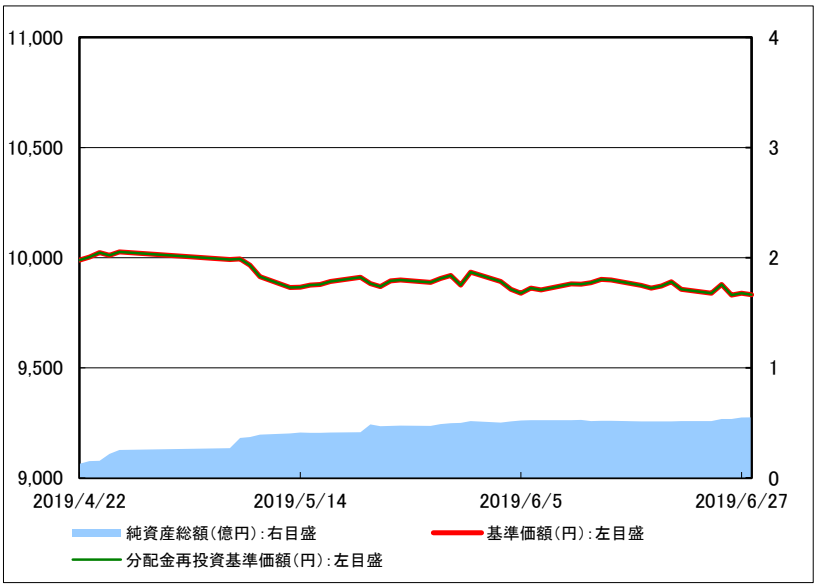
楽天・ビッグデータ日本株ファンド

追加型投信/国内/株式/特殊型(絶対収益追求型)

当初設定日 : 2019年4月22日
作成基準日 : 2019年6月28日

基準価額と純資産総額の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は、信託報酬控除後の値です。また、分配金再投資基準価額は税引前分配金を再投資したものとして計算しています。
※ 信託報酬は、後述の「ファンドの費用」および投資信託説明書(交付目論見書)でご確認ください。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月末比
基準価額	9,831 円	△ 103 円
純資産総額	0.54 億円	+0.03 億円

設定来高値	10,026 円	(2019/4/26)
設定来安値	9,830 円	(2019/6/26)
当月中高値	9,901 円	(2019/6/13)
当月中安値	9,830 円	(2019/6/26)

ファンドの騰落率

	騰落率
1カ月	△1.0%
3カ月	-
6カ月	-
1年	-
3年	-
設定来	△1.7%

※ 分配金再投資基準価額を基に算出しております。
※ 騰落率は小数点第2位を四捨五入しております。年率換算しておりません。

分配金(税引前、1万口当たり)

設定来分配金合計額 - 円

決算期	2020年5月	2021年5月	2022年5月
分配金	- 円	- 円	- 円

※ 分配金実績は、将来の分配金の水準を示唆・保証するものではありません。
※ ファンドの分配金は投資信託説明書(交付目論見書)記載の「分配方針」に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。

投資状況

組入資産	比率
楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド(積極運用型)	99.9%
短期金融資産等	0.1%
合 計	100.0%

※ 比率は、ファンドの純資産総額に対する各資産の評価額の比率です。
※ 追加設定の計上タイミングと主要投資対象の購入処理のタイミングのずれ等により、主要投資対象の比率が100%超となり、「短期金融資産等」の比率がマイナスになることがあります。

資産の状況

※ 当ページの数値はマザーファンドベースです。

投資状況

組入資産	比率
株式	75.3%
短期金融資産等	24.7%
合計	100.0%
株式先物（TOPIX）	△62.9%

※ 株式先物は、実質エクスポージャーを基に構成比を計算しています。

投資銘柄数

投資銘柄数	37

組入上位10銘柄

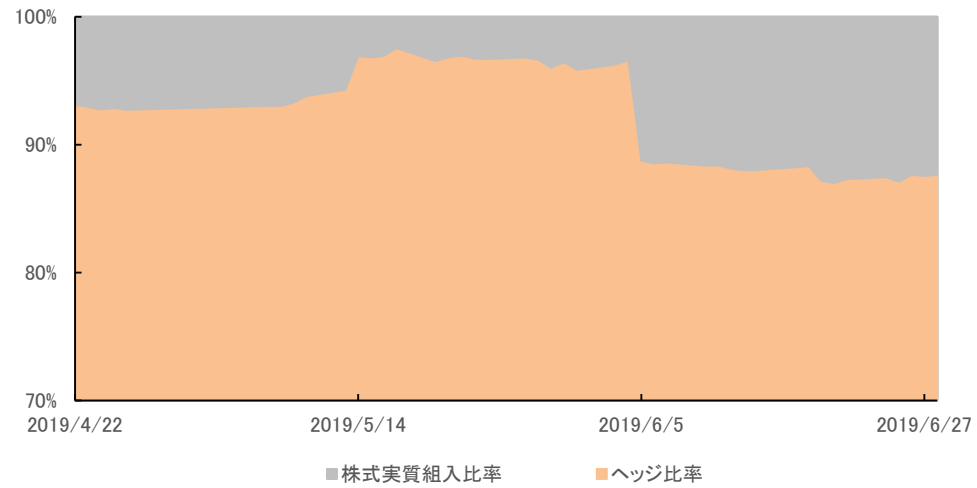
銘柄	業種	比率
テルモ	精密機器	3.4%
ダイフク	機械	3.3%
オリエンタルランド	サービス業	3.2%
花王	化学	3.2%
バンダイナムコホールディングス	その他製品	3.0%
任天堂	その他製品	2.8%
セコム	サービス業	2.7%
SGホールディングス	陸運業	2.6%
村田製作所	電気機器	2.5%
ハウス食品グループ本社	食料品	2.5%

組入上位10業種

業種	比率
化学	15.0%
電気機器	8.3%
その他製品	8.1%
食料品	7.9%
サービス業	5.9%
卸売業	5.7%
精密機器	5.7%
情報・通信業	3.3%
機械	3.3%
陸運業	2.6%

※ 比率は、マザーファンドの純資産総額に対する各資産の評価額の比率です。

株式実質組入比率およびヘッジ比率の推移



※ 株式実質組入比率およびヘッジ比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。
※ ヘッジ比率＝（TOPIX先物取引の想定元本＋短期金融資産）÷純資産総額
※ 株式実質組入比率＝100%－ヘッジ比率

運用概況・今後の運用方針

＜運用概況（マザーファンド）＞
当月の基準価額は前月末比で△1.0%となりました。
個別銘柄では、原油の上昇により輸送費などのコスト増が懸念されたハウス食品グループ本社、江崎グリコなどの食品メーカーのほか、前月までの堅調から一転して利食い売りに押された理化学機器商社のアズワンなどが下落し、マイナス寄与となりました。一方、米中貿易協議再開の期待から外需銘柄への物色が広がった流れを受け、物流システムメーカーのダイフク、制御装置・ヘルスケア機器メーカーのオムロンのほか、インドで経済重視のモディ政権が選挙で勝利を収めたことにより当該国で事業を展開する総合塗料メーカーの関西ペイントなどが上昇し、プラス寄与となりました。
また、FRB（米連邦準備制度理事会）の利下げ期待を背景とする米国株式市場のセンチメントの改善とボラティリティ低下を反映して、株価指数先物の売り建てによるヘッジ比率を若干引き下げましたが、引き続き株式実質組入比率を低位に抑えました。

＜今後の運用方針（マザーファンド）＞
引き続き、ビッグデータを活用した分析と独自の定性判断により、日本の取引所に上場している株式のうち成長が見込まれる銘柄に厳選投資するとともに、株価指数先物の売建て取引を活用し、株式の実質組入比率を機動的にコントロールすることで絶対収益の確保を目指します。

※ 上記内容は、当資料作成日時点のものであり、予告なく変更する場合があります。

市況動向

当月の国内株式市場は上昇基調で推移しました。

前月末にトランプ大統領が表明したメキシコに対する追加関税への懸念やそれに伴う急激な円高進行を受け、国内株式市場は下落から始まりました。その後6月4日（現地時間）にはパウエルFRB議長が講演で、「景気拡大を持続させるために必要ならば適切な行動をとる」と述べ利下げの可能性に言及しました。これを好感した米国株式市場に連動して、国内株式市場も大幅に上昇しました。また、トランプ米大統領がメキシコへの関税を延期すると発表したことも株価の支援材料になりました。

月中旬は薄商いの中、逃亡犯条例改正に反対する香港での大規模デモの混乱による中国株式市場の下落や、ホルムズ海峡でのタンカー攻撃に端を発したイランと米国の間の急激な緊張の高まりから地政学リスクが意識され、株式市場は上値の重い展開となりました。

月後半にかけては米長期金利の一段の低下に伴う円高進行から国内株式市場も売られる場面もありましたが、月末に大阪で開催されるG20（20カ国・地域）首脳会議で米中首脳会談が実施されると報道されると、両国貿易協議の進展への期待感から株価は月末にかけ回復基調となりました。

ファンドの特色

- 日本の取引所に上場している株式のうち、今後成長が見込まれる銘柄に厳選投資を行います。
  - 株式の個別銘柄選択にあたっては、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。
- 株価指数先物の売建て取引を活用し、株式の実質組入比率を機動的にコントロールすることで絶対収益の確保を目指します。
  - 日本の株式に分散投資するとともに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。
- 当ファンドは、「楽天・ビッグデータ日本株マザーファンド（積極運用型）」を親投資信託（「マザーファンド」）とするファミリーファンド方式で運用し、マザーファンドで実質的な運用を行います。

※ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき等、ならびに投資信託財産の規模によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

投資リスク

《基準価額の変動要因》

ファンドがマザーファンドを通じて実質的に投資する有価証券等（株価指数先物取引を含みます。）の値動きにより、基準価額は変動します。投資信託は預貯金と異なります。投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。投資家の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。投資家の皆様には、ファンドが有するリスクについてご理解のうえ投資判断をしていただくようお願いいたします。

【株価変動リスク】
当ファンドが実質的に投資する株式の価格は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給関係等の影響を受け変動します。当該株式の価格が下落した場合には、基準価額の下落要因となります。

【信用リスク】
当ファンドが実質的に投資する有価証券等の価格は、発行体の倒産、財務状況または信用状況の悪化等の影響を受けます。発行体の経営状態の悪化等により当該有価証券の価格が下落した場合には、基準価額の下落要因となります。

【流動性リスク】
当ファンドが実質的に投資する有価証券等の流動性は、需給環境や市場に対する相場見通し、経済・金融情勢等の変化、当該有価証券等が売買される市場の規模や厚み、市場参加者の差異等の影響を受けます。当該有価証券等の流動性が低下した場合、市場実勢から期待できる価格で売買が実行できず、不利な条件での売買を強いられる可能性があり、その場合、基準価額の下落要因となります。

【株価指数先物に関するリスク】
当ファンドが実質的に投資する株価指数先物は、株価変動等の影響を受けて価格が変動するため、その影響を受けます。なお、需給や当該株価指数に対する期待等により、理論上期待される水準とは大きく異なる価格となる場合があります。また、株価指数先物の売建て取引を活用している場合に、株価指数先物価格の上昇により損失が発生すると、基準価額の下落要因となります。

※ 基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

《その他留意点》

- 当ファンドは、株式へ分散投資するとともに株価指数先物の売建て取引を行うことで株式の実質組入比率を機動的にコントロールするため、株式市場全体の動きと当ファンドの基準価額の動きは大きく異なる場合があります。株式の実質組入比率を0%にしている状況でも株式市況の変動の影響を受け基準価額が下落する場合があります。また、組入れている株式の投資成果がプラスとなった場合でも株価指数先物取引によるマイナスの影響が大きい場合には、基準価額が下落する要因となります。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- 当ファンドの取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 当ファンドに関連する法令・税制・会計等は、今後、変更される可能性があります。これに伴い、当ファンドの基準価額に影響がおよぶ場合があります。
- 市況動向や資金動向等によっては、投資方針に沿った運用ができない可能性があります。
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
  分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
  投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

お申込みメモ

購　入　単　位・・・販売会社またはお申込みコースにより異なります。詳しくは、販売会社にご確認ください。

購　入　価　額・・・購入申込受付日の基準価額
※ファンドの基準価額は1万口当たりで表示されます。基準価額は委託会社の照会先でご確認ください。

換　金　単　位・・・販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にご確認ください。

換　金　価　額・・・換金申込受付日の基準価額から信託財産留保額(0.3%)を控除した額

換　金　代　金・・・原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目以降に受益者にお支払いします。

申込締切時間・・・原則として営業日の午後3時以前で販売会社が定める時限までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。受付時間は販売会社によって異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

換　金　制　限・・・投資信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みには制限を設ける場合があります。

購入・換金申込受付の中止および取消し・・・金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断により、購入・換金申込の受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金申込の受付を取消すことができます。

信　託　期　間・・・2029年5月24日まで(2019年4月22日設定)
※ただし、一定の条件により信託期間を延長または繰上償還する場合があります。

繰　上　償　還・・・委託会社は、受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、この投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

決　算　日・・・原則として、毎年5月25日(ただし、休業日の場合は翌営業日)
※第1期決算日は、2020年5月25日とします。

収　益　分　配・・・毎決算時に、原則として収益分配方針に基づき分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。

課　税　関　係・・・課税上は株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。配当控除の適用が可能です。

ファンドの費用

《投資者が直接的に負担する費用》

■ 購入時手数料
3.24%(税抜3.0%)を上限として、販売会社が定める料率とします。詳しくは販売会社にお問合わせください。

■ 信託財産留保額
換金請求受付日の基準価額に対して0.3%を乗じて得た額

《投資者が投資信託財産で間接的に負担する費用》

■ 運用管理費用(信託報酬)
運用管理費用(信託報酬)の総額は、(1)基本報酬額に(2)成功報酬額を加算して得た額とします。

(1)基本報酬額
計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.972%(税抜0.90%)の率を乗じて得た額とします。

(2)成功報酬額
ハイ・ウォーターマークを超えた場合に、その超過額に17.28%(税抜16.0%)を乗じて得た額とします。

■ その他の費用・手数料
信託事務費用、監査報酬、印刷費用、売買委託手数料等が支払われます。
※ 委託会社は、投資信託財産の規模等を考慮して、当該費用・手数料等の一部もしくは全てを負担する場合があります。
※ これらの費用・手数料等については、運用状況により変動するものであり、事前に料率や上限額を表示することができません。

*費用・手数料等の合計額は、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため表示することができません。

※ 詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「お申込みメモ」、「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

委託会社・その他の関係法人の概要

■ 委託会社　楽天投信投資顧問株式会社（ファンドの運用の指図を行う者）
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第1724号
加　入　協　会　：　一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

■ 受託会社　三井住友信託銀行株式会社（ファンドの財産の保管および管理を行う者）

販売会社

商号等		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人日本投資顧問業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第195号	○	○	○	○

・お申込み、投資信託説明書（交付目論見書）のご請求は、販売会社へお申し出ください。

・販売会社は今後変更となる場合があります。

＜当資料のお取扱いにおけるご留意点＞
●当資料は楽天投信投資顧問が作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
●ご購入のお申込みの際は最新の投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
●投資信託は値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクを伴います。）に投資しますので基準価額は変動します。したがって、投資元本や利回りが保証されるものではありません。ファンドの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金や保険契約とは異なり預金保険機構および保険契約者保護機構等の保護の対象ではありません。また、証券会社以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。
●当資料は信頼できると判断した各種情報等に基づき作成していますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、今後予告なく変更される場合があります。
●当資料中の図表、数値、その他データについては、過去のデータに基づき作成したものであり、将来の成果を示唆あるいは保証するものではありません。