

『R&I 定量投信レーティング』および新投信分類体系の創設について

格付投資情報センター(R&I)は、投資信託の定量評価体系を刷新、「R&I 定量投信レーティング」および新投信分類体系を創設し、年内をめどに公表します。新レーティングは価格変動リスク見合いのリターンを示す「シャープレシオ」を基にした5段階評価で、同一分類の中での最高評価を「5」とし、数字が小さくなるほど評価が低くなる体系です。評価期間については従来公表していた1年および3年の運用成績を基にした評価に加え、長期の資産形成を促進する観点から10年の評価も始めます。このほか補助指標として、ファンドごとに同一分類の中でのリターンおよび価格変動リスクの相対位置を「高位」「低位」などの分かりやすい言葉を使って表示します。定量評価の刷新にあわせ、投信分類も国内投信の現状を踏まえ、204分類に再編します。

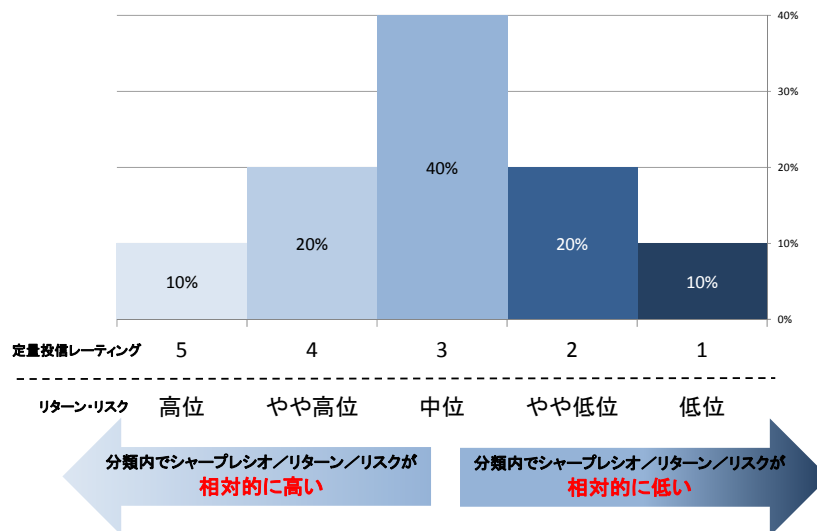
◇名称

- 『R&I 定量投信レーティング(10年)』
- 『R&I 定量投信レーティング(3年)』
- 『R&I 定量投信レーティング(1年)』

◇詳細

- 当社の投信分類(刷新)ごとによる相対評価
- シャープレシオに基づいて、評価期間ごとに「5」(最高位)から「1」まで付与
- リターンについて評価期間ごとに「高位」(相対的高リターン)から「低位」(相対的に低リターン)まで5段階で表示
- リスクについて評価期間ごとに「高位」(相対的高リスク)から「低位」(相対的に低リスク)まで5段階で表示

(符号の閾値)



◇投信分類の見直し

現在の71分類(実質45分類)を204分類(実質98分類)に再編します。海外の株式・債券や高利回り外債に関する分類などを実態にあわせて細分化することに伴い、類似ファンド内でより精緻な比較が行えるようになります。(※カッコ内の実質分類数は、為替の「ノーヘッジ」「一部ヘッジ」「フルヘッジ」を1つと数えたもの。分類対象外を除く)

◇公表時期

年内をめどに当社ウェブサイトにて公表予定

◆本件に関するお問い合わせ先

株式会社格付投資情報センター ファンド調査部(担当:海老澤、長谷川)

所在地:〒101-0054 東京都千代田区神田錦町三丁目 22 番地 テラススクエア

TEL:(03)6273-7309/e-mail:fundrating@r-i.co.jp

R&I 定量投信レーティングは、投資の参考となる情報を提供することのみを目的としており、特定のファンドを推奨するものではありません。十分信頼できると判断される情報源からの情報に基づき評価を実施していますが、その情報の正確性、完全性を保証するものではありません。この評価情報の利用によって何らかの損害が発生した場合、その原因がいかなるものであれ、(株)格付投資情報センターは一切の責任を負わないものとします。投信評価等の業務は、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。当評価に関する著作権等の知的財産権その他の一切の権利は、(株)格付投資情報センター又はその許諾者に帰属しており、許可無く複製、転載、引用することを禁じます。