

R&I ファンド大賞 2018 確定給付年金部門で受賞

- 国内株式コア部門・国内株式バリュー部門 -

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 菅野暁）が運用する2戦略が、株式会社格付投資情報センター（R&I）が選定する「R&Iファンド大賞2018」の確定給付年金部門の国内株式コア部門、国内株式バリュー部門を受賞しました。

< 受賞部門・運用戦略 >

- ・国内株式コア部門
「国内株式アクティブ(みずほ信託銀行 第26株式口/国内株式市場型戦略)」
- ・国内株式バリュー部門
「国内株式アクティブ(みずほ信託銀行 第25株式口/FCV戦略リサーチ・バリュー・プラス)」

(いずれも、みずほ信託銀行から年金運用再委託を受け、アセットマネジメントOneが運用を行っています。)

「国内株式アクティブ(第26株式口/国内株式市場型戦略)」は、「自己資本」に「将来の収益性・成長性(ROE)」を加味した企業価値を算出し、ROEの水準に応じた割安度を推定することで、幅広い投資機会を獲得する市場型のアクティブ戦略です。割安度の推定で重要な要素である「将来のROE水準の変化」に注目し、ROEの水準が維持・向上できる業績モメンタムが良好な銘柄を組入れることで安定的な超過リターン獲得を目指します。

「国内株式アクティブ(第25株式口/FCV戦略リサーチ・バリュー・プラス)」は、企業本来の収益力を反映したFCV(フリーキャッシュフロー・バリュエーション)による投資魅力度に基づき割安な銘柄を選択するアクティブ運用戦略です。市場の過度な悲観に流されない“長期的な視点”と“健全な懐疑心”を持って市場と対峙することで超過リターンの獲得を目指します。

アセットマネジメントOneでは、本受賞を励みに、投資家の資産形成に資する商品・サービスの提供と運用成績の向上に引き続き努めてまいります。

以上

上記プロダクトは特定投資家向けのものであり、特定投資家以外の方はご利用できません。

当該評価は、過去の一定期間の実績を分析したものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。

【「R&Iファンド大賞2018」について】

「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。

「確定給付年金部門」では2016、2017、2018 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、2018 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。定量評価は、「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。「確定給付年金部門」では受賞区分を設けていない。

【投資一任契約にかかるリスクと費用等について】

投資一任契約に基づく運用におきましては、以下のリスク及びお客さまの費用負担が発生致します。

リスクについて

アセットマネジメントOne株式会社の提供する運用は、株式や債券等の値動きのある有価証券等に投資をしますので、市場環境（為替市場を含みます）組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により損失を被る恐れがあります。変動要因としましては、有価証券等の価格変動リスク、金利や金融市場の変動リスク、十分な流動性の下で取引が行えない流動性リスク、有価証券等の発行体の信用リスク及びカントリーリスク等の他、外貨建資産に投資している場合には為替変動リスクがあります。このため、ご投資いただく金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。運用においてデリバティブ取引等を利用する場合、当該デリバティブ取引の額が当該デリバティブ取引等について預託すべき保証金等の額を上回る可能性があります。このため、損失が生じるおそれの他、元本超過損が生じるおそれ、追加的に保証金等の差し入れが必要となる可能性があります。当該デリバティブ取引の額の当該保証金等に対する比率については、個々の取引内容や条件により異なるため事前に示すことができません。

費用について

投資一任契約にかかる報酬として、一般に、契約資産額に対して予め定めた料率の投資顧問報酬が契約期間に応じたかかります。上記に加え、成功報酬をご負担いただく場合があります。なお、成功報酬については、予め定めた基準等にもとづき実際の運用実績等に応じて投資顧問報酬が変動するほか、お客さまと別途協議により取り決めさせていただくことから、事前に計算方法、上限額等を示すことができません。投資顧問報酬の他に、以下の手数料等が発生致します。

売買委託手数料等

投資一任契約に基づき、有価証券等の売買等を行う場合は、有価証券等の売買委託手数料等をご契約資産で負担いただく場合があります。

運用報酬等

投資一任契約に基づき、ご契約資産で投資信託等の運用商品へ投資を行う場合は、一般的には、当該運用商品に係る運用会社の運用報酬（成功報酬が設定されている場合は成功報酬を含みます）投資信託等の管理報酬、有価証券等取引に係る手数料、信託事務の処理に要する諸費用、監査費用、法律関係の費用、資産の保管等に要する費用、借入金の利息等を間接的にご負担いただきます。また、投資信託等の運用商品を換金する際に、信託財産留保額や解約手数料がかかる場合があります。これらの投資顧問報酬以外の手数料等は、契約内容・資産残高等により変動し、あらかじめその額が確定していないため、その上限額及び計算方法を記載することができません。

なお、お客さまにご負担いただくこととなる投資顧問報酬及び投資顧問報酬以外の手数料等の合計額、その上限額及び計算方法等は、契約内容・資産残高等により変動し、あらかじめその額が確定していないため、記載することができません。

【ご注意事項】

当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。

当資料は、情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。

当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データは過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

当資料における内容は作成時点（2018年5月18日）のものであり、今後予告なく変更される場合があります。株式や債券等の相場の変動等により投資した資産が減少する場合がありますが、これによる損失はお客様ご自身が負担することになります。

【アセットマネジメント One について】

アセットマネジメントOne株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約58兆円とアジアトップクラスの規模を誇ります。

統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。

HP : <http://www.am-one.co.jp/>

運用資産残高は2017年12月末時点。

商号等 / アセットマネジメントOne株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324号

加入協会 / 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会