2016年1月

投資家の皆さまへ

楽天投信投資顧問株式会社

当社ファンドのデリバティブ取引等に係る投資制限に関し
合理的な方法としてあらかじめ定めたリスク管理方法について

当社は、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号および投資信託等の運用に関する規則第17条に基づき、当社が設定・運用するファンドについて、原則として「標準的方式」(注)により適切に管理します。

(注)金融商品取引業者に対する自己資本比率規制(金融庁告示第59号「金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件」をいう。)における「市場リスク相当額」の算出方法のうち、標準的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。

以　上

楽天投信投資顧問株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第1724号
加入協会:一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

■当資料は、金融商品取引業等に関する内閣府令および投資信託等の運用に関する規則に基づき作成されたものです。■記載内容は当資料作成時点のものであり、今後、変更された場合には遅滞なく更新・開示されます。