Goldman Sachs Asset Management

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

2015 年 5 月 22 日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント
「R&I ファンド大賞 2015」受賞のお知らせ
【確定給付年金（ＤＢ）部門】

この度、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」において、以下のファンドが受賞しましたのでお知らせいたします。ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントは今回の受賞を励みに、お客さまの資産形成にお役に立てるよう、より一層努力を続けてまいりますので、引き続きご愛顧の程、よろしくお願いいたします。

部　門	ファンド名称
国内株式中小型	国内小型株式ファンダメンタル・アクティブ運用
外国株式	外国株式計量アクティブ運用

****

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社は、1996 年の設立以降、国内外の株式や債券、為替さらには不動産、ヘッジファンドなどの代替投資を含め世界の幅広い資産クラスにおいて、様々な運用サービスを提供しております。ゴールドマン・サックス・グループの投資運用部門として、世界中で展開するゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントは、長年にわたる豊富な実績に裏付けられたノウハウ、グローバルなネットワーク、最新の投資技術と世界的な調査能力を駆使し、世界の個人投資家や機関投資家、政府系機関などのお客様に資産運用サービスを提供しています。

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 325 号
加入協会：日本証券業協会、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
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

「Ｒ＆Ｉファンド大賞 2015」 の概要

「投資信託」および「投資信託／総合部門」は確定拠出年金専用ファンドを除く国内籍公募追加型株式投信、「確定拠出年金」は確定拠出年金向けに利用される国内籍公募追加型株式投信、「NISA」は NISA（少額投資非課税制度）向けに利用される国内籍公募追加型株式投信、「確定給付年金」は『R&I ユニバースデータサービス』に登録されているファンド、を対象にしており、いずれも基本的にＲ＆Ｉによる分類をベースとしている。選考は、「投資信託」、「確定拠出年金」、「NISA」、「確定給付年金」では 2013、2014、2015 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、2015 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、「投資信託」、「確定拠出年金」、「NISA」では"シャープ・レシオ"を採用、表彰対象は設定から 3 年以上かつ償還予定日まで 1 年以上の期間を有し、「投資信託」及び「NISA」では残高が 30 億円以上かつカテゴリー内で上位 50%以上、「確定拠出年金」では残高が 10 億円以上かつカテゴリー内で上位 75%以上、「NISA」では 2015 年 3 月末における過去 3 年間の月次収益率の標準偏差（年率）が 30%以下の条件を満たすファンドとしている。「確定給付年金」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。なお、「投資信託」、「確定拠出年金」、「NISA」では上位 1 ファンドを「最優秀ファンド賞」、次位 2 ファンド程度を「優秀ファンド賞」として表彰している。「確定給付年金」では受賞区分を設けていない。「投資信託／総合部門」では、2015 年 3 月末において残高 30 億円以上のファンドを 3 本以上設定する運用会社を表彰対象とし、各ファンドの 3 年間における"シャープ・レシオ"の残高加重平均値によるランキングに基づき、上位 1 社を「最優秀賞」、次位 1 社を「優秀賞」として表彰している。

「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。「投資信託／総合部門」の各カテゴリーは、受賞運用会社の該当ファンドの平均的な運用実績を評価したもので、受賞運用会社の全ての個別ファンドについて運用実績が優れていることを示すものではありません。