

運用成績表

ロレンシア・プログラム

- (1) 商品投資顧問業者名:ユタカフューチャーズ(株)
- (2) 許可番号:農林水産大臣 経済産業大臣(4)第4号
- (3) 運用戦略名:ロレンシア
- (4) 運用記録の種類:仮想取引及び顧客勘定取引
- (5) 委託手数料の体系:一枚当たり往復600円で計算。銘柄により200円から400円のディスカウントも有り。
- (6) 仮想手数料使用の有無:一枚当たり往復1000円で計算。銘柄により400円から800円のディスカウントも有り。
- (7) 報酬の体系:管理報酬は2%年率 成功報酬は20%で計算
- (8) その他:このプログラムは10年7月1日より実運用に移行。顧客勘定取引期間は3年未満。

年月	月初運用 資産残高	月間追加額	月間引出額	月次修正 運用資産	委託 手数料等	確定損益	評価損益	月次 管理報酬	月次 成功報酬	月次収支	月間 収益率	VAMI	月末運用 資産残高
----	--------------	-------	-------	--------------	------------	------	------	------------	------------	------	-----------	------	--------------

当運用プログラムのトラックレコードは、シミュレーションを含みます。

シミュレーションの運用成績表では、この運用手法により過去に運用を行っていたと仮定した場合、どの程度の運用成績であったかをシミュレーションした結果であり、一般的には以下の点で実際の結果と比し、運用手法の優劣の判断資料として限界があると言われています。

流動性等の理由で、実際にはシミュレーション通りに取引が行えない場合があり、実際の取引結果と異なる場合があること。
過去のデータを基に後追いで取引システムを考案できることから、良い結果を出すことが可能であること。

07/01	50,000,000	0	0	50,000,000	106,000	4,743,900	-2,441,400	83,333	59,033	236,134	0.47	1,004.72	50,236,134
07/02	50,236,134	0	0	50,236,134	94,500	-1,330,000	503,200	83,727	306,174	1,224,699	2.44	1,029.22	51,460,833
07/03	51,460,833	0	0	51,460,833	85,500	199,300	2,162,500	85,768	354,566	1,418,266	2.76	1,057.58	52,879,099
07/04	52,879,099	0	0	52,879,099	103,500	1,541,900	-2,029,000	88,132	0	-2,737,732	-5.18	1,002.83	50,141,367
07/05	50,141,367	0	0	50,141,367	101,000	-946,700	609,650	83,569	0	1,608,381	3.21	1,034.99	51,749,748
07/06	51,749,748	0	0	51,749,748	109,000	-1,742,700	197,050	86,250	0	-2,241,550	-4.33	990.16	49,508,198
07/07	49,508,198	0	0	49,508,198	99,500	41,000	1,137,150	82,514	0	898,586	1.82	1,008.14	50,406,785
07/08	50,406,785	0	0	50,406,785	91,500	4,564,400	-1,056,100	84,011	0	2,287,139	4.54	1,053.88	52,693,923
07/09	52,693,923	0	0	52,693,923	50,000	1,459,300	3,603,150	87,823	1,169,110	4,861,617	9.23	1,151.11	57,555,540
07/10	57,555,540	0	0	57,555,540	110,000	1,845,100	-3,242,650	95,926	0	-5,096,626	-8.86	1,049.18	52,458,914
07/11	52,458,914	0	0	52,458,914	109,500	-1,507,600	248,100	87,432	0	1,895,718	3.61	1,087.09	54,354,633
07/12	54,354,633	0	0	54,354,633	65,000	-325,100	2,699,700	90,591	0	2,035,909	3.75	1,127.81	56,390,542
08/01	56,390,542	0	0	56,390,542	105,000	4,050,600	-2,523,150	93,984	0	-1,266,234	-2.25	1,102.49	55,124,307
08/02	55,124,307	0	0	55,124,307	95,500	4,069,600	2,834,950	91,874	1,380,918	7,954,908	14.43	1,261.58	63,079,216
08/03	63,079,216	0	0	63,079,216	91,500	3,897,200	-933,000	105,132	4,823	19,295	0.03	1,261.97	63,098,511
08/04	63,098,511	0	0	63,098,511	100,500	1,402,100	-527,350	105,164	340,517	1,362,069	2.16	1,289.21	64,460,579
08/05	64,460,579	0	0	64,460,579	91,500	3,600,000	407,350	107,434	885,453	3,541,813	5.49	1,360.05	68,002,392
08/06	68,002,392	0	0	68,002,392	93,000	1,168,800	167,700	113,337	163,162	652,651	0.96	1,373.10	68,655,043
08/07	68,655,043	0	0	68,655,043	113,000	5,522,100	37,850	114,425	1,055,564	4,222,261	6.15	1,457.55	72,877,304

シミュレーション及び過去の運用結果は、将来の結果を示すものではありません。運用成績は各項目ごと各口座の合算値をもとに作成しています。

ユタカ・フューチャーズ株式会社

運用成績表

ロレンシア・プログラム

年月	月初運用 資産残高	月間追加額	月間引出額	月次修正 運用資産	委託 手数料等	確定損益	評価損益	月次 管理報酬	月次 成功報酬	月次収支	月間 収益率	VAMI	月末運用 資産残高
08/08	72,877,304	0	0	72,877,304	97,500	2,870,700	-120,150	121,462	518,247	2,072,991	2.84	1,499.01	74,950,295
08/09	74,950,295	0	0	74,950,295	101,500	1,794,800	2,568,700	124,917	871,746	3,486,987	4.65	1,568.75	78,437,281
08/10	78,437,281	0	0	78,437,281	100,500	13,385,700	314,500	130,729	2,200,154	8,800,617	11.22	1,744.76	87,237,899
08/11	87,237,899	0	0	87,237,899	84,500	-532,800	-718,850	145,396	0	-1,711,546	-1.96	1,710.53	85,526,352
08/12	85,526,352	0	0	85,526,352	91,000	1,957,800	745,300	142,544	313,572	2,965,834	3.47	1,769.84	88,492,186
09/01	88,492,186	0	0	88,492,186	107,000	-460,200	-1,009,700	147,487	0	-2,362,687	-2.67	1,722.59	86,129,499
09/02	86,129,499	0	0	86,129,499	96,500	574,400	69,800	143,549	0	1,510,351	1.75	1,752.80	87,639,850
09/03	87,639,850	0	0	87,639,850	115,500	-1,777,200	476,100	146,066	0	-1,516,966	-1.73	1,722.46	86,122,884
09/04	86,122,884	0	0	86,122,884	105,000	1,189,100	346,950	143,538	0	916,412	1.06	1,740.79	87,039,295
09/05	87,039,295	0	0	87,039,295	73,000	-1,208,800	543,150	145,065	0	-1,157,665	-1.33	1,717.63	85,881,630
09/06	85,881,630	0	0	85,881,630	114,000	4,931,000	-1,683,900	143,136	0	2,560,814	2.98	1,768.85	88,442,444
09/07	88,442,444	0	0	88,442,444	101,000	3,303,500	805,650	147,404	1,119,180	4,526,466	5.12	1,859.38	92,968,910
09/08	92,968,910	0	0	92,968,910	111,000	-1,105,000	1,650	154,948	0	-2,063,948	-2.22	1,818.10	90,904,962
09/09	90,904,962	0	0	90,904,962	98,000	224,000	-210,000	151,508	0	-139,158	-0.15	1,815.32	90,765,803
09/10	90,765,803	0	0	90,765,803	94,000	3,784,100	-241,900	151,276	279,564	3,321,360	3.66	1,881.74	94,087,163
09/11	94,087,163	0	0	94,087,163	101,000	-764,500	124,250	156,812	0	-555,162	-0.59	1,870.64	93,532,001
09/12	93,532,001	0	0	93,532,001	97,500	-3,654,700	3,015,400	155,887	0	-919,437	-0.98	1,852.25	92,612,564
10/01	92,612,564	0	0	92,612,564	74,500	4,804,200	-457,500	154,354	0	1,176,946	1.27	1,875.79	93,789,510
10/02	93,789,510	0	0	93,789,510	109,500	-1,868,000	-2,065,700	156,316	0	-3,632,516	-3.87	1,803.14	90,156,994
10/03	90,156,994	0	0	90,156,994	114,000	-2,021,400	1,598,350	150,262	0	1,492,388	1.66	1,832.99	91,649,383
10/04	91,649,383	0	0	91,649,383	98,500	2,013,900	-579,350	152,749	0	-316,549	-0.35	1,826.66	91,332,834
10/05	91,332,834	0	0	91,332,834	86,000	3,527,500	-320,400	152,221	175,980	3,458,249	3.79	1,895.82	94,791,082
10/06	94,791,082	0	0	94,791,082	111,500	-2,328,900	-1,136,585	-227,317	0	157,985	-1.20	1,873.09	93,654,497

2010年7月1日から、当プログラム実売買を開始。ただしプログラム移行期間のため、シミュレーション数値との差違があります。

10/07	0	275,000,000	0	275,000,000	161,600	-4,394,300	-67,200	458,332	0	-4,919,832	-1.79	1,000.00	270,080,168
10/08	270,080,168	25,000,000	1,418,625	293,661,543	216,500	1,094,400	-259,050	489,435	0	413,115	0.14	983.49	294,074,658
10/09	294,074,658	0	6,425,215	287,649,443	139,300	2,712,700	-152,150	479,414	0	2,340,186	0.81	991.49	289,989,629
10/10	289,989,629	0	3,462,999	286,526,630	139,300	-1,810,300	634,950	477,543	0	-1,500,743	-0.52	986.30	285,025,887
10/11	285,025,887	0	28,254,901	256,770,986	167,400	702,600	706,100	427,949	0	345,801	0.13	987.63	257,116,787
10/12	257,116,787	0	2,984,526	254,132,261	140,000	5,392,300	320,000	423,553	252,233	4,330,414	1.70	1,004.46	258,462,675
11/01	258,462,675	0	14,981,060	243,481,615	162,800	-2,275,800	871,200	405,801	0	-2,130,401	-0.87	995.67	241,351,214
11/02	241,351,214	0	3,926,134	237,425,080	103,800	9,099,700	0	395,707	1,140,478	6,692,315	2.82	1,023.73	244,117,395
11/03	244,117,395	0	2,289,922	241,827,473	28,300	-2,282,800	1,207,050	403,045	0	-1,478,795	-0.61	1,017.47	240,348,678
11/04	240,348,678	0	10,483,542	229,865,136	80,200	4,558,800	0	383,107	297,969	2,670,674	1.16	1,029.29	232,535,810
11/05	232,535,810	0	10,803,951	221,731,859	55,300	-2,903,000	209,800	369,552	0	-3,062,752	-1.38	1,015.08	218,669,107
11/06	218,669,107	0	114,314,293	104,354,814	54,000	-710,400	-18,800	173,924	0	-1,112,924	-1.07	1,004.25	103,241,890

シミュレーション及び過去の運用結果は、将来の結果を示すものではありません。運用成績は各項目ごと各口座の合算値をもとに作成しています。

ユタカ・フューチャーズ株式会社

運用成績表

ロレンシア・プログラム

年月	月初運用 資産残高	月間追加額	月間引出額	月次修正 運用資産	委託 手数料等	確定損益	評価損益	月次 管理報酬	月次 成功報酬	月次収支	月間 収益率	VAMI	月末運用 資産残高
11/07	103,241,890	30,000,000	1,170,093	132,071,797	68,200	-1,634,600	393,100	220,119	0	-1,442,819	-1.09	993.28	130,628,978
11/08	130,628,978	0	725,553	129,903,425	96,600	3,709,600	1,412,550	216,505	98,691	4,413,854	3.40	1,027.03	134,317,279
11/09	134,317,279	0	1,981,765	132,335,514	115,600	2,963,300	126,850	220,558	180,010	1,277,032	0.96	1,036.94	133,612,546
11/10	133,612,546	0	26,218,050	107,394,496	143,100	647,900	0	178,990	68,411	273,649	0.25	1,039.58	107,668,145
11/11	107,668,145	0	1,223,703	106,444,442	66,500	4,487,500	182,100	177,406	898,438	3,593,756	3.38	1,074.68	110,038,198
11/12	110,038,198	0	1,119,653	108,918,545	101,200	1,588,800	0	181,530	245,033	980,137	0.90	1,084.35	109,898,682
12/01	109,898,682	0	2,471,405	107,427,277	103,800	3,693,600	0	179,044	702,910	2,811,646	2.62	1,112.73	110,238,923
12/02	110,238,923	0	2,111,485	108,127,438	63,600	2,173,100	0	180,211	398,577	1,594,312	1.47	1,129.14	109,721,750
12/03	109,721,750	0	772,004	108,949,746	115,500	-4,945,100	501,450	181,582	0	-4,625,232	-4.25	1,081.20	104,324,514
12/04	104,324,514	0	676,422	103,648,092	63,800	615,400	34,800	172,746	0	-23,996	-0.02	1,080.95	103,624,096

シミュレーション及び過去の運用結果は、将来の結果を示すものではありません。運用成績は各項目ごと各口座の合算値をもとに作成しています。

ユタカ・フューチャーズ株式会社