

グローバルETFポートフォリオ アクティブ・マネジメント助言サービスの概要

2011年5月16日

IFA JAPAN^(R) 株式会社

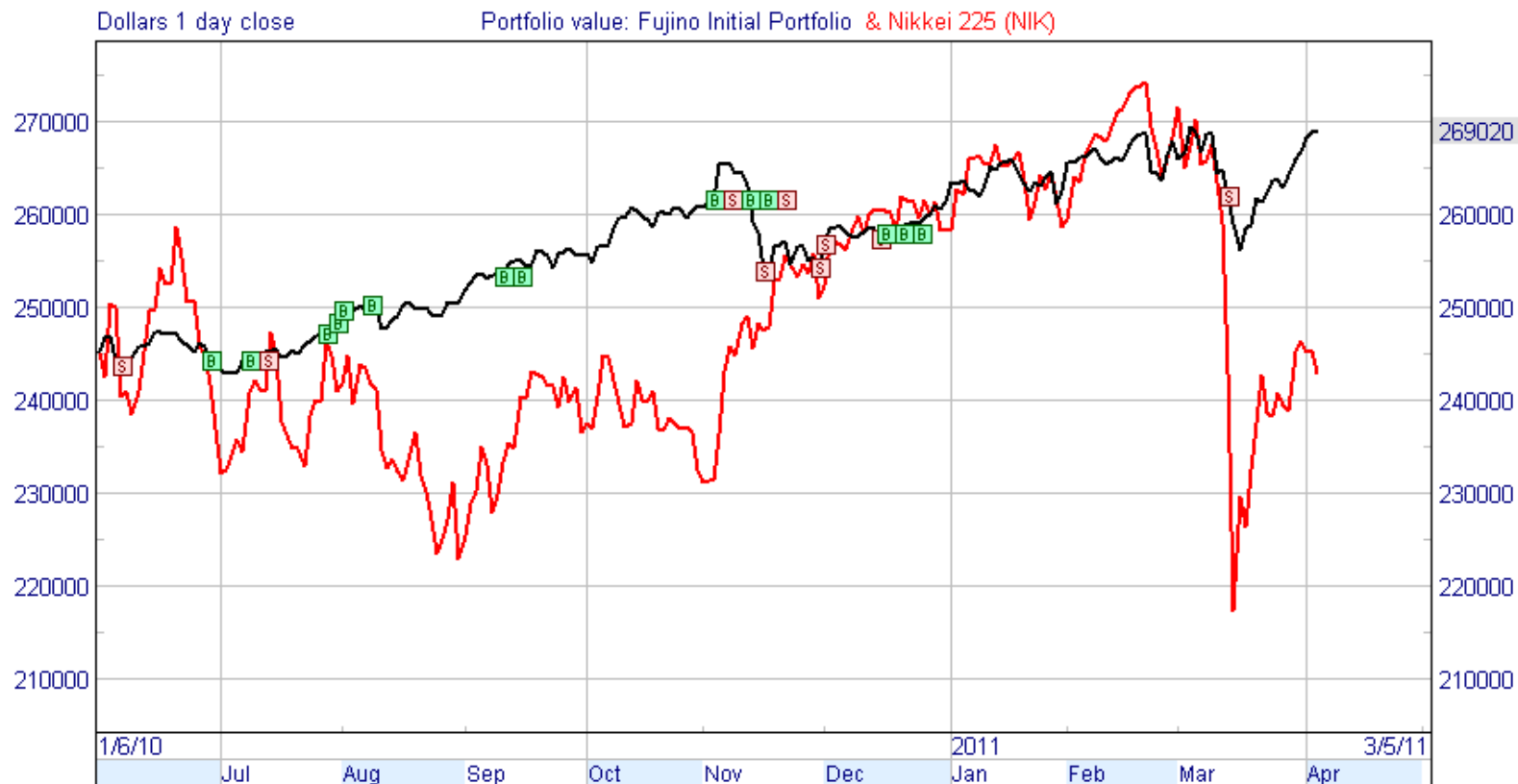
グローバルETFポートフォリオ アクティブ・マネジメント・サービス

モデルポートフォリオの運用手法

- ・ 弊社では、お客様に対する投資助言業務の一環として、グローバル・ETF・モデル・ポートフォリオを開発し、投資助言契約にもとづき提供しております。その目的は、広く外国ETFに分散投資することで絶対リターンを目指すところにあります。このため、価格が上昇トレンドにあるマーケット(=資産クラス)への投資によりキャピタル・ゲインを狙い、徹底したリスクマネジメント(=ロスカット・ルールの適用)によって損失を防ぎ、ポートフォリオの利益を確定します。
- ・ モデル・ポートフォリオの運用手法は以下の通りです。
 - ① 平均出来高を基準に世界中のETFから投資適格銘柄リスト(約200銘柄)を選別
 - ② 投資適格銘柄リストからT-MATDIモデルを使って投資ユニバース(約50銘柄)を選別
 - ③ 投資ユニバースの中で相対的に上昇トレンドの強い10~20銘柄を選定してポートフォリオを構築。
(銘柄毎の組入れ比率は、各銘柄ごとの想定ロスカット額がポートフォリオの純資産総額の1%を超えない範囲にとどめる)
 - ④ 価格が下落に転じた銘柄は、銘柄ごとに設定されたロスカット価格を、終値ベースで割り込んだ時点で確実に売却する。

グローバルETFポートフォリオ アクティブ・マネジメント・サービス

ETF・モデル・ポートフォリオのアクティブ運用例



(註) 上記「運用例」は、IFA JAPAN株式会社が、お客様に対する投資助言の一環として、紙上運用を行っているものであり、具体的な資産の運用実績を示すものではありません。したがって、同様の運用手法による将来の運用成果を保証または示唆するものではありません。