

300万米ドル・モデル・ポートフォリオ

株式会社ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメンツ
東京都渋谷区神南1-13-8 パーク・アベニュー503
Tel: 03-5459-3730 Fax:03-5459-5260

運用分析報告書

2007年1月

投資目標

(資産配分)
先物ファンド 15%
マルチストラテジー1 25%
マルチストラテジー2 20%
オプション戦略 15%
中国 3%
インド 3%
ロシア 4%
イマージング 15%

(注)このモデルポートフォリオはあくまでも例であり実際の運用開始時期、運用金額等によって諸条件が変わるため、実際の組入ファンドと異なる場合があります。

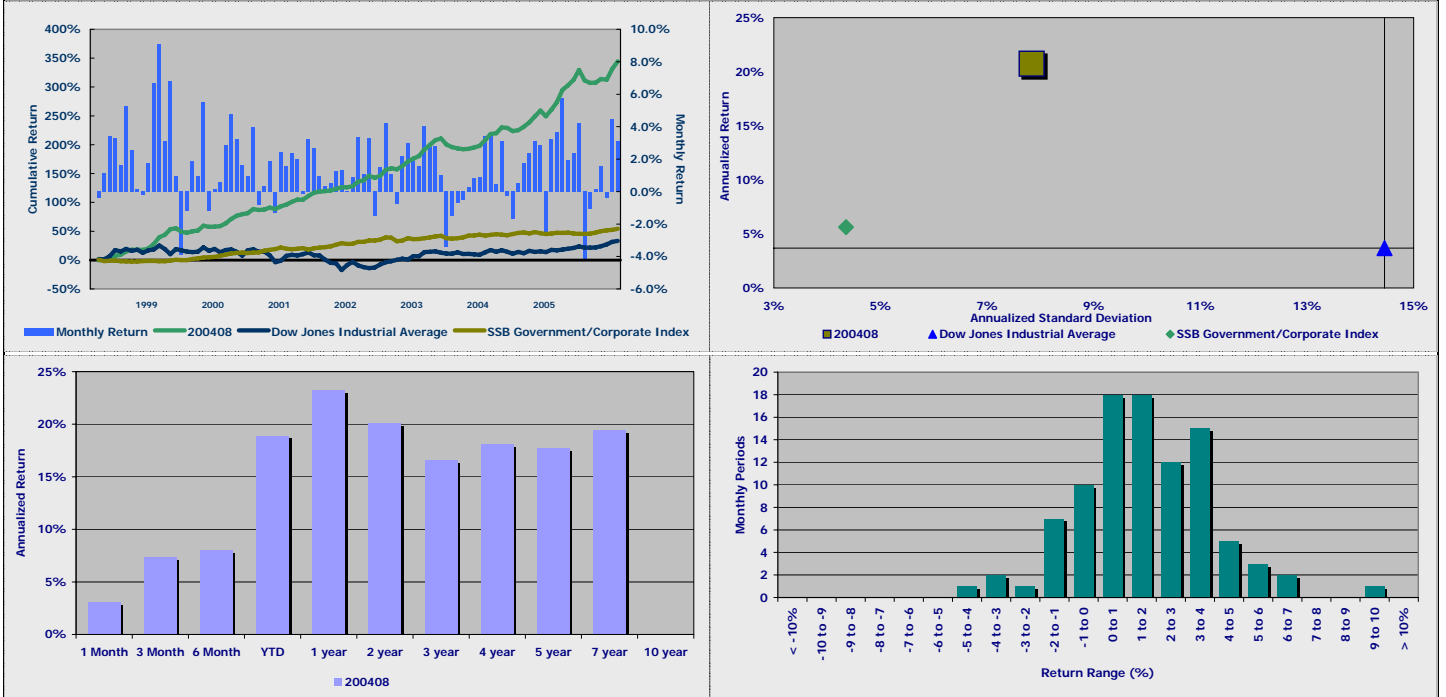
月次収益(経費用控除後)

| 年 | 1月 | 2月 | 3月 | 4月 | 5月 | 6月 | 7月 | 8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 年間 | DJIA |
|------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|
| 2006 | 5.73% | 1.95% | 2.34% | 4.19% | -4.22% | -1.03% | 0.12% | 1.56% | -0.34% | 4.48% | 3.09% | | 18.93% | 14.04% |
| 2005 | 0.44% | 3.12% | -0.28% | -1.66% | 0.54% | 1.73% | 2.36% | 3.08% | 2.88% | -2.75% | 3.23% | 3.63% | 17.31% | -0.61% |
| 2004 | 2.76% | 2.78% | 0.97% | -3.43% | -1.48% | -0.71% | -0.52% | 0.24% | 0.82% | 0.91% | 3.41% | 3.39% | 9.27% | 3.15% |
| 2003 | 1.07% | 3.28% | -1.51% | 1.50% | 4.21% | 1.08% | -0.72% | 2.19% | 2.98% | 1.88% | 1.54% | 4.03% | 23.61% | 25.32% |
| 2002 | 1.98% | -0.16% | 3.23% | 2.68% | 0.92% | 0.34% | 0.51% | 1.25% | 1.33% | -0.02% | 0.86% | 3.36% | 17.45% | -16.76% |

ベンチマーク比較

| ポートフォリオ | | DJIA | | ベンチマークとの比較 | | Dow Jones Industrial Average | | ファンド情報 | |
|-----------------|--------|--------|---------|------------------------------|-----------------------|------------------------------|--------|-----------|-----------|
| 月次 | 年率 | 月次 | 年率 | アルファ | 年率アルファ | ベータ | 相関係数 | R-Squared | 運用報酬 |
| Compound ROR | 1.58% | 20.73% | 0.30% | 3.68% | 0.02 | 0.20 | 0.13 | 0.24 | 0.06 |
| Arithmetic Mean | 1.61% | 0.39% | | | | | | | |
| 標準偏差 | 2.26% | 7.84% | 4.17% | 14.45% | | | | | |
| シャープレシオ(5.00%) | 0.53 | 1.84 | 0.00 | -0.02 | | | | | |
| 最大下落率 | -6.02% | | -33.97% | | | | | | |
| 年間収益 | | ポート | | Dow Jones Industrial Average | | Time Windows Analysis | | ロックアップ | |
| 2006 | 18.93% | 14.04% | | | 95 | Percent Profitable | 78% | 運用開始日 | 01-Aug-04 |
| 2005 | 17.31% | -0.61% | | | Average Period Return | 1.61% | 2.44% | 報告頻度 | |
| 2004 | 9.27% | 3.15% | | | Average Gain | 2.44% | -1.32% | ファンド資産 | n.a. |
| 2003 | 23.61% | 25.32% | | | Average Loss | -1.32% | 9.08% | 会社全運用資産 | n.a. |
| 直近 | | ポート | | Dow Jones Industrial Average | | Best Period | | 管理会社 | |
| 前月 | 3.09% | 1.17% | | | Worst Period | -4.22% | 6.49 | City | |
| 前四半期 | 7.34% | 7.39% | | | Profit/Loss Ratio | | | State | |
| 前年 | 23.25% | 13.10% | | | | | | Zip Code | |
| 2-Year | 20.10% | 8.26% | | | | | | 国 | |
| 3-Year | 16.62% | 7.70% | | | | | | 更新日時 | 31-Jan-07 |
| 5-Year | 17.77% | 4.41% | | | | | | | |

資産分析



※注意(必ずお読みください)

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。