

■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6期

決算日：2024年11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。

最近5期の運用実績

| 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 | | |
| | 円 | 円 | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 5期(2024年5月27日) | 9,785 | 0 | △0.6 | 94.9 | 121 |
| 6期(2024年11月25日) | 9,102 | 0 | △7.0 | 93.7 | 112 |

(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。

当期中の基準価額の推移

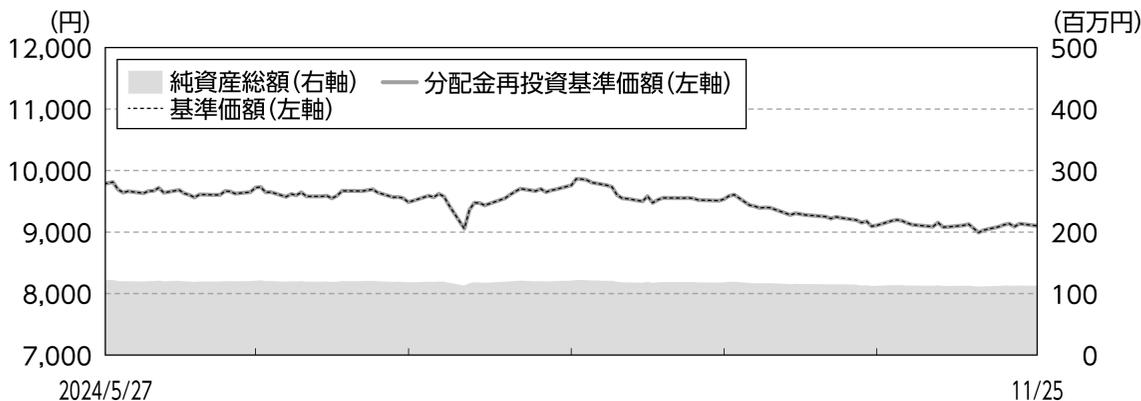
| 年月日 | 基準価額 | | 投資信託証券組入比率 |
|-------------|-------|------|------------|
| | | 騰落率 | |
| (期首) | 円 | % | % |
| 2024年5月27日 | 9,785 | — | 94.9 |
| 5月末 | 9,662 | △1.3 | 94.6 |
| 6月末 | 9,649 | △1.4 | 94.0 |
| 7月末 | 9,621 | △1.7 | 93.6 |
| 8月末 | 9,806 | 0.2 | 93.5 |
| 9月末 | 9,439 | △3.5 | 93.2 |
| 10月末 | 9,147 | △6.5 | 93.5 |
| (期末) | | | |
| 2024年11月25日 | 9,102 | △7.0 | 93.7 |

(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：9,785円

期 末：9,102円(既払分配金0円)

騰落率：△7.0%(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比7.0%下落しました。

<2024年5月末～2024年8月初旬>

国内長期金利が1%を超える水準で推移したため、東証REIT指数は軟調な値動きとなりました。さらに、7月の日本銀行金融政策決定会合での追加利上げを受けて、東証REIT指数は下落しました。当ファンドは住宅系およびホテル系の銘柄を中心に組み入れていたため、下落幅が大きくなりました。

<2024年8月初旬～2024年9月末>

8月初めの国内株式市場の大幅な下落を受け、年内の利上げ懸念が後退したことで国内長期金利が低下し、東証REIT指数は上昇しました。8月初めからの戻りでは中小型銘柄の戻りが弱く、中小型銘柄の組入比率が高い当ファンドの上昇幅は、東証REIT指数と比較し下回りました。

<2024年9月末～2024年11月25日>

年内の利上げ懸念から国内長期金利が再び上昇し、1%台に達したことなどをを受け、東証REIT指数は下落しました。住宅系リートの組入比率が高かったため、当ファンドの下落幅は、東証REIT指数と比較し上回りました。

■投資環境

当期間の東証REIT指数は下落しました。

<2024年5月末～2024年8月初旬>

6月は国内長期金利が1%を下回る水準で推移したことで、東証REIT指数が上昇した局面があったものの、7月に国内長期金利が1%台を上回る推移になったことに加え、日本銀行金融政策決定会合での追加利上げを受けて下落しました。

<2024年8月初旬～2024年9月末>

8月初めの国内株式市場の大幅な下落を受け、年内の利上げ懸念が後退したことで国内長期金利が低下し、上昇しました。

<2024年9月末～2024年11月25日>

日本銀行の利上げ懸念から国内長期金利が再び上昇し、1%台に達したことなどを受け、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」の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。2024年5月から8月は、日本アコモデーションファンド投資法人などの住宅系、いちごホテルリート投資法人などのホテル系の組入比率を高位に維持しました。9月から11月にかけては、ジャパンリアルエステイト投資法人などのオフィス系リートの組入比率を高位に維持しました。

■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6期 | |
|---------------|------------------------|--|
| | 2024年5月28日～2024年11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) | 1,304 | |

(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、円未満を四捨五入し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 |
|----------------|------------------------|---------|--|
| | 2024年5月28日～2024年11月25日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬(基本報酬) | 43円 | 0.453% | (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9,554円です。 |
| (投信会社) | (16) | (0.165) | ・委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (26) | (0.274) | ・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 | 7 | 0.077 | (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) | (7) | (0.077) | 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 | 10 | 0.103 | (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) | (10) | (0.103) | ・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) | (—) | (—) | ・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 | 60 | 0.633 | |

(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。

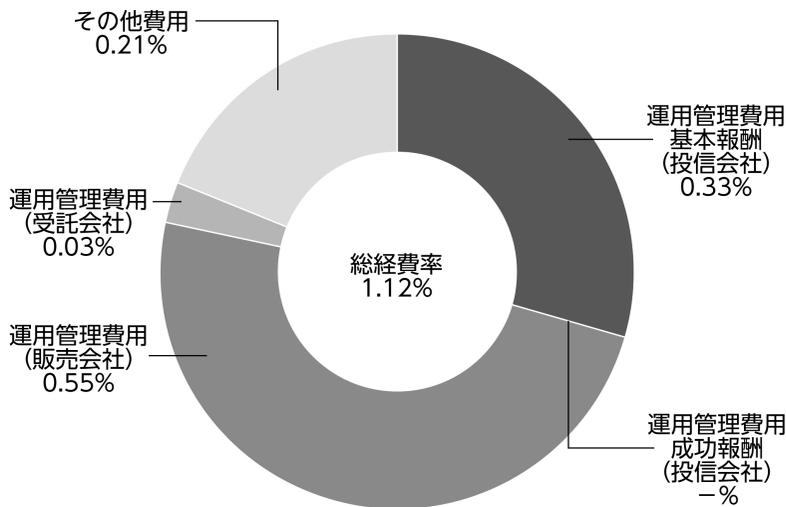
(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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 2,707 | 千円 2,671 | 千口 3,757 | 千円 3,697 |

(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 119,294 | 千口 118,243 | 千円 112,213 |

(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、118,243千口です。

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 | 112,213 | 99.0 |
| 短期金融資産、その他 | 1,097 | 1.0 |
| 投資信託財産総額 | 113,310 | 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

(2024年11月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|--------------|
| (A) 資 産 | 113,310,008円 |
| コール・ローン等 | 1,084,581 |
| <small>楽天J-REIT・オルタナティブデータ・マザーファンド(評価額)</small> | 112,213,424 |
| 未 収 入 金 | 12,000 |
| 未 収 利 息 | 3 |
| (B) 負 債 | 655,183 |
| 未 払 解 約 金 | 300 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 532,761 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 122,122 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 112,654,825 |
| 元 本 | 123,766,452 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △11,111,627 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 123,766,452口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,102円 |

(注) 期首元本額 124,240,108円
 期中追加設定元本額 4,103,672円
 期中一部解約元本額 4,577,328円

■損益の状況

(自2024年5月28日 至2024年11月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 269円 |
| 受 取 利 息 | 269 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △7,674,555 |
| 売 買 益 | 126,128 |
| 売 買 損 | △7,800,683 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △654,883 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △8,329,169 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △1,265,294 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △1,517,164 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,848,894) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△3,366,058) |
| (G) 計 (D + E + F) | △11,111,627 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | △11,111,627 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △1,517,164 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,867,477) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△3,384,641) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 14,272,691 |
| 繰 越 損 益 金 | △23,867,154 |

(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） | 2,845,129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 | 1,867,477円 |
| (D)分配準備積立金額 | 11,427,562円 |
| (E)分配対象収益額（A+B+C+D） | 16,140,168円 |
| (F)期末残存口数 | 123,766,452口 |
| (G)収益分配対象額（1万口当たり） （E/F×10,000） | 1,304.06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3期(2024年11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(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 |
|------------------------|-------------|--------------|------------------------|------------|
| | | 期 中 騰 落 率 | | |
| (設 定 日) 2021年11月26日 | 円 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 |
| 3期(2024年11月25日) | 9,490 | △6.5 | 94.0 | 112 |

(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。

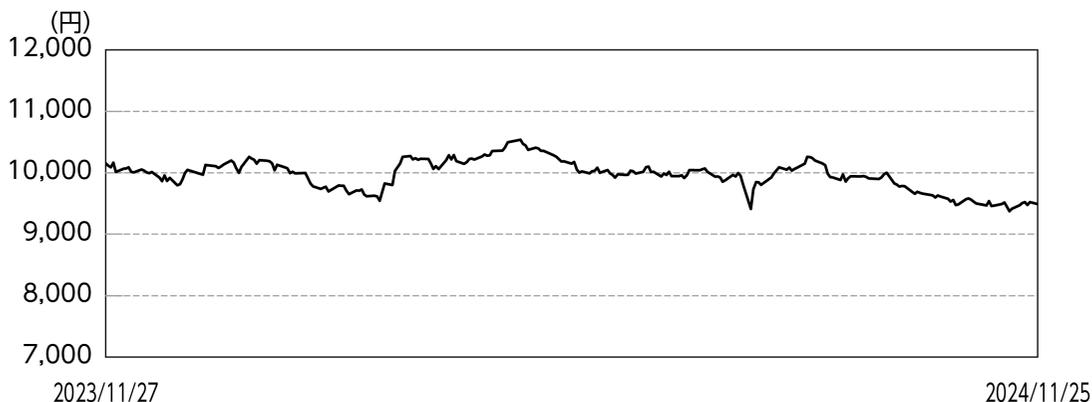
当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|----------------------|-------------|--------|------------------------|
| | | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2023年11月27日 | 円 10,154 | % — | % 92.5 |
| 11月末 | 10,165 | 0.1 | 92.4 |
| 12月末 | 10,049 | △1.0 | 92.8 |
| 2024年 1月末 | 10,152 | △0.0 | 91.6 |
| 2月末 | 9,714 | △4.3 | 92.0 |
| 3月末 | 10,229 | 0.7 | 94.1 |
| 4月末 | 10,360 | 2.0 | 95.3 |
| 5月末 | 10,022 | △1.3 | 95.0 |
| 6月末 | 10,017 | △1.3 | 94.4 |
| 7月末 | 9,997 | △1.5 | 94.0 |
| 8月末 | 10,199 | 0.4 | 93.8 |
| 9月末 | 9,826 | △3.2 | 93.6 |
| 10月末 | 9,530 | △6.1 | 93.9 |
| (期 末) 2024年11月25日 | 9,490 | △6.5 | 94.0 |

(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



■ 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は前期末比6.5%下落しました。

<2023年11月末～2024年3月中旬>

日本銀行の金融緩和修正観測からの国内長期金利上昇、J-REITからの資金流出などが影響して、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、下落幅は東証REIT指数と比較し軽微となりました。

<2024年3月中旬～2024年5月初旬>

マイナス金利解除後も当面緩和的な金融政策が継続するとの見方が広がったことなどから、東証REIT指数は大幅に上昇しました。当ファンドも上昇し、ホテル系銘柄、賃料水準の引き上げが期待できる住宅系銘柄を中心に組み入れたことで、上昇幅は東証REIT指数を上回りました。

<2024年5月初旬～2024年11月25日>

国内長期金利が1%台になるなど金利上昇が継続したことで、東証REIT指数は下落しました。当ファンドも下落し、住宅系、ホテル系銘柄を中心に組み入れたことで、下落幅は東証REIT指数を上回りました。

■投資環境

当期間の東証REIT指数は下落しました。

<2023年11月末～2024年3月中旬>

日本銀行の金融緩和修正観測からの長期金利上昇やJ-REITからの資金流出などが影響して、東証REIT指数は下落しました。

<2024年3月中旬～2024年5月初旬>

3月に日本銀行の金融政策決定会合でのマイナス金利解除があったものの、当面緩和的な金融政策が継続するとの見方が広がったことから、東証REIT指数は上昇しました。

<2024年5月初旬～2024年11月25日>

日本銀行の金融政策決定会合での利上げ決定後の大幅な市場変動や長期金利が1%台に上昇したことなどで、東証REIT指数は下落しました。

■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組み入れを行いました。2023年11月から2024年2月までは、ジャパン・ホテル・リート投資法人などのホテル系リークの組入比率を高位に維持しました。3月から8月は、日本アコモデーションファンド投資法人などの住宅系、いちごホテルリートなどのホテル系リークの組入比率を高位に維持しました。9月から11月はジャパンリアルエステイト投資法人などのオフィス系、GLP投資法人などの物流系リークの組入比率を高めました。

■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。

| | | 当期 | | | |
|---|------------------|-------|--------|-------|--------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| 国 | オリックス不動産投資法人 | — | — | 36 | 5,760 |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 17 | 5,451 | 17 | 5,865 |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 69 | 10,913 | 71 | 11,777 |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | — | — | 41 | 5,900 |
| | 森トラスト総合リート投資法人 | 90 | 6,184 | 119 | 8,434 |
| | インヴィンシブル投資法人 | 159 | 10,361 | 186 | 11,237 |
| | フロンティア不動産投資法人 | 13 | 5,860 | 13 | 5,606 |
| | 平和不動産リート投資法人 | — | — | 37 | 5,025 |
| | 福岡リート投資法人 | 35 | 6,076 | 35 | 6,030 |
| | KDX不動産投資法人 | 44 | 6,625 | 39 | 6,552 |
| 内 | 大和証券オフィス投資法人 | 9 | 5,259 | 28 | 11,822 |
| | | (9) | (—) | | |
| | スターツプロシード投資法人 | 34 | 6,646 | 64 | 12,100 |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 49 | 12,167 | 23 | 5,767 |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 61 | 4,291 | 74 | 5,292 |
| | 大和証券リビング投資法人 | 69 | 7,032 | 134 | 13,536 |
| | 47 | 6,185 | 47 | 5,859 | |

(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 | % |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | 19 | 17 | 5,040 | 4.5 |
| G L P 投資法人 | | — | 32 | 4,080 | 3.6 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | 20 | — | — | — |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | 24 | — | — | — |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | 12 | — | — | — |
| イオンリート投資法人 | | — | 29 | 3,685 | 3.3 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | — | 85 | 6,239 | 5.6 |
| トーセイ・リート投資法人 | | — | 47 | 5,837 | 5.2 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 38 | — | — | — |
| ラサールロジポート投資法人 | | — | 42 | 6,052 | 5.4 |
| スターアジア不動産投資法人 | | — | 129 | 6,501 | 5.8 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | — | 53 | 5,914 | 5.3 |
| 投資法人みらい | | 115 | — | — | — |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | — | 16 | 5,600 | 5.0 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | | — | 69 | 5,961 | 5.3 |
| 日本ビルファンド投資法人 | | — | 65 | 8,060 | 7.2 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | 10 | 15 | 8,445 | 7.5 |
| オリックス不動産投資法人 | | 36 | — | — | — |
| 東急リアル・エステート投資法人 | | 36 | 34 | 5,392 | 4.8 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 41 | — | — | — |
| 森トラスト総合リート投資法人 | | 96 | 67 | 4,107 | 3.7 |
| インヴィンシブル投資法人 | | 123 | 96 | 6,144 | 5.5 |
| 平和不動産リート投資法人 | | 37 | — | — | — |
| K D X 不動産投資法人 | | 39 | 44 | 6,617 | 5.9 |
| 大和証券オフィス投資法人 | | 10 | — | — | — |
| スタートアッププロシード投資法人 | | 30 | — | — | — |
| 大和ハウスリート投資法人 | | — | 26 | 6,120 | 5.5 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | | 98 | 85 | 5,720 | 5.1 |
| 大和証券リビング投資法人 | | 65 | — | — | — |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 849 | 951 | 105,520 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 18 | 18 | < 94.0% > | |

(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 | 105,520 | 94.0 |
| 短 期 金 融 資 産、そ の 他 | 6,704 | 6.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 112,224 | 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

(2024年11月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 112,224,080円 |
| コール・ローン等 | 5,797,941 |
| 投資証券(評価額) | 105,520,000 |
| 未 収 配 当 金 | 906,122 |
| 未 収 利 息 | 17 |
| (B) 負 債 | 12,000 |
| 未 払 解 約 金 | 12,000 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 112,212,080 |
| 元 本 | 118,243,861 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △6,031,781 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 118,243,861口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,490円 |

- (注1) 期首元本額 123,324,362円
 期中追加設定元本額 6,881,315円
 期中一部解約元本額 11,961,816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 118,243,861円

■損益の状況

(自2023年11月28日 至2024年11月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|-------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 8,331,740円 |
| 受 取 配 当 金 | 8,084,549 |
| 受 取 利 息 | 1,955 |
| そ の 他 収 益 金 | 247,300 |
| 支 払 利 息 | △2,064 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △16,271,961 |
| 売 買 益 | 1,870,798 |
| 売 買 損 | △18,142,759 |
| (C) そ の 他 費 用 | △60 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | △7,940,281 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,894,999 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △28,315 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | 41,816 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | △6,031,781 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | △6,031,781 |

- (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。