

レインボーオールシーズンズ(ゴールド円クラス)

2025年 12月

レインボーオールシーズンズ(ゴールド円クラス)の12月の運用実績は+3.26 %でした。

※当サブファンドは設定以来2019年末まではブルー戦略で運用され、2020年から戦略変更が行われました。2023年7月より、現在の名称へ変更しました。

スーパーファンドのレインボーオールシーズンズ戦略は、スーパーファンドによって新しく開発された、世界的にユニークな取引アプローチであり、定量的で完全自動的かつ人間の感情を排除した取引が行われます。スーパーファンド・レインボーオールシーズンズ戦略の目的は、株式市場、債券市場、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。また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。レインボーオールシーズンズ・ゴールド円・クラスは、「レインボーオールシーズンズ戦略」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レインボーオールシーズンズ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。

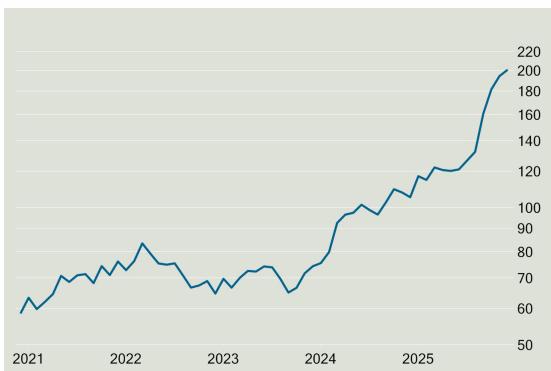
基準価額

	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
2020	59.05	53.95	49.59	54.16	56.39	58.58	66.72	68.19	62.45	59.50	59.90	65.21	+10.51 %
2021	63.43	59.91	62.11	64.65	70.84	68.71	71.06	71.48	68.30	74.42	71.14	76.18	+16.82 %
2022	72.93	76.32	83.50	79.26	75.43	74.97	75.47	71.04	66.77	67.50	69.02	64.79	-14.95 %
2023	69.81	66.75	70.10	72.64	72.41	74.31	73.96	69.82	65.13	66.70	71.75	74.37	+14.79 %
2024	75.59	79.87	92.57	96.52	97.47	101.50	98.81	96.57	102.68	109.78	107.97	105.43	+41.76 %
2025	117.22	115.05	122.55	120.93	120.42	121.34	126.85	132.61	160.74	181.94	194.46	200.80	+90.46 %

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
2020	+0.07 %	-8.64 %	-8.08 %	+9.22 %	+4.12 %	+3.88 %	+13.90 %	+2.20 %	-8.42 %	-4.72 %	+0.67 %	+8.86 %	+10.51 %
2021	-2.73 %	-5.55 %	+3.67 %	+4.09 %	+9.57 %	-3.01 %	+3.42 %	+0.59 %	-4.45 %	+8.96 %	-4.41 %	+7.08 %	+16.82 %
2022	-4.27 %	+4.65 %	+9.41 %	-5.08 %	-4.83 %	-0.61 %	+0.67 %	-5.87 %	-6.01 %	+1.09 %	+2.25 %	-6.13 %	-14.95 %
2023	+7.75 %	-4.38 %	+5.02 %	+3.62 %	-0.32 %	+2.62 %	-0.47 %	-5.60 %	-6.72 %	+2.41 %	+7.57 %	+3.65 %	+14.79 %
2024	+1.64 %	+5.66 %	+15.90 %	+4.27 %	+0.98 %	+4.13 %	-2.65 %	-2.27 %	+6.33 %	+6.91 %	-1.65 %	-2.35 %	+41.76 %
2025	+11.18 %	-1.85 %	+6.52 %	-1.32 %	-0.42 %	+0.76 %	+4.54 %	+4.54 %	+21.21 %	+13.19 %	+6.88 %	+3.26 %	+90.46 %

一口当たり純資産価額の推移



リターン値

設定来	240.28 %
年率複利リターン	22.62 %
年初来	90.46 %
過去1年間のリターン	90.46 %
月間平均	1.71 %
月間最高	21.21 %

リスク値

年間標準偏差	21.04 %
月間標準偏差	6.07 %
単一銘柄への最大投資比率	10 %
最大レバレッジ	400 %
最大下落率	22.41 %
収益プラスとなった月の割合	61.11 %

効率性

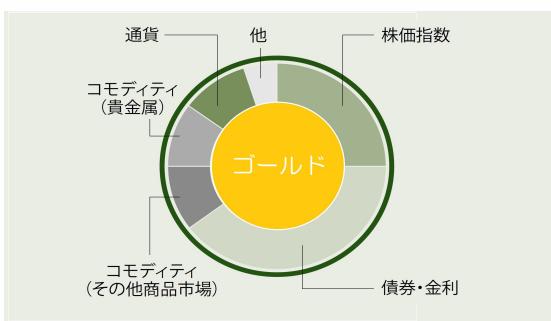
シャープレシオ**	1.07
シャープレシオ** (1年)	3.85
ソルティーノレシオ** (年換算)	2.71
ソルティーノレシオ** (1年)	44.25
米国株価指数(S&P500)との相関性	0.53
欧州株価指数(EURO STOXX 50)との相関性	0.43
アジア株価指数(Hang Seng)との相関性	0.25
日本株価指数(日経225)との相関性	0.41
マネージドファーチャーズ指数との相関性 ¹	0.38
株式マーケットニュートラル指数との相関性 ²	0.38

** 調整済(無リスク収益=0%)

1) CISDM CTA Equal Weighted Index

2) CISDM Equity Market Neutral Index

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説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。

出典: Superfund, TeleTrader

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
管理報酬(当ファンド及びマスターファンドのレベル)	純資産価額の年率1.1%
販売報酬	純資産価額の年率0.6%
代行協会員報酬	純資産価額の年率0.1%
成功報酬	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	Harneys Fiduciary (Cayman) Ltd.
代行協会員	スーパーファンド・ジャパン株式会社

