

IFAJ PMS - Global Liquidity Growth

開始日 May-09
最終日 Aug-11

Tel: 03-5803-2500

Fax: 03-5803-2501

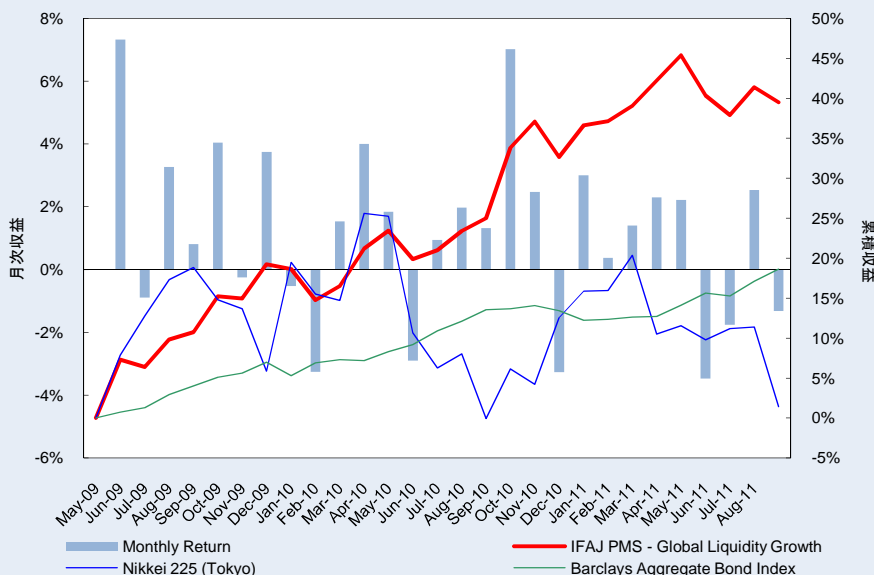
Email: info@ifaj-japan.co.jp

BM1 = Nikkei 225 (Tokyo)

BM2 = Barclays Aggregate Bond Index

モデル・ポートフォリオ

累積収益

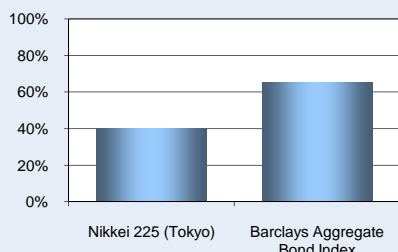


年間収益率	ポートフォリオ	BM1	BM2
2011(YTD)	2.1%	(12.5%)	5.7%
2010	15.2%	(3.0%)	6.6%
2009	18.6%	19.5%	5.3%

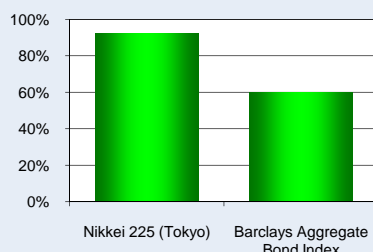
直近の収益率	ポートフォリオ	BM1	BM2
前月	(1.3%)	(8.9%)	1.3%
四半期	(0.6%)	(7.6%)	2.6%
過去1年	11.6%	1.5%	4.5%
過去2年	12.2%	(7.6%)	6.8%
過去3年			
過去5年			

ヒストリカル・データ	ポートフォリオ	BM1	BM2
収益 (年率)	15.3%	0.6%	7.6%
累積収益	39.51%	1.43%	18.62%
運用当初を1000とした値	\$1,395	\$1,014	\$1,186
単月最大収益	7.3%	12.8%	1.6%
単月最大損失	(3.5%)	(11.7%)	(1.6%)
収益月比率	67.86%	53.57%	82.14%

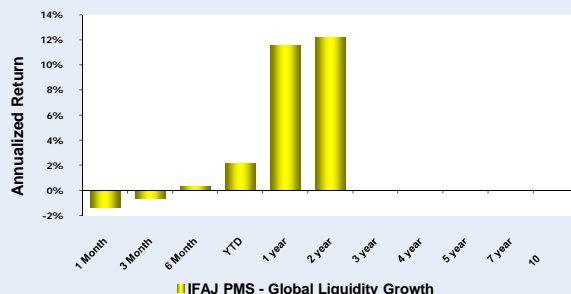
アップマーケットでのBMのアウトパフォーマンス



ダウンマーケットでのBMアウトパフォーマンス



年間収益率



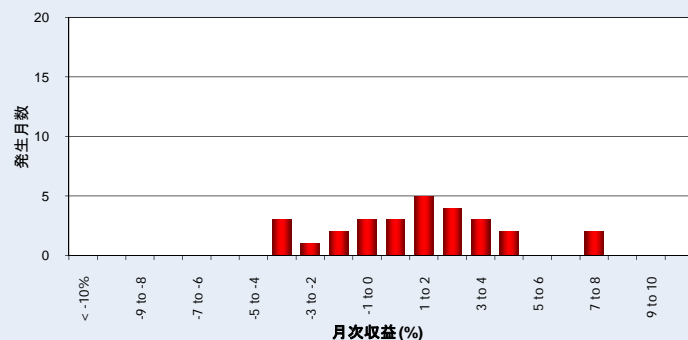
月次収益

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
2011	0.37%	1.40%	2.30%	2.22%	(3.47%)	(1.76%)	2.53%	(1.32%)					2.12%
2010	(3.25%)	1.54%	4.01%	1.85%	(2.89%)	0.95%	1.98%	1.32%	7.02%	2.47%	(3.26%)	3.00%	15.17%
2009					7.33%	(0.89%)	3.27%	0.82%	4.05%	(0.24%)	3.75%	(0.52%)	18.62%

リスク

	ポートフォリオ	BM1	BM2
標準偏差	9.7%	20.2%	2.8%
Sharpe Ratio (2.0%)	1.3	0.0	1.9
最大ドロウダウン	(5.2%)	(20.4%)	(1.6%)
ドロウダウン月数	2	5	2
回復に要した月数	0	0	4

月次収益の分布状況



IFA JAPAN® 株式会社
〒113-0033 東京都文京区本郷1-25-5
Tel: 03-5803-2500 Fax: 03-5803-2501
www.ifaj-japan.co.jp

過去のパフォーマンスは、将来のパフォーマンスを約束するものではありません