

スーパーファンド・ジャパン サブファンド・ブルー
受益者の皆様へ

スーパーファンド・ジャパン・トレーディング
(ケイマン)リミテッド
Superfund Japan Trading (Cayman) Limited

2019年12月17日

スーパーファンド・ジャパン サブファンド・ブルーの投資戦略 及びサブファンド名称等の変更について

平素よりスーパーファンド・ジャパンをご愛顧いただき、ありがとうございます。

2019年12月17日付のご通知によりお知らせしたように、このたび、外国籍投資信託スーパーファンド・ジャパン(以下、「当ファンド」)の5つあるサブファンドの1つ、サブファンド・ブルー(以下、「当サブファンド」)のマスターファンドであるスーパーファンド・ブルーSPCの投資戦略に重要な変更を行いますので、お知らせいたします。

ユニークな新投資戦略「シャープパリティ戦略」

我々の目標は、安定した長期的なパフォーマンスを生み出す取引戦略を投資家に提供することです。

スーパーファンドは最近、シャープパリティと呼ばれる世界的にユニークで新しい取引アプローチを開発いたしました(以下「スーパーファンド・シャープパリティ戦略」)。スーパーファンド・シャープパリティ戦略の目的は、株式、債券及び商品市場へのバランス投資による付加価値を通じて、安定した長期的なパフォーマンスを生み出すことです。市場のウェイト付けは、いわゆるシャープレシオを使用して調整されます。当該指標は、投資の収益が資産のリスクに匹敵するかどうかを示します。

スーパーファンド・シャープパリティ戦略では、リスク・リターン・レシオが最大となる市場セグメントをポートフォリオ内で最も重くウェイト付けします。これにより、戦略を様々な市場変動に適応させることができます。収益確保の機会をより生かすため、ファンドのサブシステムが各マーケットの下落に対してヘッジする可能性もあります。運用手法の詳細につきましては、更新された請求目論見書に掲載しております。また、当サブファンドの販売報酬が年率1%から0.6%に削減されます。その他諸費用含め、今後もファンドの継続的な運用コストの低減に努めてまいります。

上記の変更を実施するため、2020年1月1日付けで、当サブファンドのマスターファンドである「スーパーファンド・ブルーSPC 分別ポートフォリオ I」(以下、「分別ポートフォリオ」)に新しくシャープパリティ戦略が組み込まれ、分別ポートフォリオの名称が「スーパーファンド SPC 分別ポートフォリオ・シャープパリティ」と変更されます。それに伴い、同日付けで当サブファンドも名称が「スーパーファンド・ジャパン サブファンド・ブルー」から、「スーパーファンド・ジャパン サブファンド・シャープパリティ」と変更されます。また、当ファンドのマスターファンドである「スーパーファンド・ブルーSPC」及びアンダーライニング・マスターファンドである「スーパーファンド・ブルー・マスターSPC」は変更され、変更後は、「スーパーファンド SPC」が当サブファンドのマスターファンドとなり、同ファンドが直接市場に投資をいたします。



投資家の皆様は現在保有されているのと同じ純資産残高のまま、新しい「スーパーファンド・ジャパン サブファンド・シャープパリティ」の対応するクラスのシェアを自動的に獲得されます。

我々は、新しい投資戦略が投資家の皆様の最大の利益につながることを確信しています。

その他

スーパーファンドは、今回の新たな戦略への切り替えにより、現状又は今後の市場環境下におきましてもパフォーマンスを生み出す努力を続けてまいります。当サブファンドの受益者の皆様には、今後も継続して保有いただきたいと考えておりますが、2019年12月27日まで(当社必着)にはサブファンド・ブルーとして、またそれ以降は、サブファンド・シャープパリティとして、全部又は一部の受益証券を適正な価額で買戻しただけです(買戻し停止期間や買戻し費用のご負担はありません)。

今後も、投資家の皆様のニーズにお応えすべく、革新的で最新の金融商品を提供するとともに、関係コストの削減や効率化を推進に努め、リターンの向上を目指しています。

請求目論見書のご請求又はご不明な点がございましたら、下記スーパーファンド・ジャパン株式会社までお問い合わせください。

スーパーファンド・ジャパン株式会社

代表 03-3508-6700(平日 9:00~18:00)

ウェブサイト www.superfund.co.jp

E-mail tokyo@superfund.com

重要事項: この通知は情報の提供のみを目的とし、投資の勧誘・売買を目的としたものではありません。投資勧誘は法律により許可されている地域のみにて行われ、最新の目論見書等にのっとり方法で行われます。投資家の皆様は適切な投資助言を受け、法律、規制、税制に従ってください。スーパーファンドの購入は各目論見書等に従って行われます。この文書に含まれる情報のみでは購入はできません。関連投資会社であるスーパーファンドグループが運用・管理する投資信託はすべて、変動率の高い投資を行うものです。先物取引はレバレッジを用い、変動率は高く、お預りする純資産が多変動する可能性もあります。従って、投資家の皆様が投資元本のすべてを失う可能性を否定するものではありません(投資元本以上の損失はありません)。

