

■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／不動産投信	
信託期間	無期限(2021年11月26日設定)	
運用方針	主に楽天J-REIT・オルタナティブデータ・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等に上場(上場予定銘柄も含みます。)している不動産投資信託証券(J-REIT)のうち、オルタナティブデータ(人流データ等)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銘柄に投資を行います。	
主要投資対象	楽天J-REIT・オルタナティブデータ・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(上場予定銘柄も含みます。)している不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とします。
主な投資制限	楽天J-REIT・オルタナティブデータ・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。投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への投資は行いません。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J-REIT・オルタナティブデータ・ファンド 〈愛称：アクティブJ-REIT〉

第4期

決算日：2023年11月27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			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) 2021年11月26日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 100
1期(2022年 5月25日)	9,931	0	△0.7	95.1	124
2期(2022年11月25日)	10,175	0	2.5	93.2	143
3期(2023年 5月25日)	9,694	0	△4.7	94.7	137
4期(2023年11月27日)	9,845	0	1.6	92.1	125

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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3) 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。

当期中の基準価額の推移

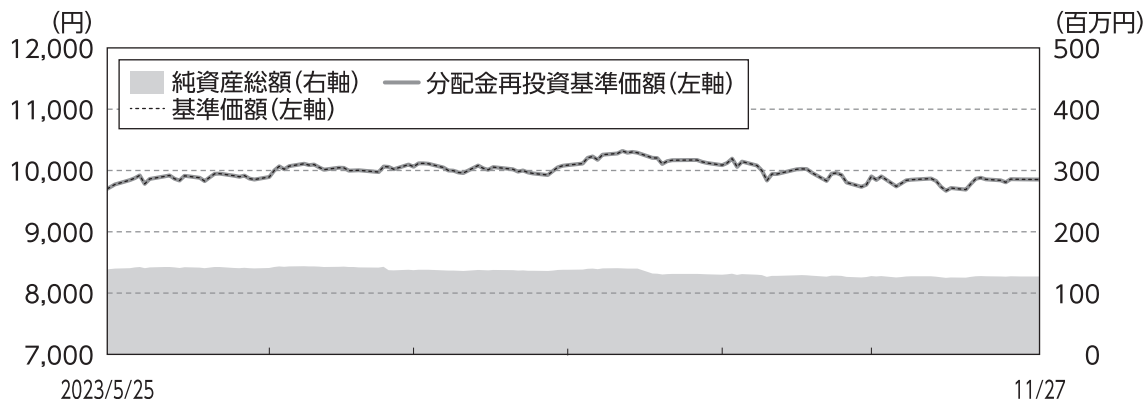
年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2023年 5月25日	円 9,694	% —	% 94.7
5月末	9,915	2.3	94.0
6月末	10,064	3.8	94.2
7月末	10,042	3.6	93.4
8月末	10,169	4.9	92.6
9月末	10,140	4.6	92.6
10月末	9,780	0.9	91.9
(期 末) 2023年11月27日	9,845	1.6	92.1

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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：9,694円

期末：9,845円 (既払分配金0円)

騰落率：1.6% (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はありません。
- (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1.6%上昇しました。

<2023年5月末～2023年6月>

3月に起きた米国の地銀破綻などを起因とした金融システム不安の後退により、東証REIT指数は上昇する局面もありましたが、日本銀行の金融政策変更に対する根強い懸念や欧米での利上げ圧力などを背景に、上値の重い展開となりました。当ファンドは合併を発表した銘柄を保有していたことなどから、基準価額は東証REIT指数と比較し上昇しました。

<2023年7月～2023年8月>

7月の日本銀行政策決定会合でYCC(長短金利操作)の運用柔軟化が決定され、長期金利は上昇したものの、金利上昇に対する過度な懸念が後退したことで、東証REIT指数は上昇しました。上昇したオフィス系銘柄の組入比率が低いことなどから、基準価額は東証REIT指数と比較し下落しました。

<2023年9月～2023年11月27日>

日本銀行のYCC修正により国内長期金利が上昇したことで、東証REIT指数は下落しました。当ファンドはホテル系銘柄の組入比率が高いことなどから、基準価額は東証REIT指数に対し下落しました。

■投資環境

<2023年5月末～2023年6月>

東証REIT指数は、3月の米国の地銀破綻などを起因としたクレジット市場に対する懸念が後退してきたことで、上昇する局面もありましたが、日本銀行の金融政策変更に対する根強い懸念や欧米主要国で利上げ圧力が強まっていることなどを背景に、上値の重い展開となりました。

<2023年7月～2023年8月>

7月の日本銀行政策決定会合でYCCの運用柔軟化が決定され、長期金利は上昇したものの、金利上昇に対する過度な懸念が後退したことで、相場は上昇しました。

<2023年9月～2023年11月27日>

日本銀行のYCC修正などにより国内長期金利が上昇したことで、相場は下落しました。

■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J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド」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J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド

不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とし、オルタナティブデータ(人流データ等)を活用して、今後高い収益成長が期待できる銘柄に厳選投資を行いました。

人流の改善が見られた銘柄を中心にポートフォリオに組み入れを行いました。人流改善傾向にあるオフィス系銘柄、ホテル系銘柄の組入比率を高くした一方で、人流改善の乏しい物流系銘柄の組入比率は低くしました。

■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	
	2023年5月26日～2023年11月27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)		736

(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、日本の金融商品取引所等に上場(上場予定銘柄を含みます。)している不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とし、オルタナティブデータ(人流データ等)を活用して、今後高い収益成長が見込める銘柄へ厳選投資します。

1万口当たりの費用明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	2023年5月26日～2023年11月27日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬(基本報酬)	46円	0.461%	(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10,018円です。
(投信会社)	(17)	(0.168)	・委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(28)	(0.279)	・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)	(1)	(0.014)	・運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 信託報酬(成功報酬)	—	—	(b) 信託報酬(成功報酬)＝(基準価額(成功報酬控除前)－ハイ・ウォーターマーク)×17.6%(税抜16%) 信託報酬(成功報酬)は、基本報酬に加えて委託会社が受領する委託した資金の運用の対価
(c) 売買委託手数料	21	0.205	(c) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(投資信託証券)	(21)	(0.205)	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
(d) その他費用	11	0.105	(d) 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)	(11)	(0.105)	・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	78	0.771	

(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。

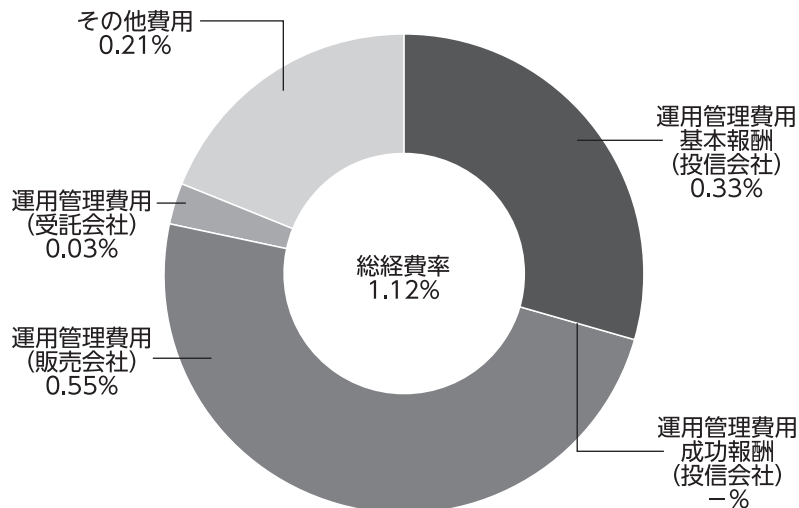
(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.12%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J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド	千口 3,641	千円 3,709	千口 18,080	千円 18,774

(注) 単位未満は切捨て。

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

当期首残高 (元 本)	当 期 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 100	百万円 -	百万円 -	百万円 100	当初設定時における取得

(注) 単位未満は切捨て。

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J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド	千口 137,763	千口 123,324	千円 125,223

(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、123,324千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
楽天J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド	125,223	98.9
短期金融資産、その他	1,384	1.1
投資信託財産総額	126,607	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11月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	126,607,862円
コール・ローン等	1,263,305
楽天J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド(詳細)	125,223,557
未 収 入 金	121,000
(B) 負 債	875,422
未 払 解 約 金	116,351
未 払 信 託 報 酬	616,964
未 払 利 息	3
そ の 他 未 払 費 用	142,104
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	125,732,440
元 本	127,712,661
次 期 繰 越 損 益 金	△1,980,221
(D) 受 益 権 総 口 数	127,712,661口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,845円

(注) 期首元本額 141,819,806円
 期中追加設定元本額 5,140,802円
 期中一部解約元本額 19,247,947円

■損益の状況

(自2023年5月26日 至2023年11月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△367円
支 払 利 息	△367
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,550,587
売 買 益	3,393,429
売 買 損	△842,842
(C) 信 託 報 酬 等	△759,094
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,791,126
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△2,504,097
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,267,250
(配 当 等 相 当 額)	(1,042,802)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,310,052)
(G) 計 (D + E + F)	△1,980,221
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△1,980,221
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,267,250
(配 当 等 相 当 額)	(1,069,457)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,336,707)
分 配 準 備 積 立 金	8,331,774
繰 越 損 益 金	△9,044,745

(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)	3,618,661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	1,069,457円
(D)分配準備積立金額	4,713,113円
(E)分配対象収益額 (A+B+C+D)	9,401,231円
(F)期末残存口数	127,712,661口
(G)収益分配対象額 (1万口当たり) (E/F×10,000)	736.11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J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド

第2期(2023年11月27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(2021年11月26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(上場予定銘柄も含みます。)している不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とします。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。 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		投資信託証券 組 入 比 率	純資産総額
	円	騰 落 率		
(設 定 日) 2021年11月26日	10,000	—	—	百万円 100
1期(2022年11月25日)	10,379	3.8	93.6	143
2期(2023年11月27日)	10,154	△2.2	92.5	125

(注1) 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。

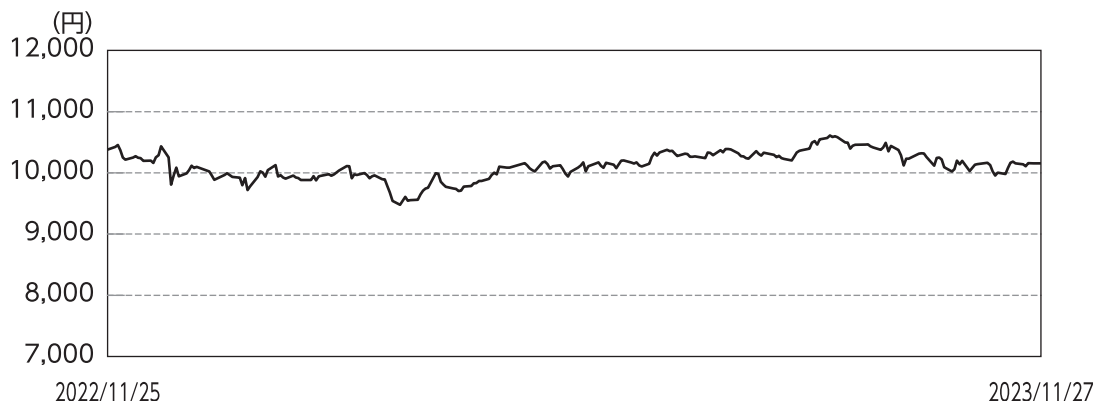
当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		投資信託証券 組 入 比 率
	円	騰 落 率	
(期 首) 2022年11月25日	10,379	—	93.6
11月末	10,370	△0.1	93.4
12月末	10,099	△2.7	93.7
2023年 1月末	9,940	△4.2	93.6
2月末	10,107	△2.6	92.2
3月末	9,758	△6.0	89.3
4月末	10,102	△2.7	91.3
5月末	10,170	△2.0	94.4
6月末	10,333	△0.4	94.6
7月末	10,320	△0.6	93.8
8月末	10,461	0.8	92.9
9月末	10,440	0.6	93.0
10月末	10,078	△2.9	92.3
(期 末) 2023年11月27日	10,154	△2.2	92.5

(注) 騰落率は期首比。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額の推移



■ 基準価額の変動要因

当ファンドの基準価額は前期末比で2.2%下落しました。

<2022年11月末～2023年2月>

12月に日本銀行の金融政策決定会合において長期金利の許容変動幅を拡大するなど金融緩和政策の修正への警戒が続き、東証REIT指数は下落しました。当ファンドも下落しましたが、人流の回復が見られたホテル系銘柄を中心に組み入れたことで基準価額の下落幅は東証REIT指数と比較し軽微となりました。

<2023年3月～2023年5月>

3月に米国の地銀の経営破綻から金融システム不安が高まり、東証REIT指数は下落しました。上昇していたホテル系銘柄を中心に大幅下落したことから、当ファンドの基準価額は東証REIT指数と比較し下落しました。

<2023年6月～2023年11月27日>

金利上昇に対する過度な懸念の払拭で、上昇する局面もありましたが、国内の金利上昇や欧米主要国での金利上昇などを背景に東証REIT指数は下落した結果、横ばいで推移しました。オフィス系、ホテル系銘柄等を中心に組み入れた結果、当ファンドの基準価額は東証REIT指数に対しほぼ横ばいで推移しました。

■投資環境

<2022年11月末～2023年3月>

東証REIT指数は、日本銀行金融政策決定会合において長期金利の許容変動幅拡大による不動産市場への影響が懸念されたことや米国の地銀の経営破綻による金融システム不安の高まりなどで相場は下落しました。

<2023年4月～2023年5月>

欧米を中心とした金融システム不安の落ち着きや日本銀行の金融緩和政策が維持されたことなどを好感し、相場は反発しました。

<2023年6月～2023年11月27日>

日本銀行の長短金利操作の柔軟化やFRB(米連邦準備制度理事会)の金融引き締めへの警戒感から相場が下落した局面もありましたが、FRBが2会合連続で金利を据え置いたことなどが好感され、上昇し、一進一退の値動きとなりました。

■当ファンドのポートフォリオ

不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とし、オルタナティブデータ(人流データ等)を活用して、今後高い収益成長が期待できる銘柄に厳選投資を行いました。

人流の改善が見られた銘柄を中心にポートフォリオに組み入れを行いました。2022年12月から2023年3月まではコロナ禍からの経済再開の動きが顕著となったホテル系の銘柄の組み入れが多くなりました。4月はホテル系に加え、商業施設系銘柄の組み入れが多くなり、5月は一部ホテル、商業施設系の銘柄からオフィス系の銘柄へ入れ替えました。6月以降はオフィス系銘柄、ホテル系銘柄の組入比率を高くした一方で、人流改善の乏しい物流系銘柄の組入比率は低くしました。

■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

引き続き日本の金融商品取引所等の上場(上場予定銘柄を含みます。)している不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とし、オルタナティブデータ(人流データ等)を活用して、今後高い収益成長が見込める銘柄へ厳選投資します。

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国	マリモ地方創生リート投資法人	55	7,031	55	7,072
	大江戸温泉リート投資法人	24	1,466	143	9,234
	投資法人みらい	258	11,761	143	6,572
	三菱地所物流リート投資法人	—	—	20	8,334
	CRE ロジスティクスファンド投資法人	44	7,908	44	7,795
	ザイマックス・リート投資法人	73	8,152	73	8,409
	タカラレーベン不動産投資法人	84	7,993	84	7,656
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	47	6,339	110	15,291
	日本ビルファンド投資法人	14	7,835	26	15,381
	ジャパンリアルエステイト投資法人	11	6,363	1	607
	日本都市ファンド投資法人	68	6,860	68	6,702
	オリックス不動産投資法人	36	6,389	42	7,467
	日本プライムリアルティ投資法人	21	7,334	21	7,425
	N T T都市開発リート投資法人	55	7,948	55	7,230
	東急リアル・エステート投資法人	79	14,978	43	8,125
	ユナイテッド・アーバン投資法人	50	7,633	53	7,851
	内	森トラスト総合リート投資法人	125	10,010	128
		(53)	(—)		
インヴィンシブル投資法人		255	14,420	132	7,491
フロンティア不動産投資法人		44	21,316	44	20,835
平和不動産リート投資法人		95	13,985	58	8,423
日本ロジスティクスファンド投資法人		21	6,555	48	14,227
福岡リート投資法人		42	6,955	42	6,940
KDX不動産投資法人		23	8,110	78	13,576
		(94)	(11,528)		
大和証券オフィス投資法人		21	13,200	11	7,024
阪急阪神リート投資法人		64	9,258	64	9,255
スターツプロシード投資法人	60	13,331	30	6,835	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	214	16,106	116	8,956	
大和証券リビング投資法人	132	14,865	67	7,695	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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
		口	口	千円	%
東海道リート投資法人		56	—	—	—
森ヒルズリート投資法人		41	—	—	—
アドバンス・レジデンス投資法人		26	19	6,194	4.9
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		—	20	6,320	5.0
日本プロロジスリート投資法人		—	24	6,662	5.3
星野リゾート・リート投資法人		12	12	7,344	5.9
積水ハウス・リート投資法人		110	—	—	—
トーセイ・リート投資法人		52	—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人		35	—	—	—
野村不動産マスターファンド投資法人		—	38	6,422	5.1
いちごホテルリート投資法人		78	—	—	—
スターアジア不動産投資法人		155	—	—	—
大江戸温泉リート投資法人		119	—	—	—
投資法人みらい		—	115	4,968	4.0
三菱地所物流リート投資法人		20	—	—	—
アドバンス・ロジスティクス投資法人		63	—	—	—
日本ビルファンド投資法人		12	—	—	—
ジャパンリアルエステイト投資法人		—	10	5,730	4.6
オリックス不動産投資法人		42	36	6,163	4.9
東急リアル・エステート投資法人		—	36	6,440	5.1
ユナイテッド・アーバン投資法人		44	41	6,256	5.0
森トラスト総合リート投資法人		46	96	7,046	5.6
インヴィンシブル投資法人		—	123	7,441	5.9
平和不動産リート投資法人		—	37	5,157	4.1
日本ロジスティクスファンド投資法人		27	—	—	—
KDX不動産投資法人		—	39	6,602	5.3
大和証券オフィス投資法人		—	10	6,860	5.5
スターツブロード投資法人		—	30	6,144	4.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人		—	98	6,928	5.5
大和証券リビング投資法人		—	65	7,124	5.7
合 計	口 数 ・ 金 額	938	849	115,805	
	銘 柄 数 <比 率>	17	18	<92.5%>	

(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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 証 券	115,805	92.4
短 期 金 融 資 産、そ の 他	9,535	7.6
投 資 信 託 財 産 総 額	125,340	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11月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	125,340,386円
コール・ローン等	8,524,091
投資証券(評価額)	115,805,600
未 収 配 当 金	1,010,695
(B) 負 債	121,025
未 払 解 約 金	121,000
未 払 利 息	25
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	125,219,361
元 本	123,324,362
次 期 繰 越 損 益 金	1,894,999
(D) 受 益 権 総 口 数	123,324,362口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,154円

(注1) 期首元本額 137,841,521円
 期中追加設定元本額 17,172,470円
 期中一部解約元本額 31,689,629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J-REIT・オルタナティブデータ・ファンド 123,324,362円

■損益の状況

(自2022年11月26日 至2023年11月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,354,138円
受 取 配 当 金	7,361,540
支 払 利 息	△7,402
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△9,858,602
売 買 益	7,361,501
売 買 損	△17,220,103
(C) そ の 他 費 用	△571
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△2,505,035
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,230,875
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△115,470
(G) 解 約 差 損 益 金	△715,371
(H) 計 (D+E+F+G)	1,894,999
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,894,999

(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(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。