

弊社設定の公募ファンドにおけるデリバティブ取引等のリスク管理方法について

弊社が設定する公募ファンドにおけるデリバティブ取引等のリスク管理は、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、以下の通り、行なっております。

【管理方法】

- 1 : 当該ファンドでリスク管理しております。管理手法にはVaR方式を用いております。
- 2 : 当該ファンドもしくは投資対象マザーファンド（あるいはその両方）でリスク管理しております。管理手法にはVaR方式を用いております。
- 3 : 当該ファンドではデリバティブ取引等を行なえませんが、投資対象となる当社私募ファンド（マザーファンドを含みます。）でリスク管理しております。管理手法にはVaR方式を用いております。
- 4 : 当該ファンドではデリバティブ取引等を行なえませんが、実質的に投資対象となる外国籍ファンドで管理する代替として、当該ファンドでリスク管理しております。管理手法にはVaR方式を用いております。
- 5 : 当該ファンドではデリバティブ取引等を行なえませんが、投資対象となる他社私募ファンドでリスク管理しております。
- 6 : デリバティブ取引等を行なえませんが、デリバティブ取引等のリスク管理は行ないません。

設定日	ファンド名	管理方法
1961/01/31	公社債投信 1月号	2
1961/02/24	公社債投信 2月号	2
1961/03/24	公社債投信 3月号	2
1961/04/24	公社債投信 4月号	2
1961/05/24	公社債投信 5月号	2
1961/06/24	公社債投信 6月号	2
1961/07/24	公社債投信 7月号	2
1961/08/21	公社債投信 8月号	2
1961/09/20	公社債投信 9月号	2
1961/10/20	公社債投信10月号	2
1961/11/20	公社債投信11月号	2
1961/12/20	公社債投信12月号	2
1979/01/11	キャピタルオープン	1
1986/02/13	インデックスファンドTSP	2
1987/11/27	ミリオン／インデックスポートフォリオ	2
1987/11/27	ミリオン／バランスポートフォリオ	2
1988/06/17	インデックスファンド225	2
1991/06/26	利益還元成長株オープン	2
1993/05/28	低位株オープン	1
1994/02/04	財形株投（一般財形30）	2
1994/02/04	財形株投（一般財形50）	2
1994/02/04	財形株投（年金・住宅財形30）	2
1995/01/17	リバース・トレンド・オープン	1
1995/01/17	ハイパー・ウェイブ	1
1996/12/02	日本トレンド・マネーポートフォリオ	1
1996/12/27	日本新興株オープン	1
1997/10/31	日興アクティブバリュー	2
1998/05/08	日興MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	6
1998/08/28	日興ジャパンオープン	2
1999/08/20	日興エコファンド	2
2000/02/18	日興クオンツ・アクティブ・ジャパン	2
2000/04/21	日興エボリューション	1
2000/09/28	ミュータント	2
2000/12/15	日興アクティブ・ダイナミクス	2
2001/07/09	上場インデックスファンド225	1
2001/09/07	日興・ピムコ・グローバル短期債券ファンド	4
2001/10/17	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	2
2001/10/17	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	2
2001/10/17	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	2
2001/10/17	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	2
2001/10/17	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	2
2001/10/17	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	2
2001/10/17	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	2
2001/10/17	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2
2001/10/17	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2
2001/10/17	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	2
2001/10/17	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	2
2001/10/17	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	2
2001/10/17	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	2
2001/10/17	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	2
2001/10/25	年金積立 アクティブ・ダイナミクス	2
2001/10/25	年金積立 クオンツ・アクティブ・ジャパン	2
2001/10/25	年金積立 日本短期債券オープン	2
2001/10/25	年金積立 インターナショナル・グロース・ファンド	2
2001/10/25	年金積立 インターナショナル・ボンド・ファンド	2
2001/10/31	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	2
2001/10/31	インデックスファンド225（日本株式）	2
2001/10/31	年金積立 Jグロース	2
2001/10/31	年金積立 エコファンド	2
2001/10/31	年金積立 ジャパンオープン	2
2001/12/20	上場インデックスファンドTOPIX	1
2001/12/21	TOPIXインデックスファンド（個人型年金向け）	2
2001/12/21	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	2
2001/12/21	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	2
2002/12/10	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	2
2002/12/10	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（DC専用）	2
2002/12/10	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	2
2002/12/10	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	2

設定日	ファンド名	管理方法
2002/12/10	DCインデックスバランス (株式20)	2
2002/12/10	DCインデックスバランス (株式40)	2
2002/12/10	DCインデックスバランス (株式60)	2
2002/12/10	DCインデックスバランス (株式80)	2
2003/02/28	GW7つの卵	2
2003/03/28	日興・GS 世界ソブリン・ファンド (毎月分配型)	5
2003/07/18	日興グローイング・ベンチャーファンド	2
2003/08/05	高金利先進国債券オープン (毎月分配型)	4
2003/08/05	財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型	4
2003/09/30	日興 豪州 インカム・オープン (毎月分配型)	5
2003/09/30	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型 (米ドルコース)	4
2003/11/07	インデックスファンド日本株式 (DC専用)	2
2003/11/07	インデックスファンド日本債券 (DC専用)	2
2003/12/18	利回り財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型	4
2004/01/27	日興グローバルREITファンド毎月分配型 A (ヘッジなし)	6
2004/03/10	ピムコ・ハイイールド・ファンド Aコース (為替ヘッジなし)	4
2004/03/10	ピムコ・ハイイールド・ファンド Bコース (為替ヘッジあり)	4
2004/03/26	ラサール・グローバルREITファンド (毎月分配型)	6
2004/05/11	日興ワールドREITファンド	6
2004/07/01	日興グローバルREITファンド (6ヵ月決算型)	6
2004/10/22	インデックスファンド Jリート	1
2004/11/30	年金インデックスファンド日本株式 (TOPIX連動型)	1
2005/02/15	日興・CS世界高配当株式ファンド (毎月分配型)	2
2005/02/28	日興AM中国A株ファンド	2
2005/04/15	日興キャッシュリッチ・ファンド	2
2005/06/15	日興AM中国A株ファンド2	2
2005/09/22	株ちょファンド日本 (高配当株・割安株・成長株) 毎月分配型	3
2005/09/29	世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型	3
2005/11/21	日興中小型グロース・ファンド	1
2005/11/22	グローバル高配当株式ファンド (奇数月分配型)	2
2006/03/01	日興BRICS株式ファンド	4
2006/03/07	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型 (円ヘッジコース)	4
2006/06/12	日興五大陸株式ファンド	2
2006/06/12	日興五大陸債券ファンド (毎月分配型)	2
2006/10/31	日興スリートップ (隔月分配型)	4
2006/12/15	世界のサイフ	4
2007/04/26	世界好配当インフラ株ファンド (偶数月分配型)	2
2007/06/21	世界銀行債券ファンド (毎月分配型)	4
2007/06/22	グローバル・カレンシー・ファンド (毎月決算型)	4
2007/06/29	アジアの財産3分法ファンド	4
2008/04/01	インデックスファンド海外新興国 (エマージング) 株式	2
2008/04/01	インデックスファンド海外新興国 (エマージング) 債券 (1年決算型)	2
2008/04/07	上場インデックスファンド中国A株 (パンダ) E Fund CSI300	3
2008/05/30	日興ジャパン高配当株式ファンド	2
2008/09/26	オーストラリア株式ファンド	2
2008/10/20	上場インデックスファンドJリート (東証REIT指数) 隔月分配型	1
2008/11/12	日興グローバルREITファンド資産成長型 (ヘッジなし)	6
2008/11/12	日興・CS世界高配当株式ファンド (資産成長型)	2
2008/11/12	高金利先進国債券オープン (資産成長型)	4
2009/07/10	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型 (ブラジルリアルコース)	4
2009/07/10	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型 (トルコリラコース)	4
2009/07/31	新ソブ	2
2009/07/31	資源ファンド (株式と通貨) ブラジルリアル・コース	4
2009/07/31	資源ファンド (株式と通貨) 南アフリカランド・コース	4
2009/07/31	資源ファンド (株式と通貨) オーストラリアドル・コース	4
2009/08/07	財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 資産成長型	4
2009/09/25	上場インデックスファンド海外債券 (FTSE WGBI) 毎月分配型	3
2009/11/20	資源株ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアル・コース> (毎月分配型)	4
2009/11/20	資源株ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランド・コース> (毎月分配型)	4
2009/11/20	資源株ファンド 通貨選択シリーズ<オーストラリアドル・コース> (毎月分配型)	4
2009/12/21	日興ブラジル株式ファンド	2
2010/01/22	上場インデックスファンド海外先進国株式 (MSCI-KOKUSAI)	3
2010/01/22	上場インデックスファンド海外新興国株式 (MSCIエマージング)	3
2010/02/19	SMBC・日興 世銀債ファンド	4
2010/02/19	日興マネー・アカウント・ファンド	2
2010/02/26	日興アッシュモア新興国財産3分法ファンド毎月分配型 (ブラジルリアルコース)	4
2010/02/26	日興アッシュモア新興国財産3分法ファンド毎月分配型 (インドルピーコース)	4
2010/02/26	日興マネー・アセット・ファンド	2
2010/03/18	世界標準債券ファンド	4
2010/05/13	上場インデックスファンド日本高配当 (東証配当フォーカス100)	1
2010/06/24	グリーン世銀債ファンド	4
2010/10/22	上場インデックスファンド米国株式 (S&P500)	3
2010/10/29	中華圏株式ファンド (毎月分配型)	3
2010/12/09	エマージング・ハイ・イールド・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース	4
2010/12/09	エマージング・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (マネープールファンド)	2
2011/02/28	円サポート	2
2011/03/03	上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本	3
2011/03/03	上場インデックスファンド豪州リート (S&P/ASX200 A-REIT)	3
2011/08/31	エマージング・プラス・円戦略コース	4
2011/08/31	エマージング・プラス・成長戦略コース	4
2011/08/31	エマージング・プラス (マネープールファンド)	2
2012/01/30	上場インデックスファンド新興国債券	3

設定日	ファンド名	管理方法
2012/08/06	アジアリートファンド（毎月分配型）	3
2012/11/21	アジア社債ファンド Aコース（為替ヘッジあり）	4
2012/11/21	アジア社債ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	4
2012/12/27	日興グラビティ・アメリカズ・ファンド	2
2013/03/22	上場インデックスファンド日経225（ミニ）	1
2013/03/25	ファイン・ブレンド（毎月分配型）	4
2013/03/25	ファイン・ブレンド（資産成長型）	4
2013/03/25	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）毎月分配型	3
2013/03/25	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）資産成長型	3
2013/05/31	アジアREITオープン（毎月分配型）	3
2013/07/16	スマート・ファイブ（毎月決算型）	4
2013/07/16	スマート・ファイブ（1年決算型）	4
2013/08/30	ピムコUSハイインカム・ローン・ファンド（毎月分配型）為替ヘッジなし	4
2013/08/30	ピムコUSハイインカム・ローン・ファンド（毎月分配型）為替ヘッジあり	4
2013/09/18	資源株ファンド 通貨選択シリーズ<米ドル・コース>（毎月分配型）	4
2013/09/24	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials	1
2013/10/21	ラサール・グローバルREITファンド（1年決算型）	2
2013/12/20	Jキャップ日本株ファンド	2
2014/01/27	上場インデックスファンドJPX日経インデックス400	1
2014/01/31	インデックスファンドJPX日経400	2
2014/02/18	ニュージーランド公社債ファンド（毎月分配型）	2
2014/02/18	インデックスファンドMLP（毎月分配型）	3
2014/03/10	インデックスファンドDAX（ドイツ株式）	2
2014/03/31	インデックスファンドNYダウ30（アメリカ株式）	2
2014/05/16	インド株式フォーカス（奇数月分配型）	4
2014/06/02	世界標準債券ファンド（1年決算型）	4
2014/07/02	ミューズニッチ米国BDCファンド（毎月分配型）	2
2014/07/02	ミューズニッチ米国BDCファンド（年2回決算型）	2
2014/08/19	欧州社債ファンド Aコース（為替ヘッジあり）	4
2014/08/19	欧州社債ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	4
2014/08/25	上場インデックスファンド日経レバレッジ指数	1
2014/08/29	スマート・ラップ・ジャパン（毎月分配型）	3
2014/08/29	スマート・ラップ・ジャパン（1年決算型）	3
2014/10/01	グローバルCOC債ファンド ヘッジなしコース	4
2014/10/01	グローバルCOC債ファンド 円ヘッジコース	4
2014/10/01	日興USグローイング・ベンチャーファンド	2
2014/11/05	グローバル・ハイブリッド・プレミア（為替ヘッジなし）	4
2014/11/05	グローバル・ハイブリッド・プレミア（為替ヘッジあり）	4
2014/11/12	インデックスファンドMLP（1年決算型）	3
2014/11/28	ミューズニッチ米国BDCファンド（為替ヘッジあり・毎月分配型）	2
2014/11/28	ミューズニッチ米国BDCファンド（為替ヘッジあり・年2回決算型）	2
2015/01/16	アジア・ヘルスケア株式ファンド	4
2015/02/13	国内株式エンハンス運用戦略ファンド（SMA専用）	2
2015/06/23	日興ロックフェラー・グローバル・エクイティ・ファンド	2
2015/08/31	グローバル・ロボティクス株式ファンド（1年決算型）	2
2015/08/31	グローバル・ロボティクス株式ファンド（年2回決算型）	2
2015/10/15	日本郵政株式／グループ株式ファンド	2
2015/11/30	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ	1
2016/01/29	ジャパン・ロボティクス株式ファンド（1年決算型）	2
2016/01/29	ジャパン・ロボティクス株式ファンド（年2回決算型）	2
2016/03/31	グローバル株式トップフォーカス	4
2016/05/24	上場インデックスファンド日本経済貢献株	1
2016/06/30	先進国資本エマージング株式ファンド（1年決算型）	2
2016/06/30	先進国資本エマージング株式ファンド（年2回決算型）	2
2016/08/29	上場インデックスファンド米国債券（為替ヘッジなし）	3
2016/08/29	上場インデックスファンド米国債券（為替ヘッジあり）	3
2016/12/16	グローバル・フィンテック株式ファンド	2
2017/01/23	グローバル・ロボティクス株式ファンド（為替ヘッジあり・1年決算型）	2
2017/01/23	グローバル・ロボティクス株式ファンド（為替ヘッジあり・年2回決算型）	2
2017/02/03	新・ミューズニッチ米国BDCファンド（為替ヘッジなし・毎月分配型）	2
2017/02/03	新・ミューズニッチ米国BDCファンド（為替ヘッジなし・年2回決算型）	2
2017/02/03	新・ミューズニッチ米国BDCファンド（為替ヘッジあり・毎月分配型）	2
2017/02/03	新・ミューズニッチ米国BDCファンド（為替ヘッジあり・年2回決算型）	2
2017/03/09	上場インデックスファンドMSCI日本株高配当低ボラティリティ（βヘッジ）	1
2017/06/22	上場インデックスファンドアジアリート	1
2017/07/31	ゴールド・ファンド（為替ヘッジあり）	2
2017/07/31	ゴールド・ファンド（為替ヘッジなし）	2
2017/09/07	新シルクロード経済圏ファンド	2
2017/09/15	グローバル・フィンテック株式ファンド（年2回決算型）	2
2017/09/15	グローバル・フィンテック株式ファンド（為替ヘッジあり）	2
2017/09/15	グローバル・フィンテック株式ファンド（為替ヘッジあり・年2回決算型）	2
2017/09/29	ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（SMA専用）	2
2017/11/30	深セン・イノベーション株式ファンド（1年決算型）	2
2018/01/31	グローバル・モビリティ・サービス株式ファンド（1年決算型）	2
2018/02/01	グローバル・メガピース	4
2018/07/31	上場インデックスファンド米国株式（S&P500）為替ヘッジあり	3
2018/08/13	グローバル・スペース株式ファンド（1年決算型）	2
2018/10/04	グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）	3
2018/10/04	グローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型）	3
2019/01/11	国内株式アクティブバリューファンド（SMA専用）	2
2019/01/16	グローバル全生物ゲノム株式ファンド（1年決算型）	2
2019/03/15	グローバル担保付き債券ファンド（為替ヘッジあり）	2

設定日	ファンド名	管理方法
2019/03/29	円キャッシュプラス・高金利先進国債券ファンド	2
2019/06/03	上場インデックスファンドJリート（東証REIT指数）隔月分配型（ミニ）	2
2019/06/28	グローバル・プロスペクティブ・ファンド	4
2019/07/02	ジパング企業債ファンド	2
2019/08/01	PIMCO新興国ハイインカム債券ファンド（毎月分配型）	4
2019/08/01	PIMCO新興国ハイインカム債券ファンド（1年決算型）	4
2019/10/31	ビッグデータ新興国小型株ファンド（1年決算型）	5
2020/02/12	グローバル5.5倍バランスファンド（1年決算型）	2
2020/03/13	上場インデックスファンド米国株式（ダウ平均）為替ヘッジあり	2
2020/05/11	華流国潮イノベーション株式ファンド（1年決算型）	2
2020/07/31	デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド	2
2020/08/31	インデックスファンドNASDAQ100（アメリカ株式）	2
2020/09/03	上場インデックスファンド日経ESGリート	1
2020/09/10	グローバル全生物ゲノム株式ファンド（年2回決算型）	2
2020/09/17	上場インデックスファンド米国株式（NASDAQ100）為替ヘッジなし	2
2020/09/17	上場インデックスファンド米国株式（NASDAQ100）為替ヘッジあり	2
2020/10/21	グローバル・モビリティ・サービス株式ファンド（年2回決算型）	2
2021/03/31	グローバル・ダイナミックヘッジα	4
2021/04/26	グローバル・エクスポネンシャル・イノベーション・ファンド	4
2021/05/14	デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド（予想分配金提示型）	2
2021/06/09	グローバル・スペース株式ファンド（年2回決算型）	2
2021/06/09	グローバル・スペース株式ファンド（為替ヘッジあり・1年決算型）	2
2021/06/09	グローバル・スペース株式ファンド（為替ヘッジあり・年2回決算型）	2
2021/06/23	グローバル5.5倍バランスファンド（予想分配金提示型）	2
2021/06/30	DC世界株式・厳選投資ファンド	4
2021/08/16	グローバル水素株式ファンド	2
2021/09/10	チャイナ・エネルギー・イノベーション株式ファンド	2
2021/12/15	Tracers グローバル2倍株（地球コンプライト）	2
2022/01/31	ジパング・オーナー企業株式ファンド	2
2022/02/14	上場インデックスファンド豪州国債（為替ヘッジあり）	3
2022/02/14	上場インデックスファンド豪州国債（為替ヘッジなし）	3
2022/03/31	グローバル・メタバース株式ファンド	2
2022/07/29	グローバル・アグリカルチャー&フード株式ファンド	2
2022/08/12	上場インデックスファンドフランス国債（為替ヘッジなし）	3
2022/08/12	上場インデックスファンドフランス国債（為替ヘッジあり）	3
2022/08/31	Tracers S&P500ゴールドプラス	2
2022/08/31	インデックスファンドS&P500（アメリカ株式）	2
2022/10/28	Tracers S&P500配当貴族インデックス（米国株式）	2
2022/12/13	上場インデックスファンド米国株式（ダウ平均）為替ヘッジなし	2
2023/02/10	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	2
2023/03/14	上場インデックスファンドS&P500先物レバレッジ2倍	1
2023/03/14	上場インデックスファンドS&P500先物インバース	1
2023/03/16	米国超長期プライム社債ファンド（奇数月分配型）	2
2023/03/16	米国超長期プライム社債ファンド（1年決算型）	2
2023/04/26	インデックスファンドMSCIオール・カントリー（全世界株式）	2
2023/04/26	Tracers MSCIオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	2
2023/06/20	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	2
2023/06/20	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	2
2023/07/12	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	4
2023/08/09	ラサール・グローバルREITファンド（奇数月分配型）	2
2023/09/11	ファイン・ブレンド（奇数月分配型）	4
2023/09/20	DC低リスク運用・先進国バランスファンド（円キャッシュプラス）	2
2023/09/26	アセアン・ギガトレンド株式ファンド	2
2023/09/29	インデックスファンドSOX指数（米国上場半導体株式）	2
2023/10/02	上場Tracers 米国債0-2年ラダー（為替ヘッジなし）	1
2023/12/18	インデックスファンドJリート（東証REIT指数）偶数月分配型	2
2023/12/22	ジャパン半導体株式ファンド	2
2024/01/31	インデックスファンド日経平均高配当株50（奇数月分配型）	2
2024/01/31	Tracers 日経平均高配当株50インデックス（奇数月分配型）	2
2024/05/16	Tracers S&P500トップ10インデックス（米国株式）	2
2024/05/17	全世界超分散株式ファンド	4