

JKWI サンプル・ファンドⅡ

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

運用報告書

2007年1月

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。

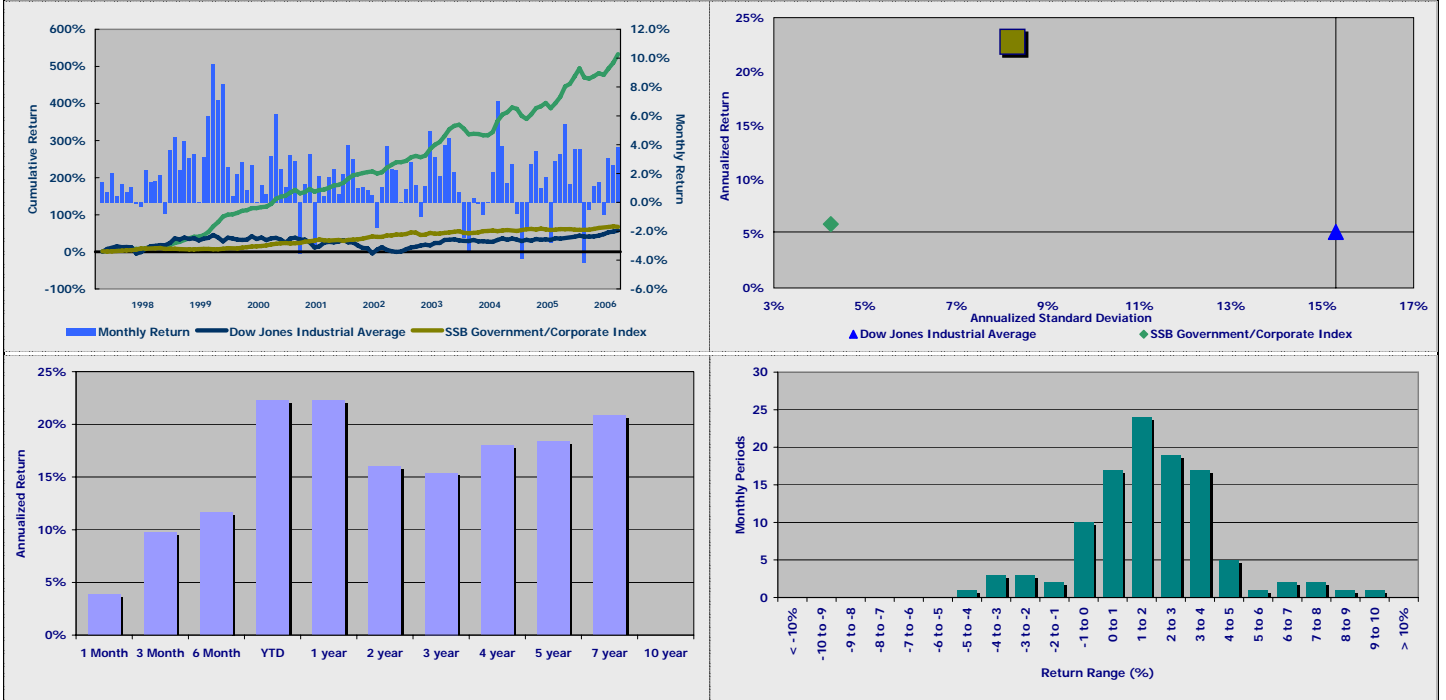
月次収益(経費用控除後)

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	5.42%	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

ファンド		DJIA		ベンチマークとの比較		ファンド情報	
月次	年率	月次	年率	Dow Jones Industrial Average			
Compound ROR	1.72%	22.76%	0.42%	5.18%	アルファ	0.02	運用報酬
Arithmetic Mean	1.75%	0.52%			年率アルファ	0.22	最小投資金額
標準偏差	2.37%	8.22%	4.42%	15.30%	ベータ	0.10	成功報酬
シャープレシオ(5.00%)	0.57	1.96	0.03	0.09	相関係数	0.19	買い付け
最大下落率	-6.48%		-33.97%		R-Squared	0.04	解約
年間収益		Dow Jones Industrial Average		Time Windows Analysis		ロックアップ	
2006	22.26%	16.29%		月数	108	運用開始日	
2005	10.06%	-0.61%		Percent Profitable	82%	報告頻度	
2004	14.17%	3.15%		Average Period Return	1.75%	ファンド資産	
2003	26.11%	25.32%		Average Gain	2.49%	会社全運用資産	
直近	Dow Jones Industrial Average			Average Loss	-1.69%	管理会社	
前月	3.82%	1.97%		Best Period	9.57%	City	
前四半期	9.74%	6.71%		Worst Period	-4.15%	State	
前年	22.26%	16.29%		Profit/Loss Ratio	6.89	Zip Code	
2-Year	16.00%	7.51%				国	
3-Year	15.38%	6.04%				更新日時	
5-Year	18.36%	4.46%					

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。