

2020年6月29日

りそなアセットマネジメント株式会社

お客さま本位の業務運営の実践に向けた 成果指標（KPI）の公表について

りそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」）は、株式会社りそなホールディングスが公表する「りそなフューチャー・デューティー基本方針（以下、「基本方針」）」のもと、当社の運用ビジネス哲学である、「真にお客さまの役に立つ資産運用サービスの提供」の実現に向けた具体的な取組方針（アクションプラン）¹、および成果指標（KPI）²を2020年3月に策定いたしました。

当資料では、今般策定した成果指標（KPI）9項目について公表いたします。詳細につきましては次頁以降をご参照ください。

また、アクションプランおよびKPIについては、定期的にその取組状況をご報告するとともに、さらなる取組み高度化のために随時見直しを実施してまいります。

当社は、「お客さまの喜びがりそなの喜び」というりそなグループの基本姿勢を貫き、お客さまの信頼に応え、真にお客さまの役に立つ資産運用サービスを提供するために努力を続けてまいります。今後とも更なるご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

以上

¹ 当社の「フィデューシャリーデューティに関するアクションプラン」につきましては当社ホームページの「お客さま本位の業務運営」（下記 URL）からご覧ください。

<https://www.resona-am.co.jp/investors/fiduciary.html>

² 当社は、アクションプランの進捗状況や定着度合を計るとともに、①より良い社会の実現への貢献、②高度な運用力、③中長期の資産形成への貢献という、当社の目指す姿を表現する KPI を設定しております。この KPI を継続公表していくことにより、多くのお客さまに信頼され、選んでいただける運用会社を目指しています。

成果指標 (KPI) ※2020年3月末基準

I. より良い社会の実現

1. エンゲージメント活動数 (アクションプランⅢ-3. 責任ある投資家としての取り組み)

継続的な投資先企業との対話や意見交換を通じて、投資先企業の価値向上、株式市場全体の底上げへの貢献に努めてまいります。なお、当社では企業に過度な負担を強いる事が無いよう、やみくもな活動数の増加は目標としておりません。エンゲージメント活動のクオリティを重視し、適正な活動数の維持を目指します。

	件数	企業数
エンゲージメント活動数	330	219

2. SDGs/ESGに関連したファンドの純資産総額推移 (アクションプランⅢ-3. 責任ある投資家としての取り組み)

当社は、株式市場の底上げへの貢献に加え、お客さまが投資をされる際に SDGs/ESG の観点における投資の選択肢を提供するため、関連するファンドの拡充に取り組んでまいります。2019年度は「Smart-i 国内株式 ESG インデックス」、「Smart-i 先進国株式 ESG インデックス」の2ファンドを設定いたしました。

	2020年3月	(2019年3月)
SDGs関連ファンド数	3	1
SDGs関連ファンド純資産総額	137億円	176億円

II. 高度な運用力

1. 代表アクティブ運用プロダクトの実績超過収益、シャープ・レシオおよびインフォメーション・レシオ (アクションプランⅢ-1. 中長期的に再現性のあるパフォーマンス)

当社は、お客さまへの”長期的に再現性を持った超過パフォーマンスの提供”が、運用会社の責務の一つと考えております。当社が注力するアクティブ運用プロダクト (運用手法) の実績パフォーマンスにより当社の運用力を表現し、お客さまから選んでいただける運用会社を目指します。

当社が株式会社りそな銀行より運用の再委託を受けている年金投資基金信託については、良好な長期運用実績 (過去10年) を示しており、全てのファンドでベンチマーク対比超過収益を獲得いたしました。

また、「りそなラップ型ファンド (安定型) [愛称: R246 (安定型)]」が2020年ファンド大賞 (投資信託部門・バランス型 (標準)) で優秀賞を受賞いたしました。

【年金投資基金信託】

過去3年（年率換算）

資産名	国内株式					
ファンド名	株式口A	株式口L	株式口W	株式口O	株式口V	株式口Z
超過収益率（対ベンチマーク）	3.82%	-1.62%	5.12%	3.49%	-3.06%	4.37%
シャープレシオ	0.25	-0.11	0.31	0.08	-0.21	0.21
インフォメーションレシオ	1.41	-0.44	1.23	0.62	-0.89	0.21
資産名	国内債券		外国債券	外国株式		
ファンド名	公社債口A	公社債口D	外証券口A	総合口O		
超過収益率（対ベンチマーク）	0.05%	0.22%	0.01%	13.47%		
シャープレシオ	0.45	0.54	0.74	0.75		
インフォメーションレシオ	0.19	1.09	0.02	1.73		

過去5年（年率換算）

資産名	国内株式					
ファンド名	株式口A	株式口L	株式口W	株式口O	株式口V	株式口Z
超過収益率（対ベンチマーク）	2.43%	0.38%	3.09%	3.10%	-0.48%	13.10%
シャープレシオ	0.18	0.04	0.20	0.27	-0.01	0.69
インフォメーションレシオ	0.88	0.10	0.74	0.55	-0.14	0.69
資産名	国内債券		外国債券	外国株式		
ファンド名	公社債口A	公社債口D	外証券口A	総合口O		
超過収益率（対ベンチマーク）	0.11%	0.35%	-0.40%			
シャープレシオ	0.65	0.74	0.01			
インフォメーションレシオ	0.47	1.59	-0.53			

過去10年（年率換算）

資産名	国内株式					
ファンド名	株式口A	株式口L	株式口W	株式口O	株式口V	株式口Z
超過収益率（対ベンチマーク）	2.65%	0.99%	2.64%	0.72%	0.65%	
シャープレシオ	0.52	0.39	0.47	0.49	0.37	
インフォメーションレシオ	1.00	0.31	0.66	0.15	0.21	
資産名	国内債券		外国債券	外国株式		
ファンド名	公社債口A	公社債口D	外証券口A	総合口O		
超過収益率（対ベンチマーク）	0.22%	0.33%	0.30%			
シャープレシオ	0.92	0.95	0.51			
インフォメーションレシオ	0.87	1.12	0.32			

【公募投資信託】

過去3年（年率換算）

ファンド名	りそなラップ型ファンド（愛称：R246）		
	安定型	安定成長型	成長型
収益率	0.64%	-0.95%	-2.97%
シャープレシオ	0.21	-0.12	-0.20

※年金投資基金信託は、株式会社りそな銀行が年金信託契約に基づき提供しているファンドであり、当社が株式会社りそな銀行より運用の再委託を受けているものを記載しています。

※年金投資基金信託の収益率については各種のコスト控除前で計算しています。

※シャープ・レシオは、短期金利（有担保コール）控除後の収益率を、当該収益率の標準偏差で除することにより得られる数値です。

※インフォメーション・レシオは、ベンチマークを上回った収益率(超過収益率)の平均を、超過収益率の標準偏差で除することにより得られる数値です。

2. 証券アナリスト資格保有者数および運用関連部署での保有比率（アクションプランIV-1. プロフェッショナルリズムの発揮）

お客さまから安心して中長期的な運用を任せていただけるよう、専門性の維持／向上に努めてまいります。

	2020年3月
証券アナリスト資格保有者数と割合	77名 (77%)

※運用関連部署は、運用戦略部、インデックス運用部、株式運用部、債券運用部、責任投資部およびトレーディング部を指し、2020年3月末時点で100名が在籍しております。

III. お客さまの資産形成への貢献

1. 積立投資向け（つみたてNISA／確定拠出年金向け）に提供しているファンドの純資産総額の推移（アクションプランII-1. 資産形成の浸透に向けた商品の提供）

当社は、お客さまの中長期的な資産形成に適した手法の一つとして、積立投資が挙げられると考えています。積立投資向けに提供するファンドの拡充を通じ、お客さまの中長期的な資産形成に貢献します。

2019年度は「りそなターゲット・イヤー・ファンド」シリーズを4ファンド、「Smart-i」シリーズを2ファンド（Smart-i 国内株式 ESG インデックス、Smart-i 先進国株式 ESG インデックス）を新規に設定し、確定拠出年金向けに提供しています。

	2020年3月	(2019年3月)
積立投資向け提供ファンド数	23	17
積立投資向け提供ファンド純資産総額	248億円	90億円

2. バランスファンド／バランス運用向け提供ファンドの純資産総額推移（アクションプランII-1. 資産形成の浸透に向けた商品の提供）

バランスファンド／バランス運用は、1つの資産に偏ることなく、値動きの異なる複数の資産を組み合わせる分散投資をするファンド／運用手法です。一般的には、同等のリターンが期待される単一資産への投資と比較して安定的な値動きとなる事が期待されるため、中長期的な資産形成に適したファンド／運用手法と考えられます。当社は、バランスファンド／バランス運用向け提供ファンドの拡充を通じ、お客さまの中長期的な資産形成に貢献します。

2019年度は、確定拠出年金やつみたてNISA向けの商品、窓口販売向けの「りそなラップ型ファンド（愛称：R246）」、「りそな・リスクコントロールファンド（愛称：みつぼしフライト）」シリーズ等の伸び率が大きく増加いたしました。

	2020年3月	(2019年3月)
バランスファンド／バランス運用向けファンドの純資産総額	5,796億円	4,102億円

※上記の数値には、株式会社りそな銀行が運用する「りそなファンドラップ」および「りそなファンドラップ（ウェルカムプラン）」向けに提供している投資信託の純資産総額を含みます。

3. お客さま向けのセミナーへの講師派遣数（アクションプランⅡ-2. 分かりやすい情報提供）

お客さま向けセミナーへの講師派遣を通じて、資産運用の考え方や現在の市場環境等、お客さまの資産形成に役立つ情報を分かりやすく提供してまいります。

	回数
お客さま向けセミナーへの講師派遣回数	82

4. インデックス型公募ファンドの資産別平均信託報酬率の推移（アクションプランⅢ-2. 低コストで良質な運用サービスの提供）

当社は、低コストのインデックス運用を通じた”様々なマーケットへの投資機会の提供”が運用会社の重要な役割の一つと考えております。信託報酬料率設定の際は、同一資産／同一運用のインデックス型公募ファンドにおいて、ファンド毎に過度な信託報酬の差が生じる事の無いよう、努めてまいります。

	国内債券	先進国債券	国内株式	先進国株式	新興国株式
ファンド数	1	2	3	2	1
平均信託報酬率	0.13%	0.19%	0.19%	0.22%	0.37%
	国内リート	先進国リート			
ファンド数	1	1			
平均信託報酬率	0.19%	0.22%			

※平均信託報酬率は、各ファンドの信託報酬率を、純資産総額を用いて加重平均することにより得られる数値です。

5. 純資産総額 100 億円以上の公募ファンド比率（アクションプランⅡ-1. 資産形成の浸透に向けた商品の提供）

当社は、商品ラインアップのやみくもな拡充を行わず、真のお客さまニーズにお応えできると考えるものに厳選して設定していく方針です。お客さまに中長期的に安定したパフォーマンスをお届けできるよう、一つ一つのファンドを大切に扱い、継続して純資産総額の拡充に取り組んでまいります。

2019 年度は、上記方針のもと、真にお客さまに必要とされるファンドを厳選して設定したことにより、全体のファンド数は増加しましたが、全体に占める純資産総額 100 億円以

上のファンドの割合も増加しました。

	2020年3月	(2019年3月)
純資産総額100億円以上のファンド数	17	12
全体のファンド数に占める割合	31.5%	30.0%

以上