

2025年 3月

※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。

[illegible]

The chart illustrates the fluctuating confidence in the U.S. as a democracy over a five-year period. It begins at approximately 45% in early 2021, rises to a peak of nearly 50% in mid-2022, and then experiences a significant decline, reaching its lowest point of about 32% in early 2024. Following this low, there is a recovery, with the percentage rising to around 38% by the end of 2025.

Year	Percentage (%)
2021 (Start)	45
2021 (Mid)	47
2021 (End)	48
2022 (Start)	49
2022 (Mid)	50
2022 (End)	48
2023 (Start)	45
2023 (Mid)	38
2023 (End)	35
2024 (Start)	32
2024 (Mid)	38
2024 (End)	37
2025 (Start)	38
2025 (Mid)	38
2025 (End)	38

設定定	-12.36%
年率複利リターン	-2.48%
年初来	10.17%
過去1年間のリターン	-0.35%
月間平均	-0.21%
月間最高	9.91%

年間標準偏差	14.69 %
月間標準偏差	4.24 %
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	39.74 %
収益プラスとなった月の割合	52.38 %

シャープレシオ**	-0.17
シャープレシオ** (1年)	-0.03
ソルティエノレシオ** (年換算)	-0.27
ソルティエノレシオ** (1年)	-0.03
米国株価指数 (S&P500) との相関性	0.78
欧州株価指数 (EURO STOXX 50) との相関性	0.66
アジア株価指数 (Hang Seng) との相関性	0.33
日本株価指数 (日経225) との相関性	0.69
マネージドフューチャーズ指数との相関性 ¹	0.22
株式マーケットニュートラル指数との相関性 ²	0.42

** 調整済(無リスク収益=0%)

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

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、すべての間接投資(申込手数料及び税金は除く)情報に関する純収益を表しています。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得られたものと見做すことができます。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。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動向等、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ます。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