「R&Iファンド大賞」について

「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。

「R&Iファンド大賞2016」の概要

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。