリースされた後の決算数字修正を反映していない場合がありますので、ご了承ください。