

2019年5月30日
アセットマネジメントOne株式会社

アセットマネジメントOneのフィデューシャリー・デューティーの実践に向けた 運用力に関する定量指標（KPI）の公表について

アセットマネジメントOne株式会社（取締役社長：菅野 暁、以下「当社」）は、株式会社みずほフィナンシャルグループが定める『〈みずほ〉の企業理念』、ならびに、第一生命グループが定める『第一生命グループの理念体系』を踏まえた「アセットマネジメントOneの企業理念」を制定し、責任感とチャレンジ精神をもって、最高水準の商品・サービスを提供し、お客さまにいちばん信頼される資産運用会社を目指してまいります。

当社は、「お客さま」の資産形成の中長期的なパートナーとして、お客さま第一で行動し、フィデューシャリーNo.1を目指すべく、その実践に向けた取り組み方針を明確化し、対応を強化する観点から(1)「フィデューシャリー・デューティーの実践に向けた取組方針」、および(2)当該取組方針の実践に向けたアクションプラン(以下「アクションプラン」)を策定・公表しております^(※1)。

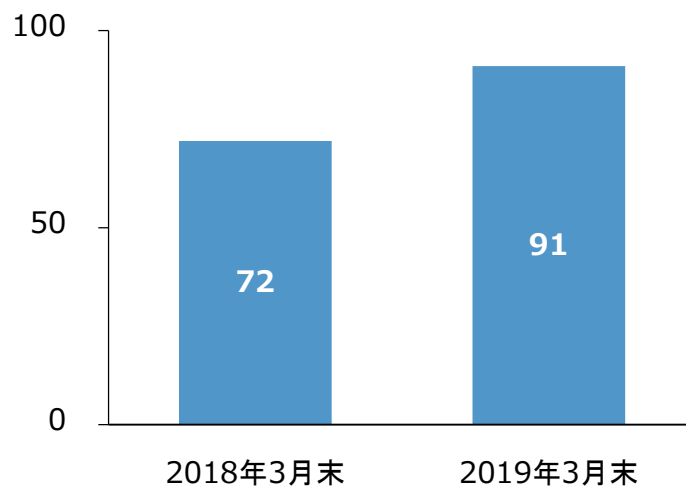
今般、当社のファンドに対する外部評価会社のレーティング^(※2)を当社運用力に関する定量指標（KPI）として新規に策定・公表します。

当該KPIは、お客さまの目線からのわかりやすさ、客観性、納得性を有しており、当社全体の運用力について、従来以上にご理解を深めていただけるものと考えております。当社における施策の成果や運用の努力等で当該KPIを改善していくことにより、パフォーマンス良好なファンドをより多くお客さまにご提供してまいります。

また、当該KPIは、今後のアクションプランにおけるPDCAサイクルの中で適切にフォローし、年度毎に公表してまいります。

以上

レーティング☆4以上のファンド数^(※3)



レーティング☆4以上のファンド数：投資資産別^(※3)

投資資産	2018年 3月末	2019年 3月末
国内株式	17	19
国内債券	1	0
海外株式	4	10
海外債券	30	36
ハイブリッド (国内、海外)	20	26
合計	72	91

(*1) アセットマネジメント One の「フィデューシャリー・デューティーの実践に向けた取組方針」について (URL) <http://www.am-one.co.jp/company/fiduciary/>

(*2) Fundmark のレーティングを使用しています。Fundmark は、株式会社野村総合研究所が提供する投資信託のパフォーマンス評価レポートです。株式会社野村総合研究所が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）を実施しています。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。最新の評価レポートに関しては、以下のウェブサイトをご覧ください。

(URL) <http://fis.nri.co.jp/ja-JP/service/ids/category/fundmark.html>

なお、株式会社野村総合研究所は、Fundmark 分類の見直しを 2019 年 8 月に予定しています。

(URL) <http://fis.nri.co.jp/ja-JP/service/ids/2019/04/20190405.html>

(*3) Fundmark のレーティングが付与されている当社の国内追加型投資信託（以下、ファンド）において、レーティングが 4（☆☆☆☆）または 5（☆☆☆☆☆）のファンドを各年 3 月末基準で集計しています（最上位評価が☆5、最下位評価が☆1）。

※Fundmark は、あくまで過去のデータを分析したものであり、将来のパフォーマンスを保証するものではありません。Fundmark は、投資判断・資産運用の参考となる情報の提供を目的としたものであり、投資勧誘を目的としたものではありません。Fundmark のいかなる部分も、その著作権、知的財産その他一切の権利は、株式会社野村総合研究所又はその許諾者に帰属しており、電子的方法又は機械的方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製、引用、転載又は転送等を行うことを禁止いたします。

（出所）株式会社野村総合研究所の資料を基に当社が作成