

# ○商品ラインナップ

資産クラス	プロダクト名	運用スタイル	ベンチマーク
国内債券	国内債券 (総合戦略型)	金利戦略をコアとし、クレジット戦略を組み合わせた総合戦略型のアクティブ運用	NOMURA-BPI (総合)
	国内債券 (短期事業債)	金利リスクはインデックスから大きく乖離させずに、短期事業債を主な投資対象として銘柄選択を行うアクティブ運用	NOMURA-BPI (国債短期)
	国内債券 (超長期債券)	自社開発の債券投資環境分析モデルによる定量的判断をベースに、マーケットセンチメント分析、イールドカーブ分析等を加味したアクティブ運用	NOMURA-BPI (国債超長期11年超)
	国内金利ロングショート	国内の債券、債券先物、債券先物オプション、選択権付債券売買取引、CPを主な投資対象とし、国内金利の変動リスクを収益源とした絶対収益を追求する運用	設定していません
グローバル債券	グローバルヘッジ付外債	先進国 (FTSE世界国債インデックス投資対象国) のイールドカーブを分析し、ショートやレバレッジを用いない現物債券のみの運用 為替は原則フルヘッジ	設定していません
	内外債券運用 (絶対収益追求型)	先進国を中心とした内外債券と通貨を投資対象とし、債券先物や外貨のショート・ポジションを活用することにより、絶対収益を追求する運用	有担保コル翌日物
	グローバル債券先物ロングショート	先進8カ国のイールドカーブを分析し、ロールダウン効果を極大化しながら金利変化によるキャピタルリスクのリスクを抑制することにより、絶対収益を追求する債券先物ロングショート運用	有担保コル翌日物
アセット	円資産マルチアセット運用	債券先物および株式先物の価格水準を分析し、中短期的価格動向を捉えながら、先物オプションおよびロスカットルールによりダウンサイドリスクを抑制し、安定した絶対収益を追求する運用	設定していません
国内株式	国内株式 (クオンツRIM型)	独自のバリュエーション評価モデル「RIM」で計測される本来の企業価値に対する割安度を重視したクオンツアクティブ運用	TOPIX (配当込み)
	国内株式 ( $\beta$ コントロール型クオンツRIM)	個別銘柄への投資 (ロングオンリー) による $\alpha$ の獲得と先物のショートを活用した $\beta$ 戦略の付加により、安定的に絶対収益を追求するロングショート運用	無担保コル翌日物
	国内株式 (割安株長期投資型)	長期投資による収益の獲得を目指す、企業調査に基づく個別銘柄選定 (集中投資) によるアクティブ運用	設定していません
	国内株式 ( $\beta$ 戦略型割安株集中投資)	個別銘柄への集中投資 ( $\alpha$ 戦略) による収益の獲得に加え、指数先物による $\beta$ ヘッジを付加することにより、安定的に絶対収益を追求する運用	無担保コル翌日物
	国内株式 (クオンツ・ベータヘッジ高配当利回り型運用)	高配当利回りの国内株式に投資しつつ、先物売り建てることで日本株との市場感応度を抑制し、絶対収益の獲得を目指す運用	無担保コル翌日物
	国内株式 (サステナブル成長株運用<ESG>)	通常の企業分析に加え、ESGの観点から企業の生み出す付加価値の動向をチェックし、成長持続性の高い企業を選別するとともに、配当利回りも考慮した国内株式の銘柄選択 (集中投資) をすることで、収益の獲得を目指す運用	設定していません
	国内株式 (ジャンメンタル/Sインフラ資源)	日本株のインフラ資源関連銘柄を投資対象に、ロング、ショート両面から絶対収益を追求する運用 (基本はネット・ニュートラル)	無担保コル翌日物
	国内株式 (ジャンメンタル/S金融)	日本株の金融セクター関連銘柄を投資対象に、ロング、ショート両面から絶対収益を追求する運用 (基本はネット・ニュートラル)	無担保コル翌日物
	国内株式 (ジャンメンタル/Sテック)	国内株式のテクノロジー関連銘柄を投資対象に、ロング/ショート両面から絶対収益を追求する運用 (基本はネット・ニュートラル)	無担保コル翌日物
	国内株式 (ジャンメンタル/Sハリュエ)	カタリストのある割安株のロングと割高株のショート、先物を使った $\beta$ コントロールで絶対収益を狙う運用	無担保コル翌日物