

ヘッジファンド



ヘッジ・ファンドとは

ヘッジ・ファンドとは、さまざまな取引手法を駆使し、絶対収益を追求し続けることを目的としたファンドです。ヘッジ(hedge)は直訳すると「避ける」という意味で、相場が下がってもその影響を受けないように運用をすることから、ヘッジ・ファンドと呼ばれます。一般の投資信託は、その商品の戦略が狙う方向に相場が動いたときのみ利益が出るものが多いのですが、ヘッジ・ファンドは、絶対収益の追及が前提となるため、先物取引や信用取引などを積極的に活用して相場の上げ下げに関係なく利益を追求するという特長があります。ローリスク・ローリターンなものから、ハイリスク・ハイリターンなものまで、ファンドの運用は様々で、投資家層も、個人富裕層から保守的な運用を好む年金基金などの機関投資家にまで広がっています。これは、ヘッジ・ファンドがリスクを抑えてリターンを追求した商品であるという認識が広まると共に、伝統的な投資先である株式・債券等との相関性も低いいため、ポートフォリオに加えることによる投資の分散効果が期待できる、などの理由によるものです。

ヘッジ・ファンドの戦略

株式ロング・ショート戦略

値上りが期待できる銘柄を買い持ち、値下がりが予想される銘柄を空売りすることで、株式市場全体が上昇局面でも下降局面でも収益を狙いに行ける戦略です。一般に、株式を買い持つことを「ロング」あるいは「ロング・ポジションをとる」と言い、売り持つことを「ショート」あるいは「ショート・ポジションをとる」と言うことから、株式ロング・ショート戦略と呼ばれています。

マーケット・ニュートラル戦略

この戦略も株式ロング・ショート戦略と同様に、個別銘柄に関する情報・分析に基づいて、ロングとショートのポジションを組み合わせた取引を行います。株式ロング・ショート戦略との違いは、買い持ちしている株の投資額と、空売りしている株の投資額を概ね等しくする投資戦略を取り、株式市場全体が上下する影響を極力受けないように運用しています。市場全体の動きを表す「ベータ」ではなく、個別銘柄の持つ「アルファ」を取りに行きます。

取扱商品

当社では、主に、日本株ロング・ショート、外国株ロング・ショート、日本株マーケット・ニュートラルの戦略をとったヘッジ・ファンドを多数取り扱っております。今後も、随時、魅力的なヘッジ・ファンドを世界中から探しだし、パフォーマンスのいいヘッジ・ファンドを厳選して導入を続けてまいります。なお、三田証券を通してヘッジ・ファンドを購入される場合には、日本国内での契約、日本語でのサポート、日本語版のレポートの提供、当社保護預り口座内での管理が可能であり、外国籍投資信託への投資経験が少ない方でも、安心してお取引をいただけます。

イベント・ドリブン戦略

企業の合併・買収・分社・増配などの重要な出来事が起きた際に、そのイベントによって生まれる収益を得るための手法です。こういったイベントは、株価を大きく動かす可能性が高いため、その機会を狙って投資することにより収益を上げる手法です。

グローバル・マクロ戦略

様々な商品が投資対象(株式、先物、デリバティブ、商品等)です。雇用、生産、物価など経済の基本的事項や市場間のゆがみに着目し、割安と思われる資産を購入し、割高と思われる資産を空売りし、収益の獲得を目指します。

アービトラージ(裁定取引)戦略

同一の商品、証券、通貨等が2つ以上の市場で取引されているとき、安い価格の市場で商品を買ひ、高い価格の市場で同一商品売り、理論上リスクなしにその価格差から利益を得る手法です。鞘取り取引とも呼ばれています。

お申し込み・お問い合わせ

当社担当者に直接お電話・メールを頂くか、当社ホームページよりお申し込み、お問い合わせをお願いいたします。その際には、「ヘッジファンドについて」とお知らせ下さい。

電話番号 03-3666-0011

Mail info@mitasec.com

WEBサイト <http://mitasec.com>

トップページの「Contact Us ~ on lineお問い合わせフォーム」をクリックして、所定の事項とお問い合わせ内容をご記入の上、送信してください。

会社概要

商号 三田証券株式会社 (Mita Securities Co., Ltd.)
登録番号 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第175号
貸金業者 東京都知事(6)第27088号
宅地建物取引業者 国土交通大臣(1)第9342号
不動産特定共同事業 金融庁長官・国土交通大臣第76号
設立年月 昭和24年(1949年)7月
資本金 5億円
代表者 代表取締役社長 三田 邦博

所在地 東京本社 〒103-0026 東京都中央区日本橋兜町3番11号
大阪支店 〒541-0054 大阪府大阪市中央区南本町一丁目7番15号
シンガポール支店 07-03/04 112 Robinson Road Singapore 068902
加入金融商品取引所 東京証券取引所、大阪取引所
加入協会 日本証券業協会
公益社団法人 東京都宅地建物取引業協会
指定紛争解決機関 (金商)特定非営利活動法人 証券・金融商品あつせん相談センター
(貸金)日本貸金業協会、貸金業相談・紛争解決センター

当社が取り扱っている商品・サービス等(以下「商品等」という。)をご利用頂く際には、各商品等に所定の手数料・諸費用等(以下「手数料等」という。)をご負担頂く場合があります。また、各商品等には価格の変動等による損失を生じるおそれがあります。なお、取引の形態や内容によって各々の取引の条件が異なってくるため、一般的なサービスの概要を説明した本資料には手数料等や個別取引のリスクを記載できておりません。各商品等にかかる手数料等及びリスクについては、契約締結前交付書面、目論見書その他説明書類(以下「説明書類等」という。)を十分にご確認下さい。投資に関する最終決定はお客様ご自身の判断でなさるようお願いいたします。