

News Release

2017年3月13日

株式会社野村総合研究所

投信評価レポート「Fundmark」をWebサイトで公開

株式会社野村総合研究所（本社：東京都千代田区、代表取締役社長：此本 臣吾、以下「NRI」）は、従来、限定対象のみに提供していた投資信託のパフォーマンス評価レポート「Fundmark（ファンドマーク）」を、本日から NRI が運営する金融 IT ソリューションの情報発信 Web サイト「NRI Financial Solutions」で公開します。

■ 「Fundmark」およびその公開について

「Fundmark」は、国内で販売されている追加型投資信託の運用実績を用いて、商品ごとにパフォーマンスの比較・評価を行っています。それぞれ運用方針の異なる投資信託には、多くの異なる要素が存在し、横並びで比較・評価を行うことは容易ではありません。そこで、NRI では、独自の調査に基づき、運用方針や運用実態に沿って投資信託の分類（Fundmark 分類：約 300 分類）を行っています。同一分類内において、投資信託のパフォーマンスを相対的に評価し、順位（ランキング）や☆印による 5 段階の評価（レーティング）を発表しています。

これまで、「Fundmark」をご契約いただいた投資信託の運用会社や販売会社等の金融機関向けに、毎月 1 回、刊行物として提供してきましたが、未契約の金融機関および個人投資家にも広く「Fundmark」を知っていただき、投資信託の評価等に活用いただく目的で、Web サイトに公開することにしました。

■ 「Fundmark」の活用方法

（1）金融機関向け*1

金融商品の商品開発、販売、運用、資産管理に携わる金融機関では、フィデューシャリー・デューティー*2を果たすために、自主的な取り組みを検討・実施しています。投資信託に関しては、取扱商品の選定・モニタリングなどを行う際に、運用実績等を第三者の立場から客観的に評価した情報（以下、「評価情報」）を積極的に活用することが求められており、この評価情報として、「Fundmark」を活用できます。また、FinTech で注目されている「ロボ・アドバイザー」で投資信託を選定する際に、指標として「Fundmark」を活用することも可能です。

（2）個人投資家向け

人口減少・超高齢化の進行や社会保障制度の改革が進展する中、個人の資産形成において、リスク性資産を活用した資産運用の必要性が高まっています。その 1 つの手段として、投資信託は期待・注目されている金融商品です。一方、投資信託は複雑な仕組みの商品も多く、個人投資家が収益の源泉やリスク度合いを十分に理解した上で商品を選択することは容易ではありません。そこで、資産形成における投資信託の商品選定や評価のために、個人投資家が「Fundmark」

を参考にすることが可能です。

NRIは、投資信託評価機関として、「Fundmark」をインターネット上に公開することで国内の金融機関の取り組みの支援および個人投資家の資産運用に貢献していきます。

***1 「Fundmark」の評価情報を営利目的で利用することをご検討・ご希望の場合**

下記の【レポート内容および関連サービスに関するお問い合わせ先】までご連絡ください。

***2 フィデューシャリー・デューティー (Fiduciary duty)**

他者の信託を得て、一定の任務を遂行すべき者が負っている幅広い様々な役割・責任の総称。

※「平成26事務年度金融モニタリング基本方針（金融庁）」より引用

■ 「Fundmark」のウェブサイト公開の概要

公開開始日	2017年 3 月 13 日 (月)
ファイル形式	PDF
更新日	毎月第9営業日 (営業日は、土日祝日を除いた日を指します)
URL	http://fis.nri.co.jp/ja-JP/service/ids/category/fundmark.html
備考	最新号のみを掲載 (バックナンバーは掲載しません)

【ニュースリリースに関するお問い合わせ先】

株式会社野村総合研究所 コーポレートコミュニケーション部 潘、瀬戸

TEL : 03-5877-7100 E-mail : kouhou@nri.co.jp

【レポート内容および関連サービスに関するお問い合わせ先】

株式会社野村総合研究所 投資情報サービス事業部 前山、和氣、私市

E-mail : fundmark-help@nri.co.jp

【ご参考】

●金融機関向け関連サービス

・IDS (Integrated Data Services) :

NRI が提供する金融情報データベースサービス。長年にわたって NRI が蓄積してきた、国内外の経済・金融・企業・証券に関するデータとともに、データを利用する際のさまざまな課題に対するソリューションを、経験豊富なデータアナリストが提供しています。詳細は、<http://ids.nri.co.jp/>をご覧ください。

・e-AURORA Fundmark/DL

投資信託の調査／分析用にデータをダウンロードするためのサービス。広範囲なファンド情報を、インターネット経由で EXCEL ワークシート上へダウンロードし、調査分析にご活用いただけます。詳細は、<http://www.e-aurora.jp/aurora/login/FundmarkDL.jsp> をご覧ください。

●関連サービスで利用可能な投資信託データの概要

国内籍公募 投資信託	属性情報	ファンド名称、コード、分類、各種手数料等
	数値情報	基準価額、分配金、純資産額、設定・解約額、各種リスク・リターン、シャープレシオ、対参考指数 α ・ β 等
	評価情報	レーティング、分類内順位、リスクレベル等
	インデックス情報	ファンド・パフォーマンス・インデックス（国内公募追加型株式投資信託全体の動向を的確に表す日次投資収益指数）
	決算情報※	保有有価証券、費用、資産・負債・元本の状況、損益状況等
	申込不可日情報※	申込不可日、海外取引所・銀行休日等
	分析情報	リスク感応度、リスクアロケーション、相関係数等
外国籍公募 投資信託	属性情報	ファンド名称、分類、各種手数料等
	数値情報	基準価額、分配金、純資産額、各種リスク・リターン、シャープレシオ、対参考指数 α ・ β 等

※「決算情報」「申込不可日情報」は、上記 IDS でのみの取り扱いとなります。