



米ドル・モデルポート・フォリオ

<http://www.jkwi.co.jp>
info@jkwi.co.jp

株式会社ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメンツ
東京都渋谷区神宮前4-3-21
アプリール表参道202

運用収益の分析

May 2004

*これは弊社がご提案をしている米ドルのモデル・ポートフォリオの運用収益です。ご質問はメールにてお問い合わせください

JK Multi Strategies Fund	20%	F	4%
A	10%	G	3%
B	15%	H	3%
C	15%		
D	20%		
E	10%		

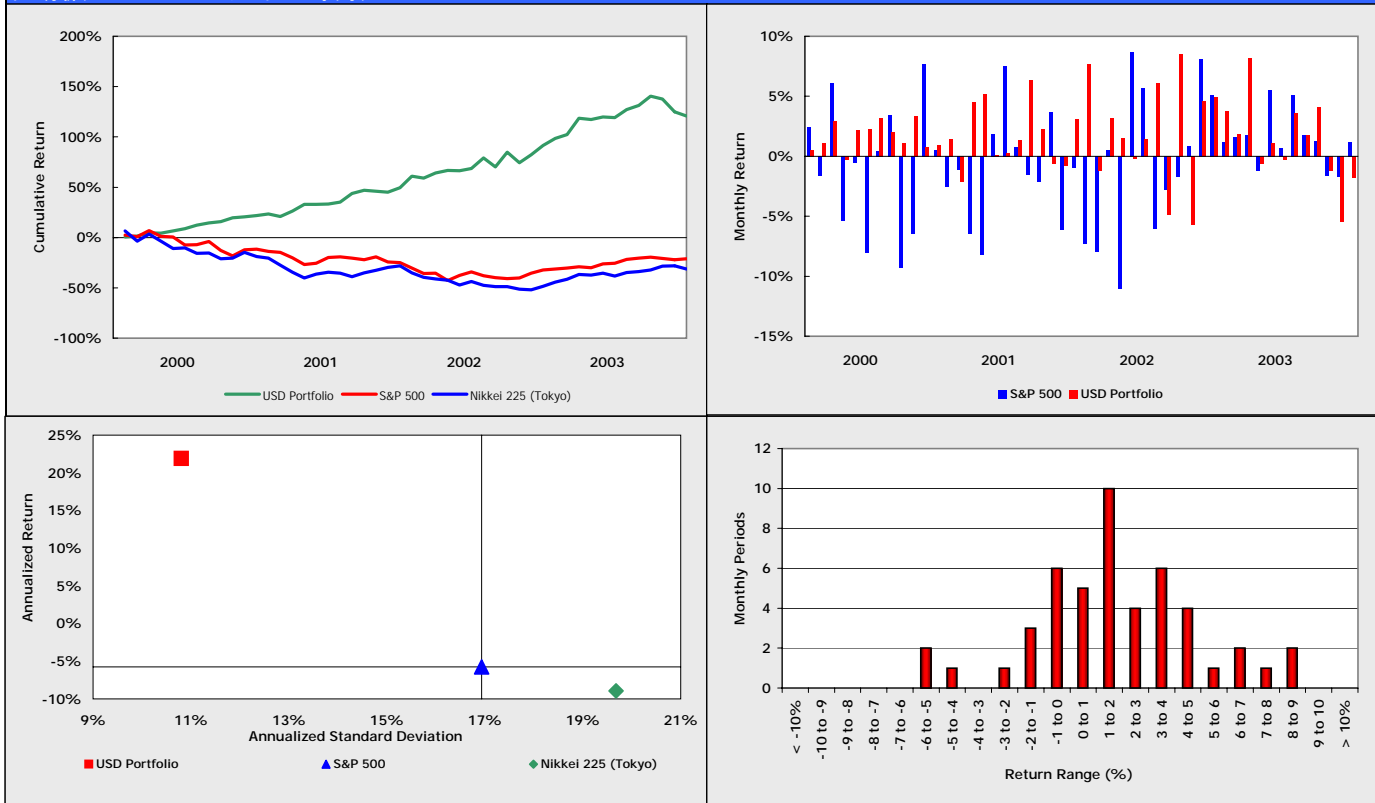
月次収益 (%) 諸費用控除後

Year	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年収益率	S&P 500
2004	1.76%	4.08%	-1.15%	-5.41%	-1.78%								-2.74%	0.79%
2003	-4.84%	8.52%	-5.66%	4.59%	4.94%	3.75%	1.84%	8.15%	-0.63%	1.11%	-0.23%	3.61%	26.90%	26.38%
2002	6.38%	2.27%	-0.61%	-0.78%	3.09%	7.70%	-1.17%	3.20%	1.48%	-0.18%	1.41%	6.14%	32.48%	-23.37%
2001	1.96%	1.12%	3.32%	0.80%	0.89%	1.41%	-2.13%	4.53%	5.15%	0.10%	0.26%	1.31%	20.16%	-13.04%
2000						0.51%	1.08%	2.95%		2.17%	2.24%	3.19%	12.43%	-7.06%

ベンチマークとの比較

	モデル・ポート		S&P 500		ベンチマークとの比較		一般情報	
	月次	年次	月次	年次	S&P 500			
平均収益(複利)	1.66%	21.91%	-0.49%	-5.76%	アルファ	0.02	運用報酬	0.45%
平均収益(単利)	1.71%		-0.37%		年次アルファ	0.22	最低投資金額	百万ドル
標準偏差	3.12%	10.80%	4.89%	16.93%	ベータ	(0.04)	成功報酬	20%
Semi Deviation	3.09%	10.70%	5.22%	18.09%	相関係数	(0.06)	お申し込み	随時
Gain Deviation	2.26%	7.83%	2.74%	9.51%	R-Squared	0.00	ご解約	随時
Loss Deviation	2.02%	7.01%	3.22%	11.15%			ハードルレート	無し
Down Dev.(10.00%)	1.74%	6.03%	4.20%	14.56%	月による分析		ロックアップ期間	1年間
Down Dev.(5.00%)	1.58%	5.46%	3.98%	13.77%	月数	48	投資家	個人/法人
Down Dev.(0%)	1.42%	4.92%	3.74%	12.96%	収益を上げている月	73%	解約通知	2ヶ月前
Sharpe(5.00%)	0.42	1.45	(0.16)	(0.55)	月次の平均	1.71%	通貨	米ドル
Sortino(10.00%)	0.50	1.73	(0.31)	(1.06)	収益	3.06%	助言対象資産	約30百万ドル
Sortino(5.00%)	0.80	2.76	(0.23)	(0.78)	損失	-1.91%	国籍	日本
Sortino(0%)	1.17	4.06	(0.13)	(0.46)	月次での最高収益	8.52%		
Skewness	(0.08)		(0.18)		月次での最低収益	-5.66%		
Kurtosis	0.50		(0.51)		収益月/損失月	430.56%		
Sterling Ratio	1.43		(0.15)					
Calmar Ratio	2.69		(0.11)					
最大下落率	-8.16%		-46.28%					

収益分析(USD Portfolioがモデルポートフォリオ)



本レポートは、売買やその他の投資行為を勧誘するためのものではありません。また、本レポート記載のデータは(株)ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメンツが信頼できると判断した各種情報源から入手したものです。また、(株)ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメンツは入手した情報の正確性を独自に確認しているわけではありません。従って(株)ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメンツはそれらデータの正確性または完全性を保証するものではなく、一切の責任を負いかねます。本レポート記載の意見は(株)ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメンツのものであり、予告なしに変更されることがあります。投資の決定は投資家ご自身の責任でなさるようお願い申し上げます。過去の実績は将来のパフォーマンスを示唆するものではありません。如何なる投資の価値、または収益も変動する可能性があり、現時点において確定した収益が保証されるものではありません。また、市場が存在しない投資については、かかる投資対象を売却したり、その価値またはリスクに関する信頼できる情報を入手することが困難となる場合があります。