

2017年12月27日

『R&I 定量投信レーティング』の公表について

格付投資情報センター(R&I)は、当社ウェブサイトの「投信関連情報・資産運用コンサルティング」コーナーを刷新し、「R&I 定量投信レーティング」を新たに公表しました。当レーティングは価格変動リスクを調整したリターンを示す「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。評価期間は1年、3年および10年の3期間です。3期間におけるリターンおよび価格変動リスクの実数値のほか、それぞれの分類内での相対位置を示す補助指標も公表します。新サイトではファンド名や会社名、分類、RC(投信リスク・クラス)、レーティング等による検索機能、検索結果の各項目(RC、レーティング、リターン、リスク)によるソート機能を追加しました。

◇R&I「投信関連情報・資産運用コンサルティング」コーナーのURL

<https://www.r-i.co.jp/investment/>

◇ウェブサイトの新情報および新機能

- 『R&I 定量投信レーティング』を新たに公表
- ファンド名や会社名、分類、RC、レーティング等による検索機能を追加
- 検索結果の各項目(RC、レーティング、リターン、リスク)によるソート機能を追加

◇『R&I 定量投信レーティング』について

- 当社の投信分類(刷新)内での相対評価
- 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」(相対的に高リターン)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」(相対的に高リスク)から「低位」(相対的に低リスク)まで5段階で表示

◆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。