

〈別添〉

## 調査関係書類作成パターン

○プロダクト概要(サマリー)

項番	項目 (内容)	作成	備考
—	表紙	要	ヘッジ付き、ヘッジなし兼用
ヘッジ付き用			
【1】-1	プロダクトの基本プロフィール	要	
【2】-1	プロダクトの概要、投資哲学等	要	
【3】-1	超過収益源泉の説明	要	
【4】-1	運用制約への対応(可否)、考え方等	要	
【5】-1	年度超過収益率、要因分析、リスク等	要	ベンチマークはWGBI・円ヘッジ
【6】-1	要因分析項目の説明	要	
【7】-1	過去の大きなドローダウンや受託額変動	要	
【8】-1	ポートフォリオ属性推移 (種別・格付ウエイト)	要	
【9】-1	ポートフォリオ属性推移 (国別配分)	要	ベンチマークはWGBI・円ヘッジ
【10】-1	ポートフォリオ属性推移 (通貨配分)	要	ベンチマークはWGBI・円ヘッジ
【11】-1	月次運用実績 (ヘッジ付き・円ベース)	要	ベンチマークはWGBI・円ヘッジ
【12】-1	オフベンチマーク国債、非国債の保有状況	要	
ヘッジなし用			
【1】-2	プロダクトの基本プロフィール	要	
【2】-2	プロダクトの概要、投資哲学等	要	
【3】-2	超過収益源泉の説明	要	
【4】-2	運用制約への対応(可否)、考え方等	要	
【5】-2	年度超過収益率、要因分析、リスク等	要	ベンチマークはWGBI・ヘッジなし
【6】-2	要因分析項目の説明	要	
【7】-2	過去の大きなドローダウンや受託額変動	要	
【8】-2	ポートフォリオ属性推移 (種別・格付ウエイト)	要	
【9】-2	ポートフォリオ属性推移 (国別配分)	要	ベンチマークはWGBI・ヘッジなし
【10】-2	ポートフォリオ属性推移 (通貨配分)	要	ベンチマークはWGBI・ヘッジなし
【11】-2	月次運用実績 (ヘッジなし・円ベース)	要	ベンチマークはWGBI・ヘッジなし
【12】-2	オフベンチマーク国債、非国債の保有状況	要	

○運用機関調査回答書(調査票)

ヘッジ付き用			
様式 No	項目 (内容)	作成	備考
—	表紙	要	
様式 1-1-1	1. (1) 会社概要	要	
様式 1-1-2	(別添 1) 企業グループ全体の一覧表	要	
様式 1-2	1. (2) 業況	要	
様式 1-3	1. (3) 組織図	要	
様式 1-4	1. (4) 運用スタッフ	要	
様式 1-5	1. (5) 運用業務に関する行政処分の状況	要	
様式 2-1	2. (1) 応募プロダクトの概要	要	
様式 2-2	2. (2) 運用体制	要	
様式 2-3-1	2. (3) 運用プロセス①②	要	
様式 2-3-2	2. (3) 運用プロセス③	要	
様式 2-4	2. (4) 運用モニタリング(ミドルオフィス体制)	要	
様式 2-5	2. (5) デリバティブの利用	要	
様式 2-6	2. (6) 為替ヘッジ	要	ヘッジ付き用のみ作成
様式 2-7	2. (7) 特記事項	要	
様式 3-1	3. (1) リスク管理体制	要	
様式 3-2	3. (2) トレーディング体制	要	
様式 3-3	3. (3) 事務処理体制	要	
様式 3-4	3. (4) ディスクロズ体制	要	
様式 3-5	3. (5) コンプライアンス・監査体制	要	
様式 3-6	3. (6) 運用報酬率表	要	
様式 3-7	3. (7) 成功報酬体系について	要	

ヘッジなし用			
様式 No	項目 (内容)	作成	備考
—	表紙	要	
様式 2-1	2. (1) 応募プロダクトの概要	要	
様式 2-2	2. (2) 運用体制	要	
様式 2-3-1	2. (3) 運用プロセス①②	要	
様式 2-3-2	2. (3) 運用プロセス③	要	
様式 2-4	2. (4) 運用モニタリング(ミドルオフィス体制)	要	
様式 2-5	2. (5) デリバティブの利用	要	
様式 2-7	2. (7) 特記事項	要	
様式 3-1	3. (1) リスク管理体制	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要
様式 3-2	3. (2) トレーディング体制	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要
様式 3-3	3. (3) 事務処理体制	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要
様式 3-4	3. (4) ディスクロズ体制	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要
様式 3-5	3. (5) コンプライアンス・監査体制	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要
様式 3-6	3. (6) 運用報酬率表	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要
様式 3-7	3. (7) 成功報酬体系について	(要)	ヘッジ付きと同内容であれば作成不要

※ヘッジなし用は、様式 1-1～様式 1-5、様式 2-6 は作成不要。