

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

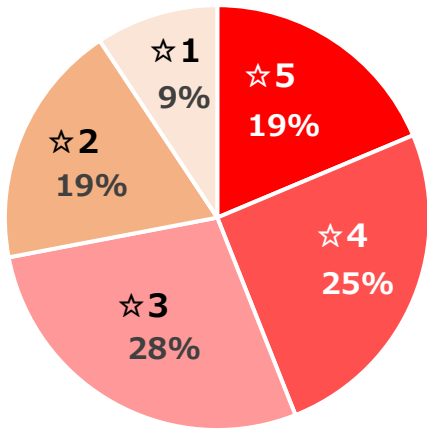
運用力以外のKPI

- 4.純資産総額
 - ・ 公募投資信託全体
 - ・ 資産形成向けファンド
 - ・ NISA対象ファンド
 - ・ 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

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上昇しました。今後も運用力およびレーティングの向上を目指します。

レーティング別分布



■ ☆5 ■ ☆4 ■ ☆3 ■ ☆2 ■ ☆1

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



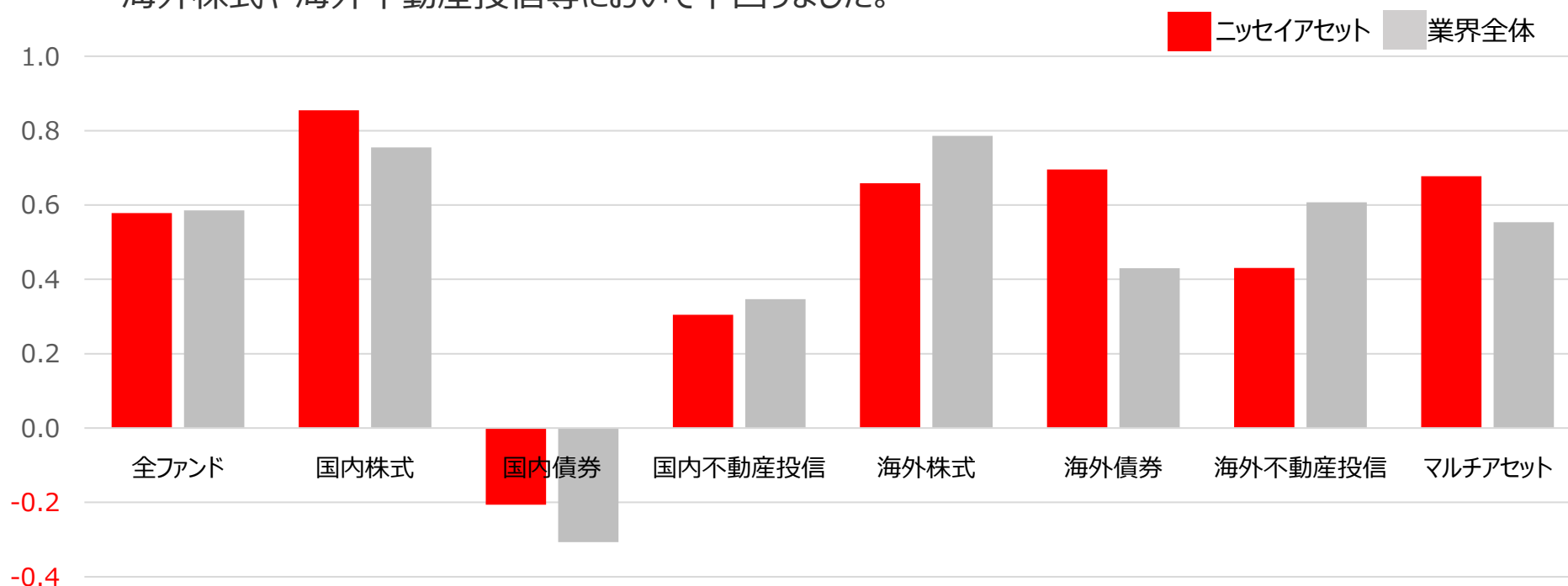
2020/3末 2021/3末 2022/3末 2023/3末 2024/3末

ニッセイアセット

(出所 : 株式会社野村総合研究所が公表している「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)

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。)
- 全ファンドでは概ね業界並みとなりました。国内株式や内外債券等において業界全体を上回った一方、海外株式や海外不動産投信等において下回りました。



(出所 : 株式会社野村総合研究所が公表している「Fundmark投信評価レポート」におけるデータを用いてニッセイアセットマネジメントが作成
・ 2023年末時点の過去5年間のシャープレシオ
・ 資産区分はFundmark 大分類による分類)

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ます。
- 2024年3月末の該当ファンドは前回公表時より1ファンド減少の3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	
 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 - 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	+8.58%	TOPIX +6.90%	+1.67%
 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	+12.71%	TOPIX +11.10%	+1.61%
 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	+19.02%	MSCI World +18.37%	+0.64%

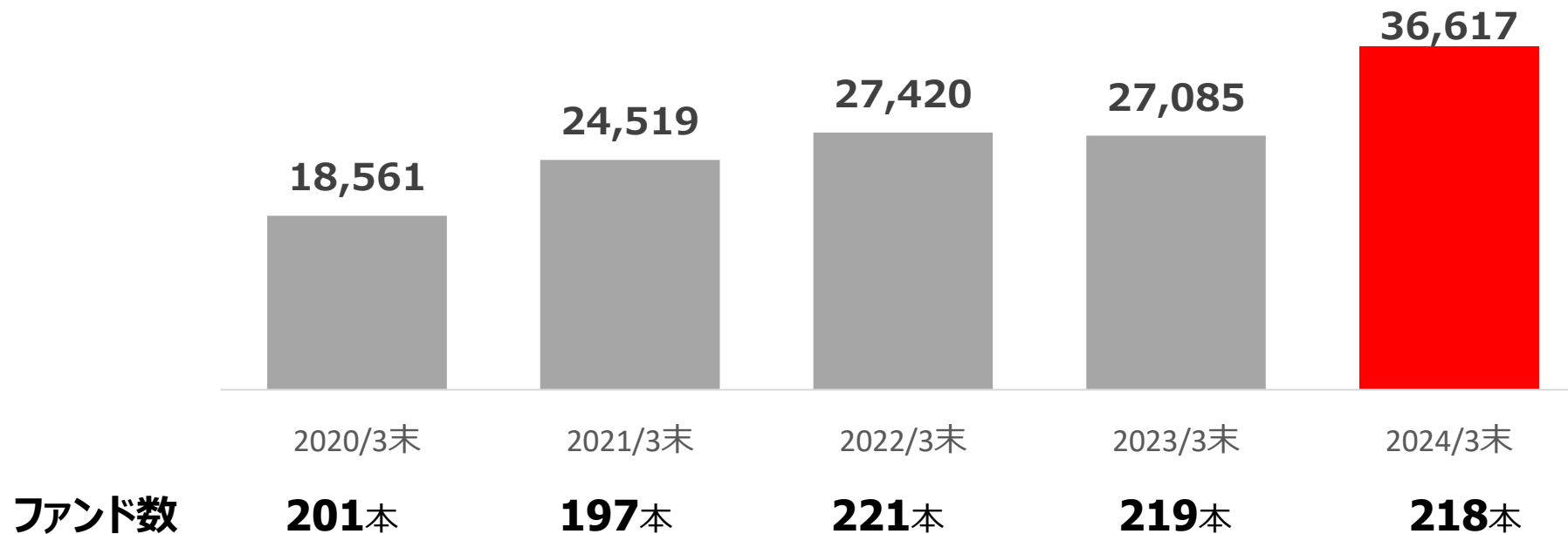
ファンドの設定来騰落率は分配金(税引前)を再投資した基準価額をもとにして計算しております。基準価額は信託報酬控除後です。

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。
- 内外株式の株価上昇を中心として、純資産総額は増加しました。

公募投資信託全体

単位：億円

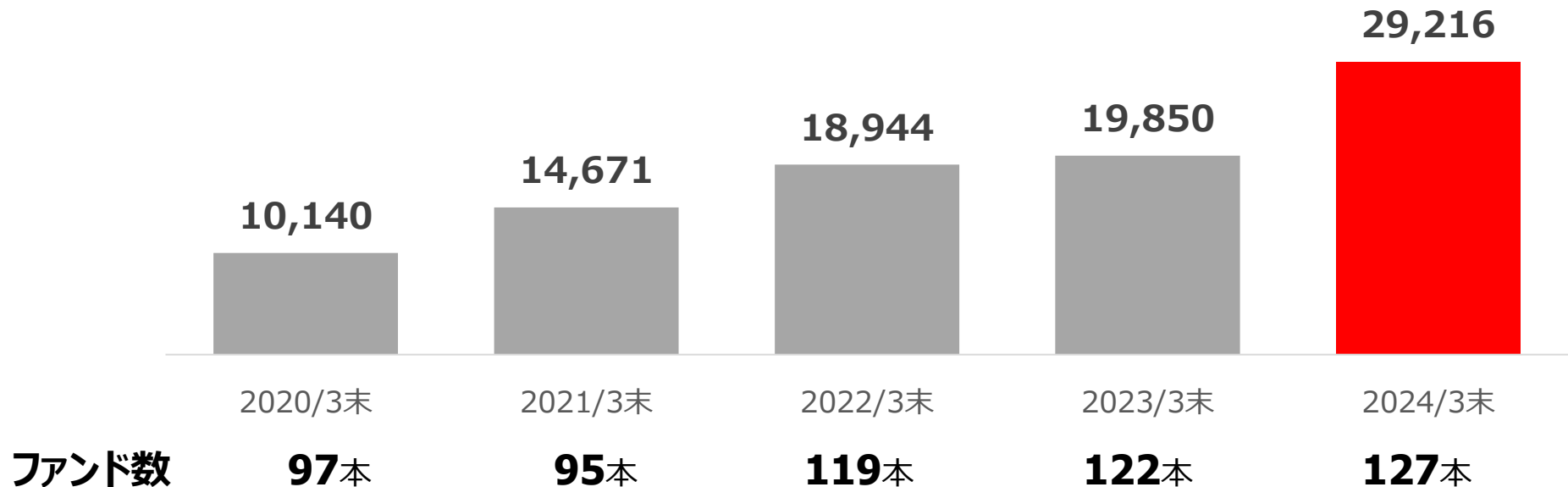


4 純資産総額

- 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、NISA対象ファンド、確定拠出年金向け商品を“資産形成向けファンド”とし、その残高合計を設定しています。
- 内外株式の株価上昇を中心として、“資産形成向けファンド”の純資産総額は増加しました。

単位：億円

資産形成向けファンド



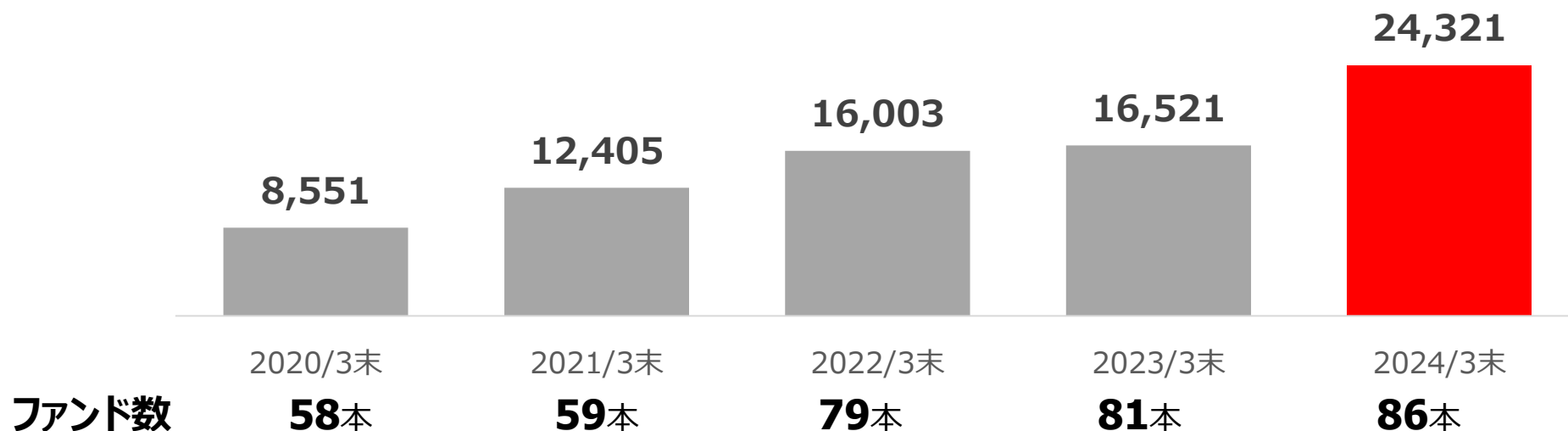
※ NISA対象ファンドの残高は、2024/3末時点のNISA対象ファンド(つみたて投資枠+成長投資枠)をもとに、各時点の残高を算出したものです。
 ※ NISA対象ファンドと確定拠出年金向け商品は一部重複しています。

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、NISA対象ファンドの純資産総額を設定しています。
- 内外株式の株価上昇に加えて、＜購入・換金手数料なし＞ニッセイNASDAQ100インデックス等への資金流入により、残高が増加しました。

NISA対象ファンド

単位：億円



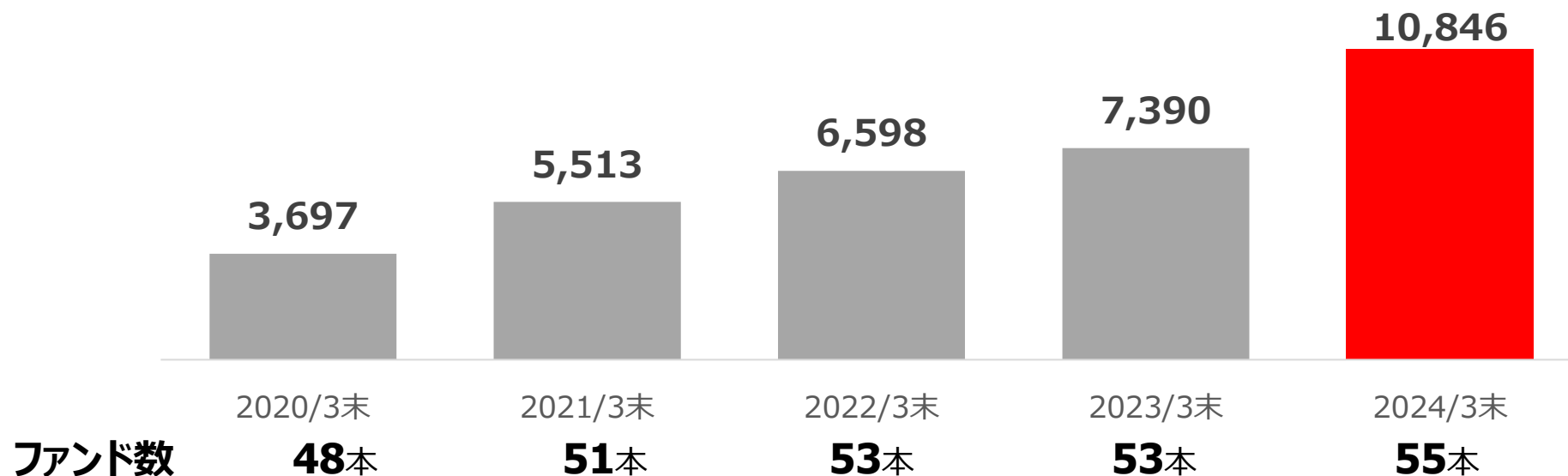
※ NISA対象ファンドの残高は、2024/3末時点のNISA対象ファンド(つみたて投資枠+成長投資枠)をもとに、各時点の残高を算出したものです。

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。
- 確定拠出年金向け商品の純資産総額は、内外株式の株価上昇を中心として、昨年度から増加しました。

確定拠出年金向け商品

単位：億円



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ます。

R&Iファンド大賞受賞本数

2020年	2021年	2022年	2023年	2024年
11 本	8 本	5 本	5 本	9 本

2024年受賞ファンド（評価基準日：2023年度末）



USドリーム

- ①② ニッセイアメリカ高配当株ファンド
(年2回決算型)／(毎月決算型)
 【北米株式高配当】
 投資信託部門：最優秀ファンド賞



- ⑤ <購入・換金手数料なし>
ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)
 【バランス型(標準)】 投資信託部門：優秀ファンド賞



スペース革命

- ③④ ニッセイ宇宙関連グローバル株式ファンド
(資産成長型・為替ヘッジなし)
(年2回決算型・為替ヘッジなし)
 【テクノロジー関連外国株式】
 投資信託部門：優秀ファンド賞



- ⑥ DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)
 【バランス型(債券中心)】 投資信託10年部門：優秀ファンド賞
- ⑦ DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)
 【バランス型(標準)】 投資信託10年部門：優秀ファンド賞
- ⑧ DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)
 【バランス型(株式・REIT中心)】
 投資信託10年部門：優秀ファンド賞
- ⑨ DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)
 【バランス型(株式・REIT中心)】
 投資信託部門：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」順位をお示します。
- 「担当者の説明能力・人柄」部門や「商品企画力・開発力」部門の低下等により順位は悪化しましたが、今後改善に努めてまいります。

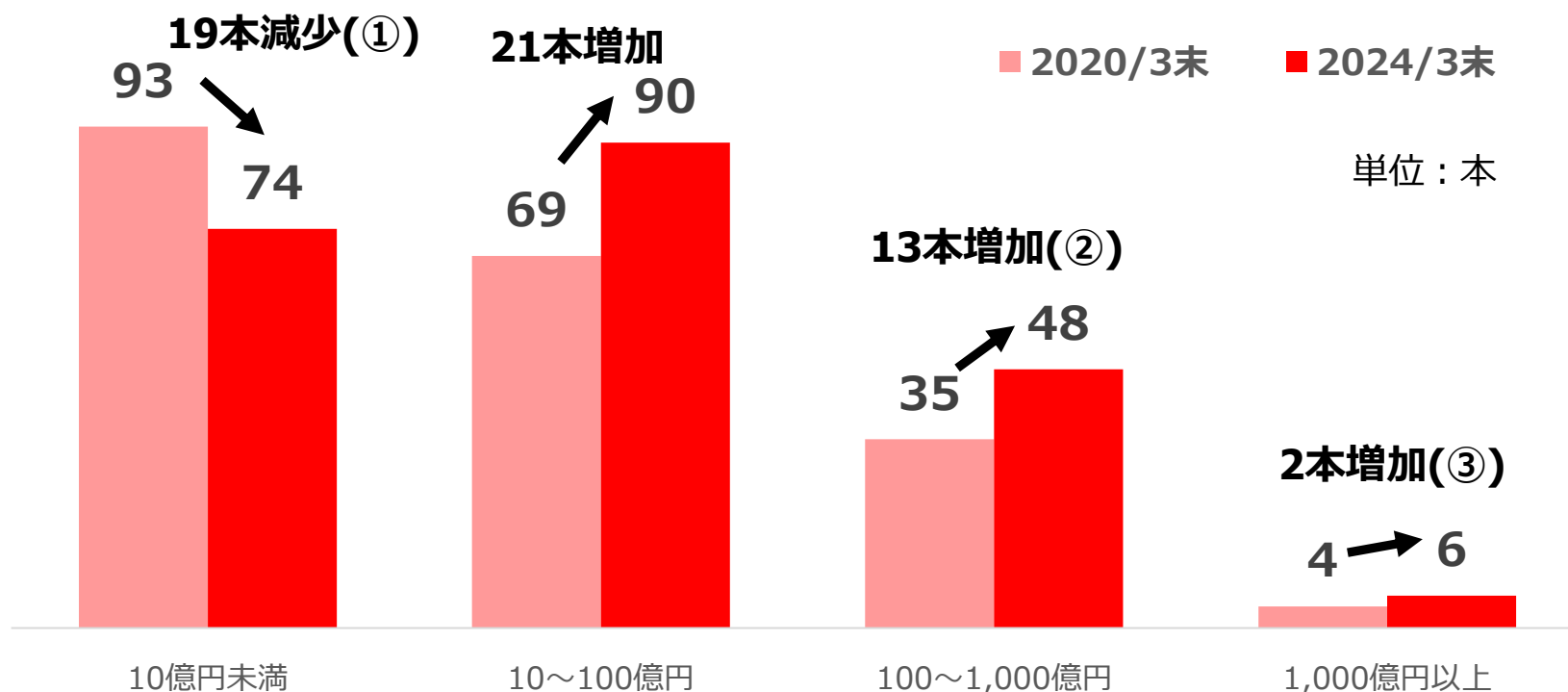
R&I「ファンド情報」投信会社満足度調査 ： 残高上位販社「総合評価」順位

2019年度	2020年度	2021年度	2022年度	2023年度
11位 /24社	13位 /22社	9位 /26社	8位 /27社	14位 /28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。
- 2020/3末と比較して、純資産総額が10億円未満の小規模ファンドが19本減少(①)する一方、100～1,000億円のファンドが13本増加(②)、1,000億円以上のファンドが2本増加(③)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。
- 昨年と比べて公募投資信託の純資産総額が時価増を中心に増加した為、1ファンドあたり平均時価残高は上昇しました。

単位：億円

