

## 「デリバティブ取引等」のリスク管理方法

当社は、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、「デリバティブ取引等」(※)に係る投資を管理する方法として、以下の方式により、適正に管理・運営いたします。

### < V a R 方式 >

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」の算出方法のうち、内部管理モデル方式 ( V a R 方式 ) の市場リスク相当額の算出方法を参考に用いたリスク量が、投資信託財産の純資産総額の80%以内となるよう管理する方法。

(※) 「金融商品取引業等に関する内閣府令 (平成 19 年府令第 52 号)」第 130 条第 1 項第 8 号及び一般社団法人投資信託協会規則「投資信託等の運用に関する規則」第 17 条に定めるデリバティブ取引等をいいます。