

スーパーファンド・ジャパン・グリーンB(ゴールド円クラス)の3月の運用実績は2.01%でした。

「スーパーファンド・グリーン」は主に、世界中の流動性が高い約150の金融先物市場と商品先物市場を投資対象とする中長期トレンドフォローを採用するマネージドフューチャーズ戦略を利用しています。より高度な分散投資を実現するために、「スーパーファンド・グリーン」は、予測モデル、カウンター・トレンド(逆張り)、短期トレンドフォローなどの短期投資戦略も利用し、上げ相場と下げ相場の両方で比較的高いリターンを上げることを目指します。「スーパーファンド・グリーン」のマネージドフューチャーズ戦略は、人間の感情を効率的に排除する独自の完全自動化トレーディング・システムに基づいており、1996年3月以降、長期間にわたり成功裏に利用されています。リスク総量は常時監視され、市場の変動性に依りて個々の取引ポジションが継続的に調整されます。「スーパーファンド・グリーン」は他の資産クラスとの長期的な相関性が比較的低いため、既存の様々なポートフォリオに追加することでポートフォリオの最適化に役立ちます。「スーパーファンド・グリーン・ゴールド」は、実証済みのマネージドフューチャーズ戦略「スーパーファンド・グリーン」と、金価格の潜在的な強い上昇の可能性を組み合わせた投資戦略です。そのため、投資家はスーパーファンド・グリーンと金価格の両方のパフォーマンスを享受することができます。

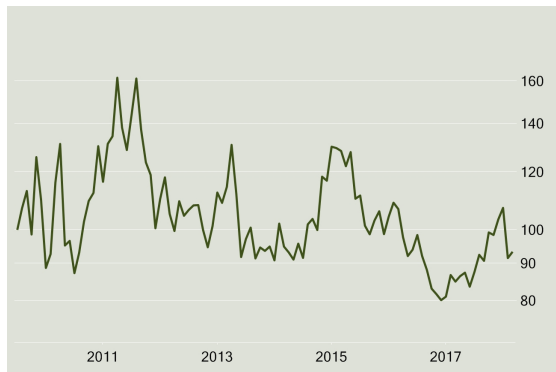
基準価額

| | 1月 | 2月 | 3月 | 4月 | 5月 | 6月 | 7月 | 8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 1-12月 |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|
| 2009 | | | | | | | | 107.08 | 113.08 | 98.55 | 125.83 | 109.84 | 9.84% |
| 2010 | 88.67 | 92.66 | 116.11 | 131.19 | 95.18 | 96.59 | 87.23 | 93.09 | 102.61 | 109.56 | 112.39 | 130.26 | 18.59% |
| 2011 | 116.41 | 131.22 | 134.38 | 161.70 | 138.12 | 128.68 | 143.79 | 161.29 | 137.23 | 123.75 | 118.97 | 100.49 | -22.85% |
| 2012 | 110.21 | 118.04 | 105.13 | 99.65 | 109.47 | 104.56 | 106.49 | 108.04 | 108.14 | 100.02 | 94.65 | 101.21 | 0.72% |
| 2013 | 112.52 | 108.90 | 114.54 | 130.81 | 111.90 | 91.77 | 97.13 | 100.72 | 91.37 | 94.59 | 93.58 | 94.88 | -6.25% |
| 2014 | 90.83 | 102.01 | 94.86 | 93.13 | 91.05 | 95.74 | 91.53 | 101.76 | 103.52 | 99.95 | 118.30 | 116.80 | 23.10% |
| 2015 | 130.04 | 129.48 | 128.29 | 122.28 | 127.85 | 110.33 | 111.46 | 101.32 | 98.62 | 102.99 | 106.05 | 98.67 | -15.52% |
| 2016 | 104.30 | 108.96 | 106.82 | 97.68 | 92.07 | 93.92 | 98.39 | 92.09 | 88.14 | 83.06 | 81.64 | 80.10 | -18.82% |
| 2017 | 80.99 | 86.71 | 84.94 | 86.42 | 87.36 | 83.58 | 87.58 | 92.43 | 90.68 | 99.20 | 98.40 | 103.35 | 29.03% |
| 2018 | 107.19 | 91.48 | 93.32 | | | | | | | | | | -9.70% |

運用実績

| | 1月 | 2月 | 3月 | 4月 | 5月 | 6月 | 7月 | 8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 1-12月 |
|------|---------|---------|---------|--------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|--------|---------|---------|
| 2009 | | | | | | | | 7.08% | 5.60% | -12.85% | 27.68% | -12.71% | 9.84% |
| 2010 | -19.27% | 4.50% | 25.31% | 12.99% | -27.45% | 1.48% | -9.69% | 6.72% | 10.23% | 6.77% | 2.58% | 15.90% | 18.59% |
| 2011 | -10.63% | 12.72% | 2.41% | 20.33% | -14.58% | -6.83% | 11.74% | 12.17% | -14.92% | -9.82% | -3.86% | -15.53% | -22.85% |
| 2012 | 9.67% | 7.10% | -10.94% | -5.21% | 9.85% | -4.49% | 1.85% | 1.46% | 0.09% | -7.51% | -5.37% | 6.93% | 0.72% |
| 2013 | 11.17% | -3.22% | 5.18% | 14.20% | -14.46% | -17.99% | 5.84% | 3.70% | -9.28% | 3.52% | -1.07% | 1.39% | -6.25% |
| 2014 | -4.27% | 12.31% | -7.01% | -1.82% | -2.23% | 5.15% | -4.40% | 11.18% | 1.73% | -3.45% | 18.36% | -1.27% | 23.10% |
| 2015 | 11.34% | -0.43% | -0.92% | -4.68% | 4.56% | -13.70% | 1.02% | -9.10% | -2.66% | 4.43% | 2.97% | -6.96% | -15.52% |
| 2016 | 5.71% | 4.47% | -1.96% | -8.56% | -5.74% | 2.01% | 4.76% | -6.40% | -4.29% | -5.76% | -1.71% | -1.89% | -18.82% |
| 2017 | 1.11% | 7.06% | -2.04% | 1.74% | 1.09% | -4.33% | 4.79% | 5.54% | -1.89% | 9.40% | -0.81% | 5.03% | 29.03% |
| 2018 | 3.72% | -14.66% | 2.01% | | | | | | | | | | -9.70% |

一口当り純資産価額の推移



リターン値

| | |
|----------|--------|
| 設定来 | -6.68% |
| 年率複利リターン | -0.79% |
| 年初来 | -9.70% |
| 月間平均 | -0.07% |
| 月間最高 | 27.68% |

リスク値

| | |
|---------------|--------|
| 年間標準偏差 | 32.60% |
| 月間標準偏差 | 9.41% |
| 取引あたりの初期最大リスク | 1.00% |
| 純資産に対する標準証拠金率 | 20% |
| 最大下落率 | 50.46% |
| 収益プラスとなった月の割合 | 52.88% |

効率性

| | |
|------------------------------------|-------|
| シャープレシオ** | -0.02 |
| シャープレシオ**(1年) | 0.47 |
| ソルティエノレシオ**(年換算) | -0.04 |
| ソルティエノレシオ**(1年) | 0.52 |
| 米国株価指数(S&P500)との相関性 | 0.36 |
| 欧州株価指数(EURO STOXX 50)との相関性 | 0.26 |
| アジア株価指数(Hang Seng)との相関性 | 0.20 |
| 日本株価指数(日経225)との相関性 | 0.16 |
| マネージドフューチャーズ指数との相関性 ¹⁾ | 0.75 |
| 株式マーケットニュートラル指数との相関性 ²⁾ | 0.18 |

** 調整済(無リスク収益=0%)

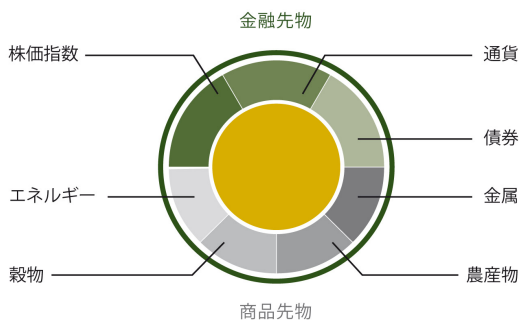
¹⁾ CISDM CTA Equal Weighted Index

²⁾ CISDM Equity Market Neutral Index

ファンド情報

| | |
|---------------|---------------------------------------|
| 形態 | ケイマン籍 オープンエンド契約型外国投資信託 |
| 通貨 | 日本円 |
| 管理料等 | 純資産価額の年率3.36%(上限) |
| 代行協会員報酬 | 純資産価額の年率0.5% |
| マスターファンドの販売報酬 | 日本で販売された受益証券の純資産価額の年率1.8% |
| マスターファンドの成功報酬 | 純資産増加額の25%(ハイウォーターマーク方式) |
| 申込み | 2ヵ月ごと |
| 買戻請求 | 毎月 |
| 管理会社 | Superfund Japan Trading (Cayman) Ltd. |
| 受託会社 | Harnneys Trustees (Cayman) Ltd. |
| 代行協会員 | スーパーファンド・ジャパン株式会社 |

スーパーファンドの分散投資対象



上記は単なる概念図です。各市場への投資比率は市場の状況により継続的に調整されます。

免責事項: 本資料は、投資に係る参考情報を提供することを目的とし、代行協会員が翻訳・作成した参考資料であり、特定の有価証券の勧誘を目的として作成したものではありません。金融商品取引法に基づく法定の開示資料ではありません。本資料に記載されている運用実績は、すべての間接費用(申込手数料及び税金(は除く)差し引き後の純収益で表しています。これらの過去の運用実績は将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。本資料に記載されている情報は、信頼性が高い情報源よりまとめられたものですが、情報に関する正確性、完全性、信頼性を保証するものではありません。情報等の利用により生じた損害等に対し、代行協会員及び販売会社等は一切責任を負いません。世界各国の経済・金融状況の変化、為替や商品市況を含む各国市場の変動、及びそれらに関する外部評価の変化等によりファンドの価格が変動し、投資元本を大きく割り込む可能性があり、場合によっては投資金額全額を失う可能性があります。お申込みの際には、投資信託説明書(目録見書)などで必ず詳細をご確認の上、ご自身でご判断ください。

出典: Superfund, TeleTrader

