



(ご参考)「R & I ファンド大賞 2010」について

特徴

ファンドの運用実績評価において、

- ・今年度で4回目の表彰
2007年から開始、今年度で4回目の表彰
- ・3分野表彰
確定給付年金向けファンド及び個人投資家向けファンド、確定拠出年金向けファンドの3分野で同時に表彰を実施するのはR&Iのみ。
- ・国内系による本格的な表彰
純粋な国内企業によるファンドの表彰は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、また自ら運用も手がけていない。表彰はこうした中立的な立場から行う。

概要

・表彰対象

「投資信託」、「投資信託／総合部門」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、「確定拠出年金」は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、「確定給付年金」は『R&I ユニバース計測サービス』に登録されているファンド、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。今年度について、「投資信託」は国内株式型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、国内REIT型、外国REIT型、中国関連株式型、エマージング債券型、国内SRIファンド型の各カテゴリーを、「確定拠出年金」は国内株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、バランス型の各カテゴリーを、「確定給付年金」は国内株式グロース型、国内株式バリュー型、国内株式コア型、国内中小型株式型、国内債券型、外国株式型、エマージング株式型、外国債券型、エマージング債券型、バランス型、日本株式マーケットニュートラル型の各カテゴリーを対象とする予定。また、「投資信託／総合部門」は国内株式総合、外国株式総合、外国債券総合、バランス総合の各カテゴリーを対象とする予定。

・選考方法

選考は、「投資信託」、「確定拠出年金」、「確定給付年金」では2008、2009、2010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、2010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」、「確定拠出年金」では「シャープ・レシオ」を採用、表彰対象は設定から3年以上かつ償還予定日まで1年以上の期間を有し、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、「確定拠出年金」のバランス型は、ライフサイクルファンド(アセットアロケーション、各資産の運用スタイルがともにパッシブのものは除く)を構成する複数のファンドの2008、2009、2010年それぞれの3月末時点における1年間の「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、いずれも上位75%に入っているファンドに関して、2010年3月末の平均残高が10億円以上の条件を満たすファンドとしている。「確定給付年金」では原則として定量評価に「インフレーション・レシオ」を採用している。なお、「投資信託」、「確定拠出年金」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、2010年3月末において残高10億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1社を「優秀賞」として表彰している。

「R & I ファンド大賞」は、過去のデータに基づいたものであり、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、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、投資家に当該ファンドの購入、売却、保有を推奨するものではありません。また、当社の顧客に対して提供している定性評価情報とは関係ありません。当大賞は信頼すべき情報に基づいて格付投資情報センターが算出したものであり、その正確性及び完全性は必ずしも保証されていません。当大賞に関する著作権その他の権利は、格付投資情報センターに帰属します。当社の許諾無く、これらの情報を使用(複製、改変、送信、頒布、切除を含む)することを禁じます。「投資信託／総合部門」の各カテゴリーについては、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、必ずしも受賞運用会社の全ての個別ファンドそれぞれ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。投資の基準価額等は QUICK 調べ。