

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^{あい}A I

第15期（決算日：2024年7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7月31日に第15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		%	%	百万円
11期(2022年8月1日)	8,542		0		65.1	△56.3	2,401
12期(2023年1月31日)	8,464		0		59.8	△50.1	2,210
13期(2023年7月31日)	8,489		0		67.8	△56.0	1,995
14期(2024年1月31日)	8,473		0		65.9	△58.4	1,835
15期(2024年7月31日)	8,416		0		71.0	△49.2	1,590

(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		%	%	%
2024年1月31日	8,473		—	65.9	△58.4
2月末	8,393		△0.9	66.1	△56.1
3月末	8,396		△0.9	65.9	△54.7
4月末	8,387		△1.0	72.1	△45.1
5月末	8,391		△1.0	74.0	△45.2
6月末	8,434		△0.5	76.2	△50.0
(期末)					
2024年7月31日	8,416		△0.7	71.0	△49.2

(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15期：2024年2月1日～2024年7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15期首	8,473円
第15期末	8,416円
既払分配金	0円
騰落率	-0.7%

※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す。

※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0.7%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たことから、プラスに寄与しました。また、月次予測モデルにおいても、各国の株価上昇が継続するとの予測から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安定高配当モデルにおいて、収益性や財務健全性の評価や、配当利回りの高さから組入っていた安定成長銘柄群がマイナスに影響しました。また、ニュースピックモデルにおいても、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。

信託報酬が基準価額の下落要因となりました。

第15期：2024年2月1日～2024年7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。

期間の初めから2024年3月にかけては、国内企業決算が概ね堅調であったことや為替の円安・米ドル高進行に加えて、日銀のマイナス金利解除後も緩和的な金融環境が継続するとの見方などが好感され、国内株式市場は上昇しました。

4月から6月にかけては、根強い米インフレ圧力への警戒感や中東情勢の緊迫化などがマイナス材料となった一方、国内企業決算が概ね堅調であったことや為替

の円安・米ドル高進行などがプラス材料となり、一進一退の動きとなりました。

その後は、インフレ鈍化を示唆する米経済指標を受けて、米連邦準備制度理事会（FRB）による利下げ観測が高まったことなどがプラス材料となった一方、為替の円高・米ドル安の急速な進行や米ハイテク株の軟調な決算などを受け、市場心理が悪化したことなどがマイナス材料となりました。

結果、期間を通じてみると、国内株式市況は上昇しました。

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）

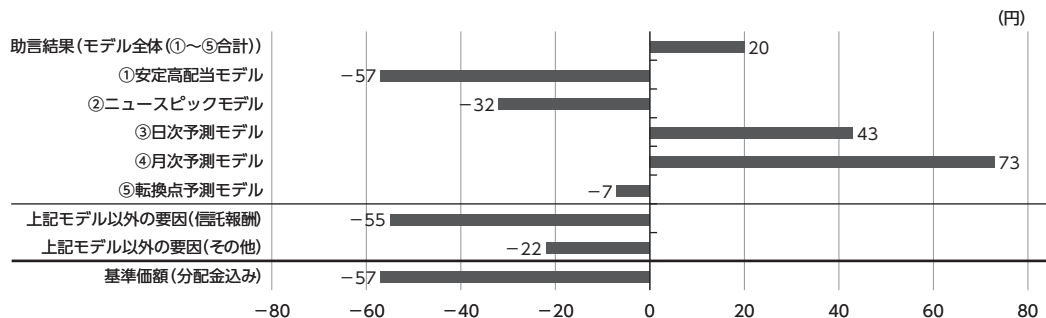
株式個別銘柄戦略	わが国の株式への投資に加え、組入株式における株式市場に対する感応度を排除できると考える量の株価指数先物の売建てを行うことで収益の獲得をめざします。 ※以下①、②の2つのモデルがあります。
モデル	内容
A Iによる中長期投資 安定高配当モデル（①）	決算短信や有価証券報告書等の企業の業績にかかる文字情報と配当利回りを組み合わせて、株式相場の下落局面でも強みを持ち安定的な収益獲得が期待できる安定高配当銘柄を選定します。
A Iによる短期投資 ニュースピックモデル（②）	経済ニュース、市場参加者（アナリスト等）の利益予想等を用いて複合的に評価し銘柄を選定します。
先物アロケーション戦略	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15期 2024年2月1日～2024年7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	388

（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。）

2024年2月1日～2024年7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	55	0.657	(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)	(30)	(0.361)	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)	(0.274)	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)	(0.026)	
(先物・オプション)	(1)	(0.013)	
(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	58	0.698	

期中の平均基準価額は、8,402円です。

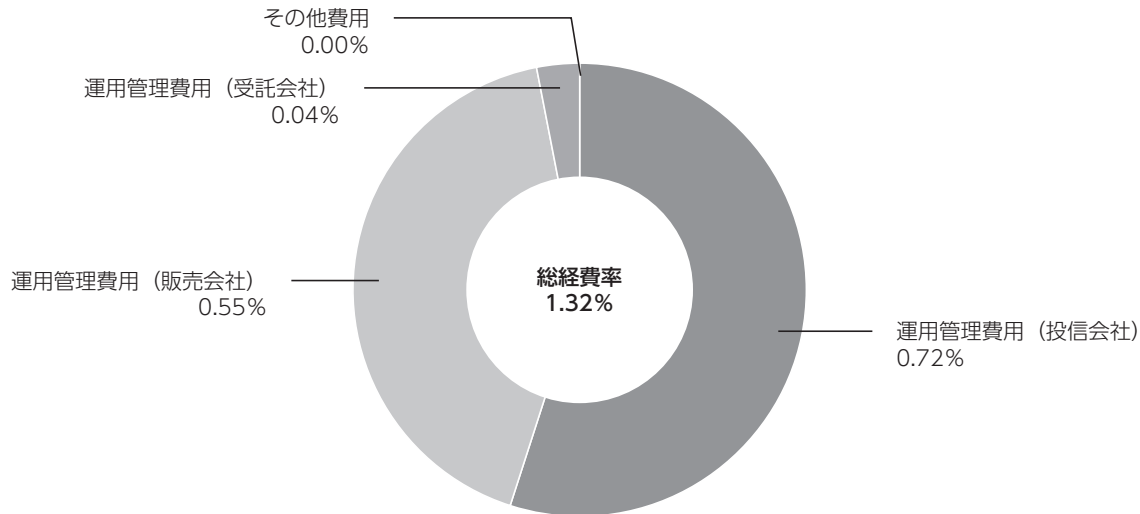
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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

(2024年2月1日～2024年7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 560,805	千円 519,550	千口 830,354	千円 768,900

○株式売買比率

(2024年2月1日～2024年7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	2,183,619千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,188,257千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.83	

(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

(2024年2月1日～2024年7月31日)

利害関係人との取引状況

< A I 日本株式オープン（絶対収益追求型） >

該当事項はございません。

< A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型） >

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 1,008	百万円 —	% —	百万円 1,174	百万円 13	% 1.1

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。

利害関係人の発行する有価証券等

< A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型） >

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 3	百万円 0.901476	百万円 2

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

< A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型） >

種 類	買 付 額
株式	百万円 5

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)	673千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B) / (A)	1.6%

(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HCキャピタル、ジャックス、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2024年7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
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）	千口 1,971,186	千口 1,701,637	千円 1,583,544

○投資信託財産の構成

(2024年7月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）	千円 1,583,544	% 98.6
コール・ローン等、その他	23,277	1.4
投資信託財産総額	1,606,821	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年7月31日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,606,821,005
コール・ローン等	15,546,882
A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）（評価額）	1,583,544,097
未収入金	7,730,000
未収利息	26
(B) 負債	16,040,445
未払解約金	4,824,385
未払信託報酬	11,191,875
その他未払費用	24,185
(C) 純資産総額（A－B）	1,590,780,560
元本	1,890,109,960
次期繰越損益金	△ 299,329,400
(D) 受益権総口数	1,890,109,960口
1万口当たり基準価額（C／D）	8,416円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,166,579,631円
 期中追加設定元本額 736,209,414円
 期中一部解約元本額 1,012,679,085円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8416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299,329,400円です。

③分配金の計算過程

項 目	2024年2月1日～ 2024年7月31日
費用控除後の配当等収益額	3,410,364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	32,872,710円
分配準備積立金額	37,078,313円
当ファンドの分配対象収益額	73,361,387円
1万口当たり収益分配対象額	388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（2024年2月1日～2024年7月31日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,021
受取利息	4,053
支払利息	△ 32
(B) 有価証券売買損益	4,573,547
売買益	5,868,866
売買損	△ 1,295,319
(C) 信託報酬等	△ 11,216,060
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 6,638,492
(E) 前期繰越損益金	△ 173,408,737
(F) 追加信託差損益金	△ 119,282,171
（配当等相当額）	（ 32,464,274）
（売買損益相当額）	（△151,746,445）
(G) 計（D＋E＋F）	△ 299,329,400
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（G＋H）	△ 299,329,400
追加信託差損益金	△ 119,282,171
（配当等相当額）	（ 32,872,710）
（売買損益相当額）	（△152,154,881）
分配準備積立金	40,488,677
繰越損益金	△ 220,535,906

（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等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。

A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）

《第15期》決算日2024年7月31日

〔計算期間：2024年2月1日～2024年7月31日〕

「A I 日本株式マザーファンド（絶対収益追求型）」は、7月31日に第15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15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
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
15期(2024年7月31日)	9,306		0.0	71.3	△49.5	1,583

(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	
				騰 落 率
(期 首) 2024年 1月31日	円 9,305	% —	% 65.9	% △58.5
2月末	9,226	△0.8	66.3	△56.2
3月末	9,239	△0.7	65.8	△54.7
4月末	9,241	△0.7	72.2	△45.1
5月末	9,258	△0.5	74.0	△45.3
6月末	9,316	0.1	76.5	△50.2
(期 末) 2024年 7月31日	9,306	0.0	71.3	△49.5

(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概ね変わらずとなりました。

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たことから、プラスに寄与しました。また、月次予測モデルにおいても、各国の株価上昇が継続するとの予測から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安定高配当モデルにおいて、収益性や財務健全性の評価や、配当利回りの高さから組入れていた安定成長銘柄群がマイナスに影響しました。また、ニュースピックモデルにおいても、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。

●投資環境について**◎株式市況**

- ・国内株式市況は上昇しました。
- ・期間の初めから2024年3月にかけては、国内企業決算が概ね堅調であったことや為替の円安・米ドル高進行に加えて、日銀のマイナス金利解除後も緩和的な金融環境が継続するとの見方などが好感され、国内株式市場は上昇しました。4月から6月にかけては、根強い米インフレ圧力への警戒感や中東情勢の緊迫化などがマイナス材料となった一方、国内企業決算が概ね堅調であったことや為替の円安・米ドル高進行などがプラス材料となり、一進一退の動きとなりました。その後は、インフレ鈍化を示唆する米経済指標を受けて、米連邦準備制度理事会（FRB）による利下げ観測が高まったことなどがプラス材料となった一方、為替の円高・米ドル安の急速な進行や米ハイテク株の軟調な決算などを受け、市場心理が悪化したことなどがマイナス材料となりました。結果、期間を通じてみると、国内株式市況は上昇しました。

●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。

○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

(2024年2月1日～2024年7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)	(0.026)	
合 計	(1)	(0.013)	
期中の平均基準価額は、9,260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

(2024年2月1日～2024年7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
		408	1,008,696	507	1,174,922
		(24)	()		

(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
		—	—	5,481	5,873

○株式売買比率

(2024年2月1日～2024年7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	2,183,619千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,188,257千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.83

(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

(2024年2月1日～2024年7月31日)

利害関係人との取引状況

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 1,008	百万円 —	% —	百万円 1,174	百万円 13	% 1.1

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 3	百万円 0.901476	百万円 2

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 5

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)	673千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B) / (A)	1.6%

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HCキャピタル、ジャックス、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2024年7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
水産・農林業 (0.1%)				
ニッスイ	1.7	—	—	—
マルハニチロ	0.2	0.2	—	674
鉱業 (0.4%)				
INPEX	6.9	2.1	—	4,884
建設業 (2.6%)				
ショーボンドホールディングス	0.4	0.3	—	1,736
タマホーム	0.1	—	—	—
安藤・間	0.8	—	—	—
長谷工コーポレーション	2.1	1.3	—	2,449
奥村組	0.1	0.1	—	514
東洋建設	0.3	—	—	—
五洋建設	—	2.1	—	1,405
住友林業	1	—	—	—
大和ハウス工業	1.1	2.1	—	9,015
ライト工業	0.2	—	—	—
積水ハウス	4	2.4	—	9,072
中電工	0.2	—	—	—
九電工	—	0.8	—	5,557
食料品 (4.5%)				
日清製粉グループ本社	—	1.2	—	2,239
寿スピリッツ	1	1	—	1,928
森永乳業	0.3	1.5	—	5,418
明治ホールディングス	0.7	0.7	—	2,659
伊藤ハム米久ホールディングス	0.1	0.1	—	444
アサヒグループホールディングス	1.1	0.9	—	4,999
キリンホールディングス	5.8	4.9	—	10,439
宝ホールディングス	—	0.7	—	801
日清オイリオグループ	0.1	—	—	—
キッコーマン	0.4	—	—	—
味の素	1	0.3	—	1,869
日本たばこ産業	4.1	4.4	—	19,509
繊維製品 (0.1%)				
帝人	0.9	—	—	—

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
ゴールドウイン	0.6	0.1	—	931
パルプ・紙 (0.1%)				
日本製紙	4.2	0.6	—	582
化学 (7.9%)				
クラレ	2.4	2.5	—	4,647
日産化学	1.1	0.8	—	3,899
クレハ	0.3	1.7	—	5,081
日本曹達	0.1	0.1	—	542
東ソー	3.2	5.2	—	10,675
トクヤマ	0.5	—	—	—
セントラル硝子	0.1	—	—	—
デンカ	—	0.2	—	439
信越化学工業	3.8	2.9	—	19,569
日本触媒	—	0.3	—	490
カネカ	0.3	—	—	—
三井化学	0.9	—	—	—
東京応化工業	—	1.1	—	4,295
KHネオケム	—	0.2	—	449
ダイセル	2.5	2.4	—	3,517
積水化学工業	—	1	—	2,273
アイカ工業	0.3	0.3	—	1,045
UBE	0.3	—	—	—
日本化薬	4.3	—	—	—
日油	—	1.3	—	2,806
花王	0.7	0.6	—	3,962
関西ペイント	—	1.8	—	4,453
artience	0.3	—	—	—
富士フィルムホールディングス	1	1.9	—	6,802
ノエビアホールディングス	0.2	0.1	—	582
タカラバイオ	0.5	—	—	—
JCU	0.2	—	—	—
デクセリアルズ	0.5	0.2	—	1,465
クミアイ化学工業	0.5	—	—	—
エフビコ	—	1.8	—	4,669

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バルカー	0.1	—	—
ユニ・チャーム	1	1.4	7,025
医薬品 (3.6%)			
武田薬品工業	1.2	1.3	5,592
アステラス製薬	5.3	—	—
塩野義製薬	2.4	1	6,597
日本新薬	—	0.3	1,034
中外製薬	3.1	1.3	8,591
科研製薬	0.1	0.1	408
ロート製薬	0.9	0.5	1,767
小野薬品工業	2.6	3.7	8,278
ツムラ	0.2	0.2	801
JCRファーマ	0.4	—	—
東和薬品	0.2	0.2	613
第一三共	—	0.6	3,688
大塚ホールディングス	0.7	0.3	2,328
ベプチドリーム	0.7	0.3	831
サワイグループホールディングス	—	0.1	662
石油・石炭製品 (-%)			
ENEOSホールディングス	8.1	—	—
ゴム製品 (0.8%)			
ブリヂストン	1	1.3	8,040
ニッタ	—	0.2	820
三ツ星ベルト	0.1	—	—
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日本板硝子	0.6	—	—
太平洋セメント	0.4	—	—
日本碍子	—	2.3	4,706
日本特殊陶業	2.8	0.6	2,712
MARUWA	0.1	—	—
ニチアス	0.4	—	—
鉄鋼 (1.3%)			
日本製鉄	4	4.2	13,776
神戸製鋼所	2.1	—	—
JFEホールディングス	1.8	—	—
東京製鐵	—	0.3	574
大和工業	0.2	0.1	798
日本冶金工業	0.1	—	—
大太平洋金属	4.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
非鉄金属 (0.6%)			
三井金属鉱業	1.3	—	—
DOWAホールディングス	1.2	—	—
古河電気工業	—	1.1	4,559
住友電気工業	—	1.1	2,541
フジクラ	1.1	—	—
AREホールディングス	0.5	—	—
金属製品 (0.7%)			
トーカロ	0.8	0.3	594
東洋製罐グループホールディングス	2.2	—	—
横河ブリッジホールディングス	—	0.2	545
三和ホールディングス	3	1.8	5,850
文化シヤッター	0.3	0.2	349
日本発條	5	—	—
機械 (5.5%)			
ツガミ	0.5	1.8	3,002
オークマ	0.1	—	—
芝浦機械	0.1	—	—
アマダ	—	1.3	2,323
牧野フライス製作所	0.1	—	—
オーエスジー	0.6	—	—
ディスコ	0.2	0.1	4,946
三井海洋開発	—	0.2	569
SMC	0.1	0.1	7,415
小松製作所	1.2	2.3	10,021
日立建機	0.3	0.7	2,654
ローツェ	—	0.1	2,485
クボタ	1.7	1.4	3,052
ダイキン工業	0.3	—	—
ダイフク	1.5	1.3	3,563
平和	0.6	0.3	647
SANKYO	0.2	2.3	3,838
竹内製作所	0.3	0.2	976
アマノ	0.4	—	—
グローリー	—	1.6	4,376
NTN	—	2	613
PILLAR	0.1	0.1	512
キッツ	—	0.5	556
マキタ	—	0.8	3,950

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井E&S	—	0.4	535
三菱重工業	0.4	—	—
I H I	1.2	1	5,550
電気機器 (13.5%)			
日清紡ホールディングス	—	3.9	4,303
ブラザー工業	—	1.8	5,603
山洋電気	0.1	—	—
ソシオネクスト	1	0.7	2,154
芝浦メカトロニクス	—	0.1	797
I D E C	0.3	—	—
富士通	0.3	—	—
ルネサスエレクトロニクス	8.4	4.4	11,343
セイコーエプソン	1.7	—	—
ワコム	—	4.2	3,057
E I Z O	0.1	—	—
パナソニック ホールディングス	5.7	8.5	10,591
アンリツ	0.8	—	—
ソニーグループ	1.4	1.6	21,648
ホシデン	0.2	0.3	620
ヒロセ電機	0.1	0.1	1,892
アズビル	—	1.3	5,704
日本光電工業	0.6	—	—
堀場製作所	0.3	0.3	3,598
アドバンテスト	1.5	0.7	4,220
キーエンス	0.3	0.4	26,356
日置電機	0.1	0.1	807
シスメックス	0.4	—	—
日本マイクロニクス	0.3	—	—
レーザーテック	0.2	0.1	2,683
日本電子	0.2	0.3	1,830
ファナック	2.8	1	4,510
浜松ホトニクス	0.3	—	—
新光電気工業	0.6	1.5	8,539
京セラ	2.4	1.4	2,661
村田製作所	2.5	1.7	5,696
ニチコン	—	3.9	4,321
S C R E E Nホールディングス	—	0.2	2,579
キャノン	3.9	1	4,742
東京エレクトロン	0.4	0.4	12,408

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (6.7%)			
豊田自動織機	—	0.2	2,566
日産自動車	13.5	8.3	4,035
いすゞ自動車	4.3	1.2	2,481
トヨタ自動車	3.4	7.3	21,527
三菱自動車工業	7.2	3.5	1,536
カヤバ	0.1	0.1	525
マツダ	2.5	4.6	6,311
本田技研工業	11.6	6.3	10,376
スズキ	—	2.5	4,398
S U B A R U	4.9	3.3	9,855
ヤマハ発動機	4.8	5.1	7,216
シマノ	0.3	0.2	5,346
精密機器 (1.3%)			
マニー	0.6	0.2	423
ニコン	2.5	—	—
オリンパス	5.1	—	—
タムロン	—	0.2	856
HOYA	0.7	0.6	11,364
シチズン時計	1.4	0.8	820
ニプロ	1.1	1.2	1,580
その他製品 (3.0%)			
スノーピーク	0.3	—	—
パラマウントベッドホールディングス	—	0.2	507
バンダイナムコホールディングス	3.4	2	6,412
S H O E I	0.5	0.4	802
パイロットコーポレーション	0.2	—	—
大日本印刷	—	1	4,970
アシックス	—	0.7	1,732
ビジョン	0.8	0.6	917
任天堂	2.7	2.2	18,453
オカムラ	—	0.2	445
美津濃	0.1	—	—
電気・ガス業 (1.1%)			
中部電力	2.1	—	—
関西電力	4	3.6	9,261
東北電力	—	2.4	3,058
九州電力	3.6	—	—
電源開発	1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京瓦斯	1.8	—	—
陸運業 (3.1%)			
京浜急行電鉄	—	4	4,748
京王電鉄	—	1.1	4,139
東日本旅客鉄道	—	2.7	7,627
東海旅客鉄道	—	1.8	6,381
センコーグループホールディングス	0.5	4.2	4,838
AZ-COM丸和ホールディングス	0.3	—	—
九州旅客鉄道	0.8	0.7	2,814
SGホールディングス	1.9	1.4	2,132
NIPPON EXPRESSホールディン	—	0.3	2,238
海運業 (1.0%)			
日本郵船	—	1.3	6,368
商船三井	1.9	1	4,812
空運業 (0.4%)			
日本航空	—	1.6	3,940
ANAホールディングス	2.5	—	—
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三井倉庫ホールディングス	—	0.2	964
住友倉庫	0.3	0.2	566
上組	0.3	0.3	1,032
情報・通信業 (8.8%)			
システナ	1.1	1.6	544
デジタルアーツ	0.1	—	—
T I S	1.7	1.4	4,522
コーエーテクモホールディングス	—	0.6	881
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.2	—	—
コムチュア	0.3	—	—
ラクス	—	0.3	623
ビジョナル	—	0.1	788
野村総合研究所	1	0.9	4,203
ラクスル	—	4.4	4,994
オービック	0.4	—	—
L I N E ヤフー	—	12.2	4,550
日本オラクル	0.4	0.4	4,892
フューチャー	0.4	—	—
電通総研	0.1	0.1	569
日本テレビホールディングス	0.9	—	—
テレビ朝日ホールディングス	0.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電信電話	116.6	89.8	14,403
KDD I	5.4	5.7	25,764
ソフトバンク	7.7	6.6	12,969
NTTデータグループ	—	2	4,719
D T S	0.2	—	—
カブコン	—	1.1	3,522
S C S K	1	0.8	2,362
富士ソフト	—	0.8	5,784
NSD	0.4	—	—
コナミグループ	—	0.3	3,423
卸売業 (6.9%)			
あらた	—	0.2	719
東京エレクトロン デバイス	—	0.1	395
双日	1.2	—	—
神戸物産	1	—	—
あい ホールディングス	0.3	0.2	506
ダイワボウホールディングス	—	2.3	6,552
マクニカホールディングス	0.4	0.2	1,221
TOKAIホールディングス	0.3	0.3	303
コメダホールディングス	0.5	—	—
三菱食品	0.1	0.1	532
メディカルホールディングス	1.5	—	—
アズワン	0.2	—	—
伊藤忠商事	2.1	2.5	19,457
丸紅	5.6	4.2	12,014
長瀬産業	2.2	—	—
豊田通商	—	2.3	6,975
兼松	0.3	—	—
三井物産	3.5	2.6	9,178
山善	0.4	—	—
住友商事	1.7	2.9	10,956
三菱商事	0.9	—	—
菱洋エレクトロ	0.1	—	—
ユアサ商事	0.1	—	—
阪和興業	0.2	0.3	1,749
三菱オブリ	—	0.2	413
サンゲツ	0.4	0.2	600
サンリオ	—	1.2	3,859
加賀電子	0.1	0.1	547

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西本Wismettacホールディングス	—	0.3	421
オートボックスセブン	0.4	—	—
イエローハット	0.2	0.4	1,054
因幡電機産業	0.4	0.2	792
小売業 (6.7%)			
アスクル	0.4	0.2	425
アダストリア	—	0.1	331
くら寿司	—	0.7	2,726
バルグループホールディングス	0.2	0.3	609
ビックカメラ	—	3.2	5,433
DCMホールディングス	0.4	1	1,449
Monotaro	1.9	1.6	3,384
J. フロント リテイリング	—	1.9	3,473
ZOZO	1.9	1.3	5,701
物語コーポレーション	0.3	0.1	342
ウエルシアホールディングス	0.2	0.4	804
クリエイトSDホールディングス	0.1	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	1.6	2.9	5,250
ノジマ	0.4	0.3	496
良品計画	1.5	—	—
コーナン商事	0.1	0.2	810
バン・パシフィック・インターナショナルホ	—	0.7	2,758
コロワイド	2.3	2.3	4,762
日本瓦斯	—	0.3	704
青山商事	3.8	0.3	462
しまむら	—	0.8	5,875
高島屋	0.6	1.6	4,500
丸井グループ	—	2.1	5,116
イオン	—	1.3	4,465
イズミ	—	0.2	717
ケーズホールディングス	0.7	—	—
アインホールディングス	0.8	—	—
ヤマダホールディングス	2.8	3.5	1,597
アーケランズ	—	0.3	546
パローホールディングス	—	0.3	765
ファーストリテイリング	0.2	0.2	8,330
サンドラッグ	0.6	1	4,170
銀行業 (6.7%)			
いよぎんホールディングス	1.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
めぶきフィナンシャルグループ	7.9	6.8	4,318
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.1	0.1	458
あおぞら銀行	0.9	—	—
三井住友トラスト・ホールディングス	1.6	2.2	8,450
三井住友フィナンシャルグループ	2.1	4.1	44,751
南都銀行	0.2	—	—
セブン銀行	2.9	—	—
みずほフィナンシャルグループ	2.7	5	17,240
トモニホールディングス	1.1	1.4	607
証券、商品先物取引業 (0.0%)			
FPG	0.3	—	—
SBIホールディングス	1.4	—	—
野村ホールディングス	13.2	—	—
松井証券	0.5	0.4	338
保険業 (4.1%)			
SOMPOホールディングス	1.9	5.1	17,681
MS&ADインシュアランスグループホール	2.4	5.9	21,133
東京海上ホールディングス	—	1.2	7,226
その他金融業 (2.6%)			
全国保証	0.5	0.3	1,868
プレミアグループ	—	0.2	402
クレディセゾン	0.5	2.2	7,713
みずほリース	0.1	2	2,280
東京センチュリー	—	1	1,614
アイフル	—	1.6	627
リコーリース	0.1	—	—
オリックス	5.9	2.3	8,427
三菱HCキャピタル	—	2.3	2,508
日本取引所グループ	1.7	1	3,549
イー・ギャランティ	0.4	—	—
不動産業 (0.9%)			
大東建託	0.2	0.3	5,440
サムティホールディングス	—	0.2	551
ヒューリック	1.9	1.6	2,354
オープンハウスグループ	0.8	0.3	1,608
飯田グループホールディングス	1.6	—	—
スターツコーポレーション	0.2	—	—
カチタス	0.3	0.3	563

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
サービス業 (4.1%)				
日本M&Aセンターホールディングス	1.2	—	—	—
UTグループ	—	0.2	653	—
パーソルホールディングス	14.4	—	—	—
カカココム	1	1	2,084	—
ディップ	0.3	0.3	922	—
ベネフィット・ワン	0.4	—	—	—
エムスリー	1	—	—	—
アウトソーシング	1	—	—	—
博報堂DYホールディングス	—	3.5	4,312	—
電通グループ	1	2.1	8,406	—
オリエンタルランド	—	1.3	5,566	—
ユー・エス・エス	1	3	4,068	—

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
サイバーエージェント	2.9	—	—	—
KeepPer 技研	0.1	—	—	—
ジャパンマテリアル	0.4	—	—	—
リクルートホールディングス	2.1	1.3	11,255	—
日本郵政	4.4	2.3	3,689	—
ペイカレント・コンサルティング	0.6	0.9	4,090	—
ジャパンエレベーターサービスホールディン	0.5	—	—	—
セコム	0.4	—	—	—
メイテックグループホールディングス	0.7	0.3	1,023	—
船井総研ホールディングス	0.2	0.3	659	—
合 計	株 数 ・ 金 額	534	460	1,129,744
	銘柄数 < 比率 >	280	256	< 71.3% >

(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
		—	783

○投資信託財産の構成

(2024年7月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,129,744	69.5
コール・ローン等、その他	494,934	30.5
投資信託財産総額	1,624,678	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年7月31日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,602,230,656
コール・ローン等	440,061,100
株式(評価額)	1,129,744,900
未収入金	10,030,910
未収配当金	2,840,955
未収利息	762
差入委託証拠金	19,552,029
(B) 負債	18,605,132
未払金	10,875,132
未払解約金	7,730,000
(C) 純資産総額(A-B)	1,583,625,524
元本	1,701,637,758
次期繰越損益金	△ 118,012,234
(D) 受益権総口数	1,701,637,758口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,306円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,971,186,538円
 期中追加設定元本額 560,805,750円
 期中一部解約元本額 830,354,530円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9306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） 1,701,637,758円

③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は118,012,234円です。

○損益の状況（2024年2月1日～2024年7月31日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	15,458,110
受取配当金	15,348,430
受取利息	109,989
その他収益金	3,196
支払利息	△ 3,505
(B) 有価証券売買損益	86,351,747
売買益	157,800,580
売買損	△ 71,448,833
(C) 先物取引等取引損益	△103,046,800
取引益	21,370,300
取引損	△124,417,100
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,236,943
(E) 前期繰越損益金	△136,974,071
(F) 追加信託差損益金	△ 41,255,750
(G) 解約差損益金	61,454,530
(H) 計(D+E+F+G)	△118,012,234
次期繰越損益金(H)	△118,012,234

(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) 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) (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。