

『R & I ファンド大賞 2020』選考結果を公表

～確定給付年金部門～



格付投資情報センター(R&I)は、優れた運用成績を示したファンドを表彰する「R&I ファンド大賞 2020」(後援:日本経済新聞社)における確定給付年金部門の選考結果を公表しました(<https://www.r-i.co.jp/jpn/>)。今回は年金基金運用におけるニーズが高まっている絶対収益追求型の「外国債券アンコンストレインド」および「オルタナティブ」を新たに設けました。確定拠出年金向け投資信託が対象の「iDeCo・DC 部門」(4月23日に公表)とあわせ、R&Iでは今後も、年金向け運用商品の公平・中立な評価に力を入れていきます。

当ファンド大賞は、純粋な運用実績による定量評価のみで、各分野で優れたパフォーマンスを示したファンド・運用戦略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（伝統資産）】

部門	運用戦略名称	運用会社
国内株式 コア	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
	国内株式リサーチアクティブ戦略	日興アセットマネジメント株式会社
	株式口A_市場型	株式会社 りそな銀行
国内株式 グロース	国内グロース株式	ニッセイアセットマネジメント株式会社
	日本株式アクティブ・グロース	野村アセットマネジメント株式会社
	ジャパン・サステナブル・グロース	フィデリティ投信株式会社
国内株式 バリュー	シンプレクス・ジャパン・バリューアップ・マスターカンパニー	シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
	シンプレクス“ネットキャッシュ株式”ファンド(適格機関投資家限定/年金向け)	シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
	国内株式マザー投信・高配当株式・絶対リターン型	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
国内中小型 株式	国内株式 中小型 リサーチアクティブ	アセットマネジメント One 株式会社
	特別勘定第1特約 円貨建株式口B	住友生命保険相互会社
	国内株式マザー投信・中小型株型	三井住友DSアセットマネジメント株式会社



NEWS RELEASE

部門	運用戦略名称	運用会社
国内債券	国内債券 リサーチアクティブ クレジット型	アセットマネジメント One 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
	年金日本債券アクティブ	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
外国株式	MF S 外国株式 (成長型)	MF S インベストメント・マネジメント株式会社
	外国株式アクティブ(No.26/MFS グローバル・グロース)	みずほ信託銀行株式会社
	外国株式アクティブ・グロース	明治安田アセットマネジメント株式会社
外国債券	グローバル債券 (除く日本)	ウエリントン・マネージメント・ジャパン・ピーティーイー・リミテッド
	特別勘定第 1 特約 外国債券口	日本生命保険相互会社
	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
外国株式 エマージング	グローバル・エマージング・マーケット株式運用	JP モルガン・アセット・マネジメント株式会社
	グローバルエマージング株式	シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社
	エマージング株式戦略	マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
外国債券 エマージング	エマージング債券	ピムコジャパンリミテッド
	外国債券第 60 ファンド (PIMCO 外債アクティブファンド (エマージング型))	三菱 UFJ 信託銀行株式会社
外国債券 アンコンストレインド	外国債券 絶対収益追求型	アセットマネジメント One 株式会社
	外貨建証券第 88 ファンド (内外債券安定収益志向型(為替フルヘッジ))	三菱 UFJ 信託銀行株式会社

【確定給付年金（オルタナティブ）】

部門	運用戦略名称	運用会社
債券系	キャブラ・グローバル・リラティブバリュー・トラスト (GRV)	株式会社 キャブラ・インベストメント・ジャパン
	グローバル債券レラティブバリュー戦略(円ヘッジあり)	三菱商事アセットマネジメント株式会社
	キャブラ・グローバル・レラティブ・バリュー・トラスト	株式会社 りそな銀行
株式マーケットニュートラル	日本株集中投資・絶対収益追求ファンド (適格機関投資家専用)	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
株式ロングショート	国内株式マザー投信・ロングショート型	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
CTA・マクロ	グローバル・マクロ型ヘッジファンド	マーサー・インベストメンツ株式会社
マルチアセット	グローバル・リスクファクター・パリティ戦略 【GRiPS】	アセットマネジメント One 株式会社
マルチストラテジー	ミレニアム・マルチ・ストラテジー	みずほ信託銀行株式会社
保険	CS アイリス・ライフ ファンド	みずほ信託銀行株式会社
イベントドリブン	Nineteen 77 グローバル・マージャー・アービトラージ・リミテッド Class A-JPY Shares	UBS アセット・マネジメント株式会社

【iDeCo・DC部門】 ※2020年4月23日に公表されたものです。

部門	賞	ファンド名称	運用会社
国内株式	最優秀ファンド賞	大同リサーチ&アクティブオープン(愛称:RAO(らお))	T&Dアセットマネジメント株式会社
	優秀ファンド賞	フィデリティ・ジャパン・オープン(確定拠出年金向け)	フィデリティ投信株式会社
国内中小型株式	最優秀ファンド賞	JPM中小型株・アクティブ・オープン	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
国内債券	最優秀ファンド賞	シュローダー年金運用ファンド日本債券(愛称:年金運用日本債券)	シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社
	優秀ファンド賞	明治安田日本債券ファンド(愛称:ホワイトウイング)	明治安田アセットマネジメント株式会社
外国株式	最優秀ファンド賞	年金積立 インターナショナル・グロース・ファンド(愛称:DC Iグロース)	日興アセットマネジメント株式会社
	優秀ファンド賞	大和住銀DC海外株式アクティブファンド 大和住銀DC外国株式ファンド	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
外国債券	最優秀ファンド賞	グローバル・ボンド・ポート(Dコース)	アセットマネジメント One 株式会社
	優秀ファンド賞	大和住銀DC外国債券ファンド	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
外国債券 円ヘッジ	最優秀ファンド賞	グローバル・ボンド・ポート(Cコース)	アセットマネジメント One 株式会社
	優秀ファンド賞	ピクテ円インカム・セレクト・ファンド(毎月分配型)(愛称:円インカム・セレクト)	ピクテ投信投資顧問株式会社
バランス型 (債券中心)	最優秀ファンド賞	大和住銀DC年金設計ファンド30	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
	優秀ファンド賞	東京海上セレクション・バランス 30	東京海上アセットマネジメント株式会社

「R & I ファンド大賞 2020」について

選考方法・対象

「投資信託部門」、「iDeCo・DC部門」、「NISA部門」、「確定給付年金部門(オルタナティブ以外)」では2018、2019、2020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、2020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、2015、2020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2020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、2020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。「投資信託20年部門」では、2010、2020年それぞれの3月末における10年間の運用実績データを用いた定量評価および2020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、2020年3月末における20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。「確定給付年金部門(オルタナティブ)」は2020年3月末時点における3年間の騰落率がプラスかつ同一戦略の中で上位50%に入っているファンドに対して、2020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。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」、「投資信託20年部門」ではシャープ・レシオを採用、「確定給付年金部門」では定量評価に主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」、「NISA部門」、「投資信託10年部門」、「投資信託20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、「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。「投資信託/総合部門」では、2020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年間にわたるシャープ・レシオの残高加重平均値によるランキングに基づき表彰している。「投資信託部門」、「投資信託/総合部門」、「投資信託10年部門」および「投資信託20年部門」は確定拠出年金専用ファンド、SMA・ラップ口座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R&I独自の「NISAスクリーニング」基準を満たした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。

後援

日本経済新聞社

「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。