# 定量指標(KPI)

- 「お客様本位の業務運営に係る方針」に基づく社内の取組結果を定量的に示すため、以下の指標をKPIとして設定しています。
- なお、以下の指標はいずれも公募投資信託に係るものです。

## 運用力KPI

**1.本数加重レーティング**

**2.資産別残高加重シャープレシオ**

**3.当社設定基準達成ファンド**

## 運用力以外のKPI

**4.純資産総額**

- 公募投資信託全体
- 資産形成に資するファンド
- ＜購入・換金手数料なし＞シリーズ
- 確定拠出年金向け商品

**5.アワード受賞本数**

**6.満足度調査結果(販売会社に対する調査)**

**7.残高別ファンド本数**

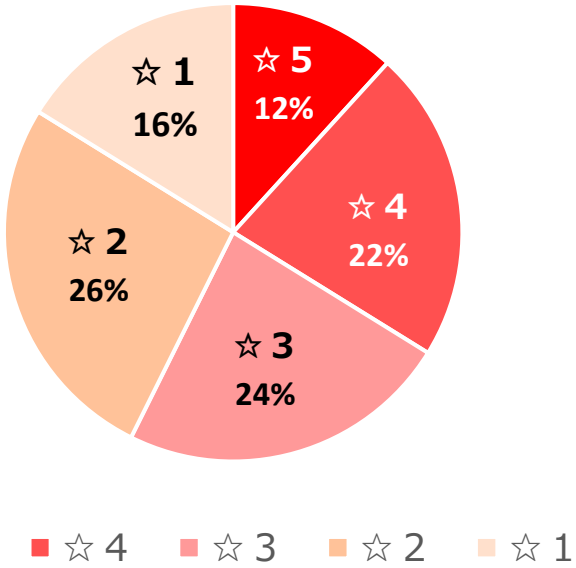
**8.1ファンドあたり平均時価残高**

# 定量指標(KPI)の状況

## 1 本数加重レーティング

- 外部機関によるレーティングを用いたKPIとして本数加重レーティングをお示しします。
- 本数加重レーティングは前年から若干低下しました。運用力改善に努め、レーティング向上を目指します。

### レーティング別分布

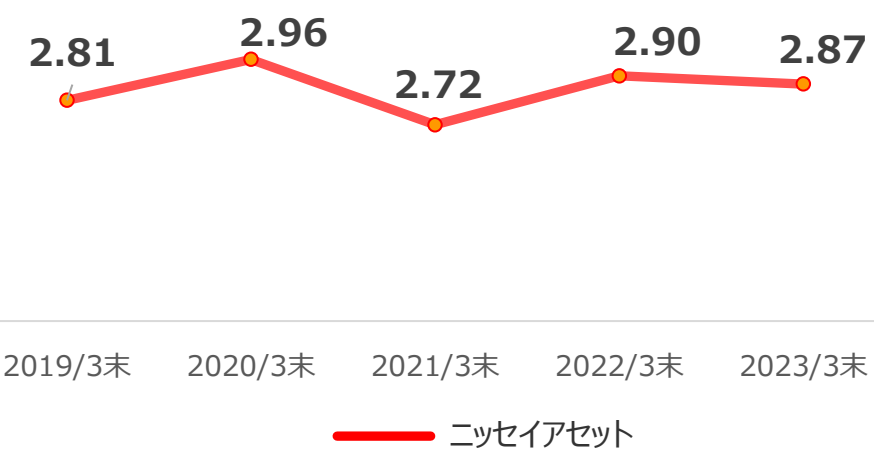



Fundmarkのレーティングは☆が多いほど上位

上位 ←→ 下位

| ☆5 | ☆4 | ☆3 | ☆2 | ☆1 |
|---|---|---|---|---|
| 上位10% | ～33% | ～67% | ～90% | ～100% |

### 本数加重レーティング

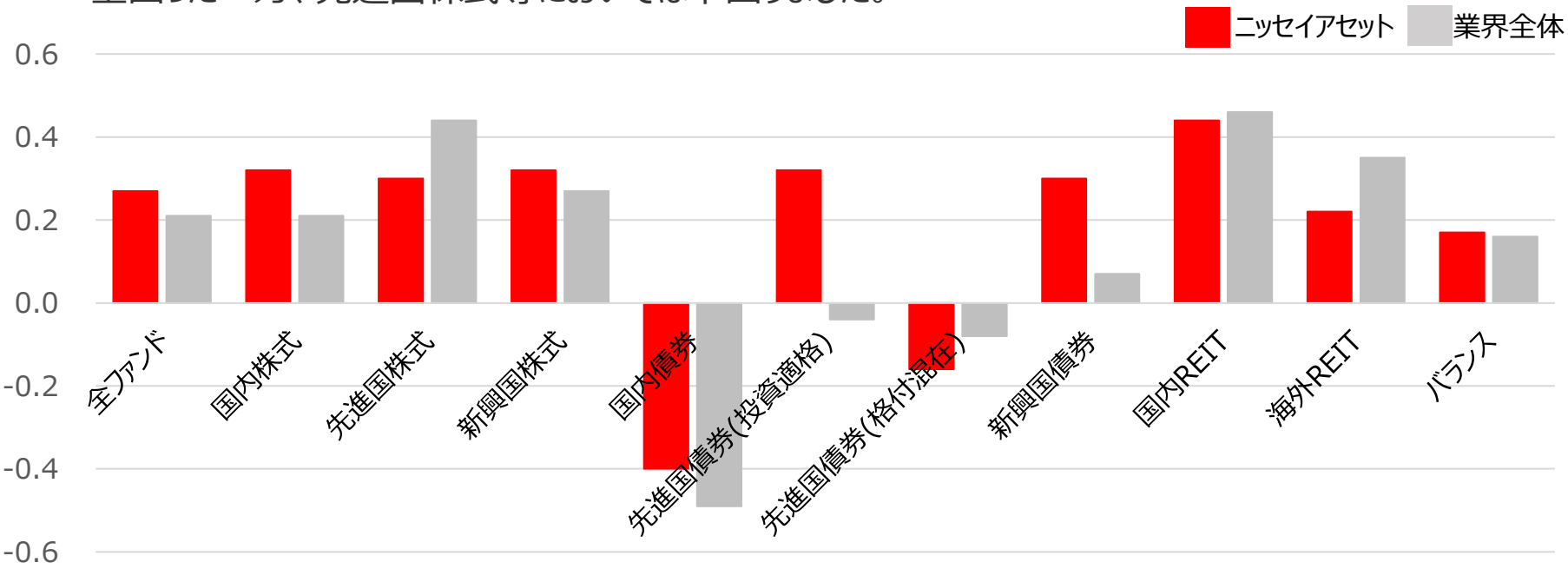



(出所 ： 株式会社野村総合研究所(以下「NRI」)が公表している「Fundmark投信評価レポート」における
レーティングを用いてニッセイアセットマネジメントが作成)

# 定量指標(KPI)の状況

## 2 資産別残高加重シャープレシオ

- 他社比較可能なKPIとして、当社ファンドの資産別残高加重シャープレシオをお示しし、業界全体との比較も掲載します。(シャープレシオとは、リターンのばらつきを示す標準偏差をリスク尺度として、負担したリスク1単位あたりの収益効率性を測ったものです。)
- 全ファンドでは業界全体を上回りました。国内株式や先進国債券(投資適格)等において業界全体を上回った一方、先進国株式等においては下回りました。




(出所　：　金融庁「国内運用会社の運用パフォーマンスを示す代表的な指標(KPI)の測定と国内公募投信についての諸論点に関する分析の公表について」をもとにニッセイアセットマネジメントが作成。
- 2022年末時点の過去５年間のシャープレシオ
- 資産区分はQUICKによる分類 )

NISSAY ASSET MANAGEMENT

# 3 当社設定基準達成ファンド

- 設定来で市場全体を上回るパフォーマンスをあげており、かつ、純資産総額が100億円以上のファンドをお示しします。
- 2023年3月末の該当ファンドは前回公表時同様、4ファンドとなりました。基準達成ファンドを増やせるよう取り組んでいきます。

| ファンド | | 主な投資対象 | 設定年月 | 設定来騰落率(年率) | | 超過収益率 ③=①-② |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 名称 | 特色等 | | | ファンド① | 市場全体② | |
| 日本株グロースオープン【生活3C】 | • 健全な生活＝Clean,<br>創造的な生活＝Creative,<br>快適な生活＝Comfortable<br>の創出に貢献する「3C」企業に投資 | 国内株式 | 2000年2月 | **+3.02%** | TOPIX **+2.53%** | **+0.49%** |
| 健康応援ファンド | • 成長が見込まれる健康関連産業に厳選投資<br>• 当社の強みであるESGも銘柄選択に活用 | 国内株式 | 2008年4月 | **+8.42%** | TOPIX **+4.92%** | **+3.50%** |
| JPX日経400アクティブファンド | • 優れた経営効率と利益成長力を有し、株価の上昇が期待される銘柄に厳選投資 | 国内株式 | 2014年2月 | **+10.00%** | TOPIX **+8.20%** | **+1.80%** |
| 宇宙関連グローバル株式【スペース革命】 | • 収益の拡大が見込まれ、株価上昇が期待できる宇宙関連銘柄に厳選投資 | 外国株式(日本含) | 2018年11月 | **+13.81%** | MSCI World **+13.24%** | **+0.57%** |

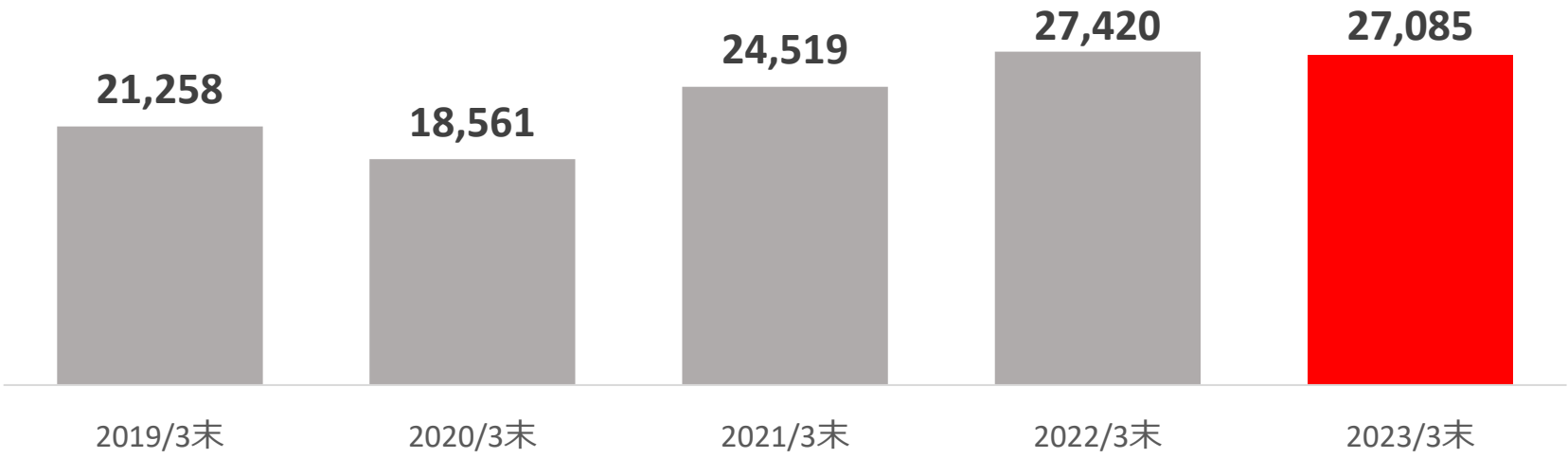
ファンドの設定来騰落率は分配金(税引前)を再投資した基準価額をもとにして計算しております。基準価額は信託報酬控除後です。

# 4 純資産総額

- お客様から信頼頂いているKPIとして、公募投資信託全体の純資産総額を設定しています。
- 資金流入は増加したものの、金利上昇等に伴う海外資産の下落により、純資産総額は若干減少しました。

## 公募投資信託全体

単位：億円




| | 2019/3末 | 2020/3末 | 2021/3末 | 2022/3末 | 2023/3末 |
|---|---|---|---|---|---|
| ファンド数 | 204本 | 201本 | 197本 | 221本 | 219本 |

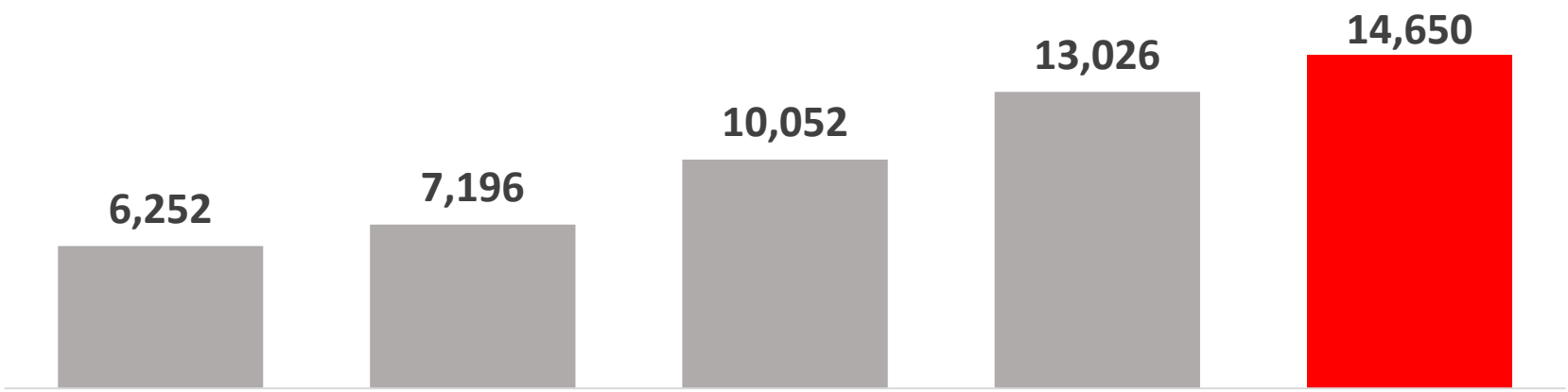
# 定量指標(KPI)の状況

## 4 純資産総額

- 長期的なお客様の資産形成のお役に立っているかを測るKPIとして、公募投資信託のうち、＜購入・換金手数料なし＞シリーズ、確定拠出年金向け商品、つみたてNISA対象ファンドを“資産形成に資するファンド”とし、その残高合計を設定しています。
- 特に海外の市況は軟調だったものの、それを上回る資金流入があり、“資産形成に資するファンド“の純資産総額は増加しました。

**資産形成に資するファンド**

単位：億円




| | 2019/3末 | 2020/3末 | 2021/3末 | 2022/3末 | 2023/3末 |
|---|---|---|---|---|---|
| ファンド数 | 61本 | 61本 | 65本 | 67本 | 69本 |

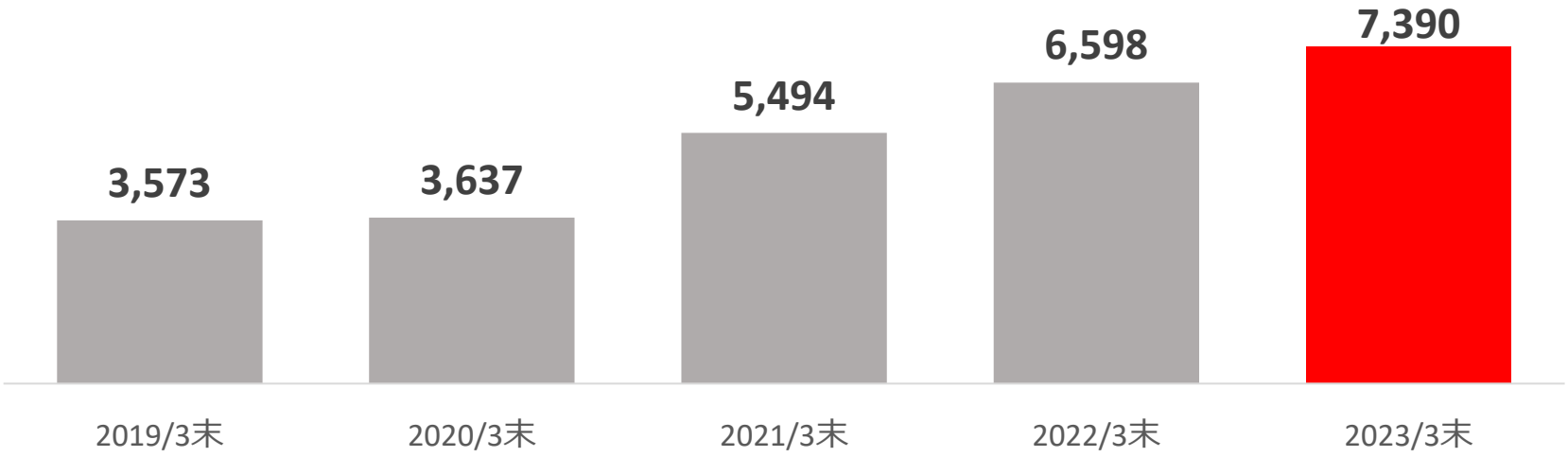
# 定量指標(KPI)の状況

## 4 純資産総額

- お客様から信頼頂き、中長期的な資産形成のお役に立っているかを測るKPIとして、退職に向けて投資頂く商品の成長を測る確定拠出年金向け商品の純資産総額を設定しています。
- DC外国株式インデックスファンドを中心に資金が流入し、確定拠出年金向け商品の純資産総額は増加しました。

**確定拠出年金向け商品**

単位：億円




| | 2019/3末 | 2020/3末 | 2021/3末 | 2022/3末 | 2023/3末 |
|---|---|---|---|---|---|
| ファンド数 | 48本 | 48本 | 51本 | 53本 | 53本 |

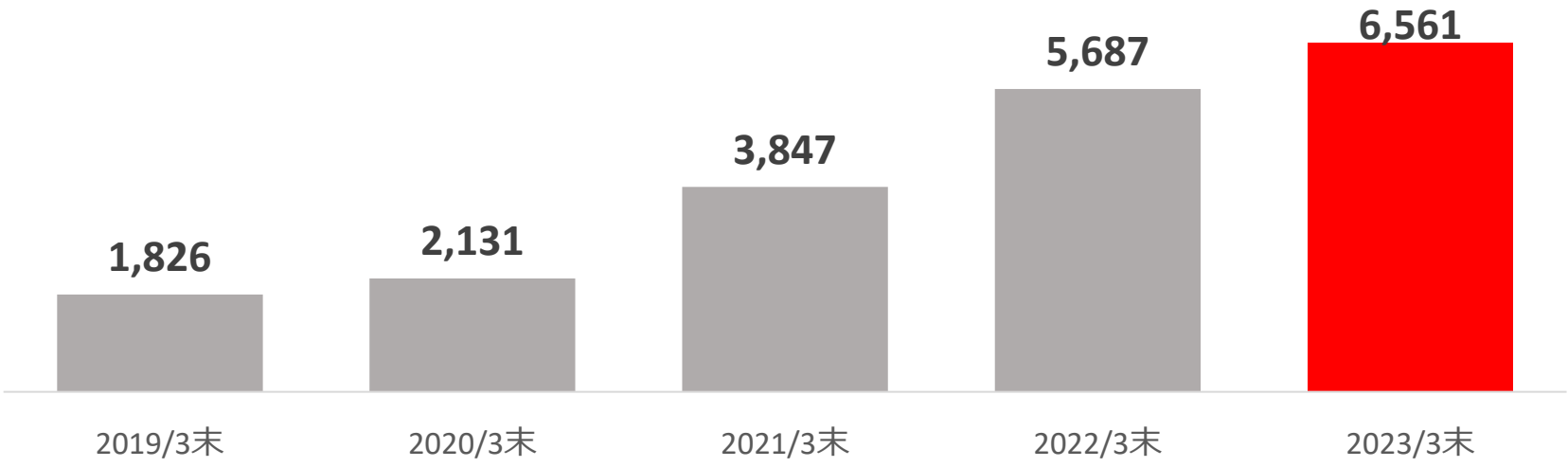
# 定量指標(KPI)の状況

## 4 純資産総額

- お客様から信頼頂き、長期的な資産形成のお役に立っているかを測るKPIとして、低コストかつシンプルで分かりやすい商品である＜購入・換金手数料なし＞シリーズの純資産総額を設定しています。
- ＜購入・換金手数料なし＞外国株式インデックスファンドを中心に残高が増加しました。

**＜購入・換金手数料なし＞シリーズ**

単位：億円




| | 2019/3末 | 2020/3末 | 2021/3末 | 2022/3末 | 2023/3末 |
|---|---|---|---|---|---|
| ファンド数 | 12本 | 12本 | 13本 | 13本 | 15本 |

# 5 アワード受賞本数

- 第三者である外部機関からの評価を用いたKPIとして、R&Iファンド大賞受賞本数をお示しします。
- 受賞本数の増加に向け取り組んでまいります。

**R&Iファンド大賞受賞本数**

| 2019年 | 2020年 | 2021年 | 2022年 | 2023年 |
|---|---|---|---|---|
| 3 本 | 11 本 | 8 本 | 5 本 | 5 本 |

**2023年に受賞したファンド(評価基準日：2022年度末)は以下の通りです。**

**ニッセイ健康応援ファンド**

【カテゴリー：国内株式ESG】
- 投資信託10年部門「最優秀ファンド賞」

**ニッセイアメリカ高配当株ファンド（毎月決算型）／（年２回決算型）**
**愛称：USドリーム（毎月）／（年２回）**

【カテゴリー：北米株式高配当】
- 投資信託部門「最優秀ファンド賞」

**ニッセイ世界リートオープン（毎月決算型）／（年２回決算型）**

【カテゴリー：グローバルREIT】
- 投資信託部門「最優秀ファンド賞」

# 6 満足度調査結果(販売会社に対する調査)

- 第三者である外部機関からの評価を用いたKPIとして、R&I「ファンド情報」投信会社満足度調査の残高上位販社総合評価順位をお示しします。
- 担当者の説明能力の評価等が改善し、ここ数年で最高位となりました。

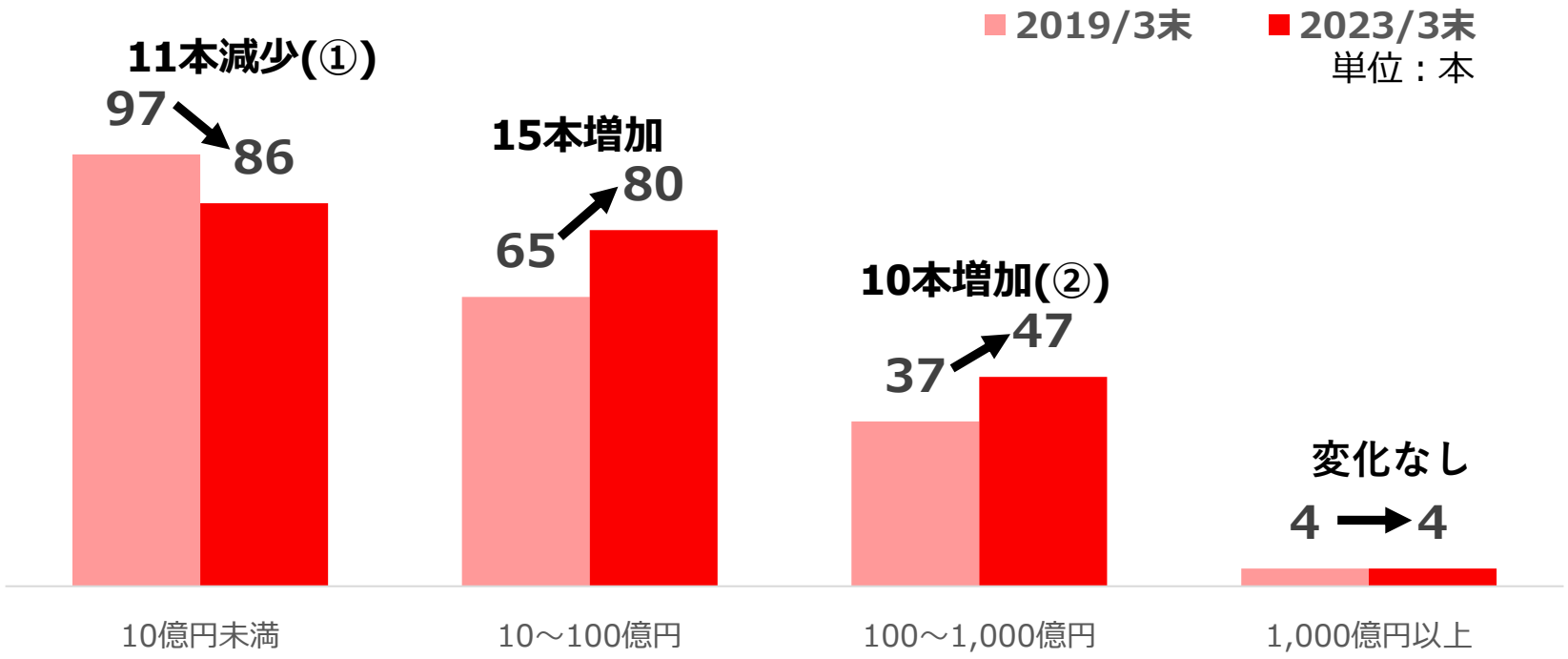
**R&I「ファンド情報」投信会社満足度調査　：　残高上位販社総合評価順位**

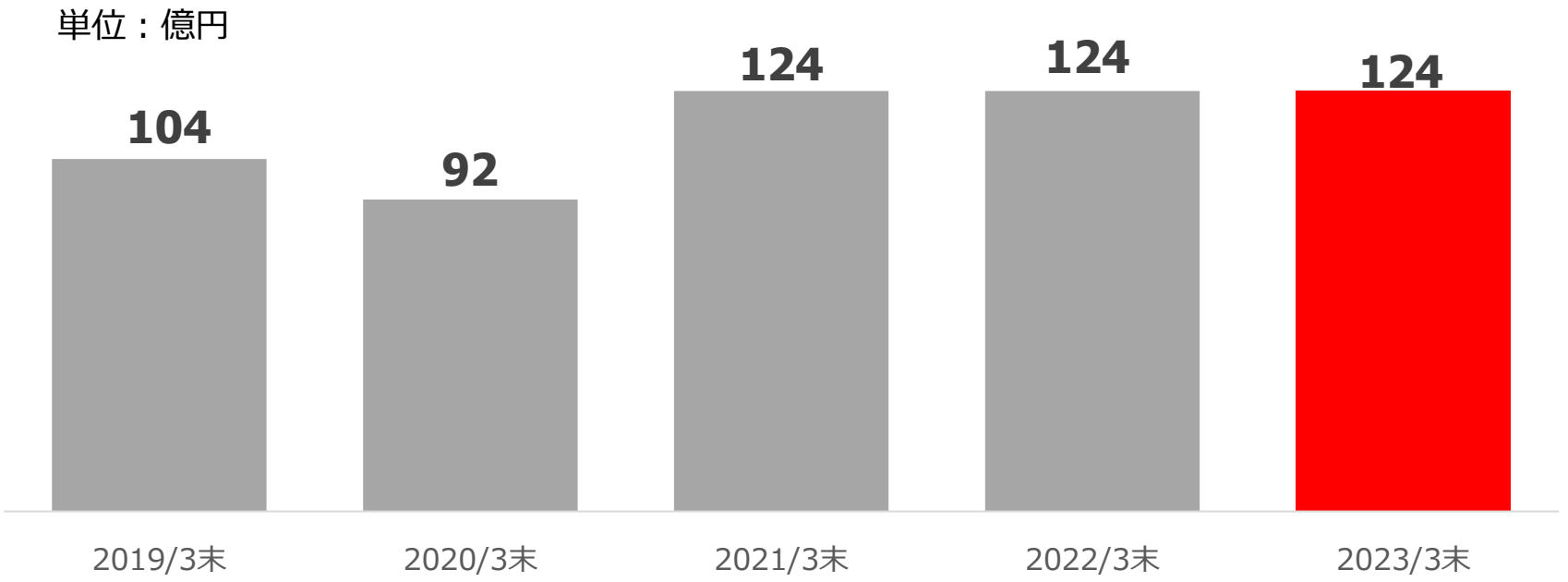
| 2018年度 | 2019年度 | 2020年度 | 2021年度 | 2022年度 |
|---|---|---|---|---|
| 10位 /25社 | 11位 /24社 | 13位 /22社 | 9位 /26社 | 8位 /27社 |

投資信託の預かり資産残高上位50販社による評価順位。10件以上の回答を受領した投信会社が評価対象。

# 7 残高別ファンド本数

- ファンドガバナンスの取組み状況をお伝えするKPIとして、公募投資信託の残高別ファンド本数を設定しています。小規模ファンドの本数を減らし、規模の大きいファンドの本数を増やしていくことで、より効率的かつ安定的なファンド運営を目指します。
- 2019年と比較して、純資産総額が10億円未満の小規模ファンドが11本減少(①)する一方、100～1,000億円のファンドが10本増加(②)しました。



# 8 1ファンドあたり平均時価残高

- ファンドガバナンスの取組み状況をお伝えするKPIとして、1ファンドあたり平均時価残高を設定しています。より効率的かつ安定的なファンド運営に取り組んだ成果として、この残高の増加を目指していきます。
- 昨年と比べてファンド数は減少したものの、残高も減少した為、1ファンドあたり平均時価残高は横ばいとなりました。