

『R & I ファンド大賞 2017』受賞運用戦略を公表

～確定給付年金部門～



格付投資情報センター(R&I)は、4月20日に「R&I ファンド大賞 2017」(後援:日本経済新聞社、協賛:QUICK 資産運用研究所)の投資信託、iDeCo・DC、NISA、投資信託10年部門およびQUICK特別賞を公表したの
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
(www.r-i.co.jp/jpn/ie/itr/fund_award/)。R&Iでは、長年にわたり確定給付
年金向け運用戦略や個人投資家向け公募投信、iDeCo・DC(確定拠出年
金)向け投信等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、iDeCo・DC、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。

受賞運用戦略一覧

【確定給付年金】

部門	運用戦略名称	運用会社
国内株式 コア	国内株式特化型	ニッセイ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
	国内株式第41ファンド(市場型)	三菱UFJ信託銀行株式会社
国内株式 グロース	SMAM国内株式グロース	三井住友アセットマネジメント株式会社
	国内株式第74ファンド(サステイナブル成長銘柄投資型)	三菱UFJ信託銀行株式会社
	日本株式戦略	レオス・キャピタルワークス株式会社
国内株式 バリュー	ジャパン・バリュー・リアライゼーション	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
	国内株式アクティブ(第25株式口/FCV戦略リサーチ・バリュー・プラス)	みずほ信託銀行株式会社
	SMAM国内株式高配当	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	年金国内株式中小型	大和住銀投信投資顧問株式会社
	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
	小型株(集中投資)/株式ロZ	株式会社りそな銀行

(つづき)

部門	運用戦略名称	運用会社
国内債券	国内債券アクティブ運用	アムンディ・ジャパン株式会社
	国内債券アクティブ戦略 ブロード・マーケット型	日興アセットマネジメント株式会社
	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
外国株式	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
	グローバル・フォーカス・グロース(除く日本)株式運用戦略(エマージング制限付)	ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド 東京支店
外国債券	外国債券 リサーチアクティブ 金利・為替・クレジット型	アセットマネジメントOne株式会社
	グローバル・ボンド(除日本)(為替ヘッジなし)	フィデリティ投信株式会社
	外国債券アクティブ	野村アセットマネジメント株式会社
外国株式 エマージング	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
	エマージング市場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
	新興国株式HALO戦略	UBSアセット・マネジメント株式会社
外国債券 エマージング	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
	外貨建エマージング債券(総合)	アッシュモアジャパン株式会社
	エマージング債券運用戦略	ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド 東京支店

※運用会社名で五十音順に掲載

「R & I ファンド大賞 2017」について

特徴

- ・今年度で 11 回目の表彰
2007 年から開始、今年度で 11 回目の表彰
- ・4分野表彰
確定給付年金向け運用商品及び個人投資家向けファンド、iDeCo・DC 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。
- ・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。

選考方法・対象

- ・投資信託、iDeCo・DC、NISA、投資信託 10 年および確定給付年金部門について
「投資信託部門」、「iDeCo・DC 部門」、「確定給付年金部門」では 2015、2016、2017 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、2017 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。「NISA 部門」では「R&I NISA スクリーニング」の 2017 年版(2 月 10 日に公表)の基準を満たしたファンドに関して、2017 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。「投資信託 10 年部門」では、2012、2017 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 2017 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、2017 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、「投資信託部門」、「iDeCo・DC 部門」、「NISA 部門」、「投資信託 10 年部門」では「シャープ・レシオ」を採用、「確定給付年金部門」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。表彰対象は償還予定日まで 1 年以上の期間を有し、「投資信託部門」、「投資信託 10 年部門」では残高が 30 億円以上かつカテゴリー内で上位 50%以上、「NISA 部門」では残高が 30 億円以上、「iDeCo・DC 部門」では残高が 10 億円以上かつカテゴリー内で上位 75%以上の条件を満たすファンドとしている。なお、「投資信託部門」、「iDeCo・DC 部門」、「NISA 部門」、「投資信託 10 年部門」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。「確定給付年金部門」では受賞区分を設けていない。「投資信託／総合部門」では、2017 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。「投資信託部門」、「投資信託／総合部門」および「投資信託 10 年部門」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、「iDeCo・DC 部門」は iDeCo・DC (個人型および企業型確定拠出年金) 向けに利用される国内籍公募追加型株式投信、「NISA 部門」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、「確定給付年金部門」は「R&I ユニバースデータサービス」に登録されている運用商品を対象にしており、いずれも基本的に R&I による分類をベースとしている。
- ・「QUICK 特別賞」について
2016 年 4 月から 2017 年 3 月まで 1 年間の各月末時点における 5 期間(5 年間、3 年間、1 年間、6 カ月間、3 カ月間)の運用実績データ(シャープレシオ)を用いた定量評価によるランキングに基づいて表彰している。表彰対象は 2017 年 3 月末時点で(1)運用実績が 6 年以上(2)償還予定日までの期間が 1 年以上(3)原則として残高が 10 億円以上—の条件を満たすファンド。過去 12 カ月間ににおける上記 5 期間の「シャープレシオ(年率換算)の平均値」を合計し、この合計値が最大となるファンドをリスク階級別(QFR=1~4)にそれぞれ1本ずつ抽出したうえで、4 本の中で累積 1 年間リターン(課税前分配金再投資ベース)が最高のファンドを「QUICK 特別賞」とする。対象は決算回数が年 1 回または年 2 回の国内籍公募追加型株式投信のうち、リスク階級の QUICK ファンド・リスク(QFR)が 1~4 の水準にあるファンド(QFR が 5 と 5*は対象外)。ただし、原則として ETF、販売停止中、限定追加型、マネープール相当、ブルベア型、ラップ専用、ミリオン型、一般財形型は除外する。

後援 日本経済新聞社

協賛 QUICK 資産運用研究所

「R&Iファンド大賞」は、R&IまたはQUICK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またはQUICK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またはQUICK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。