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ので、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（東証ＲＥＩＴ指数）毎月分配型	2
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（ブラジルレアルコース）	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	資源ファンド（株式と通貨）ブラジルレアル・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
2009/08/07	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＜ブラジルレアル・コース＞（毎月分配型）	4
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
2010/02/26	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（ブラジルレアルコース）	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
2010/10/22	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・ブラジルレアルコース	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
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	ロックフェラー・オールアメリカ株式ファンド	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

設定日	ファンド名	管理方法
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
2014/08/25	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ＣｏＣｏ債ファンド　ヘッジなしコース	4
2014/10/01	グローバルＣｏＣｏ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
2014/11/12	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ト運用戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	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
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

設定日	ファンド名	管理方法
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（地球コンプリート）	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
2024/06/28	2050年満期米国国債ファンド（年４回分配型）	2
2024/07/11	上場インデックスファンド日経半導体株	1
2024/08/21	新・ミューズニッチ米国ＢＤＣファンド（為替ヘッジなし・年４回分配型）	2
2024/10/07	インデックスファンドNifty50（インド株式）	2
2024/10/25	ＤＣ日本株人材活躍企業応援ファンド	2
2024/11/12	Tracers S&P1000インデックス（米国中小型株式）	2
2025/01/24	Tracers NASDAQ100ゴールドプラス	2
2025/04/22	グローバル・ロボティクス株式ファンド（予想分配金提示型）	2
2025/04/22	グローバル・ロボティクス株式ファンド（為替ヘッジあり・予想分配金提示型）	2
2025/05/16	NASDAQ100ゴールドプラス	2
2025/05/29	Tracers DJ USディビデンド100（米国高配当株式）年４回分配型	2