

R & I ファンド大賞 2020 の概要

「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。

「投資信託部門」、「iDeCo・DC 部門」、「NISA 部門」、「確定給付年金部門」では2018、2019、2020 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、2020 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。「投資信託10 年部門」では、2015、2020 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2020 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、2020 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。「投資信託20 年部門」では、2010、2020 年それぞれの3 月末における10 年間の運用実績データを用いた定量評価および2020 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、2020 年3 月末における20 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、「投資信託部門」、「iDeCo・DC部門」、「NISA 部門」、「投資信託10 年部門」、「投資信託20 年部門」ではシャープ・レシオを採用、「確定給付年金部門」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。表彰対象は償還予定日まで1 年以上の期間を有し、「投資信託部門」、「NISA 部門」、「投資信託10 年部門」、「投資信託20 年部門」では残高が30 億円以上かつカテゴリー内で上位50%以上、「iDeCo・DC 部門」では残高が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。「投資信託／総合部門」では、2020 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表彰している。「投資信託部門」、「投資信託／総合部門」、「投資信託10 年部門」および「投資信託20 年部門」は確定拠出年金専用ファンド、SMA・ラップ口座専用ファンドを除く国内籍公募追加型株式投信、「iDeCo・DC 部門」はiDeCo・DC（個人型および企業型確定拠出年金）向けに利用される国内籍公募追加型株式投信、「NISA 部門」はR&I 独自の「NISA スクリーニング」基準を満たした国内籍公募追加型株式投信、「確定給付年金部門」は『R&I ユニバースデータサービス』に登録されている運用商品を対象にしており、いずれも基本的にR&I による分類をベースとしている。