

■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／インデックス型	
信託期間	無期限(2020年2月27日設定)	
運用方針	主に楽天・新経連株価指数マザーファンド(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に上場している株式に投資し、投資成果を新経連株価指数(Japan New Economy Index)(以下「対象指数」という場合があります。)の動きに連動させることを目指して運用を行います。	
主要投資対象	楽天・新経連株価指数ファンド	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に上場している株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	楽天・新経連株価指数ファンド	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・新経連株価指数ファンド 〈愛称：JANEインデックス〉

第1期

決算日：2021年2月15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。

■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			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率	純資産総額
	(分配落)	税金込 分配金	期中騰落率		期中騰落率			
(設定日) 2020年 2月27日	円 10,000	円 —	% —	4,075.43	% —	% —	% —	百万円 314
1期(2021年 2月15日)	13,673	0	36.7	5,610.83	37.7	93.2	6.6	378

(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」は、実質組入比率を記載しています。

(注4) 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。

ベンチマークは、新経連株価指数(Japan New Economy Index)です。

新経連株価指数(Japan New Economy Index)は、一般社団法人新経済連盟(新経連: Japan Association of New Economy (JANE))が独自開発した指数で、新経連に加盟する上場企業で構成され、2012年6月1日を1,000ポイントとして2019年6月に算出開始した新しい株価指数です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率
		騰落率		騰落率		
(設定日) 2020年 2月27日	円 10,000	% —	4,075.43	% —	% —	% —
2月末	9,520	△4.8	3,878.14	△4.8	94.7	4.2
3月末	8,815	△11.9	3,591.31	△11.9	94.5	5.4
4月末	9,618	△3.8	3,923.33	△3.7	96.2	2.7
5月末	11,012	10.1	4,499.80	10.4	95.8	3.5
6月末	10,805	8.1	4,414.13	8.3	97.7	1.9
7月末	10,627	6.3	4,345.70	6.6	98.2	1.4
8月末	11,577	15.8	4,738.88	16.3	95.3	3.7
9月末	12,223	22.2	5,019.38	23.2	94.8	4.5
10月末	11,822	18.2	4,857.68	19.2	97.6	1.9
11月末	12,626	26.3	5,183.46	27.2	97.8	1.6
12月末	12,649	26.5	5,188.27	27.3	96.0	3.2
2021年 1月末	12,571	25.7	5,156.83	26.5	98.5	1.4
(期末) 2021年 2月15日	13,673	36.7	5,610.83	37.7	93.2	6.6

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比。

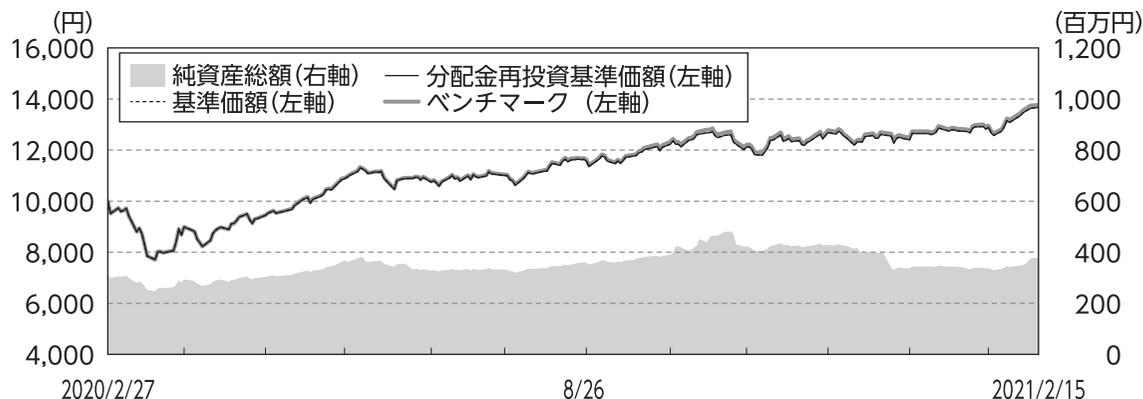
(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(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」は、実質組入比率を記載しています。

(注4) 設定日の基準価額には当初設定価額を用いています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：13,673円(既払分配金0円)

騰落率：36.7%(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) ベンチマークは、新経連株価指数(Japan New Economy Index)です。
- (注4) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、設定日の基準価額を起点として指数化しています。
- (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。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は設定日比36.7%上昇しました。

設定当初は、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への悪影響が懸念され、国内外の株式市場が売り一色のなか、基準価額は一旦大幅に下落しました。2020年3月以降は、新型コロナウイルスの治療薬や経済活動の再開に対する期待などを背景に株式市場が落ち着きを見せるなか、基準価額は設定価額を上回り、その後も上昇基調で推移しました。特に夏場以降「With コロナ」を見越す形で、新経連株価指数(Japan New Economy Index)採用銘柄のなかでもインターネットサービス新興企業の株価上昇が基準価額の上昇を牽引しました。

2020年後半から期末にかけては、国内における新型コロナウイルス感染者数の急激な増加を受けて基準価額の上値を抑える局面もありましたが、国内主要企業の業績改善基調、米大統領選挙の決着を受けた米国の政治不透明感の後退、新型コロナウイルスワクチンの迅速な開発と普及による経済活動の正常化が期待され、国内外の株式市場とともに基準価額の上昇基調が継続しました。

■投資環境

2020年前半は新型コロナウイルスの感染拡大により世界経済への深刻な悪影響が出るのではないかと懸念から、株式市場は3月に一旦大幅に下落しました。その後は各国当局の政策総動員のスタンスを背景に持ち直し、新規感染者数の増加傾向の鈍化や経済活動の再開に対する期待などから上昇に転じました。

2020年後半から期末にかけては、欧米における新型コロナウイルス感染再拡大への警戒、米中対立の激化を巡る懸念などの悪材料から一旦下落する局面もありましたが、国内主要企業の業績改善傾向、米国議会における追加経済対策、新型コロナウイルスワクチンの普及による経済正常化への期待などを受けて概ね上昇基調で推移しました。

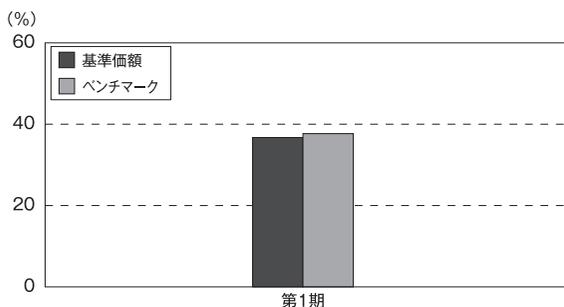
■当ファンドのポートフォリオ

追加設定・解約による資金フローを鑑みながら、「楽天・新経連株価指数マザーファンド」(以下、「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、わが国の金融商品取引所に上場している株式の組入比率を高位に維持し、投資成果を新経連株価指数の動きに連動させることを目指して運用を行いました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。

当期の基準価額の騰落率は+36.7%と上昇し、ベンチマーク比では $\Delta 1.0\%$ となりました。主な差異要因としては、マザーファンドにおける資金の流出入に伴う組入銘柄の売買執行コスト、当ファンドにおける信託報酬等の要因が挙げられます。



■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1期	
	2020年2月27日～2021年2月15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)		3,672

(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

引き続き、マザーファンドへの投資を通じて、わが国の金融商品取引所に上場している株式の組入比率を高位に維持し、投資成果を新経連株価指数の動きに連動させることを目指して運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	2020年2月27日～2021年2月15日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	54円	0.480%	(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11,155円です。
（投信会社）	(30)	(0.272)	・委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(20)	(0.181)	・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	7	0.063	(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）	(7)	(0.059)	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
（先物・オプション）	(1)	(0.005)	
(c) その他費用	8	0.073	(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）	(2)	(0.016)	・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）	(6)	(0.058)	・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	69	0.616	

(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。

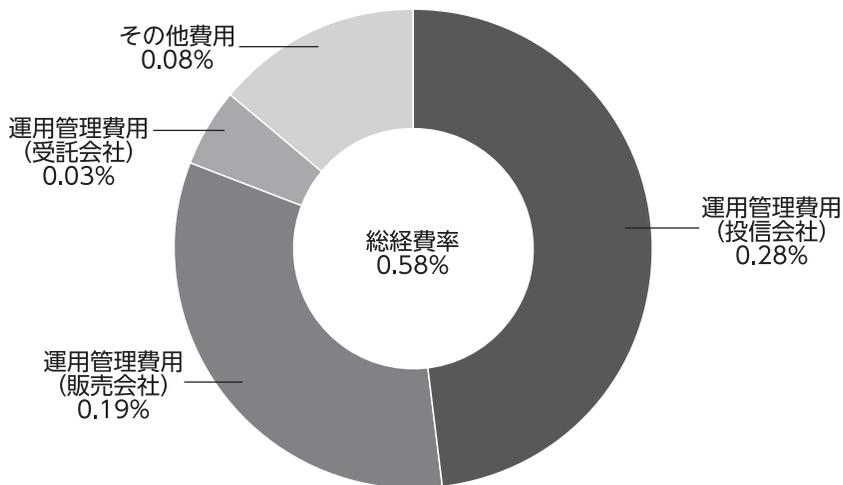
(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.58%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・新経連株価指数マザーファンド	千口 506,288	千円 544,168	千口 230,975	千円 277,777

(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・新経連株価指数マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	688,588千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	337,740千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	2.03

(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

■利害関係人の発行する有価証券等

<楽天・新経連株価指数マザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 12	百万円 3	百万円 10

(注1) 買付額および売付額は受渡し代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 単位未満は切捨て。

※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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、楽天株式会社です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当初設定 元 本	当期解約 元 本	当期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 300	百万円 123	百万円 177	当初設定時における取得とその一部処分

(注) 単位未満は切捨て。

組入資産の明細

■親投資信託残高

	当 期 末	
	口 数	評 価 額
楽天・新経連株価指数マザーファンド	千口 275,312	千円 378,555

(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、275,312千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
楽天・新経連株価指数マザーファンド	千円 378,555	% 99.6
短期金融資産、その他	1,377	0.4
投資信託財産総額	379,932	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

(2021年2月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	379,932,236円
コール・ローン等	1,377,072
楽天・新経連株価指数マザーファンド(評価額)	378,555,164
(B) 負 債	1,218,346
未払解約金	53,080
未払信託報酬	908,434
未払利息	3
その他未払費用	256,829
(C) 純資産総額(A-B)	378,713,890
元 本	276,985,097
次期繰越損益金	101,728,793
(D) 受益権総口数	276,985,097口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,673円

(注) 設定元本額

期中追加設定元本額

期中一部解約元本額

314,607,585円

267,217,614円

304,840,102円

■損益の状況

(自2020年2月27日 至2021年2月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△725円
支 払 利 息	△725
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	70,874,543
売 買 損 益	105,135,881
売 買 損 益	△34,261,338
(C) 信 託 報 酬 等	△1,949,741
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	68,924,077
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	32,804,716
(配 当 等 相 当 額)	(△262)
(売 買 損 益 相 当 額)	(32,804,978)
(F) 計 (D+E)	101,728,793
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	101,728,793
追 加 信 託 差 損 益 金	32,804,716
(配 当 等 相 当 額)	(351,550)
(売 買 損 益 相 当 額)	(32,453,166)
分 配 準 備 積 立 金	68,924,077

(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(E)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）	4,194,406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）	64,729,671円
(C)収益調整金額	32,804,716円
(D)分配準備積立金額	－円
(E)分配対象収益額（A+B+C+D）	101,728,793円
(F)期末残存口数	276,985,097口
(G)収益分配対象額（1万口当たり） （E/F×10,000）	3,672.70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。

一般社団法人新経済連盟（以下「新経済連盟」）及び新経済連盟の委託先、リサーチパートナー又はデータプロバイダー（以下「新経済連盟等」といいます。）は、金融商品に関して対象インデックス及び関連商標を利用するライセンスを付与することを除き、ライセンシーと一切の関係を有していません。

新経済連盟等は、金融商品等の支援、推奨、販売又は宣伝等を行うものではなく、金融商品又はその運用成果に関連して、何ら保証するものではなく、かつ（過失の有無を問わず）いかなる責任も負うものではありません。また、新経済連盟及び新経済連盟の委託先は、金融商品の購入者又は他のいかなる第三者との間でも、何ら契約上の関係を有していません。

楽天・新経連株価指数マザーファンド

第1期(2021年2月15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(2020年2月27日設定)
運用方針	わが国の株式に投資し、投資成果を新経連株価指数(Japan New Economy Index)の動きに連動させることを目指します。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場している株式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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
(設定日) 2020年2月27日	円 10,000	% —	4,075.43	% —	% —	% —	百万円 314
1期(2021年2月15日)	13,750	37.5	5,610.83	37.7	93.3	6.6	378

(注1) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注2) 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。

ベンチマークは、新経連株価指数(Japan New Economy Index)です。

新経連株価指数(Japan New Economy Index)は、一般社団法人新経済連盟(新経連: Japan Association of New Economy (JANE))が独自開発した指数で、新経連に加盟する上場企業で構成され、2012年6月1日を1,000ポイントとして2019年6月に算出開始した新しい株価指数です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率
		騰落率		騰落率		
(設定日) 2020年2月27日	円 10,000	% —	4,075.43	% —	% —	% —
2月末	9,520	△4.8	3,878.14	△4.8	94.7	4.2
3月末	8,819	△11.8	3,591.31	△11.9	94.5	5.4
4月末	9,626	△3.7	3,923.33	△3.7	96.3	2.7
5月末	11,026	10.3	4,499.80	10.4	95.9	3.5
6月末	10,824	8.2	4,414.13	8.3	97.7	1.9
7月末	10,650	6.5	4,345.70	6.6	98.3	1.4
8月末	11,607	16.1	4,738.88	16.3	95.3	3.7
9月末	12,262	22.6	5,019.38	23.2	94.9	4.5
10月末	11,866	18.7	4,857.68	19.2	97.6	1.9
11月末	12,680	26.8	5,183.46	27.2	97.8	1.6
12月末	12,710	27.1	5,188.27	27.3	96.1	3.2
2021年1月末	12,638	26.4	5,156.83	26.5	98.5	1.4
(期末) 2021年2月15日	13,750	37.5	5,610.83	37.7	93.3	6.6

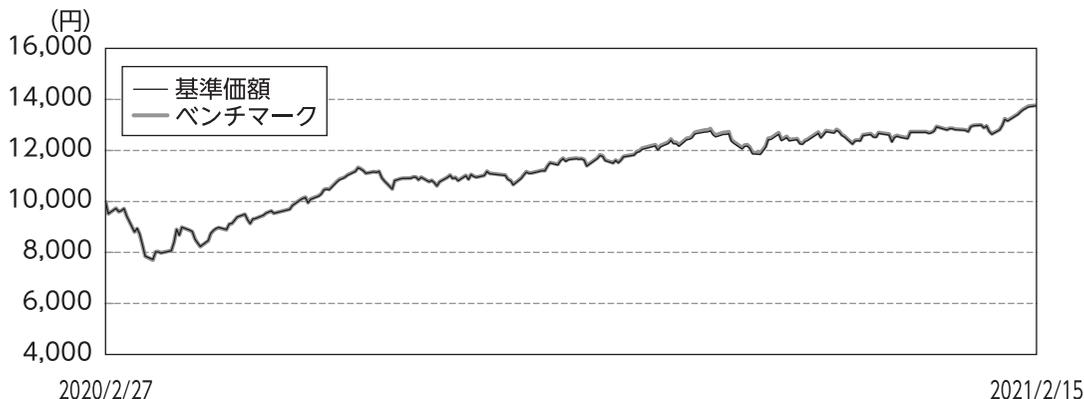
(注1) 騰落率は設定日比。

(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注3) 設定日の基準価額には当初設定価額を用いています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



- (注1) ベンチマークは、新経連株価指数 (Japan New Economy Index) です。
(注2) ベンチマークは、設定日の基準価額を起点として指数化しています。
(注3) 設定日の基準価額には当初設定価額を用いています。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は設定日比37.5%上昇しました。

設定当初は、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への悪影響が懸念され、国内外の株式市場が売り一色のなか、基準価額は一旦大幅に下落しました。2020年3月以降は、新型コロナウイルスの治療薬や経済活動の再開に対する期待などを背景に株式市場が落ち着きを見せるなか、基準価額は設定価額を上回り、その後も上昇基調で推移しました。特に夏場以降「With コロナ」を見越す形で、新経連株価指数 (Japan New Economy Index) 採用銘柄のなかでもインターネットサービス新興企業の株価上昇が基準価額の上昇を牽引しました。

2020年後半から期末にかけては、国内における新型コロナウイルス感染者数の急激な増加を受けて基準価額の上値を抑える局面もありましたが、国内主要企業の業績改善基調、米大統領選挙の決着を受けた米国の政治不透明感の後退、新型コロナウイルスワクチンの迅速な開発と普及による経済活動の正常化が期待され、国内外の株式市場とともに基準価額の上昇基調が継続しました。

■投資環境

2020年前半は新型コロナウイルスの感染拡大により世界経済への深刻な悪影響が出るのではないかと懸念から株式市場は3月に一旦大幅に下落しました。その後は各国当局の政策総動員のスタンスを背景に持ち直し、新規感染者数の増加傾向の鈍化や経済活動の再開に対する期待などから上昇に転じました。

2020年後半から期末にかけては、欧米における新型コロナウイルス感染再拡大への警戒、米中対立の激化を巡る懸念などの悪材料から一旦下落する局面もありましたが、国内主要企業の業績改善傾向、米国議会における追加経済対策、新型コロナウイルスワクチンの普及による経済正常化への期待などを受けて概ね上昇基調で推移しました。

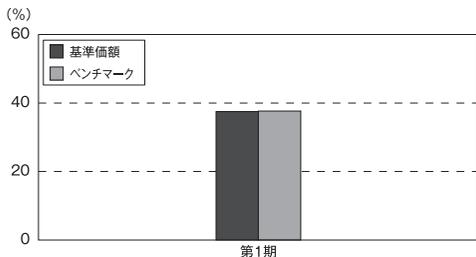
■当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークである新経連株価指数と連動する投資成果を目指して運用を行いました。株式組入比率は期を通じて高位の水準を維持し、追加設定・解約による資金フローを鑑みながら、株価指数先物取引も活用しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

当期の基準価額の騰落率は+37.5%となり、ベンチマーク比では△0.2%となりました。主な差異要因としては、資金の流出入に伴う組入銘柄の売買執行コスト等の要因が挙げられます。



■今後の運用方針

引き続き、わが国の金融商品取引所に上場している株式に投資し、投資成果を新経連株価指数の動きに連動させることを目指して運用を行います。また、追加設定・解約による資金フローを鑑みながら、株価指数先物取引も活用します。

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 (株式) (先物・オプション)	7円 (7) (1)	0.063% (0.059) (0.005)
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)
合計	7	0.063
期中の平均基準価額は11,185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		290 (6)	468,018 (-)	113	220,569

(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。

■先物取引の種類別取引状況

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		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
株 式 先 物 取 引		285	262	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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	688,588千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	337,740千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	2.03

(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

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 12	百万円 3	百万円 10

(注1) 買付額および売付額は受渡し代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 単位未満は切捨て。

※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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、楽天株式会社です。

組入資産の明細

■国内株式(上場株式)

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
建設業(2.8%)	千株	千円
Lib Work	0.2	376
安藤・間	12.4	9,622
化学(4.2%)		
ファンケル	2.3	9,338
ノエビアホールディングス	1.1	5,472
医薬品(1.1%)		
大幸薬品	2.8	3,976
石油・石炭製品(3.4%)		
出光興産	4.4	12,060
機械(3.9%)		
フリュー	1.4	1,639
セガサミーホールディングス	6.6	12,289
電気機器(3.2%)		
富士通	0.7	11,252
精密機器(0.9%)		
セイコーホールディングス	1.9	3,087
その他製品(0.5%)		
ウイルコホールディングス	1.1	171
プロネクサス	1.4	1,656
陸運業(6.3%)		
東急	7.5	10,995
セイノーホールディングス	7	11,186

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
情報・通信業(33.1%)		
ゲンダイエージェンシー	1	300
出前館	1.9	5,880
グリーン	7	4,207
ソケッツ	0.1	107
メディカルネット	0.1	98
K L a b	2.2	1,922
デジタルハーツホールディングス	0.8	1,206
ホットリンク	1	529
イルグルム	0.2	271
テクマトリックス	2.5	4,927
ドリコム	0.8	706
ユニリタ	0.5	959
フリービット	0.6	604
コムチュア	1.6	4,832
アイル	0.8	1,262
クラウドワークス	0.6	1,242
モバイルファクトリー	0.2	206
アカツキ	0.4	1,722
エディア	0.3	150
ユーザベース	1.3	4,140
マネーフォワード	2.2	10,637
ソースネクスト	5.4	1,738
M-マート	0.1	99
ラクスル	1.3	5,193
メルカリ	2.2	13,508
プロパティデータバンク	0.2	427
ブロードバンドセキュリティ	0.1	237
リックソフト	0.1	355
スマレジ	0.2	964
フリー	1.1	13,288
クレスコ	1	1,424
トレンドマイクロ	1.7	10,353
日本オラクル	0.9	11,421
ビジョン	2.3	2,295
富士ソフト	1.6	9,456
卸売業(0.3%)		
エフティグループ	0.7	1,003
小売業(9.3%)		
オイシックス・ラ・大地	1.6	4,795
サンワカンパニー	0.5	152
白鳩	0.3	84
ジェネレーションパス	0.3	179
エスエルディー	0.1	65
B E E N O S	0.7	1,897
リネットジャパングループ	0.5	345
A m i d Aホールディングス	0.1	115
上新電機	1.6	5,248
日本瓦斯	1.8	9,360
ニトリホールディングス	0.5	10,450
その他金融業(0.5%)		
プレミアグループ	0.8	1,877
不動産業(7.4%)		
東急不動産ホールディングス	18.3	12,663
グッドコムアセット	0.5	666
グローバル・リンク・マネジメント	0.2	164
フェイスネットワーク	0.1	125

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
パーク24	千株 5.4	千円 12,619
サービス業(23.1%)		
LIFULL	5.1	2,157
FRONTEO	1.6	1,091
カカクコム	3.5	12,600
デジタルホールディングス	1	2,003
ベネフィット・ワン	3.2	9,712
ぐるなび	2.3	1,396
オールアバウト	0.3	289
ファンコミュニケーションズ	2.8	1,156
ライク	0.7	1,358
エスプール	4.3	4,368
日本サード・パーティ	0.2	154
セブテーニ・ホールディングス	4.5	2,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.6	393
ネクシィーズグループ	0.4	395
サイバーエージェント	1.4	9,912
楽天	9.8	10,878
エフアンドエム	0.6	1,004
弁護士ドットコム	0.5	5,520
Gunosy	0.9	720
イー・ガーディアン	0.6	2,049
ベクトル	1.8	2,359
タメニー	0.6	94
グローバルキッズCOMPANY	0.2	178
ホープ	0.2	501
GameWith	0.5	290
クックビズ	0.1	107
ジーニー	0.4	362
みらいワークス	0.2	232
RPAホールディングス	1.9	1,252
スプリックス	0.5	421
プロレド・パートナーズ	0.3	1,090
ピアラ	0.2	381
ブランディングテクノロジー	0.1	119
サイバー・パス	0.1	243
ウイザス	0.8	403
トランス・コスモス	1.4	4,029
合 計	182	353,035
株 数 銘 柄 数 <比 率>	103	<93.3%>

(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。

■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		
ミニTOPIX	9	—
日経225mini	15	—

(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 353,035	% 93.3
短 期 金 融 資 産、そ の 他	25,527	6.7
投 資 信 託 財 産 総 額	378,562	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

(2021年2月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	378,562,204円
コール・ローン等	23,356,844
株 式(評価額)	353,035,800
未 収 入 金	722,700
未 収 配 当 金	541,610
差 入 委 託 証 拠 金	905,250
(B) 負 債	63
未 払 利 息	63
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	378,562,141
元 本	275,312,847
次 期 繰 越 損 益 金	103,249,294
(D) 受 益 権 総 口 数	275,312,847口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,750円

- (注1) 設定元本額 314,607,000円
 期中追加設定元本額 191,681,470円
 期中一部解約元本額 230,975,623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・新経連株価指数マザーファンド 275,312,847円

■損益の状況

(自2020年2月27日 至2021年2月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,853,183円
受 取 配 当 金	4,864,636
そ の 他 収 益 金	4,501
支 払 利 息	△15,954
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	105,586,503
売 買 益	119,681,623
売 買 損	△14,095,120
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,732,230
取 引 益	5,876,080
取 引 損	△4,143,850
(D) そ の 他 費 用	△775
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	112,171,141
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	37,879,530
(G) 解 約 差 損 益 金	△46,801,377
(H) 計 (E+F+G)	103,249,294
次 期 繰 越 損 益 金(H)	103,249,294

- (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(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。
 (注3) 損益の状況の中で(G)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。