

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	2027年1月29日まで（2017年2月1日設定）	
運用方針	A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式への投資と株価指数先物取引の売建てを行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ファンドの運用は三菱UFJ信託銀行から投資助言を受け行います。	
主要運用対象	ベビーフンド	A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）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。
主な組入制限	ベビーフンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、決算日の基準価額水準が当初元本額10,000円（10,000口当たり）を超えている場合に、当該超過分の範囲内で分配します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

絶対収益追求とは、特定の市場の動向に左右されにくい収益の追求をめざすことをいいます。必ず収益を得られることを意味するものではありません。

## 運用報告書（全体版）

A I 日本株式オープン  
（絶対収益追求型）愛称：日本<sup>あい</sup>A I

第14期（決算日：2024年1月31日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「A I 日本株式オープン（絶対収益追求型）」は、去る1月31日に第14期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用  
フリーダイヤル

0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00、  
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			株組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金 分配	み 騰	期 落			
	円	円	騰	率	%	%	百万円
10期(2022年1月31日)	8,560	0	△2.0	60.4	△49.2	2,544	
11期(2022年8月1日)	8,542	0	△0.2	65.1	△56.3	2,401	
12期(2023年1月31日)	8,464	0	△0.9	59.8	△50.1	2,210	
13期(2023年7月31日)	8,489	0	0.3	67.8	△56.0	1,995	
14期(2024年1月31日)	8,473	0	△0.2	65.9	△58.4	1,835	

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準	価額		株組入比率	株式先物比率
		騰	落		
(期首)	円	騰 <td>率 <td>%</td> <td>%</td> </td>	率 <td>%</td> <td>%</td>	%	%
2023年7月31日	8,489	—		67.8	△56.0
8月末	8,474	△0.2		70.3	△62.4
9月末	8,461	△0.3		63.9	△62.0
10月末	8,414	△0.9		64.0	△59.7
11月末	8,465	△0.3		68.1	△59.8
12月末	8,456	△0.4		64.9	△54.8
(期末)					
2024年1月31日	8,473	△0.2		65.9	△58.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第14期：2023年8月1日～2024年1月31日

## 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第14期首	8,489円
第14期末	8,473円
既払分配金	0円
騰落率	-0.2%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの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。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

**基準価額の動き**

基準価額は期間の初めに比べ0.2%の下落となりました。

**基準価額の主な変動要因****上昇要因**

先物アロケーション戦略の日次予測モデルにおいて、マクロ指標などによる予測からA Iが判断し実質国内株式組入比率を調整し、プラスに寄与しました。また、月次予測モデルにおいても、各国の株価上昇による予測からA Iが判断し実質国内株式組入比率を調整し、プラスに寄与しました。

**下落要因**

株式個別銘柄戦略のニュースピックモデルにおいて、ネットワークで繋がった関連企業と比較して株価が出遅れており反発を期待し組入れていた銘柄群がマイナスに影響しました。

第14期：2023年8月1日～2024年1月31日

## 投資環境について

### ▶ 国内株式市況

#### 国内株式市況は上昇しました。

米国で金融引き締め長期化懸念が高まったことなどから長期金利が上昇し、米国株が下落したことなどから下落する局面があったものの、国内企業決算が概

ね堅調となったことや、日銀が金融緩和政策を継続する方針を示したことなどを背景に外国為替市場で円安・米ドル高が進行したことなどから上昇し、期間を通してみると上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ A I 日本株式オープン（絶対収益追求型）

A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）受益証券を主要投資対象とし、実質的な運用はマザーファンドで行いました。

### ▶ A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）

A I（人工知能）等を活用した三菱UFJ信託銀行からの投資助言を基に、わが国の株式に投資を行うと同時に株価指数先物取引等を行いました。株式個別銘柄戦略と先物アロケーション

戦略の2つを組み合わせた運用を行いました。

株式個別銘柄戦略では、わが国の株式への投資に加え株価指数先物を売建てることで収益の獲得をめざしました。

先物アロケーション戦略では、株式相場が上昇局面であると判断した場合に、株価指数先物の売建てる量を減らすことで実質株式組入比率を引き上げることを基本とし、株式相場の上昇による収益も一部獲得することをめざしました。

各運用戦略で採用するモデルはファンド全体のリスク・リターンに配慮して選定しました。

（ご参考）

■ファンドで採用するモデル（決算日現在）

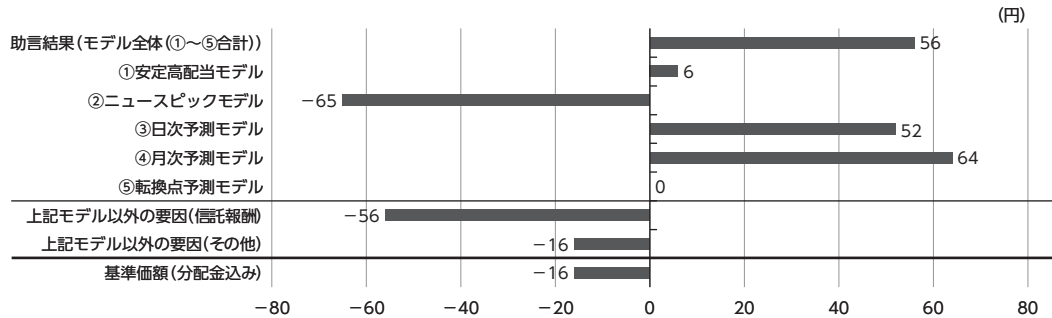
株式個別銘柄戦略	わが国の株式への投資に加え、組入株式における株式市場に対する感応度を排除できると考える量の株価指数先物の売建てを行うことで収益の獲得をめざします。 ※以下①、②の2つのモデルがあります。
モデル	内容
A Iによる中長期投資 安定高配当モデル（①）	決算短信や有価証券報告書等の企業の業績にかかる文字情報と配当利回りを組み合わせて、株式相場の下落局面でも強みを持ち安定的な収益獲得が期待できる安定高配当銘柄を選定します。
A Iによる短期投資 ニュースピックモデル（②）	経済ニュース、市場参加者（アナリスト等）の利益予想等を用いて複合的に評価し銘柄を選定します。
先物アロケーション戦略	株式相場が上昇局面であると判断した場合に、株価指数先物の売建ての量を減らして実質株式組入比率を引き上げることにより、株式相場の上昇による収益も一部獲得することをめざします。 ※以下③～⑤の3つのモデルがあります。
モデル	内容
A Iによる日次予測モデル （③）	ディープ・ラーニングを行うことによって、データの特徴から、因果関係を見出し、翌日の株式市場の値動きを日々予測します。
A Iによる月次予測モデル （④）	過去の投資環境から類似性を見出して1ヵ月先の株式市場の値動きを日々予測します。
転換点予測モデル（⑤）	株価や指数値等の推移から株式市場の転換点を日々予測します。

※上記は、決算日現在に採用しているモデルであり、将来変更する場合があります。

※投資助言元である三菱UFJ信託銀行の資料に基づき作成したものです。

## （ご参考）

### ■ 助言結果を用いた当期の要因分析（ベビーファンドベース）



- ・ 上記は、基準価額の要因分析を助言結果を用いて簡便的に計算した概算値であり、その正確性、完全性等を保証するものではありません。
- ・ 四捨五入のため全体計（基準価額（分配金込み）の変動幅）と内訳の合計が相違することがあります。
- ・ 投資助言元である三菱UFJ信託銀行の資料に基づき作成したものです。
- ※ 上記モデルで株式個別銘柄戦略に該当するもの（①、②）は、わが国の株式への投資に加え、組入株式における株式市場に対する感応度を排除できると考える量の株価指数先物の売り建てを行うことによる収益獲得の結果の概算を表しています。
- ※ 上記モデルで先物アロケーション戦略に該当するもの（③、④、⑤）は、株式相場が上昇局面と判断した場合、株価指数先物の売り建ての量を減らして実質株式組入比率を引き上げたことによる収益獲得の結果の概算を表しています。
- ※ 助言結果（モデル全体（①～⑤合計））については、各モデルのパフォーマンスを累積したものであるため、単純に合計した値とは異なります。
- ※ モデルと実際のポートフォリオでは、売買単位の制約による銘柄構成割合のずれ、売買タイミングの違いによる評価損益のずれ、先物アロケーション戦略における取引対象の違いなどがあり、それらから生じたパフォーマンスの乖離が「上記モデル以外の要因（その他）」に含まれております。

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

## 分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第14期 2023年8月1日～2024年1月31日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	367

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）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）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計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 （作成対象期間末での見解です。）

### ▶ A I 日本株式オープン（絶対収益追求型）

引き続き、A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）を主要投資対象とし、実質的な運用はマザーファンドで行います。

### ▶ A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）

モデルに応じて銘柄入替、ならびに先物ヘッジ比率（実質株式組入比率）の機動的操作を行い、収益獲得に努めます。

（※なお、投資環境の変化や技術の進歩等が生じ、モニタリング等においてより適切と判断した場合には、新たなモデルの採用や入替を行います。）



2023年8月1日～2024年1月31日

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	56	0.664	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
( 投 信 会 社 )	(31)	(0.365)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(23)	(0.277)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	( 2 )	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.040	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
( 株 式 )	( 2 )	(0.024)	
(先物・オプション)	( 1 )	(0.016)	
(c) その他費用	0	0.001	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.001)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	59	0.705	

期中の平均基準価額は、8,454円です。

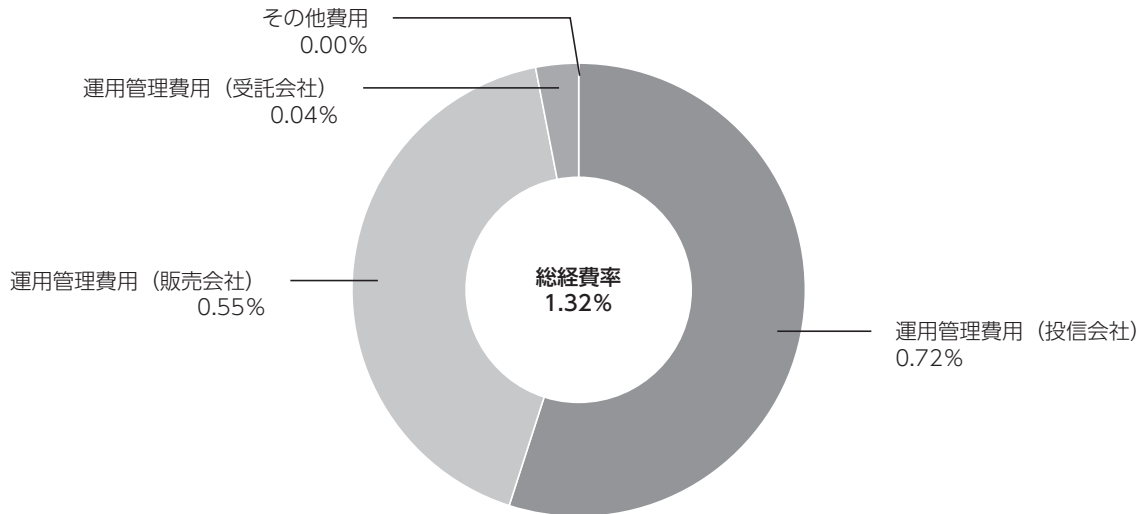
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 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親投資信託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) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## （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、売買委託手数料及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1.32%**です。



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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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。

## ○売買及び取引の状況

(2023年8月1日～2024年1月31日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）	千口 —	千円 —	千口 177,213	千円 164,040

## ○株式売買比率

(2023年8月1日～2024年1月31日)

## 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 I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）	
(a) 期中の株式売買金額	1,952,701千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,263,932千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.54	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年8月1日～2024年1月31日)

## 利害関係人との取引状況

&lt; A I 日本株式オープン（絶対収益追求型） &gt;

該当事項はございません。

&lt; A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型） &gt;

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 852	百万円 3	% 0.4	百万円 1,100	百万円 9	% 0.8

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	770千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B) / (A)	0.9%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

### ○組入資産の明細

(2024年1月31日現在)

#### 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）	2,148,400	1,971,186	1,834,189

### ○投資信託財産の構成

(2024年1月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）	1,834,189	98.9
コール・ローン等、その他	19,628	1.1
投資信託財産総額	1,853,817	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年1月31日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,853,817,343
コール・ローン等	19,628,270
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）（評価額）	1,834,189,073
(B) 負債	17,973,019
未払解約金	5,191,172
未払信託報酬	12,754,269
未払利息	5
その他未払費用	27,573
(C) 純資産総額（A－B）	1,835,844,324
元本	2,166,579,631
次期繰越損益金	△ 330,735,307
(D) 受益権総口数	2,166,579,631口
1万口当たり基準価額（C/D）	8.473円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,350,521,554円  
 期中追加設定元本額 60,220,549円  
 期中一部解約元本額 244,162,472円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8473円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は330,735,307円です。

## ③分配金の計算過程

項 目	2023年8月1日～ 2024年1月31日
費用控除後の配当等収益額	2,124,526円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	18,714,998円
分配準備積立金額	58,874,789円
当ファンドの分配対象収益額	79,714,313円
1万口当たり収益分配対象額	367円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

\*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

## ○損益の状況（2023年8月1日～2024年1月31日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,722
受取利息	54
支払利息	△ 1,776
(B) 有価証券売買損益	9,701,965
売買益	9,326,682
売買損	375,283
(C) 信託報酬等	△ 12,781,842
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 3,081,599
(E) 前期繰越損益金	△ 282,201,517
(F) 追加信託差損益金	△ 45,452,191
（配当等相当額）	（ 18,633,063）
（売買損益相当額）	（△ 64,085,254）
(G) 計（D＋E＋F）	△ 330,735,307
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（G＋H）	△ 330,735,307
追加信託差損益金	△ 45,452,191
（配当等相当額）	（ 18,714,998）
（売買損益相当額）	（△ 64,167,189）
分配準備積立金	60,999,315
繰越損益金	△ 346,282,431

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税相当額を含めて表示しています。  
 (注) (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。

## 【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)

## A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）

### 《第14期》決算日2024年1月31日

〔計算期間：2023年8月1日～2024年1月31日〕

「A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）」は、1月31日に第14期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主としてわが国の株式への投資と株価指数先物取引の売建てを行います。株価指数先物取引の売建てを行うことにより株式市場の価格変動リスクの低減を図ることを基本としますが、市況見通しに応じて株式の実質組入比率を調整する場合があります。株式の実質組入比率の限度は、組入株式の市場感応度が半分程度となるまでとします。株式投資に係る銘柄選定および株式の実質組入比率の決定は、A I（Artificial Intelligence：人工知能）等を活用した複数のモデルを用います。なお、採用されるモデルについては定期的に見直します。ファンドの運用は三菱UFJ信託銀行から投資助言を受け行います。
主 要 運 用 対 象	わが国の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 組 入 制 限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

絶対収益追求とは、特定の市場の動向に左右されにくい収益の追求をめざすことをいいます。必ず収益を得られることを意味するものではありません。

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
10期(2022年1月31日)	9,155	△1.4		60.7	△49.5	2,532
11期(2022年8月1日)	9,196	0.4		65.4	△56.5	2,394
12期(2023年1月31日)	9,173	△0.3		60.1	△50.3	2,198
13期(2023年7月31日)	9,260	0.9		68.0	△56.1	1,989
14期(2024年1月31日)	9,305	0.5		65.9	△58.5	1,834

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額 騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
(期 首) 2023年7月31日	円 9,260	% —	% 68.0
8月末	9,254	△0.1	70.4
9月末	9,250	△0.1	64.1
10月末	9,209	△0.6	64.3
11月末	9,275	0.2	68.2
12月末	9,275	0.2	64.9
(期 末) 2024年1月31日	9,305	0.5	65.9

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.5%の上昇となりました。

基準価額等の推移



## ●基準価額の変動要因

## (上昇要因)

- 先物アロケーション戦略の日次予測モデルにおいて、マクロ指標などによる予測からA Iが判断し実質国内株式組入比率を調整し、プラスに寄与しました。また、月次予測モデルにおいても、各国の株価上昇による予測からA Iが判断し実質国内株式組入比率を調整し、プラスに寄与しました。

## (下落要因)

- 株式個別銘柄戦略のニュースピックモデルにおいて、ネットワークで繋がった関連企業と比較して株価が出遅れており反発を期待し組入っていた銘柄群がマイナスに影響しました。

**●投資環境について****◎国内株式市況**

- ・国内株式市況は上昇しました。
- ・米国で金融引き締め長期化懸念が高まったことなどから長期金利が上昇し、米国株が下落したことなどから下落する局面があったものの、国内企業決算が概ね堅調となったことや、日銀が金融緩和政策を継続する方針を示したことなどを背景に外国為替市場で円安・米ドル高が進行したことなどから上昇し、期間を通してみると上昇しました。

**●当該投資信託のポートフォリオについて**

- ・A I（人工知能）等を活用した三菱UFJ信託銀行からの投資助言を基に、わが国の株式に投資を行うと同時に株価指数先物取引等を行いました。

- ・株式個別銘柄戦略と先物アロケーション戦略の2つを組み合わせた運用を行いました。
- ・株式個別銘柄戦略では、わが国の株式への投資に加え株価指数先物を売建てすることで収益の獲得をめざしました。
- ・先物アロケーション戦略では、株式相場が上昇局面であると判断した場合に、株価指数先物の売建ての量を減らすことで実質株式組入比率を引き上げることを基本とし、株式相場の上昇による収益も一部獲得することをめざしました。
- ・各運用戦略で採用するモデルはファンド全体のリスク・リターンに配慮して選定しました。

**○今後の運用方針**

- ・モデルに応じて銘柄入替、ならびに先物ヘッジ比率（実質株式組入比率）の機動的操作を行い、収益獲得に努めます。

（※なお、投資環境の変化や技術の進歩等が生じ、モニタリング等においてより適切と判断した場合には、新たなモデルの採用や入替を行います。）



## ○1万口当たりの費用明細

(2023年8月1日～2024年1月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	4	0.040	
(先物・オプション)	(2)	(0.024)	
合 計	(1)	(0.016)	
期中の平均基準価額は、9,253円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2023年8月1日～2024年1月31日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		384	852,054	484	1,100,647
		( 38)	( -)		

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株式分割・増資割当および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。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		-	-	6,367	6,523

## ○株式売買比率

(2023年8月1日～2024年1月31日)

## 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	1,952,701千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,263,932千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.54

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年8月1日～2024年1月31日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 852	百万円 3	% 0.4	百万円 1,100	百万円 9	% 0.8

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	770千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B) / (A)	0.9%

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項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年1月31日現在)

## 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	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.2%)</b>				
ニッスイ	1.6	1.7	1,372	
マルハニチロ	0.1	0.2	585	
<b>鉱業 (1.2%)</b>				
INPEX	4.5	6.9	14,110	
<b>建設業 (2.7%)</b>				
ショーボンドホールディングス	0.4	0.4	2,636	
タマホーム	0.1	0.1	408	
安藤・間	1.2	0.8	956	
長谷工コーポレーション	2.3	2.1	4,046	
奥村組	0.1	0.1	517	
東洋建設	0.5	0.3	390	
五洋建設	1.4	—	—	
住友林業	0.9	1	4,384	
大和ハウス工業	3.9	1.1	5,042	
ライト工業	—	0.2	413	
積水ハウス	4.9	4	13,388	
中電工	—	0.2	557	
三機工業	0.4	—	—	
<b>食料品 (4.2%)</b>				
森永製菓	0.3	—	—	
寿スピリッツ	0.1	1	1,995	
森永乳業	0.3	0.3	907	
明治ホールディングス	1.2	0.7	2,499	
伊藤ハム米久ホールディングス	0.8	0.1	414	
アサヒグループホールディングス	—	1.1	6,061	
キリンホールディングス	6.3	5.8	12,313	
宝ホールディングス	0.9	—	—	
日清オイリオグループ	0.3	0.1	451	
キッコーマン	0.5	0.4	3,656	
味の素	2.1	1	6,087	
日清食品ホールディングス	0.5	—	—	
日本たばこ産業	5.2	4.1	15,969	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>繊維製品 (0.6%)</b>				
帝人	—	0.9	1,227	
ワコールホールディングス	1.9	—	—	
オンワードホールディングス	8.7	—	—	
ゴールドウイン	0.6	0.6	5,998	
<b>パルプ・紙 (0.5%)</b>				
日本製紙	0.4	4.2	5,766	
レンゴー	1.2	—	—	
<b>化学 (6.8%)</b>				
クラレ	—	2.4	3,724	
住友化学	7	—	—	
日産化学	1.4	1.1	6,514	
クレハ	—	0.3	850	
日本曹達	0.1	0.1	572	
東ソー	1.8	3.2	6,115	
トクヤマ	0.4	0.5	1,189	
セントラル硝子	0.1	0.1	277	
デンカ	2.5	—	—	
信越化学工業	7.2	3.8	22,325	
カネカ	—	0.3	1,082	
三井化学	—	0.9	3,936	
ダイセル	2.3	2.5	3,632	
アイカ工業	0.4	0.3	1,029	
UBE	0.5	0.3	739	
日本化薬	—	4.3	5,691	
花王	2.2	0.7	4,104	
D I C	0.4	—	—	
a r t i e n c e	0.3	0.3	831	
富士フィルムホールディングス	—	1	9,410	
ファンケル	2.5	—	—	
ノエビアホールディングス	0.3	0.2	1,050	
タカラバイオ	0.4	0.5	629	
J C U	0.1	0.2	750	
デクセリアルズ	0.4	0.5	2,149	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クミアイ化学工業	—	0.5	425
日東電工	1.4	—	—
バルカー	0.1	0.1	451
ユニ・チャーム	1.5	1	5,088
<b>医薬品 (5.3%)</b>			
武田薬品工業	—	1.2	5,234
アステラス製薬	4.6	5.3	9,142
塩野義製薬	1.7	2.4	17,064
日本新薬	1	—	—
中外製薬	3.9	3.1	16,575
科研製薬	0.1	0.1	349
ロート製薬	1.5	0.9	2,734
小野薬品工業	2.6	2.6	6,947
久光製薬	1	—	—
ツムラ	—	0.2	534
JCRファーマ	0.4	0.4	438
東和薬品	—	0.2	517
大塚ホールディングス	—	0.7	4,076
ベプチドリーム	0.6	0.7	912
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			
ENEOSホールディングス	13.2	8.1	4,848
<b>ゴム製品 (0.6%)</b>			
ブリヂストン	2	1	6,444
三ツ星ベルト	0.1	0.1	495
<b>ガラス・土石製品 (1.4%)</b>			
日本板硝子	0.8	0.6	368
太平洋セメント	—	0.4	1,220
日本特殊陶業	2.6	2.8	11,200
MARUWA	—	0.1	2,980
ニチアス	0.4	0.4	1,386
<b>鉄鋼 (2.6%)</b>			
日本製鉄	5.2	4	14,280
神戸製鋼所	—	2.1	4,319
JFEホールディングス	1.8	1.8	4,218
大和工業	0.3	0.2	1,644
大同特殊鋼	0.1	—	—
日本冶金工業	—	0.1	478
大太平洋金属	—	4.3	6,153

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>非鉄金属 (1.2%)</b>			
三井金属鉱業	—	1.3	5,963
DOWAホールディングス	—	1.2	6,207
フジクラ	1	1.1	1,345
AREホールディングス	—	0.5	1,028
<b>金属製品 (1.6%)</b>			
トーカロ	0.8	0.8	1,262
東洋製罐グループホールディングス	—	2.2	5,186
横河ブリッジホールディングス	0.3	—	—
三和ホールディングス	2.2	3	6,826
文化シヤッター	—	0.3	442
日本発條	—	5	6,137
<b>機械 (4.6%)</b>			
ツガミ	0.5	0.5	601
オークマ	—	0.1	669
芝浦機械	—	0.1	360
牧野フライス製作所	—	0.1	602
オーエスジー	—	0.6	1,213
DMG森精機	0.4	—	—
ディスコ	0.4	0.2	8,076
ナブテスコ	1.7	—	—
SMC	0.1	0.1	8,291
小松製作所	4.6	1.2	5,094
日立建機	—	0.3	1,270
クボタ	1.7	1.7	3,829
ダイキン工業	0.4	0.3	7,165
ダイフク	1.7	1.5	4,407
平和	0.4	0.6	1,317
SANKYO	0.6	0.2	1,810
竹内製作所	—	0.3	1,530
アマノ	0.4	0.4	1,364
NTN	1.6	—	—
不二越	0.1	—	—
日本ピラー工業	—	0.1	490
三菱重工業	1.2	0.4	3,976
IHI	0.9	1.2	3,414
スター精密	0.3	—	—
<b>電気機器 (14.4%)</b>			
ブラザー工業	2.6	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
安川電機	1.2	—	—	—
山洋電気	—	0.1	—	618
PHCホールディングス	3.7	—	—	—
ソシオネクスト	0.3	1	—	3,432
ニデック	0.8	—	—	—
オムロン	0.8	—	—	—
I D E C	0.3	0.3	—	892
富士通	0.5	0.3	—	6,252
ルネサスエレクトロニクス	6.6	8.4	—	20,764
セイコーエプソン	—	1.7	—	3,683
ワコム	0.9	—	—	—
E I Z O	0.1	0.1	—	512
パナソニック ホールディングス	5.2	5.7	—	8,028
アンリツ	—	0.8	—	937
ソニーグループ	—	1.4	—	20,573
TDK	2.5	—	—	—
ホシデン	—	0.2	—	364
ヒロセ電機	0.3	0.1	—	1,726
マクセル	2.3	—	—	—
アズビル	1	—	—	—
日本光電工業	—	0.6	—	2,705
堀場製作所	0.9	0.3	—	3,591
アドバンテスト	0.4	1.5	—	8,734
キーエンス	0.1	0.3	—	19,974
日置電機	—	0.1	—	659
シスメックス	1.2	0.4	—	3,203
日本マイクロニクス	0.3	0.3	—	1,335
レーザーテック	0.3	0.2	—	7,956
スタンレー電気	1.8	—	—	—
山一電機	2.5	—	—	—
日本電子	0.3	0.2	—	1,365
ファナック	1.8	2.8	—	11,527
ローム	0.7	—	—	—
浜松ホトニクス	0.6	0.3	—	1,762
新光電気工業	0.8	0.6	—	3,318
京セラ	0.9	2.4	—	5,238
村田製作所	1.7	2.5	—	7,537
小糸製作所	1.3	—	—	—
S C R E E Nホールディングス	0.1	—	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
キヤノン	5.7	3.9	—	15,912
リコー	3	—	—	—
東京エレクトロン	0.5	0.4	—	11,146
<b>輸送用機器 (6.8%)</b>				
日産自動車	12.9	13.5	—	7,943
いすゞ自動車	2.6	4.3	—	8,739
トヨタ自動車	—	3.4	—	10,200
三菱自動車工業	6	7.2	—	3,390
カヤバ	—	0.1	—	515
マツダ	2.6	2.5	—	4,553
本田技研工業	—	11.6	—	19,435
S U B A R U	—	4.9	—	14,655
ヤマハ発動機	—	4.8	—	6,753
シマノ	0.2	0.3	—	6,406
<b>精密機器 (2.7%)</b>				
東京精密	0.1	—	—	—
マニー	—	0.6	—	1,237
ニコン	1.8	2.5	—	3,793
トプコン	0.5	—	—	—
オリンパス	10.2	5.1	—	11,220
HOYA	1.2	0.7	—	13,261
朝日インテック	1.5	—	—	—
シチズン時計	1.2	1.4	—	1,318
ニプロ	—	1.1	—	1,311
<b>その他製品 (3.1%)</b>				
スノーピーク	0.3	0.3	—	268
パンダイナムコホールディングス	4	3.4	—	10,931
S H O E I	0.4	0.5	—	993
パイロットコーポレーション	0.5	0.2	—	827
N I S S H A	0.3	—	—	—
アシックス	1.3	—	—	—
ローランド	0.1	—	—	—
ビジョン	0.8	0.8	—	1,293
任天堂	3.6	2.7	—	22,437
コクヨ	2.9	—	—	—
美津濃	0.1	0.1	—	443
<b>電気・ガス業 (2.0%)</b>				
中部電力	2.6	2.1	—	4,026
関西電力	2	4	—	8,082

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
九州電力	—	3.6	3,990	
電源開発	3.1	1	2,484	
東京瓦斯	—	1.8	6,121	
東邦瓦斯	1.3	—	—	
<b>陸運業 (0.6%)</b>				
相鉄ホールディングス	1.5	—	—	
小田急電鉄	2.7	—	—	
西日本旅客鉄道	0.9	—	—	
東海旅客鉄道	0.4	—	—	
センコーグループホールディングス	—	0.5	578	
ニッコンホールディングス	0.4	—	—	
AZ-COM丸和ホールディングス	0.3	0.3	458	
九州旅客鉄道	3	0.8	2,597	
SGホールディングス	2.1	1.9	3,637	
<b>海運業 (0.8%)</b>				
日本郵船	2.2	—	—	
商船三井	1	1.9	10,089	
明海グループ	3.2	—	—	
<b>空運業 (0.7%)</b>				
日本航空	2.1	—	—	
ANAホールディングス	—	2.5	8,175	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.1%)</b>				
三井倉庫ホールディングス	0.1	—	—	
住友倉庫	0.3	0.3	798	
上組	—	0.3	1,021	
<b>情報・通信業 (8.0%)</b>				
システナ	3.9	1.1	330	
デジタルアーツ	0.1	0.1	508	
T I S	—	1.7	5,616	
グリー	8.7	—	—	
テクマトリックス	0.4	—	—	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.4	0.2	497	
コムチュア	0.3	0.3	551	
野村総合研究所	2.1	1	4,533	
オービック	0.5	0.4	9,094	
日本オラクル	0.8	0.4	4,668	
フューチャー	—	0.4	704	
電通総研	0.1	0.1	554	
デジタルガレージ	1.3	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ネットワンシステムズ	0.4	—	—	
日本テレビホールディングス	—	0.9	1,556	
テレビ朝日ホールディングス	—	0.3	529	
スカパーJ SATホールディングス	0.9	—	—	
日本電信電話	145	116.6	21,722	
KDD I	4.4	5.4	26,443	
ソフトバンク	5.7	7.7	15,118	
松竹	0.4	—	—	
D T S	—	0.2	730	
カブコン	1.1	—	—	
S C S K	—	1	2,906	
NSD	0.9	0.4	1,112	
<b>卸売業 (7.4%)</b>				
双日	1	1.2	4,204	
神戸物産	1.5	1	3,770	
あい ホールディングス	0.3	0.3	748	
ダイワボウホールディングス	2	—	—	
マクニカホールディングス	0.3	0.4	3,164	
TOKAIホールディングス	—	0.3	298	
コマダホールディングス	0.5	0.5	1,415	
三菱食品	—	0.1	504	
メディカルホールディングス	—	1.5	3,538	
アズワン	0.3	0.2	1,121	
伊藤忠商事	1.9	2.1	14,179	
丸紅	3.7	5.6	14,232	
長瀬産業	—	2.2	5,331	
兼松	0.6	0.3	690	
三井物産	2.2	3.5	21,108	
山善	—	0.4	507	
住友商事	2.8	1.7	5,805	
三菱商事	—	0.9	2,308	
菱洋エレクトロ	0.1	0.1	378	
ユアサ商事	—	0.1	493	
阪和興業	0.3	0.2	1,088	
サンゲツ	0.3	0.4	1,304	
加賀電子	0.1	0.1	689	
オートバックスセブン	0.4	0.4	642	
イエローハット	0.5	0.2	367	
因幡電機産業	0.4	0.4	1,416	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スズケン	1.5	—	—	—
<b>小売業 (4.7%)</b>				
ローソン	0.6	—	—	—
アスクル	0.4	0.4	802	802
バルグループホールディングス	0.1	0.2	475	475
DCMホールディングス	0.8	0.4	550	550
Monotaro	2.2	1.9	2,660	2,660
ZOZO	2.2	1.9	6,180	6,180
物語コーポレーション	—	0.3	1,569	1,569
ウエルシアホールディングス	—	0.2	498	498
クリエイティブSDホールディングス	0.1	0.1	322	322
オイシックス・ラ・大地	0.3	—	—	—
コスモス薬品	0.1	—	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	1.4	1.6	9,369	9,369
ノジマ	0.4	0.4	745	745
良品計画	—	1.5	3,454	3,454
コーナン商事	0.1	0.1	392	392
コロワイド	—	2.3	5,438	5,438
コメリ	0.1	—	—	—
青山商事	—	3.8	6,809	6,809
高島屋	—	0.6	1,236	1,236
イズミ	0.1	—	—	—
ケーズホールディングス	1	0.7	938	938
アインホールディングス	—	0.8	3,865	3,865
ヤマダホールディングス	6.7	2.8	1,261	1,261
ニトリホールディングス	0.8	—	—	—
ファーストリテイリング	0.2	0.2	7,948	7,948
サンドラッグ	1.4	0.6	2,674	2,674
<b>銀行業 (3.2%)</b>				
いよぎんホールディングス	—	1.2	1,212	1,212
めぶきフィナンシャルグループ	—	7.9	3,510	3,510
東京きらばしフィナンシャルグループ	0.1	0.1	435	435
あおぞら銀行	1.4	0.9	2,931	2,931
三井住友トラスト・ホールディングス	1.3	1.6	4,865	4,865
三井住友フィナンシャルグループ	1.7	2.1	16,170	16,170
ふくおかフィナンシャルグループ	1.2	—	—	—
南都銀行	—	0.2	537	537
ほくほくフィナンシャルグループ	0.4	—	—	—
セブン銀行	4.5	2.9	897	897

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
みずほフィナンシャルグループ	4.4	2.7	7,295	7,295
山口フィナンシャルグループ	1	—	—	—
トモニホールディングス	1.2	1.1	449	449
<b>証券、商品先物取引業 (1.3%)</b>				
FPG	—	0.3	510	510
SBIホールディングス	1.8	1.4	5,101	5,101
大和証券グループ本社	6.3	—	—	—
野村ホールディングス	—	13.2	10,153	10,153
松井証券	0.6	0.5	415	415
<b>保険業 (2.4%)</b>				
かんぽ生命保険	1.4	—	—	—
SOMPOホールディングス	1.2	1.9	14,612	14,612
MS&ADインシュアランスグループホール	2.8	2.4	14,755	14,755
第一生命ホールディングス	2.8	—	—	—
<b>その他金融業 (2.4%)</b>				
全国保証	0.5	0.5	2,750	2,750
クレディセゾン	0.5	0.5	1,380	1,380
みずほリース	0.1	0.1	538	538
アイフル	1.4	—	—	—
リコーリース	0.1	0.1	508	508
オリックス	3.1	5.9	16,924	16,924
日本取引所グループ	2.1	1.7	5,582	5,582
イー・ギャランティ	0.3	0.4	775	775
<b>不動産業 (1.2%)</b>				
大東建託	0.4	0.2	3,365	3,365
ヒューリック	3.2	1.9	3,112	3,112
サムティ	1.6	—	—	—
プレサンスコーポレーション	0.3	—	—	—
オープンハウスグループ	0.5	0.8	3,716	3,716
東急不動産ホールディングス	3.6	—	—	—
飯田グループホールディングス	—	1.6	3,588	3,588
スターツコーポレーション	0.1	0.2	609	609
カチタス	0.3	0.3	552	552
<b>サービス業 (4.3%)</b>				
日本M&Aセンターホールディングス	2.1	1.2	1,070	1,070
UTグループ	0.1	—	—	—
パーソルホールディングス	—	14.4	3,408	3,408
カカココム	4.4	1	1,688	1,688
ディップ	—	0.3	758	758

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ベネフィット・ワン	0.9	0.4		848
エムスリー	1.7	1		2,354
アウトソーシング	5	1		1,740
電通グループ	0.6	1		3,932
H. U. グループホールディングス	2	—		—
リゾートトラスト	2.5	—		—
ビー・エム・エル	0.1	—		—
ユー・エス・エス	1.5	1		2,800
サイバーエージェント	4.3	2.9		2,773
Keeper 技研	0.1	0.1		655
ジャパンマテリアル	0.6	0.4		1,009
リクルートホールディングス	3.1	2.1		12,446

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本郵政	3.6	4.4		6,230
ペイカレント・コンサルティング	1	0.6		2,079
ジャパンエレベーターサービスホールディング	0.8	0.5		1,121
トランス・コスモス	1.6	—		—
セコム	—	0.4		4,288
メイテックグループホールディングス	1	0.7		2,054
船井総研ホールディングス	0.4	0.2		516
イオンディライト	0.1	—		—
合 計	株 数 ・ 金 額	597	534	1,209,619
	銘柄数<比率>	284	280	<65.9%>

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。  
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

### 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 株式先物取引 TOPIX	百万円 —	百万円 1,072

### ○投資信託財産の構成

(2024年1月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,209,619	64.6
コール・ローン等、その他	663,561	35.4
投資信託財産総額	1,873,180	100.0



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年1月31日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,873,180,741
コール・ローン等	585,980,181
株式(評価額)	1,209,619,350
未収入金	5,206,276
未収配当金	2,528,400
差入委託証拠金	69,846,534
(B) 負債	38,968,274
未払金	38,968,100
未払利息	174
(C) 純資産総額(A-B)	1,834,212,467
元本	1,971,186,538
次期繰越損益金	△ 136,974,071
(D) 受益権総口数	1,971,186,538口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,305円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,148,400,259円  
 期中追加設定元本額 0円  
 期中一部解約元本額 177,213,721円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9305円です。

- ②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

A I 日本株式オープン（絶対収益追求型） 1,971,186,538円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は136,974,071円です。

## 【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)

## ○損益の状況（2023年8月1日～2024年1月31日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	15,530,665
受取配当金	15,627,885
受取利息	3,088
その他収益金	2,255
支払利息	△ 102,563
(B) 有価証券売買損益	105,505,715
売買益	163,263,385
売買損	△ 57,757,670
(C) 先物取引等取引損益	△112,139,400
取引益	59,352,900
取引損	△171,492,300
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,896,980
(E) 前期繰越損益金	△159,044,772
(F) 解約差損益金	13,173,721
(G) 計(D+E+F)	△136,974,071
次期繰越損益金(G)	△136,974,071

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)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。