

## プレミアFXファンド4号投資事業組合のご案内



- 当社の会社概要について -

- 【商号等】 プレミア証券株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第162号
- 【本店所在地】 〒103-0016 東京都中央区日本橋小網町9番3号 CANAL TOWER 6階
- 【加入協会】 日本証券業協会
- 【指定紛争解決機関】 非特定非営利法人 証券・金融商品あっせん相談センター
- 【資本金】 464,715,500円（平成23年11月30日現在）
- 【主な事業】 金融商品取引業
- 【設立年月】 平成17年1月
- 【連絡先】 03-5652-3801 又はお取引のある本支店にご連絡ください。

本ファンドの出資の申し込みにあたっては、プレミアFXファンド4号投資事業組合契約書、及び契約締結前交付書面兼リスク説明書をあらかじめお読みいただき、お申し込みください。

## 1、本ファンドの特徴について

### (1) 証券会社が運用するファンド

プレミア証券オリジナルの金融商品として、FXで運用を行うファンドをご用意いたしました。  
証券会社が組成、販売及び運用を行う「透明性」の高いファンドです。

### (2) 利回り追求型のファンド

FXで運用する利回り追求型のファンドです。FXは実際の取引金額に比べ少額の資金で取引ができることから投資効率が良く、また、為替相場のトレンドに合わせ「売り」「買い」どちらからでもポジションを組むことが可能なことから、上昇局面、下落局面のどちらからでも、利益を得る機会があります。

### (3) 当ファンドの運用手法

運用手法は、アルゴリズム理論とテクニカル指標の組み合わせに基づくシステム・トレード運用のみで行います。

## 2、FX自動売買運用について

**【取引手法】** FX取引ツールのMT4（メタトレード）の自動売買機能を使用して、資金管理、発注及び決済は、完全に自動化しています。MT4は、アルゴリズム理論に基づいて専用開発されたオープンソースであり、テクニカル指標との組み合わせで、正確な為替相場のトレンドをキャッチしての運用を行うことが可能となります。

具体的には、MT4の基本ツールを基に独自の手法を組み合わせ、特定の通貨ペアのトレンド発生時にポジションが入り、あらかじめ定めた利益額に達したとき、またはクローズ時間に達したとき、またはトレンドが終わるまでポジションを保有しようとしています。途中、為替相場の状況に応じてシステムが自動的に利益や損失の確定を行い、利益の最大化を図りながら損失などのリスクを管理します。

**【取引回数】** 1ヶ月平均 約150回程度

**【取引時間帯】** 設定のロジックにより異なりますが、取引時間帯は主に日本時間のA.M.5:00からエントリーが入り、概ねP.M.3:00までにポジションは決済されます。

**【リスク管理】** システム運用の最大のリスクであるシステムトラブル等に対応すべく、運用ソフトは自社内で管理し、随時システムトラブルに対応しております。また、保有するポジションには全てストップロス値を定め不測の相場変動による損失も自動的にロスカットされ、許容するリスクをコントロールしています。システム設定は、全てのロジックについて検証（バックテスト）を行い、予想される利益をもとに、個別と全体のリスク許容度を決定します。また、以下の項目を組み合わせることによりリスク分散を図っております。

取扱通貨ペアの複数設定

トレンド相場、またはボックス相場に対応したロジック

エントリー時間帯やクローズ時間帯の設定（一部、設定しないものもあります。）

テイクプロフィット（T/P）とストップロス（S/L）の設定

取引ロット数と最大同時ポジション保有数の設定

使用するチャート（15分又は1時間）の最適化

取引可能日

### 3、FX自動売買運用の当初システム設定について

通貨ペア	type	使用チャート	S/L ( pips )	最大ポジション	取引日	エントリー時間	加ズ時間
<b>1. ロジックの特徴・・・時間帯レンジ相場を利用</b>							
usd/chf	逆張り	15分足	75 pips	2ポジション	火～金	5:30～7:40	13:00まで
eur/cad	逆張り	15分足	75 pips	2ポジション	火～金	5:30～7:40	13:00まで
aud/cad	逆張り	15分足	75 pips	2ポジション	火～金	5:30～7:40	13:00まで
<b>2. ロジックの特徴・・・ボックス圏においてトレードするオシレーター系</b>							
usd/chf	逆張り	15分足	75 pips	2ポジション	火～金	5:00～7:00	15:00まで
eur/cad	逆張り	15分足	75 pips	2ポジション	火～金	5:00～7:00	15:00まで
aud/cad	逆張り	15分足	75 pips	2ポジション	火～金	5:00～7:00	15:00まで
<b>3. ロジックの特徴・・・前週末レートとの「窓」による価額の歪みを利用</b>							
usd/jpy	逆張り	1時間足	60 pips	1ポジション	月	6:00 ( 7:00 )	9:00 ( 10:00 )
usd/chf	逆張り	1時間足	50 pips	1ポジション	月	6:00 ( 7:00 )	9:00 ( 10:00 )
gbp/usd	逆張り	1時間足	60 pips	1ポジション	月	6:00 ( 7:00 )	9:00 ( 10:00 )

上記ロジックは、利益の最大化のためにロット数を含め逐次見直しを行います。

上記ロジック以外に、新たなロジックの開発を行い設定を行う予定です。

上記3.のエントリー時間及びクローズ時間のカッコ書は、冬時間適用時の時間となります。

上記エントリー時間は、Forex.com日本の取引時間帯により表示しておりますので、業者による異なる場合があります。

### 4、本ファンドの税金基礎知識

本ファンドで発生した益金は、「雑所得」として「総合課税」の対象となるため、「確定申告」が必要な場合があります。

- 本ファンドで確定申告が必要な場合

給与所得が2千万円以下の1ヶ所から給与の支払を受けている方のうち、本ファンドの益金と他の雑所得を合算した合計金額が20万円を超えた方

- 税金の具体例

給与所得者のA氏は、本ファンドの益金が100万円あり、年度中の課税所得金額の合計が600万円となりました。

$$\text{計算式：} 100\text{万円} \times 30\% = 30\text{万円}$$

(税金についての注意事項)

雑所得は他の所得と損益通算はできません。

取引の損金を翌年以降の雑所得と相殺する繰越控除の適用はありません。

税金に関する最終的なご判断は最寄の税務署にご確認下さい。

雑所得の税率は6段階の累進(所得税+住民税)

課税される所得金額		税率
195万円以下		15%
195万円超	330万円以下	20%
330万円超	695万円以下	30%
695万円超	900万円以下	33%
900万円超	1,800万円以下	43%
1,800万円超		50%

- 本ファンドの税制適用に関する根拠

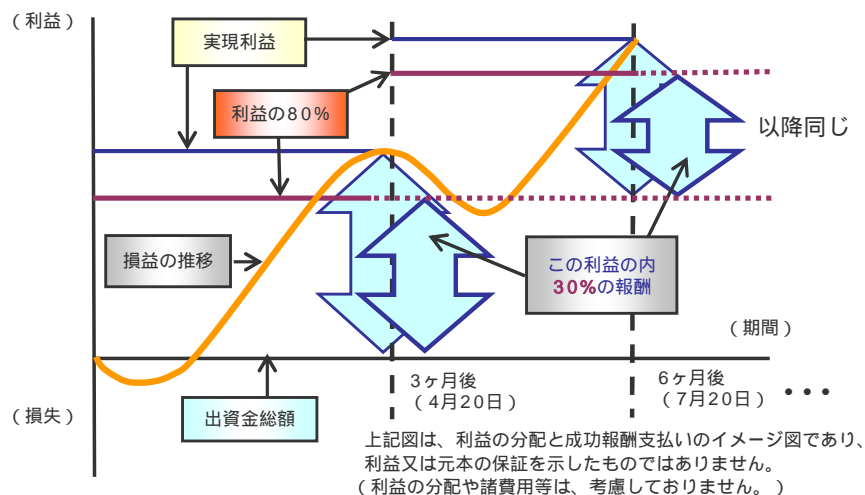
【個人】 所得税基本通達36・37 共-19及び共-20に基づき、本ファンドに係る利益等の帰属時期及び利益額等の計算を行うこととなります。

【法人】 法人税基本通達14-1-1及び14-1-2に基づき、本ファンドに係る利益等の帰属時期及び利益額等の計算を行うこととなります。

## 5、本ファンドの概要について

- |                   |   |
|-------------------|---|
| (1) ファンドの名称       | プレミアFXファンド4号投資事業組合  |
| (2) ファンド設立の根拠法    | 民法（明治29年法律第89号）第667条に規定する組合契約に基づく   |
| (3) ファンド業務の登録届出   | 金融商品取引法第63条の3第1項に基づく適格機関投資家等特例業務届出書を関東財務局へ提出  |
| (4) ファンドの募集・運用・管理 | プレミア証券株式会社  |
| (5) ファンドの運用対象     | 国内外の金融商品取引業者が行うFXによる各国通貨  |
| (6) ファンドの運用方法     | FXシステムトレード運用  |
| (7) 利益の分配金        | 平成24年4月20日、同年7月20日、同年10月20日現在において、本組合の利益から諸費用を控除した金額が出資金総額を超過した場合には、その超過額の80%を上限として、その算出された金額から成功報酬（30%（消費税込））を差し引き、その残額を利益の分配としてお支払いします。                                     |
| (8) 設立報酬          | 出資金総額に対し1.05%（消費税込）   |
| (9) 管理報酬          | 出資金総額に対し月額0.525%（消費税込）（年換算6.30%（消費税込））  |
| (10) 成功報酬         | 平成23年4月20日、同年7月20日、同年10月20日現在において、本組合の利益から諸費用を控除した金額が出資金総額を超過した場合には、その超過額の80%を上限として、その算出された金額に対し30%（消費税込）<br>運用期間が終了し、本組合の利益から諸費用を控除した金額が出資金総額を超過した場合には、出資金総額の超過額に対し30%（消費税込） |

【利益分配及び成功報酬のイメージ図】



- |             |                             |
|-------------|-----------------------------|
| (11) 運用期間   | 11ヶ月（平成24年1月23日～同24年12月20日） |
| (12) 出資金払込日 | 平成24年1月20日（金）               |
| (13) 最低出資口数 | 一口金10万円                     |

## 6、本ファンドの出資金払込み銀行口座について

- |        |                                |
|--------|--------------------------------|
| 【銀行口座】 | 三菱東京UFJ銀行 日本橋中央支店（普通預金）0132158 |
| 【口座名義】 | プレミアFXファンド4号投資事業組合             |