

『R & I ファンド大賞 2016』受賞ファンドを公表

～確定給付年金部門～



格付投資情報センター(R&I)は、先月4月22日に「R&I ファンド大賞 2016」(後援:日本経済新聞社、協賛:QUICK 資産運用研究所)の投資信託、確定拠出年金、NISA 部門および10周年特別表彰を公表したのに続き、この度、確定給付年金部門の受賞ファンドを公表しました(http://www.r-i.co.jp/jpn/ie/itr/fund_award/)。R&I では、長年にわたり確定給付年金向けファンドや個人投資家向けファンド、確定拠出年金向けファンドの定量評価および定性評価を行ってきました。当大賞は、現状の定量評価の枠組みを活用し、投資信託、確定拠出年金、NISA、確定給付年金の各分野で優れた運用成績を示したファンドを表彰するものです。恣意性を排除した基準により第三者の立場から選定するア

ワードとして、多くの資産運用関係者の方々に認知されています。

受賞ファンド一覧

【確定給付年金】

部門	受賞ファンド名称	運用会社
国内株式 コア型	MFS日本株式コンセントレーテッド	MFSインベストメント・マネジメント株式会社
	日本長期成長株集中投資戦略	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
	SMAM国内株式ニュー α	三井住友アセットマネジメント株式会社
国内株式 グロース型	国内株式GARP	東京海上アセットマネジメント株式会社
	国内株式Focus	東京海上アセットマネジメント株式会社
	日本株式	日本コムジェスト株式会社
国内株式 バリュー型	国内株式 オポチュニティ戦略	シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社
	特別勘定第1特約 円貨建株式ロV	住友生命生命保険相互会社
	SMAM国内株式バリュー	三井住友アセットマネジメント株式会社
国内中小型 株式型	特別勘定第1特約 円貨建株式ロB	住友生命生命保険相互会社
	SMAM国内株式中小型	三井住友アセットマネジメント株式会社
	国内株式第37ファンド(中小型リサーチ重視型)	三菱UFJ信託銀行株式会社
国内債券型	国内債券アクティブ運用	アムンディ・ジャパン株式会社
	国内債券S43 スプレッド型	三井住友信託銀行株式会社
	日本債券アクティブ	明治安田アセットマネジメント株式会社

(つづき)

部門	受賞ファンド名称	運用会社
外国株式型	グローバル・オポチュニティーズ(除く日本)	ウエリントン・マネージメント・ジャパン・ピーティイー・リミテッド
	外国株式計量アクティブ運用	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
	外国株式アクティブ(KOKUSAI)	野村アセットマネジメント株式会社
外国債券型	外国債券 リサーチアクティブ 金利・為替型	DIAMアセットマネジメント株式会社
	フィデリティ・グローバル・ボンド(除日本)	フィデリティ投信株式会社
	ブラックロック グローバル債券アクティブ運用戦略	ブラックロック・ジャパン株式会社
外国株式 エマージング 型	エマージング・マーケット・ストラテジック・コア株式運用	アライアンス・バーンスタイン株式会社
	エマージング・マーケット・リサーチ・エクイティ	ウエリントン・マネージメント・ジャパン・ピーティイー・リミテッド
	グローバル・エマージング市場株式	日本コムジエスト株式会社
外国債券 エマージング 型	外貨建エマージング債券(国債)	アッシュモアジャパン株式会社
	エマージング市場債券	ウエリントン・マネージメント・ジャパン・ピーティイー・リミテッド
	ピクテ・エマージング債券(ドル建て)	ピクテ投信投資顧問株式会社

※運用会社名で五十音順に掲載

(ご参考)「R & I ファンド大賞 2016」について

特徴

ファンドの運用実績評価において、

- ・今年度で 10 回目の表彰
2007 年から開始、今年度で 10 回目の表彰
- ・4分野表彰
確定給付年金向けファンド及び個人投資家向けファンド、確定拠出年金向けファンド、NISA 向けファンドの4分野で同時に表彰を実施するのはR&Iのみ。
- ・国内系による本格的な表彰
純粋な国内企業によるファンドの表彰はR&Iのみ。
- ・中立・公正な立場からの表彰
R&Iはあらゆる運用機関と一線を画しており、自ら運用も手がけていない。こうした中立的な立場から表彰する。

概要

・表彰対象

「投資信託」、「投資信託／総合部門」および「10 周年特別表彰」は確定拠出年金専用ファンドを除く国内籍公募追加型株式投信、「確定拠出年金」は確定拠出年金向けに利用される国内籍公募追加型株式投信、「NISA」はNISA(少額投資非課税制度)向けに利用される国内籍公募追加型株式投信、「確定給付年金」は『R&I ユニバーサデータサービス』に登録されているファンド、を対象にしており、いずれも基本的にR&Iによる分類をベースとしている。今年度について、「投資信託」は国内株式型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、国内REIT型、外国REIT型、国内SRI・環境関連型、北米株式型、欧州株式型、エマージング株式マルチリージョナル型、アジア株式マルチカントリー型、インド株式型、中国関連株式型、インフラ関連外国株式型、医療・バイオ関連外国株式型、外国債券円ヘッジ型、北米債券型、オーストラリア・ニュージーランド債券型、エマージング債券マルチリージョナル型、アジア債券型、ハイイールド債券型の各カテゴリーを、「確定拠出年金」は国内株式型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、外国債券円ヘッジ型の各カテゴリーを、「NISA」は国内株式型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券円ヘッジ型、バランス安定型、バランス安定成長型、バランス成長型の各カテゴリーを、「投資信託／総合部門」は国内株式総合、外国株式総合、外国債券総合、バランス総合の各カテゴリーを、「10 周年特別表彰」は国内株式型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、外国債券円ヘッジ型の各カテゴリーを対象とした。なお、「確定給付年金」は国内株式コア型、国内株式グロース型、国内株式バリュー型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、外国株式エマージング型、外国債券エマージング型の各カテゴリーを対象とした。

・選考方法

選考は、「投資信託」、「確定拠出年金」、「NISA」、「確定給付年金」では 2014、2015、2016 年それぞれの 3 月末時点における1年間の運用実績データを用いた定量評価がいずれも上位 75%に入っているファンドに関して、2016 年 3 月末における 3 年間の定量評価によるランキングに基づいて表彰している。「10 周年特別表彰」では、2011、2016 年それぞれの 3 月末における 5 年間の運用実績データを用いた定量評価および 2016 年 3 月末時点における 3 年間の運用実績データを用いた定量評価がいずれも上位 75%に入っているファンドに関して、2016 年 3 月末における 10 年間の定量評価によるランキングに基づいて表彰している。定量評価は、「投資信託」、「確定拠出年金」、「NISA」、「10 周年特別表彰」では「シャープレシオ」を採用、表彰対象は償還予定日まで1年以上の期間を有し、「投資信託」、「NISA」、「10 周年特別表彰」では残高が 30 億円以上かつカテゴリー内で上位 50%以上、「確定拠出年金」では残高が 10 億円以上かつカテゴリー内で上位 75%以上、「NISA」では 2016 年 3 月末における過去 3 年間の月次収益率の標準偏差(年率)が 30%以下の条件を満たすファンドとしている。「確定給付年金」では定量評価に「インフォメーション・レシオ」を採用している。なお、「投資信託」、「確定拠出年金」、「NISA」、「10 周年特別表彰」では上位 1 ファンドを「最優秀ファンド賞」、次位 2 ファンド程度を「優秀ファンド賞」として表彰している。「確定給付年金」では受賞区分を設けていない。「投資信託／総合部門」では、2016 年 3 月末において残高 30 億円以上のファンドを 3 本以上設定する運用会社を表彰対象とし、各ファンドの 3 年間における「シャープレシオ」の残高加重平均値によるランキングに基づき、上位 1 社を「最優秀賞」、次位 2 社を「優秀賞」として表彰している。

後援 日本経済新聞社

協賛 QuickKnowledge
資産運用研究所

「R & I ファンド大賞」は、R & I が信頼し得ると判断した過去のデータに基づく参考情報（ただし、その正確性及び完全性につき R & I が保証するものではありません）の提供を目的としており、特定商品の購入、売却、保有を推奨、又は将来のパフォーマンスを保証するものではありません。当大賞は、信用格付業ではなく、金融商品取引業等に関する内閣府令第 299 条第 1 項第 28 号に規定されるその他業務（信用格付業以外の業務であり、かつ、関連業務以外の業務）です。当該業務に関しては、信用格付行為に不当な影響を及ぼさないための措置が法令上要請されています。当大賞に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は R & I に帰属しており、無断複製・転載等を禁じます。「投資信託／総合部門」の各カテゴリーは、受賞運用会社の該当ファンドの平均的な運用実績を評価したもので、受賞運用会社の全ての個別ファンドについて運用実績が優れていることを示すものではありません。