

ニュースリリース

日興アセットマネジメント株式会社

日興アセットマネジメント

国内株式運用、国内債券運用、グローバル REIT 運用において高い評価を獲得

～ 「アジアインベスター 2007 アchievement Award」、 「R&I ファンド大賞 2007」を受賞 ～

[東京 2007 年 5 月 16 日] 日興アセットマネジメント株式会社(取締役会長兼 CEO:ティモシー・マッカーシー、以下「日興 AM」)は、先頃相次いで発表された「アジアインベスター 2007 アchievement Award」および「R&I ファンド大賞 2007」において、国内株式運用や国内債券運用、グローバル REIT 運用の優れた運用成績が評価され、計 6 件の賞を受賞しました。「アジアインベスター アchievement Award」は昨年引き続き 2 年連続の受賞となりました。

「アジアインベスター 2007 アchievement Award」は、アジア地域の機関投資家向け金融専門誌、アジアインベスター誌が選定しています。日興 AM は、「日本株部門」において、2006 年末までの過去 10 年間におけるリスク調整後の運用成績が、ノミネートされた運用会社の中でトップであったことなどが評価され、同賞を受賞しました。来る 5 月 18 日に香港で行なわれる授与式は、アジア地域の運用機関から荣誉ある式典として広く敬意を払われています。

「R&I ファンド大賞 2007」は、個人投資家向けファンドや、確定給付年金ならびに確定拠出年金向けファンドの定量評価、定性評価の分野で長期的な実績を持つ株式会社格付投資情報センター(R&I)が、本年度より選定を開始しました。この記念すべき第 1 回目の表彰で、投資信託の【外国 REIT 部門】において、「日興・AMP グローバル REIT ファンド 毎月分配型 A(ヘッジなし)」と「ラサール・グローバル REIT ファンド(毎月分配型)」の 2 本が優秀ファンド賞を受賞しました。また、確定給付年金については、【国内株式型部門】で「国内株式ファンダメンタル・バリュー戦略」、【国内債券型部門】で「国内債券アクティブ戦略クレジット特化型」と「国内債券アクティブ戦略ブロードマーケット型」の両ファンド、計 3 本が表彰されています。

受賞にあたり、社長兼 CIO のビル・ワイルダーは次のように述べています。「アジアインベスター誌および格付投資情報センターよりこのような名誉ある賞を受け、大変光栄に思います。我々運用会社にとって何よりも大切な使命は、優れたパフォーマンスを投資家の皆様にご提供し、利益を還元することです。この度高い評価をいただいたことを励みに、今後も更なる運用実績の向上と競争力のある商品・サービスの提供に全力を尽くしていきます」。

以上

「アジアンインベスター アchievement アワード」について

機関投資家の資産運用に関して実施される「アジアンインベスター 2007 アchievement アワード」の選出方法には2段階あります。

第一に、マーサー社およびワトソンワイアット社のデータに基づいて、1カ年の運用成績に対する賞においては運用リターンのみ、他の賞についてはインフォメーション・レシオをみます。このスクリーニングにより上位3あるいは4社に絞り込みます。

第二段階として、ノミネートされた運用会社より、アルファの源泉や戦略、運用チームの経験、革新性、インタビューなどに関して情報の提供を得て、分析を実施します。これによりアジアンインベスター誌の定性的評価を下します。

同一の資産クラスにおいてコンスタントに良い運用成績を上げている場合においては優位となり、また顧客側の証言に関しても重要な選別基準としています。ノミネートされた運用会社はアジアンインベスターより提供される質問表への回答を提出することになります。ほぼ全てのカテゴリーにおける選出は非常に競争が激しいものの、ごく限られたカテゴリーに関しては、1社のみが回答書を提出したために、不戦勝となったケースも過去にあります。

詳細は下記URLをご参照ください(英文): <http://www.asianinvestor.net/article.aspx?ClaNID=31760>

「R&I ファンド大賞 2007」について

・表彰対象

「投資信託」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、「確定給付年金」は『R&I ユニバース計測サービス』に登録されているファンドを対象としており、いずれも基本的にR&Iによる分類をベースとしております。今年度については、「投資信託」は国内株式型、国内中小型株式型、外国株式型、外国債券型、外国債券毎月分配型、アジア・オセアニア株式型、外国REIT型の各カテゴリーを、「確定拠出年金」は国内株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、バランス型の各カテゴリーを、「確定給付年金」は国内株式型、国内債券型、外国株式型、外国債券型、バランス型の各カテゴリーを対象としております。

・選考方法

選考は、2005、2006、2007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、2007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」では“シャープ・レシオ”を採用、表彰対象は設定から3年以上経過し、残高が10億円以上かつカテゴリー内で上位75%以上の条件を満たすファンドとしております。「確定給付年金」では定量評価として“インフォメーション・レシオ”を採用しております。なお、「投資信託」、「確定拠出年金」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「優勝ファンド賞」として表彰しております。「確定給付年金」では受賞区分を設けておりません。

「R&Iファンド大賞」は、過去のデータに基づいたもので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、投資の参考となる情報提供のみを目的とし、投資家に当該ファンドの購入、売却、保有を推奨するものではありません。また、格付投資情報センターの顧客に対して提供している定性評価情報とは関係ありません。当大賞は信頼すべき情報に基づいて格付投資情報センターが算出したもので、その正確性及び完全性は必ずしも保証されていません。当大賞に関する著作権その他の権利は、格付投資情報センターに帰属し、同社の許諾無くこれらの情報を使用(複製、改変、送信、頒布、切除を含む)することを禁じます。

国内・外国株式及び国内・外国債券等を対象としたオルタナティブ運用戦略

これらの戦略は、主に株式・債券、デリバティブ(金融派生商品)など、値動きのある証券(外貨建証券は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、弊社が運用するお客様の運用資産の評価額は変動します。したがって投資元本を割り込むことがあります。

これらの戦略の主なリスクは、以下の通りです。

【価格変動リスク】

一般に株式の価格動向は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。特に投資する中小型株式や新興企業の株式は、株式市場全体の平均に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、運用資産の評価額にも大きな影響を与える場合があります。また、債権、未上場株式および投資事業有限責任組合の組合財産などは一般的に価格変動が大きくなる傾向があります。

一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合に価格が下落しますが、価格変動は、残存期間・発行条件などによってばらつきがあります。また、新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて価格変動が大きくなる傾向があります。

デリバティブ取引においては、原資産自体の価値の変動や、原資産に関する事情(金利、為替、株価指数、原資産発行体の経営・財務状況及びこれらに関する外部評価などを含みますが、これらだけに限られません)の変化等により、支払うないしは、受け取るキャッシュフローが変動しますので、これらから損失を被る場合があります。また、中途解約する場合、支払い金額を通算した結果として、金銭等の支払い義務が生じるリスクがあります。

【流動性リスク】

市場規模や取引量が少ない証券の場合、組み入れ銘柄を売却する際に、市場実勢から期待される価格での売却ができず、不測の損失を被るリスクがあります。デリバティブ取引の場合、権利行使期間に制限が設けられている場合があります。

【信用リスク】

一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず、重大な危機が生じた場合には、当戦略にも重大な損失が生じるリスクがあります。

また、デリバティブの場合、取引の相手方や取り扱い業者が倒産または支払い停止に陥った場合などには、取引が履行されず多大の損失を被る場合があります。また、原資産の発行体の倒産や支払い停止など、原資産に関連する信用リスクの影響をも受けます。

【為替変動リスク】

外貨建て資産については、一般に外国為替相場が当該資産の現地通貨に対して円高になった場合には、当戦略にも重大な損失が生じるリスクがあります。

【カントリーリスク】

投資対象国である新興国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)などを理由に市況動向や資金動向に急変が起きる可能性があり、これらを理由に重大な損失が生じるリスク、投資方針に従った運用ができなくなるリスクがあります。また、情報開示などの基準が先進国とは異なることから、投資判断に際して正確な情報を十分に確保できない場合があります。

➤ 報酬等の概要

お客様には以下の費用をご負担いただきます。

○投資顧問報酬等 固定報酬:年率3%以内

成功報酬:運用成果等に応じて成功報酬をご負担いただく場合があります。

○その他費用

組入れ有価証券の売買委託手数料、有価証券の保管などに要する費用、管理費用、監査費用、ファンド設立に係わる費用、借入金の利息、借り株費用など

※成功報酬、その他費用については、運用戦略および運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

➤ これらの戦略の投資に際し、投資一任契約に基づき投資信託に投資する場合があります。

➤ デリバティブ取引に際し、取引相手の定める委託証拠金がかかる場合があります。

日興アセットマネジメント株式会社

〒100-0006 東京都千代田区有楽町1丁目1番3号 東京宝塚ビル

www.nikkoam.com