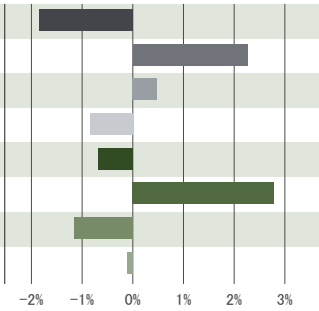
スーパーファンド・トレンド マネージャーズ・レポート

2026年9月

セクター別の寄与率

セクター	配分比率	寄与率
株価指数	31 %	−1.82 %
債券	15 %	2.25 %
金利	9 %	0.49 %
通貨	20 %	−0.84 %
穀物	3 %	−0.67 %
エネルギー	10 %	2.79 %
金属	4 %	−1.16 %
農産物	8 %	−0.08 %
合計	100 %	0.96 %

パフォーマンスへの寄与率



上記データは全てSuperfund Trend USD SICAVのものです。セクター配分比率のチャートは、該当報告期間において、Superfund Trend USD SICAVの先物契約・先渡契約の未決済ポジションを維持するのに必要とされる予想証拠金の比率を表しています。必要な証拠金は市場の状況に応じて急激に変化するため、この配分比率は単なる参考値として捉えてください。なお、スーパーファンドの他のファンドは、Superfund Trend USD SICAVと類似の投資戦略を採用していますが、それらのファンドの証拠金配分比率は、取引対象の市場に固有の規制や制限、運用資産額の大小、売買のタイミング等、複数の要因(これらに限定されません)に応じて異なります。

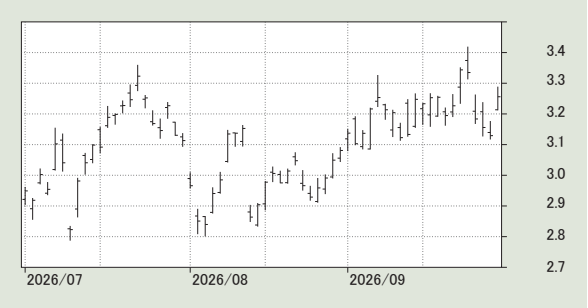
ポジション分析 (月次パフォーマンスへの寄与率)

プラス寄与 上位3位	ポジション	寄与率
NYMEX RBOBガス先物	ロング(買い)/ショート(売り)	0.86 %
NYMEX灯油先物	ロング(買い)/ショート(売り)	0.58 %
IPE軽油先物	ロング(買い)/ショート(売り)	0.50 %

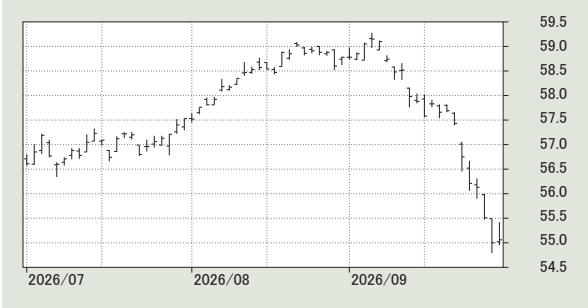
マイナス寄与 下位3位	ポジション	寄与率
CME_メキシコペソ先物	ロング(買い)/ショート(売り)	−0.52 %
CME_EuroYen	ロング(買い)/ショート(売り)	−0.45 %
NYCE綿花先物	ロング(買い)/ショート(売り)	−0.52 %

マーケット分析 (月次パフォーマンスへの寄与率)

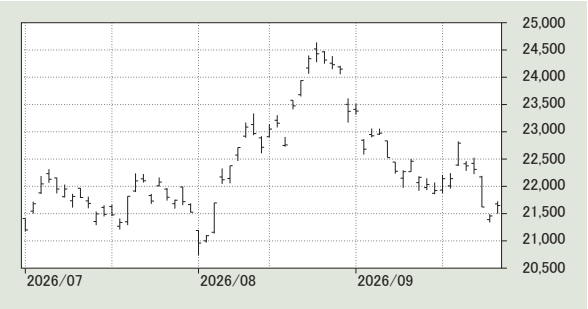
NYMEX RBOBガス先物　ロング(買い)/ショート(売り) | 0.86 %



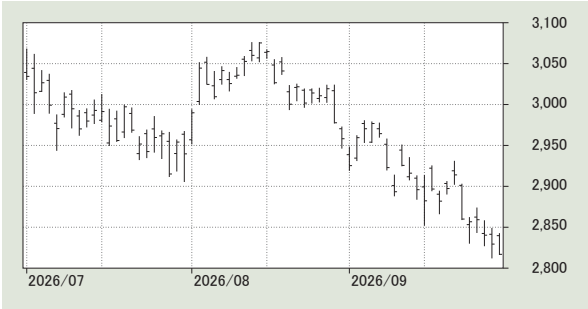
CME_メキシコペソ先物　ロング(買い)/ショート(売り) | −0.52 %



TCE金先物　ロング(買い)/ショート(売り) | −0.41 %



CME_mRussel2k_IX　ロング(買い)/ショート(売り) | −0.39 %



重要事項:過去の実績(シミュレーションまたは実際の結果にかかわらず)は将来のパフォーマンスを保証するものではありません。本資料は、Superfund Trend SICAVの受益者を対象に作成されたマネージャーズレポートを、スーパーファンド・ジャパン:サブファンド・トレンドの受益者への情報提供のため、日本語訳したレポートです。本資料は、販売を提案するものでも、投資を促すものでもありません。スーパーファンド・ジャパンへの投資をご検討される際は、投資信託説明書(目論見書等)の内容(特にリスクや諸費用等)をご確認のうえ、ご判断ください。この情報は、個人の目標、資産状況、またはニーズを考慮せずに作成されています。そのため、投資を検討する前に、その適切性・適合性をご自身の状況に照らし合わせて考慮する必要があります。投資信託説明書(目論見書等)についての確認や質問等は、販売会社や販売取次会社、及び取扱う金融商品仲介業者等にお気軽にお問い合わせください。Superfundのファンドは投機的な投資であり、先物やオプションの取引では大きな損失が発生するリスクがあります。市場条件により30%から50%程度の基準価額の下落が発生する可能性があり、それを超える基準価額の下落も発生する可能性があります。元本の全損も排除できません。日本国内からの投資においては、スーパーファンドのすべてのファンドは為替変動が純資産価額の変動に大きく影響致します。過去の実績は、将来のパフォーマンスを保証するものではありません。出典:Superfund, TeleTrader

免責事項　－必ずお読みください－

本資料は、スーパーファンド・ジャパン株式会社が作成したものであり、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。また、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、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。

本資料に記載されているマネージャーズレポートは、Superfund Trend USD SICAV のものです。本資料は、Superfund Trend SICAV の受益者を対象に作成されたマネージャーズレポートを、スーパーファンド・ジャパン・サブファンド・トレンド（旧称：グリーン）の受益者への情報提供のため、日本語訳したレポートです
また、本資料に記載されている Superfund Trend Master【旧 Superfund Cayman】（販売終了）の運用実績は、各スーパーファンド・トレンド戦略（A、B、C）のうち、最も長い実績を持つファンドの過去の運用実績等を示したものです。これらは閲覧・参照用データとしてのみ記載しており、日本において募集されているファンド若しくはそのマスターファンドとは異なる商品であることをご理解ください。また、同じ投資戦略を採用するスーパーファンドのファンドの運用実績は、手数料・報酬体系の違い、運用資産額の規模、レバレッジの違い、売買のタイミング等、複数の要因（これらに限定されません）に応じて異なります。スーパーファンドの特定のファンドに対する投資に伴うリスク、手数料、報酬、費用等の詳細については、該当の目論見書を必ずお読みください。

スーパーファンドが取扱うファンドは投機性の高い金融商品です。主なリスクには、市場リスク、金利リスク、信用リスク、為替リスク、デリバティブ取引リスクがあります。ファンドの純資産価額は各市場などの価格変動によって大きな影響を受けるほか、レバレッジを伴う先物やオプション取引は、急激な損失を被る恐れがあるため、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。

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なく、将来の運用成果、市場環境の変動等を保証するものでもありません。また予想指数は、分析時の見解に基づいたものであり、これらの予想指数が変更されても本資料を再発行する義務はありません。本資料に記載されている情報等の利用により生じた損害等に対し、当社は一切責任を負いません。

■会社概要■

商号等：	スーパーファンド・ジャパン株式会社 金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第 98 号
本店所在地：	東京都港区虎ノ門二丁目９番１号　虎ノ門ヒルズ江戸見坂テラス１１階
加入協会等：	日本証券業協会、日本投資者保護基金
指定紛争解決機関：	特定非営利活動法人　証券・金融商品あっせん相談センター
資本金：	275 百万円 (2026 年 3 月末現在)
主な事業：	金融商品取引業
設立：	2005 年 11 月 1 日
連絡先：	TEL 03 3508 6700　　FAX 03 3508 6730
ホームページ：	http://www.superfund.co.jp