

「デリバティブ取引に係る投資制限」に関するリスク管理方法

当社が設定・運用を行う公募投資信託におけるデリバティブ取引等に係る投資にあたっては、一般社団法人投資信託協会の規則に定められた合理的な方法の一つである「標準的方式」を用いて算出したリスク量が、投資信託財産の純資産総額の 80%以内になるよう管理します。

「標準的方式」のリスク量は、金融商品取引業者に対する自己資本比率規制における「市場リスク相当額」の算出方法を参考に計算します。

但し、投資信託約款においてデリバティブ取引等の利用方法をヘッジ目的のみに制限している場合等には、「簡便法」（各デリバティブ取引等の想定元本が、投資信託財産の純資産総額を超えないように管理する方法）により管理する場合があります。

以上