

JKWI サンプル・ファンド II

運用報告書

2007年1月

株式会社ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメント
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

投資目標

年間18%の収益率をより低い変動率及び市場との相関性にて達成する。市場における上下の変動にかかわらず収益を獲得するために、多様に分散された戦略(ロング・ショート等)を採用して運用を行う。また市場の動向によってはレバレッジを利用する。

月次収益(割引率)

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	5.42%	1.27%	3.70%	3.73%	-4.15%	-0.53%	1.17%	1.42%	-0.83%	3.05%	2.57%	3.82%	22.26%	16.29%
2005	1.31%	2.68%	-0.81%	-3.93%	-1.72%	2.69%	3.59%	1.00%	1.79%	-2.83%	2.84%	3.37%	10.06%	-0.61%
2004	4.49%	2.13%	0.70%	-2.42%	-3.49%	0.28%	-0.12%	-0.85%	0.05%	2.10%	7.05%	3.88%	14.17%	3.15%
2003	2.31%	2.21%	0.06%	0.91%	2.77%	1.19%	-1.00%	1.16%	4.97%	3.12%	1.86%	4.01%	26.11%	25.32%
2002	2.31%	0.58%	1.98%	3.95%	2.99%	0.97%	1.07%	0.88%	0.54%	-1.78%	1.05%	3.88%	19.89%	-16.76%

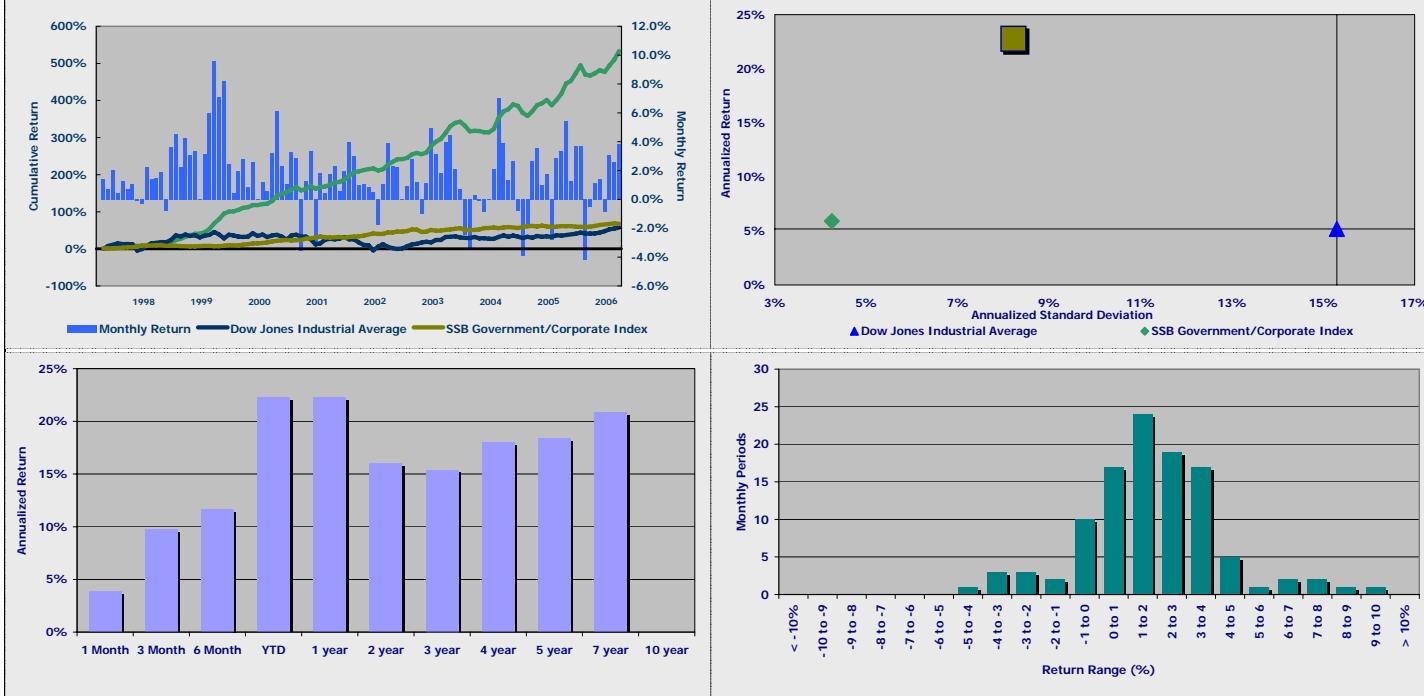
ベンチマーク比較

月次	ファンド		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	R-Squared		
Compound ROR	1.72%	22.76%	0.42%	5.18%	0.02	0.04	2.0	
Arithmetic Mean	1.75%		0.52%		0.22		最小投資金額	\$1,000,000
標準偏差	2.37%	8.22%	4.42%	15.30%	0.10		成功報酬	20.00
シャープレシオ(5.00%)	0.57	1.96	0.03	0.09	0.19		買い付け	Monthly
最大下落率	-6.48%		-33.97%				解約	Quarterly

年間収益

年	ファンド	Dow Jones Industrial Average	Time Windows Analysis	ファンド情報
2006	22.26%	16.29%	月数	108
2005	10.06%	-0.61%	Percent Profitable	82%
2004	14.17%	3.15%	Average Period Return	1.75%
2003	26.11%	25.32%	Average Gain	2.49%
直近	ファンド	Dow Jones Industrial Average	Average Loss	-1.69%
前月	3.82%	1.97%	Best Period	9.57%
前四半期	9.74%	6.71%	Worst Period	-4.15%
前年	22.26%	16.29%	Profit/Loss Ratio	6.89
2-Year	16.00%	7.51%		
3-Year	15.38%	6.04%		
5-Year	18.36%	4.46%		

収益分析



※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説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・インベストメントが信頼できる、と判断した各種情報源から入手したものですが、(株)ジェイ・ケイ・ウィルトン・インベストメント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・インベストメント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・インベストメントのものであり、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。