スーパーファンド・ジャパン・トレンド（ゴールド米ドル・クラス）　2026年 9月

スーパーファンド・ジャパン・トレンド（ゴールド米ドル・クラス）の9月の運用実績は-5.62 %でした。

スーパーファンドの「トレンド（旧称グリーン）戦略」は、世界中の流動性が高い多様な商品先物と金融先物市場を投資対象とするマネージドフューチャーズ戦略です。中長期のトレンド戦略を主要戦略とし、マーケット環境に合わせ、相場上昇時、下落時または低いボラティリティに関わらず機動的なアプローチにより、収益確保を目指します。またシステムがファンドのリスク総量を継続的に監視し、市場の変動性に応じて個々の取引ポジションが継続的に調整されます。スーパーファンドの「トレンド戦略」は他の資産クラスとの長期的な相関性が低いため、ポートフォリオの分散化に効果があると期待されます。スーパーファンドのトレンド・ゴールドクラスは、「マネージドフューチャーズ戦略」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のトレンド戦略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
2018	1.02	0.89	0.91	0.89	0.86	0.80	0.78	0.76	0.71	0.66	0.67	0.70	−26.32 %
2019	0.75	0.77	0.77	0.80	0.78	0.89	0.91	1.03	0.94	0.94	0.94	0.98	+40.00 %
2020	1.07	1.05	1.09	1.18	1.19	1.19	1.37	1.36	1.21	1.15	1.08	1.20	+22.45 %
2021	1.18	1.18	1.18	1.22	1.38	1.26	1.32	1.32	1.26	1.32	1.22	1.29	+7.50 %
2022	1.27	1.40	1.48	1.47	1.41	1.26	1.24	1.08	1.06	1.02	1.02	1.01	−21.71 %
2023	0.99	0.96	0.87	0.86	0.84	0.83	0.83	0.74	0.71	0.74	0.75	0.80	−20.79 %
2024	0.75	0.79	0.91	0.93	0.89	0.91	0.89	0.87	0.92	0.91	0.89	0.83	+3.75 %
2025	0.89	0.86	0.91	0.93	0.92	0.92	0.94	1.01	1.23	1.31	1.40	1.52	+83.13 %
2026	1.83	2.15	1.87	1.93	1.90	1.63	1.58	1.78	1.68				+10.53 %

運用実績

2018	+7.37 %	−12.75 %	+2.25 %	−2.20 %	−3.37 %	−6.98 %	−2.50 %	−2.56 %	−6.58 %	−7.04 %	+1.52 %	+4.48 %	−26.32 %
2019	+7.14 %	+2.67 %	+0.00 %	+3.90 %	−2.50 %	+14.10 %	+2.25 %	+13.19 %	−8.74 %	+0.00 %	+0.00 %	+4.26 %	+40.00 %
2020	+9.18 %	−1.87 %	+3.81 %	+8.26 %	+0.85 %	+0.00 %	+15.13 %	−0.73 %	−11.03 %	−4.96 %	−6.09 %	+11.11 %	+22.45 %
2021	−1.67 %	+0.00 %	+0.00 %	+3.39 %	+13.11 %	−8.70 %	+4.76 %	+0.00 %	−4.55 %	+4.76 %	−7.58 %	+5.74 %	+7.50 %
2022	−1.55 %	+10.24 %	+5.71 %	−0.68 %	−4.08 %	−10.64 %	−1.59 %	−12.90 %	−1.85 %	−3.77 %	+0.00 %	−0.98 %	−21.71 %
2023	−1.98 %	−3.03 %	−9.38 %	−1.15 %	−2.33 %	−1.19 %	+0.00 %	−10.84 %	−4.05 %	+4.23 %	+1.35 %	+6.67 %	−20.79 %
2024	−6.25 %	+5.33 %	+15.19 %	+2.20 %	−4.30 %	+2.25 %	−2.20 %	−2.25 %	+5.75 %	−1.09 %	−2.20 %	−6.74 %	+3.75 %
2025	+7.23 %	−3.37 %	+5.81 %	+2.20 %	−1.08 %	+0.00 %	+2.17 %	+7.45 %	+21.78 %	+6.50 %	+6.87 %	+8.57 %	+83.13 %
2026	+20.39 %	+17.49 %	−13.02 %	+3.21 %	−1.55 %	−14.21 %	−3.07 %	+12.66 %	−5.62 %				+10.53 %

一口当り純資産価額の推移



リターン値

設定来	76.84 %
年率複利リターン	6.73 %
年初来	10.53 %
月間平均	0.54 %
月間最高	21.78 %

リスク値

年間標準偏差	24.78 %
月間標準偏差	7.15 %
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	52.03 %
収益プラスとなった月の割合	42.86 %

効率性

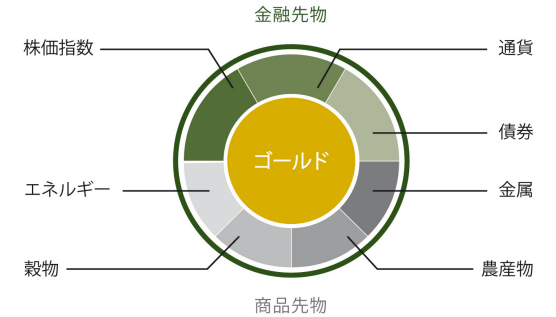
シャープレシオ**	0.27
シャープレシオ**（1年）	0.95
ソルティーノレシオ**（年換算）	0.52
ソルティーノレシオ**（1年）	2.04
米国株価指数（S&P500）との相関性	0.25
欧州株価指数（EURO STOXX 50）との相関性	0.20
アジア株価指数（Hang Seng）との相関性	0.23
日本株価指数（日経225）との相関性	0.14
マネージドフューチャーズ指数との相関性[1]	0.57
株式マーケットニュートラル指数との相関性[2]	0.85

** 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	米ドル
管理報酬（マスターファンドのレベル）	純資産価額の年率2.0%
販売会社報酬（マスターファンドのレベル）	純資産価額の年率1.8%
代行協会員報酬	純資産価額の年率0.1%
成功報酬（マスターファンドのレベル）	純資産増加額の20%（ハイウォーターマーク方式）
申込み	毎週
買戻請求	毎週
管理会社	Superfund Japan Trading (Cayman) Ltd.
受託会社	Ascentium (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。

SUPERFUND
THE FUTURE OF INVESTING

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なく、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。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（目論見書）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