

Superfund Green Q-AG¹

2024年12月

旧ファンド名: Superfund Q-AG

SUPERFUND GREEN Q-AG¹の12月の運用実績は-3.54%でした。

スーパーファンドの「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。マーケット環境に合わせ、複数の投資期間、及び複数の投資戦略から、機動的に選別します。また多面的なアプローチにより、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収益確保を狙います。より高度な分散投資を実現するために、中長期のトレンド戦略と短期トレンド戦略(トレンド・フォロー、予測モデル、カウンター・トレンド、パターン認識等)の融合を図りました。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「グリーン戦略」は他の資産クラスとの長期的な相関性が低いいため、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グリーン・ゴールドクラスは、「グリーン戦略」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グリーン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。

運用実績

設定日: 1996/03/08, 設定時INDEX 1,000.00; 評価日: 2024/12/31, 基準価額 3,897.62

	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	設定来
1996			-2.09%	+1.12%	-0.59%	-0.05%	-0.17%	+0.75%	-1.48%	-1.76%	-0.29%	-6.07%	-10.30%	-10.30%
1997	+3.46%	+8.24%	-4.62%	-2.49%	+7.94%	+7.41%	+11.32%	-11.42%	+0.80%	-6.24%	+1.60%	+5.58%	+20.70%	8.27%
1998	-2.54%	+4.58%	+3.60%	-4.81%	+8.74%	+1.96%	+10.40%	+9.88%	-0.65%	-3.21%	+13.77%	+9.90%	+62.55%	75.98%
1999	+4.11%	+0.98%	-1.70%	+6.32%	-5.80%	-0.43%	+1.13%	-2.71%	+4.53%	-3.17%	+10.56%	+10.50%	+25.39%	120.67%
2000	+1.84%	-1.14%	-4.20%	-0.20%	+6.27%	+1.13%	-4.08%	+10.90%	-6.29%	-4.42%	+5.06%	+18.96%	+23.19%	171.84%
2001	+1.55%	+1.45%	+12.76%	-12.81%	+4.32%	+0.39%	+1.83%	+6.15%	+15.41%	+3.95%	-12.76%	-0.98%	+18.82%	223.02%
2002	-0.59%	-2.48%	-1.44%	-2.99%	+1.31%	+13.67%	+13.78%	+8.20%	+11.94%	-13.78%	-6.38%	+16.58%	+38.42%	347.11%
2003	+12.76%	+12.04%	-16.72%	-1.60%	+10.04%	-4.83%	-1.02%	+1.47%	-2.87%	+6.54%	-2.25%	+12.86%	+24.33%	455.90%
2004	+2.97%	+8.69%	+0.42%	-11.69%	+4.08%	-7.04%	+0.52%	-3.80%	+4.04%	+2.58%	+8.99%	+2.74%	+10.98%	516.94%
2005	-6.97%	+0.49%	+1.94%	-9.04%	+2.62%	+3.88%	-0.82%	-1.16%	+1.11%	-6.29%	+9.53%	+2.86%	-3.30%	496.58%
2006	+4.77%	-3.32%	+2.32%	+3.51%	-5.27%	-2.14%	-8.98%	-0.18%	+6.01%	+5.66%	-0.26%	+9.43%	+10.47%	559.05%
2007	+0.62%	-6.43%	-3.46%	+7.61%	+3.52%	+2.45%	-6.84%	-8.71%	+5.36%	+8.32%	-5.71%	+3.43%	-1.81%	547.09%
2008	-2.21%	+14.17%	+1.59%	-1.23%	+6.52%	+9.88%	-10.26%	-8.36%	+2.59%	+17.48%	+2.36%	+1.81%	+35.44%	776.41%
2009	+0.82%	+0.62%	-2.42%	-7.82%	-11.88%	-2.39%	-6.44%	+3.61%	+3.77%	-9.25%	+14.99%	-8.31%	-24.46%	562.04%
2010	-9.79%	+2.66%	+14.13%	+5.58%	-16.62%	+1.04%	-2.29%	+4.10%	+3.74%	+5.49%	-2.72%	+10.93%	+12.93%	647.66%
2011	-3.78%	+4.90%	-0.55%	+8.99%	-8.97%	-2.14%	+6.16%	+0.64%	-3.31%	-11.17%	-3.79%	-3.95%	-17.35%	517.96%
2012	+0.15%	+1.97%	-7.18%	-0.64%	+18.54%	-8.94%	+2.23%	-2.36%	-2.87%	-4.37%	-4.47%	+2.50%	-7.70%	470.40%
2013	+4.33%	+0.78%	+1.47%	+11.70%	-8.26%	-3.14%	+0.37%	-1.92%	-2.61%	+2.66%	+0.44%	+1.73%	+6.50%	507.48%
2014	-3.03%	+4.04%	-3.31%	-1.01%	+1.41%	-0.39%	-1.83%	+6.45%	+1.82%	-0.90%	+8.15%	-1.71%	+9.34%	564.21%
2015	+4.52%	+2.36%	+0.83%	-2.37%	-0.72%	-7.61%	+4.92%	-6.86%	-0.01%	+1.54%	+5.71%	-2.43%	-1.15%	556.59%
2016	+0.30%	+1.47%	-1.72%	-5.40%	-2.61%	+0.60%	+3.11%	-3.15%	-1.73%	-5.60%	-1.84%	-1.25%	-16.75%	446.60%
2017	-0.08%	+2.89%	-0.43%	-0.05%	+1.04%	-2.20%	+3.23%	+1.81%	-0.75%	+7.24%	+0.35%	+1.61%	+15.32%	530.31%
2018	+5.11%	-8.21%	+0.90%	-0.51%	-2.32%	-1.86%	+0.24%	-0.93%	-3.42%	-7.87%	+0.23%	-0.21%	-17.93%	417.27%
2019	+2.39%	+2.43%	+1.73%	+2.77%	-3.19%	+3.24%	+0.91%	+4.79%	-3.75%	-1.70%	+1.62%	+0.88%	+12.40%	481.43%
2020	+3.72%	-0.14%	+0.90%	+1.27%	-0.93%	-1.73%	+3.72%	-0.72%	-4.55%	-2.86%	+0.00%	+2.28%	+0.61%	484.98%
2021	+0.60%	+4.77%	+0.49%	+0.48%	+2.56%	-1.57%	+1.59%	-0.26%	-0.92%	+1.82%	-4.88%	+1.52%	+6.06%	520.43%
2022	+0.18%	+1.77%	+3.21%	+2.30%	-0.32%	-6.86%	+0.64%	-6.61%	+0.38%	-1.61%	-3.64%	-2.37%	-12.74%	441.38%
2023	-4.37%	+0.85%	-11.09%	-1.41%	-0.69%	+0.77%	-1.33%	-5.83%	+0.52%	-2.11%	-0.70%	+3.77%	-20.29%	331.54%
2024	-2.85%	+3.23%	+5.52%	-0.58%	-3.62%	+1.26%	-3.67%	-3.41%	+0.49%	-2.99%	+0.54%	-3.54%	-9.68%	+289.76%

一口当り純資産価額の推移



リターン値

設定来	289.76%
年率複利リターン	4.83%
年初来	-9.68%
過去1年間のリターン	-9.68%
月間平均	0.39%
月間最高	18.96%

リスク値

年間標準偏差	19.86%
月間標準偏差	5.73%
取引あたりの初期最大リスク	1.00%
純資産に対する証拠金率(月間平均)	13.44%
純資産に対する標準証拠金率	20%
最大下落率	56.16%
収益プラスとなった月の割合	52.89%

効率性

シャープレシオ**	0.24
シャープレシオ**(1年)	-0.90
ソルティエノレシオ**(年換算)	0.40
ソルティエノレシオ**(1年)	-2.75
米国株価指数(S&P500)との相関性	-0.03
欧州株価指数(EURO STOXX 50)との相関性	-0.01
アジア株価指数(Hang Seng)との相関性	-0.01
マネージドフューチャーズ指数との相関性 ²	0.70
株式マーケットニュートラル指数との相関性 ³	0.22

** 調整済(無リスク収益=0%)
2) CISDM CTA Equal Weighted Index
3) CISDM Equity Market Neutral Index

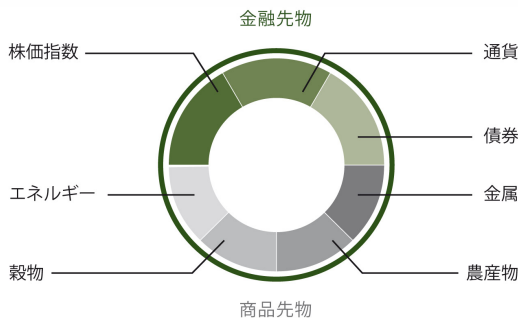
ファンド情報

ISIN	AT0000979794
WPKNR-Germany	630 824
管理料等	0.4%
成功報酬	20%
買戻請求	月次
通貨	EUR
支払代理人	Liechtensteinische Landesbank (Oesterreich) AG
監査法人	KPMG Austria
法律顧問	Kindel & Kindel
トレーディング・アドバイザー	Superfund Investment Management Inc.
ホームページ	www.superfund.com

運用実績

	Superfund Green Q-AG ¹	MSCIワールド
2019/12/31 - 2020/12/31	+0.61%	+14.06%
2020/12/31 - 2021/12/31	+6.06%	+20.14%
2021/12/31 - 2022/12/30	-12.74%	-19.11%
2022/12/30 - 2023/12/29	-20.29%	+21.40%
2023/12/29 - 2024/12/31	-9.68%	+16.84%

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。

1) 本資料に記載されている Superfund UnternehmensBeteiligungsAG (Superfund Green Q-AG)(販売終了)の運用実績は、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。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。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。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ご確認ください。最終頁の「免責事項」もお読みください。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 Superfund Green Q-AG(販売終了)、Superfund Green Master【旧 Superfund Cayman】(販売終了)の運用実績は、各スーパーファンド・グリーン戦略(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(2024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