

■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／国内／株式／特殊型(絶対収益追求型)	
信託期間	2019年4月22日から2029年5月24日まで	
運用方針	主に楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所等に上場している株式のうち、楽天をはじめとする様々な情報ソースのビッグデータを活用した分析を基に、独自の定性判断により厳選された今後成長が見込まれる株式に投資を行うとともに、絶対収益の確保を目的として、株価指数先物取引を積極的に活用します。	
主要投資対象	楽天・ビッグデータ日本株ファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所等に上場している株式および株価指数先物取引にかかる権利を主要投資対象とします。
主な投資制限	楽天・ビッグデータ日本株ファンド	マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価損益を含みます。)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、市況動向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。 留保益の運用については特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

運用報告書(全体版)

楽天・ビッグデータ日本株ファンド 〈愛称：楽天AIファンド〉

第4期

決算日：2023年5月25日

受益者の皆様へ

平素は当ファンドにご投資いただき、厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは、このたび上記決算を行いましたので、当期間の運用状況につきまして、ご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

楽天投信投資顧問株式会社

<https://www.rakuten-toushin.co.jp/>

東京都港区南青山二丁目6番21号

本資料(運用報告書(全体版))の記載内容のお問い合わせ先

TEL：03-6432-7746

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

※お客様のお取引内容等につきましては販売会社にお問い合わせください。

Rakuten 楽天投信投資顧問

■本資料の表記に関する注記

- ・金額等の数値は表記未満切捨または四捨五入により表示しております。このため、各項目の合計の値が合計欄と一致しないことがあります。
- ・－印は、組入・売買が無いことを示します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率 比	株式先物 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率				
(設定日) 2019年 4月22日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	百万円 12
1期(2020年 5月25日)	9,929	0	△0.7	68.5	△29.6	1.5	67
2期(2021年 5月25日)	10,716	0	7.9	91.1	—	1.8	70
3期(2022年 5月25日)	10,571	0	△1.4	71.2	△75.0	6.8	73
4期(2023年 5月25日)	10,309	0	△2.5	74.0	△66.9	4.7	70

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物組入比率」、「投資信託証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

(注4) 当ファンドの運用方針に対応する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

(注5) 設定日の基準価額には当初設定価額を、純資産総額には当初設定元本を用いています。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組入率 比	株式先物 組入比率	投資信託証券 組入比率
	騰落率	騰落率			
(期首) 2022年 5月25日	円 10,571	% —	% 71.2	% △75.0	% 6.8
5月末	10,594	0.2	72.8	△76.1	6.9
6月末	10,547	△0.2	71.5	△74.8	7.2
7月末	10,486	△0.8	74.3	△77.9	6.6
8月末	10,563	△0.1	74.8	△78.2	6.6
9月末	10,590	0.2	70.6	△66.7	6.4
10月末	10,744	1.6	75.3	△75.4	6.3
11月末	10,566	△0.0	78.0	△79.5	6.2
12月末	10,643	0.7	76.0	△74.9	4.9
2023年 1月末	10,593	0.2	79.0	△78.5	4.8
2月末	10,477	△0.9	79.5	△80.1	5.2
3月末	10,458	△1.1	75.8	△73.5	4.7
4月末	10,476	△0.9	78.2	△75.8	5.0
(期末) 2023年 5月25日	10,309	△2.5	74.0	△66.9	4.7

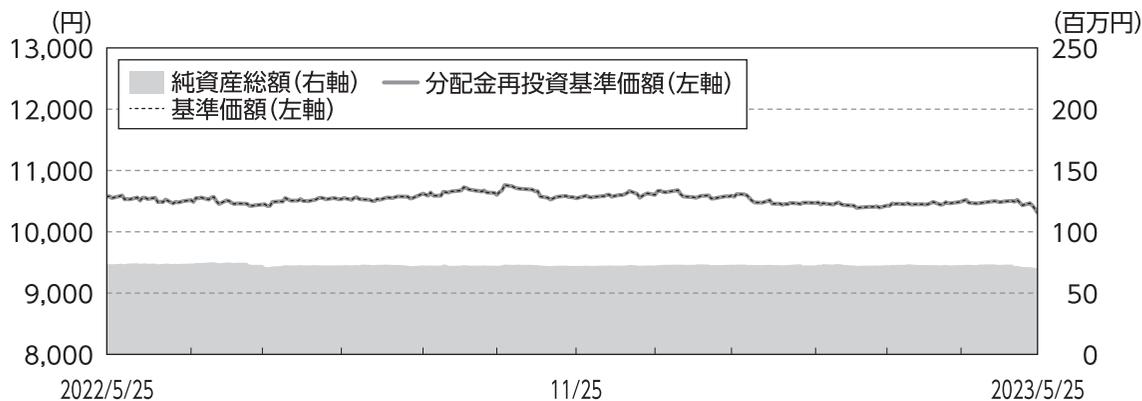
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物組入比率」、「投資信託証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



期首：10,571円

期末：10,309円(既払分配金0円)

騰落率：△2.5%(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込)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。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額を起点として指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は前期末比2.5%下落しました。

<2022年5月末～2022年9月>

米国でインフレが進む中でFRB(米連邦準備制度理事会)による急速な金融引き締めが警戒されたことや、コロナ禍での経済活動の制限が続く中国経済の先行き懸念など懸念材料も多く、ヘッジ比率を高水準で維持した為、基準価額は概ね横ばいで推移しました。

<2022年10月～2022年12月>

堅調な企業決算や日本への入国規制の緩和によりインバウンド需要増への期待など株価の支援材料はあるも、FRBが金融引き締めを継続する姿勢を示したことや、12月の日本銀行の金融政策決定会合にて長期金利の許容変動幅を拡大したことで円高が大幅に進行するなど不安材料もあることから、引き続きヘッジ比率を高水準で維持し、基準価額は概ね横ばいで推移しました。

<2023年1月～2023年5月25日>

景気の先行き不透明感や3月の米国での地方銀行の金融危機などを背景にヘッジ比率を高位で維持しました。個別銘柄のパフォーマンスの悪化などから、基準価額はやや下落しました。

■投資環境

＜2022年5月末～2022年9月＞

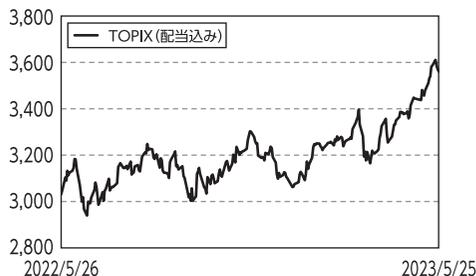
米国における金融引き締めや中国におけるコロナ禍での経済活動制限、台湾を巡る米中関係の悪化などがあり、相場はレンジ内での動きに終始し、ほぼ横ばいの動きとなりました。

＜2022年10月～2022年12月＞

堅調な企業業績やコロナ禍からの経済再開期待で一時的に相場が持ち直す場面もありましたが、米国の金融引き締め継続や日本銀行による金融政策修正による円高進行もあり、一進一退の動きとなりました。

＜2023年1月～2023年5月25日＞

米国の地方銀行破綻など不安材料もありましたが、米国での利上げ打ち止め観測や懸念されたほど企業業績見通しが悪くないことなどを背景に相場は上昇しました。



(出所)ブルームバーグのデータ等を基に楽天投信投資顧問にて作成

■当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

主要投資対象である「楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)」受益証券の組入比率を高位に維持する運用を行いました。

楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)

ビッグデータ等から抽出された候補銘柄について、成長性、安全性等を精査し投資を行いました。期を通じて、コロナ禍からの経済活動の再開により恩恵が受けられる内需関連(特にレジャー・鉄道関連)などの組入比率を高める一方、世界景気の減速を懸念し設備投資関連(特に電機・機械など)は組み入れを抑えました。

ヘッジ比率は米国での金融引き締めや中国の経済再開の遅れ、欧米での金融システム不安など不透明要因が多かったこともあり、期を通じて高位を維持しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

■分配金

運用の基本方針等を勘案し、収益分配は見送らせていただきました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

●分配原資の内訳

(1万口当たり・税込)

項 目	第4期	
	2022年5月26日～2023年5月25日	
当期分配金 (円)		—
(対基準価額比率) (%)		(—)
当期の収益 (円)		—
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		703

(注1) 「対基準価額比率」は「当期分配金」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」は経費控除後の配当等収益および経費控除後の有価証券売買等損益、「当期の収益以外」は収益調整金および分配準備積立金です。

(注3) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、円未満を切捨てて表示しているため、合計した額が「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、「楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)」受益証券を投資対象とし、投資割合を高位に維持することを目指します。

楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)

引き続き、楽天グループをはじめとする様々な情報ソースのビッグデータを活用した分析に加え、独自の定性判断により今後成長が見込まれる銘柄を厳選します。

またこれらの厳選された銘柄についての投資ポートフォリオに対し、株価指数先物取引を組み合わせた運用を行うことで、市場の上昇・下落に左右されにくい、あらゆる相場環境で絶対収益の確保を目指します。

1万口当たりの費用明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	2022年5月26日～2023年5月25日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	105円	0.990%	(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は10,561円です。
（投信会社）	(61)	(0.578)	・委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(41)	(0.385)	・購入後の情報提供、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等の対価
（受託会社）	(3)	(0.027)	・運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	16	0.147	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（株式）	(12)	(0.113)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に 支払う手数料
（投資信託証券）	(2)	(0.018)	
（先物・オプション）	(2)	(0.017)	
(c) その他費用	21	0.202	(c) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（監査費用）	(－)	(－)	・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
（印刷費用）	(21)	(0.201)	・印刷費用は、有価証券届出書、目論見書、運用報告書等 の作成、印刷および提出等に係る費用
（その他）	(0)	(0.000)	・その他は、金銭信託への預入金額に対する手数料、その 他投資信託財産の運営にかかる費用等
合 計	142	1.339	

(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。

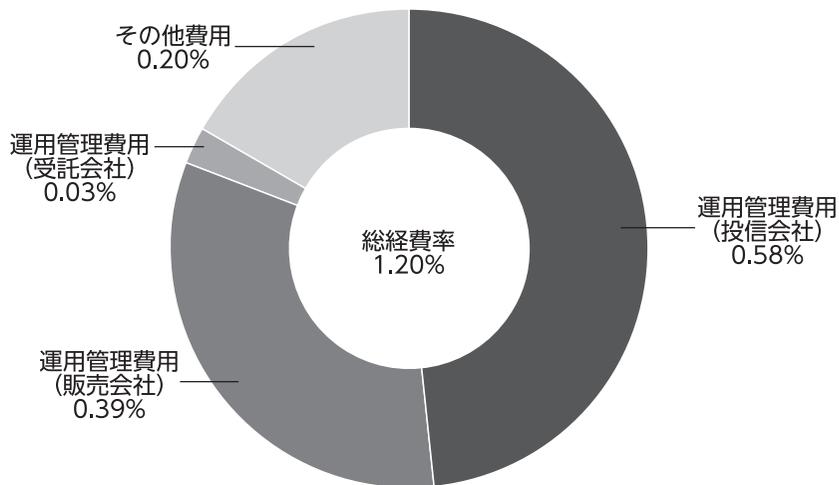
(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ (参考情報) 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.20%です。



(注1) 各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

■親投資信託受益証券の設定、解約状況

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)	千口 10,050	千円 11,498	千口 12,231	千円 13,920

(注) 単位未満は切捨て。

株式売買比率

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

〈楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)〉

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,709,291千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,171,819千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	1.80

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

該当事項はありません。

※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項に規定されている利害関係人です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

該当事項はありません。

組入資産の明細

■親投資信託残高

	前 期 末	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)	千口 63,409	千口 61,228	千円 68,968

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の当期末現在の受益権口数は、2,802,581千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)	68,968	97.5
短期金融資産、その他	1,778	2.5
投資信託財産総額	70,746	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年5月25日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	70,746,468円
コール・ローン等	1,778,452
楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)(評価額)	68,968,016
(B) 負 債	606,298
未払解約金	177,366
未払信託報酬	357,239
未払利息	5
その他未払費用	71,688
(C) 純資産総額(A-B)	70,140,170
元 本	68,036,413
次期繰越損益金	2,103,757
(D) 受益権総口数	68,036,413口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,309円

(注) 期首元本額 69,590,527円
 期中追加設定元本額 15,278,419円
 期中一部解約元本額 16,832,533円

■損益の状況

(自2022年5月26日 至2023年5月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,112円
支 払 利 息	△1,112
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△892,666
売 買 益	57,702
売 買 損	△950,368
(C) 信 託 報 酬 等	△868,771
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△1,762,549
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	902,226
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,964,080
(配 当 等 相 当 額)	(2,170,327)
(売 買 損 益 相 当 額)	(793,753)
(G) 計 (D+E+F)	2,103,757
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	2,103,757
追 加 信 託 差 損 益 金	2,964,080
(配 当 等 相 当 額)	(2,195,206)
(売 買 損 益 相 当 額)	(768,874)
分 配 準 備 積 立 金	2,591,050
繰 越 損 益 金	△3,451,373

(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替えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には成功報酬が含まれます。(消費税相当額を含めて表示しています。)なお、当期における成功報酬はありませんでした。

(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。

<分配金の計算過程>

項 目	当期
(A)配当等収益額 (費用控除後)	467,498円
(B)有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C)収益調整金額	2,195,206円
(D)分配準備積立金額	2,123,552円
(E)分配対象収益額 (A+B+C+D)	4,786,256円
(F)期末残存口数	68,036,413口
(G)収益分配対象額 (1万口当たり) (E/F×10,000)	703.47円
(H)分配金額 (1万口当たり)	－円
(I)収益分配金金額 (F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)

第5期(2023年5月25日)

《運用報告書》

●当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限(2018年8月3日設定)
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。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式および株価指数先物取引にかかる権利を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。

当マザーファンドはこのたび上記決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

楽天投信投資顧問株式会社

東京都港区南青山二丁目6番21号

URL : <https://www.rakuten-toushin.co.jp/>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 率				
(設 定 日) 2018年 8月 3日	10,000	—	—	—	—	百万円 2,590
1期(2019年 5月27日)	10,012	0.1	66.6	△63.4	—	4,006
2期(2020年 5月25日)	10,206	1.9	68.7	△29.8	1.5	4,051
3期(2021年 5月25日)	11,349	11.2	92.4	—	1.9	4,376
4期(2022年 5月25日)	11,417	0.6	72.4	△76.3	7.0	4,308
5期(2023年 5月25日)	11,264	△1.3	75.3	△68.0	4.8	3,156

(注1) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注2) 当ファンドの運用方針に対応する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

(注3) 設定日の基準価額には当初設定価額を、純資産総額には当初設定元本を用いています。

当期中の基準価額の推移

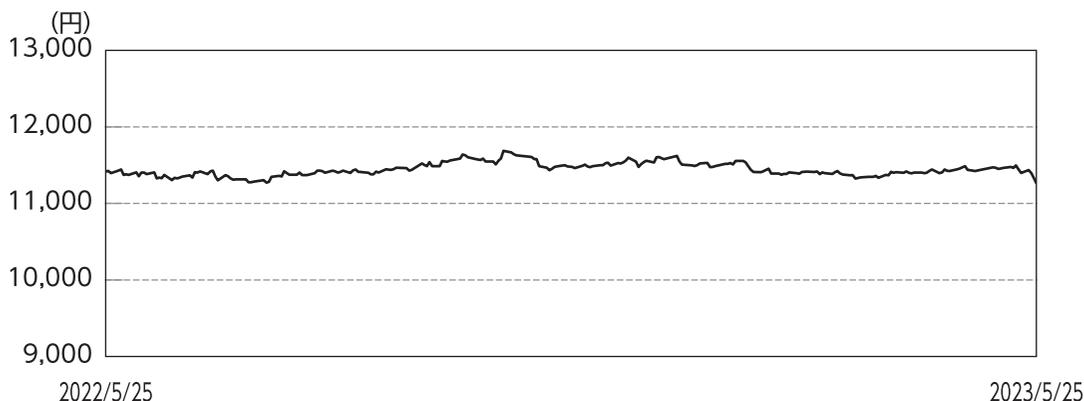
年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2022年 5月25日	11,417	—	72.4	△76.3	7.0
5月末	11,445	0.2	73.9	△77.3	7.0
6月末	11,405	△0.1	72.6	△76.0	7.3
7月末	11,348	△0.6	75.5	△79.2	6.7
8月末	11,445	0.2	76.1	△79.5	6.7
9月末	11,487	0.6	71.8	△67.8	6.5
10月末	11,668	2.2	76.5	△76.6	6.4
11月末	11,483	0.6	79.3	△80.8	6.3
12月末	11,579	1.4	77.2	△76.1	5.0
2023年 1月末	11,536	1.0	80.3	△79.8	4.9
2月末	11,419	0.0	80.8	△81.4	5.3
3月末	11,409	△0.1	77.0	△74.7	4.8
4月末	11,439	0.2	79.4	△77.0	5.1
(期 末) 2023年 5月25日	11,264	△1.3	75.3	△68.0	4.8

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は前期末比1.3%下落しました。

<2022年5月末～2022年9月>

米国でインフレが進む中でFRB(米連邦準備制度理事会)による急速な金融引き締めが警戒されたことや、コロナ禍での経済活動の制限が続く中国経済の先行き懸念など懸念材料も多く、ヘッジ比率を高水準で維持した為、基準価額は概ね横ばいで推移しました。

<2022年10月～2022年12月>

堅調な企業決算や日本への入国規制の緩和によりインバウンド需要増への期待など株価の支援材料はあるも、FRBが金融引き締めを継続する姿勢を示したことや、12月の日本銀行の金融政策決定会合にて長期金利の許容変動幅を拡大したことで円高が大幅に進行するなど不安材料もあることから、引き続きヘッジ比率を高水準で維持し、基準価額は概ね横ばいで推移しました。

<2023年1月～2023年5月25日>

景気の先行き不透明感や3月の米国での地方銀行の金融危機などを背景にヘッジ比率を高位で維持しました。個別銘柄のパフォーマンスの悪化などから、基準価額はやや下落しました。

■投資環境

<2022年5月末～2022年9月>

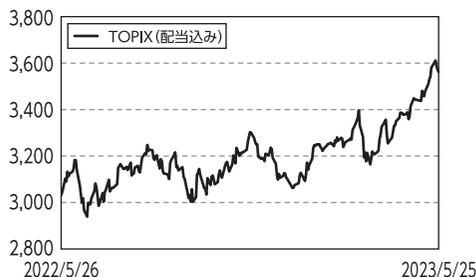
米国における金融引き締めや中国におけるコロナ禍での経済活動制限、台湾を巡る米中関係の悪化などがあり、相場はレンジ内での動きに終始し、ほぼ横ばいの動きとなりました。

<2022年10月～2022年12月>

堅調な企業業績やコロナ禍からの経済再開期待で一時的に相場が持ち直す場面もありましたが、米国の金融引き締め継続や日本銀行による金融政策修正による円高進行もあり、一進一退の動きとなりました。

<2023年1月～2023年5月25日>

米国の地方銀行破綻など不安材料もありましたが、米国での利上げ打ち止め観測や懸念されたほど企業業績見通しが悪くないことなどを背景に相場は上昇しました。



(出所)ブルームバーグのデータ等を基に楽天投信投資顧問にて作成

■当ファンドのポートフォリオ

ビッグデータ等から抽出された候補銘柄について、成長性、安全性等を精査し投資を行いました。

期を通じて、コロナ禍からの経済活動の再開により恩恵が受けられる内需関連（特にレジャー・鉄道関連）などの組入比率を高める一方、世界景気の減速を懸念し設備投資関連（特に電機・機械など）は組み入れを抑えました。

ヘッジ比率は米国での金融引き締めや中国の経済再開の遅れ、欧米での金融システム不安など不透明要因が多かったこともあり、期を通じて高位を維持しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

■今後の運用方針

引き続き、楽天グループをはじめとする様々な情報ソースのビッグデータを活用した分析に加え、独自の定性判断により今後成長が見込まれる銘柄を厳選します。

またこれらの厳選された銘柄についての投資ポートフォリオに対し、株価指数先物取引を組み合わせた運用を行うことで、市場の上昇・下落に左右されにくい、あらゆる相場環境で絶対収益の確保を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料	16円	0.141%
(株式)	(12)	(0.107)
(投資信託証券)	(2)	(0.018)
(先物・オプション)	(2)	(0.016)
(b) その他費用	0	0.000
(その他)	(0)	(0.000)
合計	16	0.141
期中の平均基準価額は11,471円です。		

(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。なお、費用項目については5ページ(1万口当たりの費用の明細の項目の概要)をご参照下さい。

(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

■株式

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	千株	千円	千株	千円	
上 場	779 (74)	2,296,957 (-)	869	3,412,334	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は増資割当、株式転換・合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■投資信託証券

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	口	千円	口	千円	
星野リゾート・リート投資法人	—	—	66	46,666	
積水ハウス・リート投資法人	690	55,217	690	50,429	
いちごホテルリート投資法人	803	77,090	803	82,762	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	166	87,825	166	81,236	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	387	55,608	709	104,465	
日本ビルファンド投資法人	98	54,473	—	—	
フロンティア不動産投資法人	29	15,393	162	86,701	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,068	87,247	1,702	121,989	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

派生商品の取引状況等

■先物取引の銘柄別取引・残高状況

銘柄別	当 期				当期末評価額		
	買 建		売 建		買建額	売建額	評価損益
	新規 買付額	決済額	新規 売付額	決済額			
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引							
TOPIX	—	—	14,039	15,666	—	2,148	△130

(注) 単位未満は切捨て。

株式売買比率

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,709,291千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,171,819千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	1.80

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

該当事項はありません。

※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項に規定されている利害関係人です。

組入資産の明細

■国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
建設業(5.3%)				
ショーボンドホールディングス	25.7	22.3	125,772	
西松建設	32.1	—	—	
食料品(0.5%)				
理研ビタミン	—	6.4	13,107	
繊維製品(0.7%)				
ゴールドウイン	—	1.3	15,561	
化学(5.1%)				
信越化学工業	4.6	4	17,288	
富士フイルムホールディングス	9.8	3.1	25,931	
ノエビアホールディングス	—	7.3	39,420	
アクシージア	—	32.5	38,642	
医薬品(3.0%)				
第一三共	25.4	15.8	72,379	
非鉄金属(—%)				
アサヒホールディングス	53.4	—	—	
機械(5.2%)				
SMC	0.6	—	—	
ダイキン工業	5.7	2.9	78,401	
平和	—	18.3	44,725	
電気機器(8.6%)				
イビデン	5.7	—	—	
ニデック	3.1	2.2	15,875	
ソニーグループ	10.5	5	66,350	
キーエンス	2.3	1.2	82,860	
日本セラミック	—	14.8	39,175	
東京エレクトロン	0.5	—	—	
輸送用機器(6.7%)				
デンソー	6.5	—	—	
トヨタ自動車	86.4	48.9	94,792	
スズキ	—	14.2	64,681	
シマノ	4.1	—	—	
精密機器(0.6%)				
HOYA	4.7	0.9	14,760	
その他製品(2.1%)				
スノーピーク	10.6	—	—	
バンダイナムコホールディングス	9.3	—	—	
SHO E I	17.8	19	50,255	
電気・ガス業(2.6%)				
東京瓦斯	—	20	60,700	
陸運業(8.7%)				
京成電鉄	—	14.5	74,820	
西日本旅客鉄道	26.6	22.4	131,174	
情報・通信業(12.7%)				
GMOペイメントゲートウェイ	6.6	2.2	23,694	
インターネットイニシアティブ	26	21.8	59,078	
オービック	3.4	1.3	29,250	
東映アニメーション	2.6	—	—	
日本電信電話	50.6	42.1	173,409	
ソフトバンクグループ	6.6	3.2	16,208	
卸売業(19.6%)				
伊藤忠商事	47.3	30	142,200	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
				千円
豊田通商	18.9	15.8	15.8	98,592
三菱商事	—	—	21.6	121,802
サンリオ	—	—	11.3	64,975
加賀電子	—	—	7.5	38,925
小売業(2.1%)				
ロイヤルホールディングス	—	—	12.6	34,561
ファーストリテイリング	0.5	—	0.5	16,580
銀行業(5.9%)				
九州フィナンシャルグループ	—	—	24.9	13,022
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	—	58.6	53,478
三井住友フィナンシャルグループ	32.8	—	13.1	72,836
証券、商品先物取引業(—%)				
SBIホールディングス	15	—	—	—
保険業(2.3%)				
第一生命ホールディングス	19.9	—	10.6	25,742
東京海上ホールディングス	—	—	9.7	29,546
不動産業(1.1%)				
平和不動産	22.6	—	—	—
日本空港ビルデング	7.1	—	4	25,600
サービス業(7.2%)				
オリエンタルランド	5.1	—	19.5	102,063
リクルートホールディングス	7.2	—	—	—
ペイカレント・コンサルティング	0.9	—	5.8	29,870
東京都競馬	—	—	9.5	38,807
合 計		株 数 ・ 金 額		
		618	602	2,376,914
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	42	< 75.3% >

(注1) ()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
星野リゾート・リート投資法人	135	69	46,437	1.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人	322	—	—	—
日本ビルファンド投資法人	—	98	53,018	1.7
フロンティア不動産投資法人	133	—	—	—
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,306	672	51,206	1.6
合 計	1,896	839	150,661	
口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	<4.8%>	

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円	百万円
株式先物取引		
TOPIX	—	2,148

(注) 単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 2,376,914	% 72.3
投 資 証 券	150,661	4.6
短 期 金 融 資 産 、 そ の 他	759,749	23.1
投 資 信 託 財 産 総 額	3,287,324	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年5月25日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,287,324,574円
コール・ローン等	518,585,680
株 式(評価額)	2,376,914,510
投 資 証 券(評価額)	150,661,400
未 収 配 当 金	25,662,984
差 入 委 託 証 拠 金	215,500,000
(B) 負 債	130,548,420
未 払 金	130,544,000
未 払 利 息	1,534
そ の 他 未 払 費 用	2,886
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,156,776,154
元 本	2,802,581,065
次 期 繰 越 損 益 金	354,195,089
(D) 受 益 権 総 口 数	2,802,581,065口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,264円

- (注1) 期首元本額 3,773,854,126円
 期中追加設定元本額 10,050,916円
 期中一部解約元本額 981,323,977円
- (注2) 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額
 楽天・ビッグデータ日本株ファンド(積極運用型)(一般投資家私募) 2,741,352,357円
 楽天・ビッグデータ日本株ファンド 61,228,708円

■損益の状況

(自2022年5月26日 至2023年5月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	73,154,804円
受 取 配 当 金	73,707,326
そ の 他 収 益 金	2,361
支 払 利 息	△554,883
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	366,633,461
売 買 益	535,101,875
売 買 損	△168,468,414
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△489,166,600
取 引 益	22,953,400
取 引 損	△512,120,000
(D) そ の 他 費 用	△15,602
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△49,393,937
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	534,737,965
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,447,084
(H) 解 約 差 損 益 金	△132,596,023
(I) 計 (E+F+G+H)	354,195,089
次 期 繰 越 損 益 金(I)	354,195,089

- (注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益及び(C)先物取引等取引損益は期末の評価替えによるものを含みます。
- (注2) 損益の状況の中で(G)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。
- (注3) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

お知らせ

該当事項はありません。