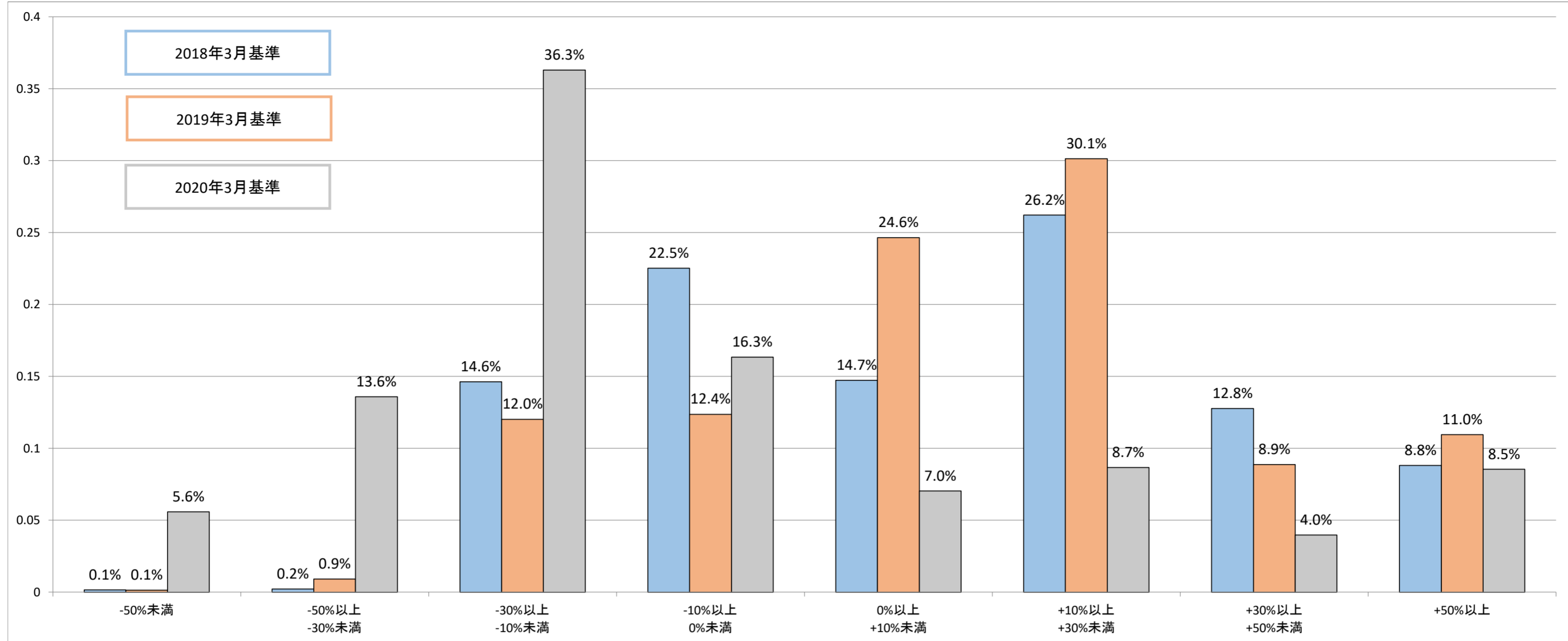


## 投資信託の販売会社における比較可能な共通KPI

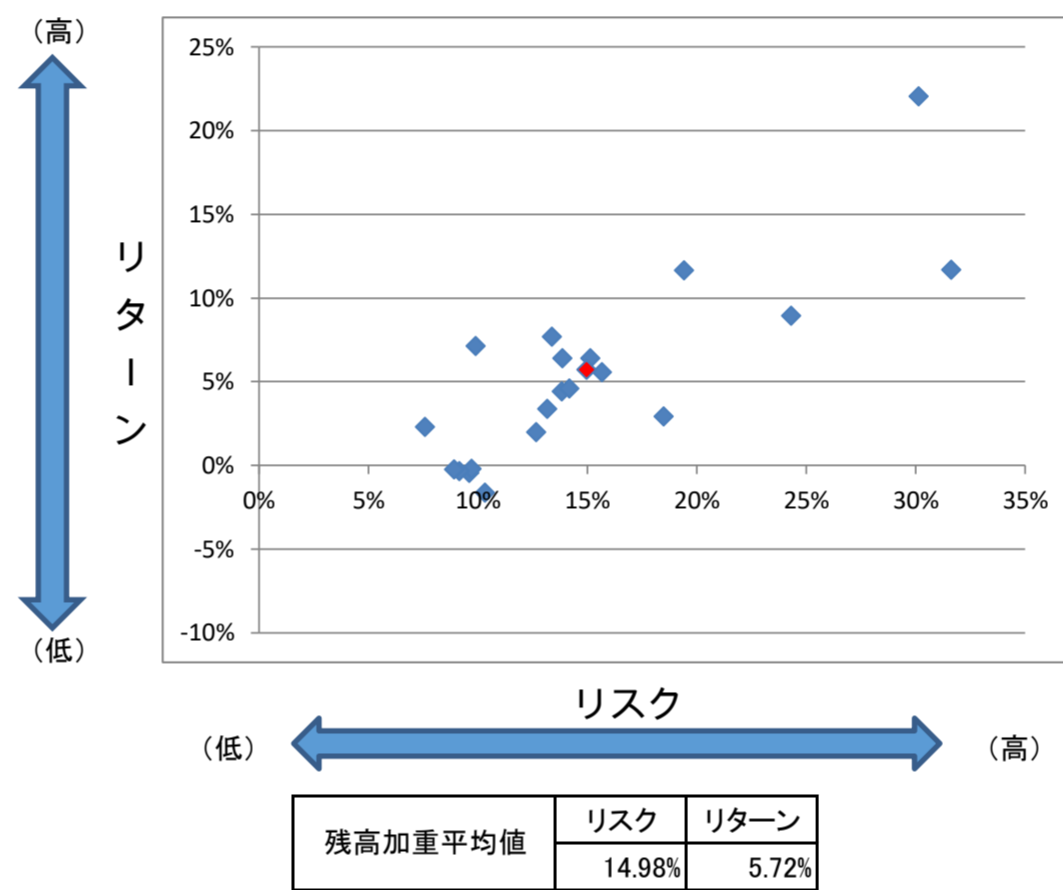
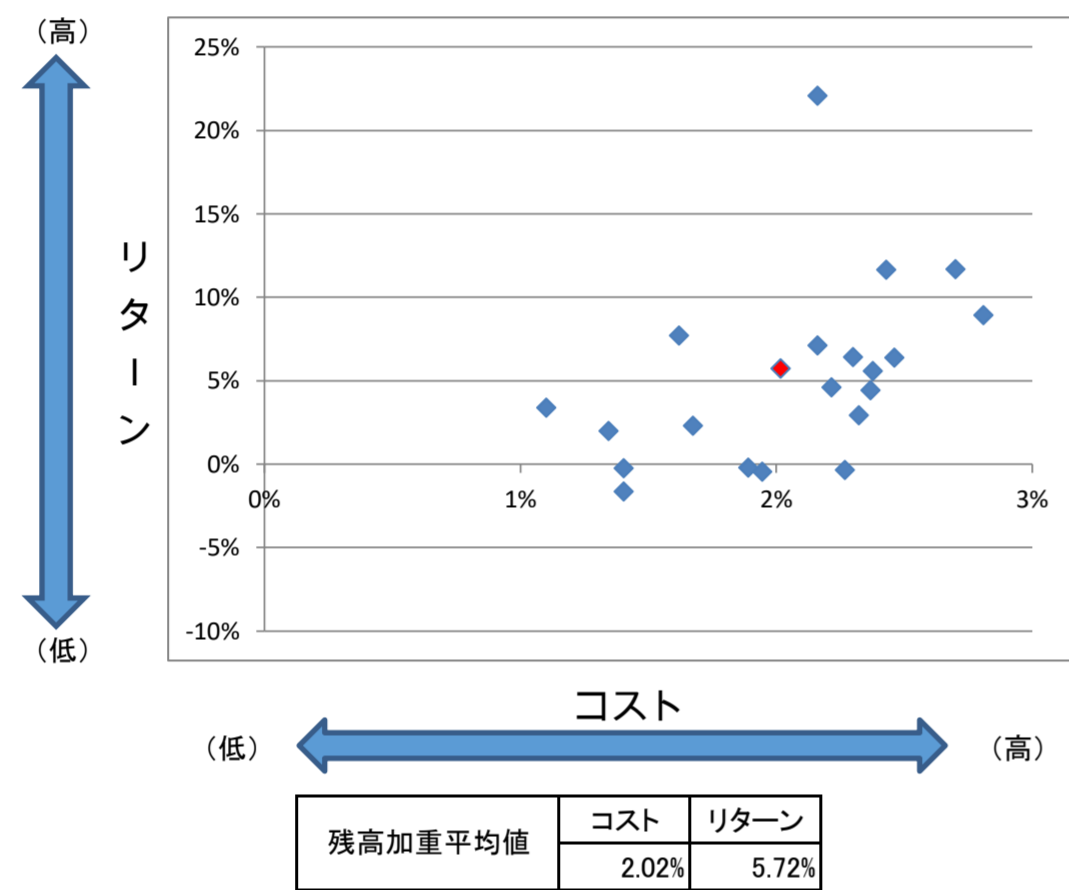
2018年6月29日に金融庁から公表されました「投資信託の販売会社における比較可能な共通KPI」につきまして、当社の状況は以下の通りです。  
 当社は、「お客様に『安心』を提供する投資環境を整備する」ことを目指し、お客様視点に立った業務遂行とお客様の利益を最優先とする意識の定着を図ってまいります。

### 運用損益別顧客比率



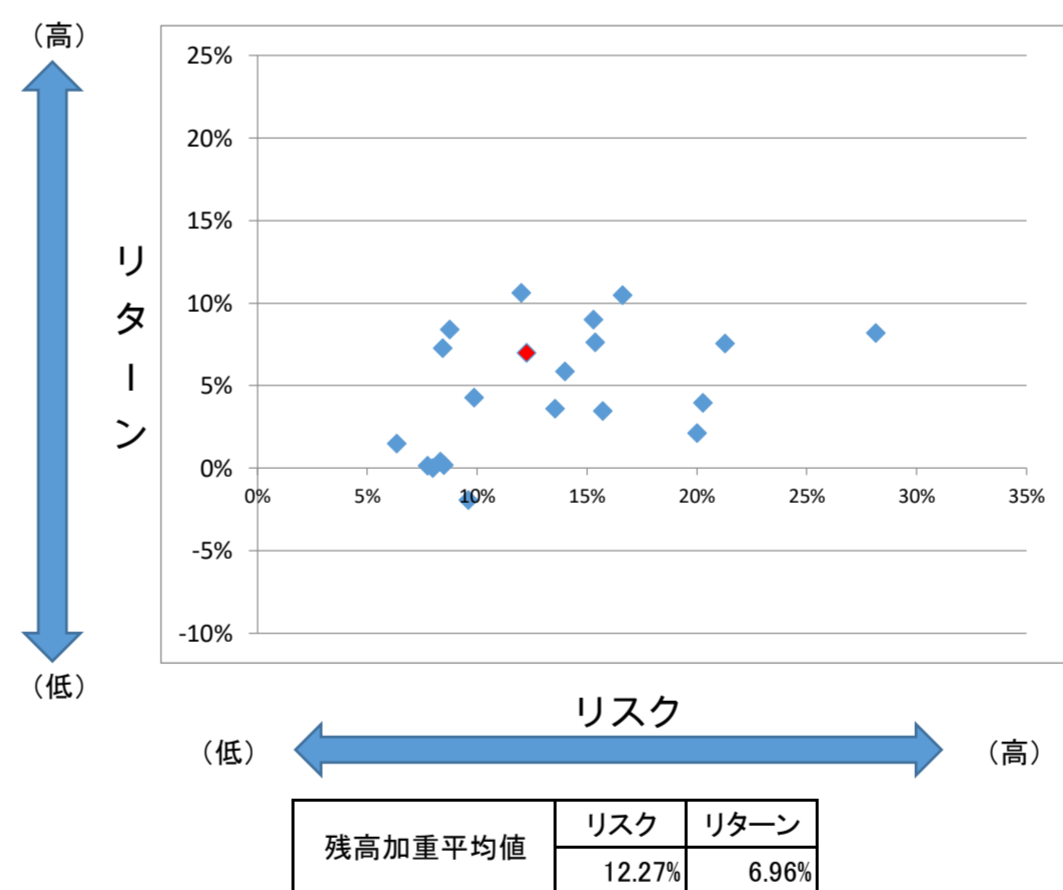
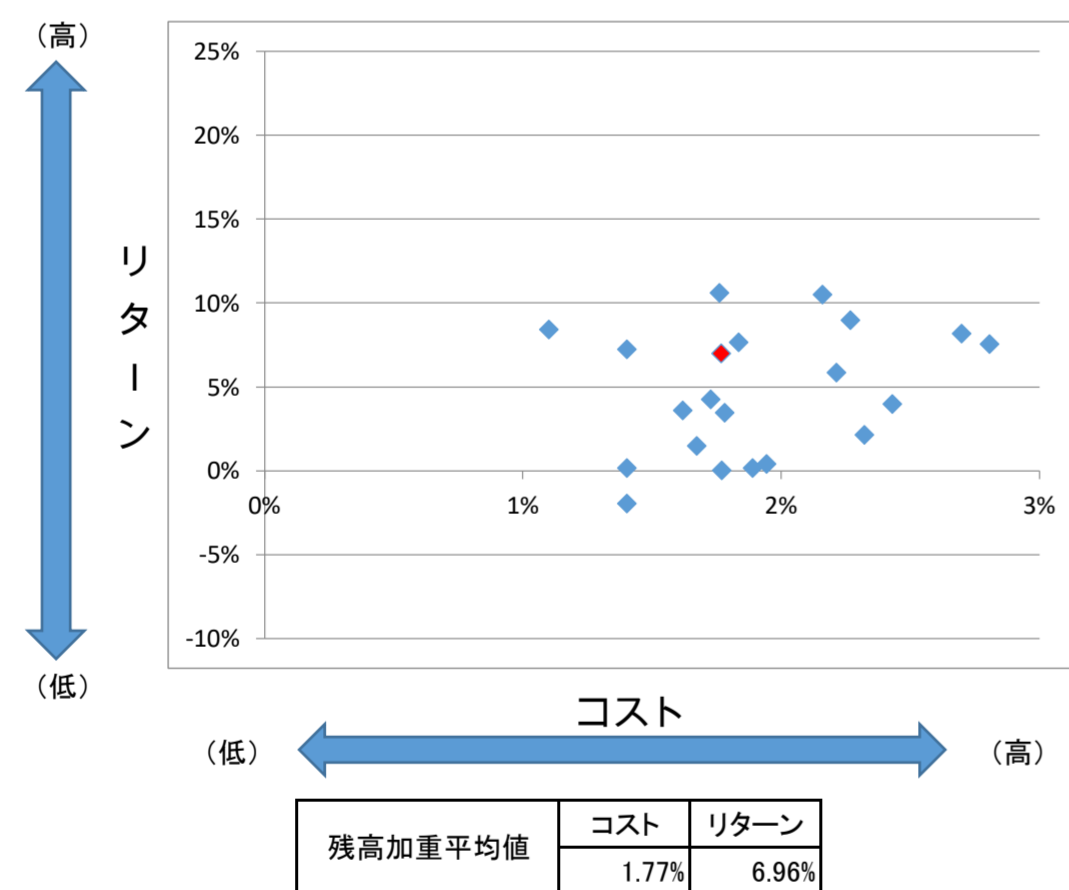
### 投資信託預り残高上位20銘柄（設定後5年以上）のコスト・リターン、リスク・リターン

《基準日：2018/03》



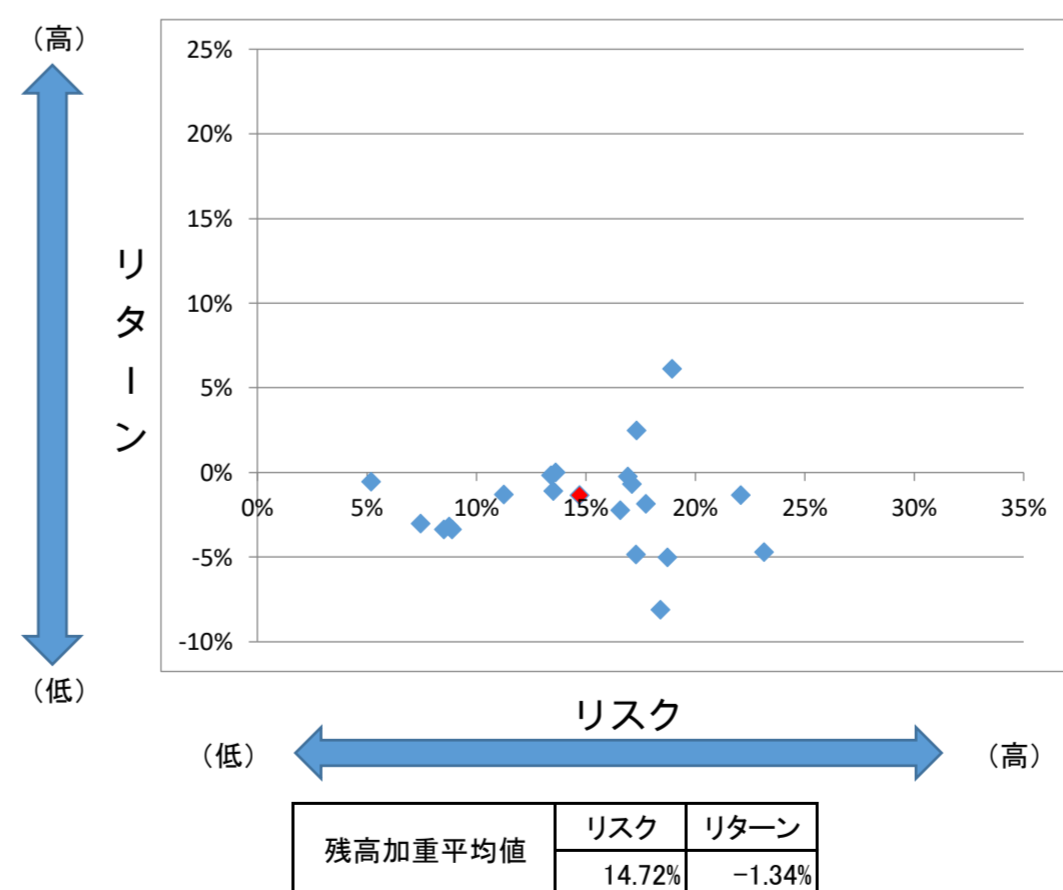
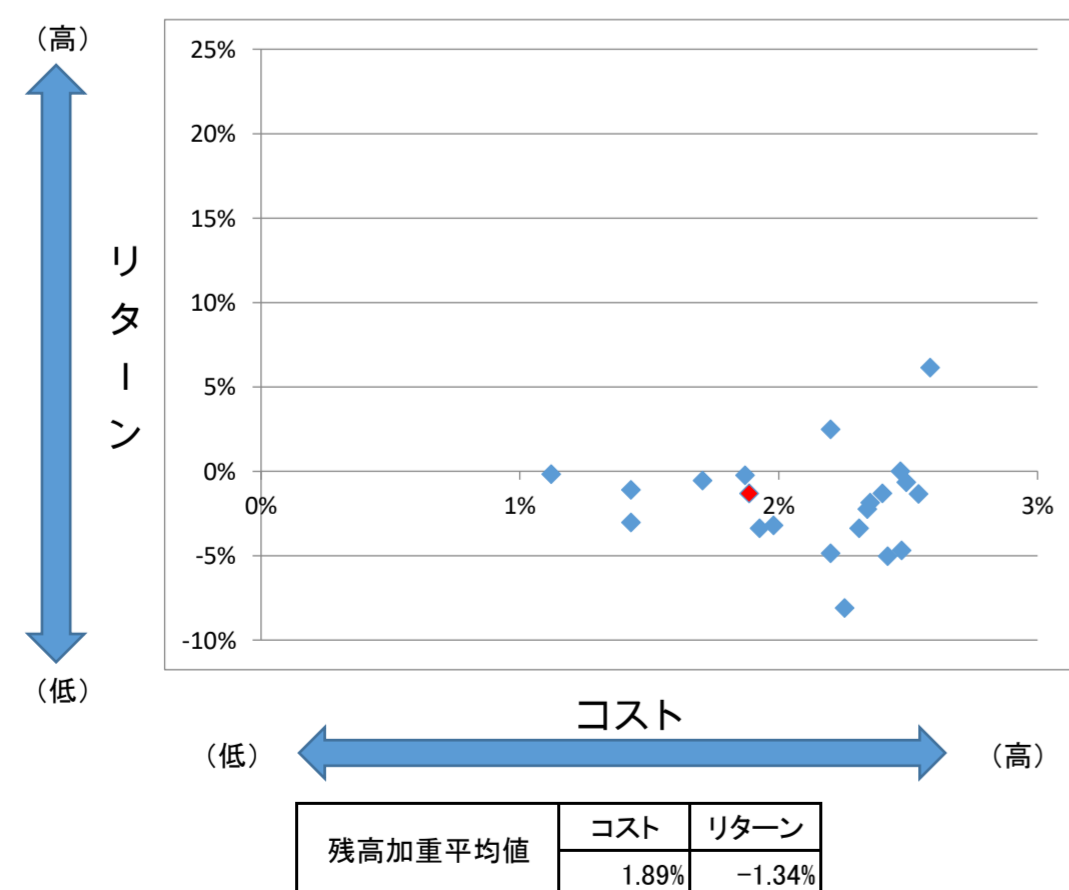
- ① 新光US-REITオープン
- ② ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)
- ③ DIAM J-REITオープン(毎月決算コース)
- ④ アジア・オセアニア好配当成長株オープン(毎月分配型)
- ⑤ きらめきジャパン
- ⑥ インド債券ファンド(毎月分配型)
- ⑦ グローバル・ソブリンオープン(毎月決算型)
- ⑧ ハリス世界株ファンド(毎月決算型)
- ⑨ インベスコ オーストラリア債券ファンド(毎月決算型)
- ⑩ MHAM豪ドル債券ファンド(毎月決算型)
- ⑪ アジア好利回りリートファンド
- ⑫ ワールド・リート・オープン(毎月決算型)
- ⑬ HSBCインド・インフラ株式オープン
- ⑭ アジア・オセアニア債券オープン
- ⑮ HSBCブラジル債券オープン
- ⑯ みずほUSハイイールドオープンBコース
- ⑰ 短期豪ドル債券オープン(毎月分配型)
- ⑱ DIAM高格付インカム・オープン(毎月決算コース)
- ⑲ DIAM世界好配当株オープン(毎月決算コース)
- ⑳ HSBCインドオープン

《基準日：2019/03》



- ① 新光US-REITオープン
- ② ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)
- ③ DIAM J-REITオープン(毎月決算)
- ④ アジア・オセアニア好配当成長株オープン(毎月分配型)
- ⑤ きらめきジャパン
- ⑥ インド債券ファンド(毎月分配型)
- ⑦ グローバル・ソブリンオープン 毎月決算
- ⑧ ハリス世界株ファンド(毎月決算型)
- ⑨ MHAM豪ドル債券ファンド(毎月決算型)
- ⑩ インベスコオーストラリア債券ファンド毎月
- ⑪ ワールド・リート・オープン(毎月決算型)
- ⑫ アジア・オセアニア債券オープン(毎月決算)
- ⑬ アジア好利回りリート・ファンド
- ⑭ HSBCインド・インフラ株式オープン
- ⑮ 好配当日本株式オープン
- ⑯ DIAM世界好配当株オープン(毎月決算)
- ⑰ DIAM高格付インカムオープン(毎月決算)
- ⑱ HSBCブラジル債券オープン(毎月決算型)
- ⑲ 短期豪ドル債券オープン(毎月分配型)
- ⑳ HSBCインドオープン

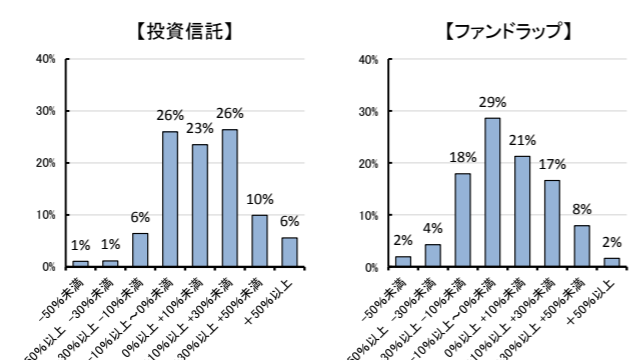
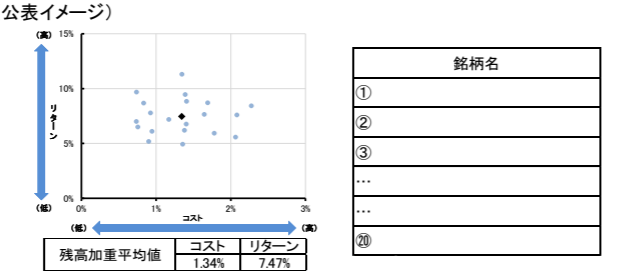
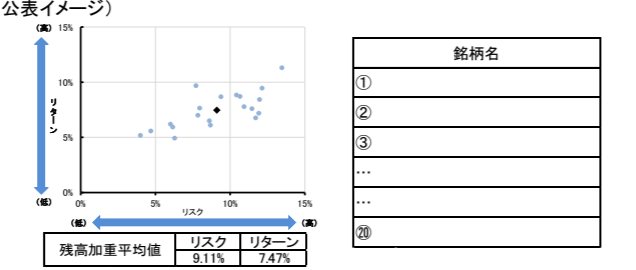
《基準日：2020/03》



- ① ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)
- ② 新光US-REITオープン
- ③ DIAM J-REITオープン(毎月決算)
- ④ ニッポン成長株オープン
- ⑤ アジア好利回りリート・F
- ⑥ 証券ジャパン日本株オープン
- ⑦ グローバル・ソブリンオープン 毎月決算
- ⑧ インド債券ファンド(毎月分配型)
- ⑨ アジア・オセアニア好配当成長株OP(毎月)
- ⑩ MHAM豪ドル債券ファンド(毎月決算型)
- ⑪ インベスコオーストラリア債券ファンド毎月
- ⑫ キャピタルベトナム成長株インカムファンド
- ⑬ 朝日レハリス世界株ファンド(毎月決算型)
- ⑭ アジア・オセアニア債券オープン(毎月決算)
- ⑮ ピクテ・グローバルインカム株式F毎月分配
- ⑯ DIAM厳選米園株式ファンド
- ⑰ 日興ラサール・グローバルREITファンド
- ⑱ 好配当日本株式オープン
- ⑲ ワールド・リート・オープン(毎月決算型)
- ⑳ DIAM高格付インカムオープン(毎月決算)

以下の点にご留意ください。  
 ・ ファンドラップの取扱いはありません。  
 ・ 投資信託には、ETF・上場REIT、公社債（MRF・MMF等）、私募投信を含みません。  
 ・ 運用損益別顧客比率は、トータルリターン通知制度に基づく基準日時時点のトータルリターンに基づき算出しており、2011年3月末日以前の買付のある方は除きます。  
 ・ コスト・リターン、リスク・リターンにおける◆表示は対象20銘柄の残高加重平均値を示します。  
 ・ 外貨建て投資信託における運用損益の算出方法は、評価額は基準日現在の為替レートおよび運用損益は取引日の為替レートで算出しております。  
 ・ 投資信託の販売会社における比較可能な共通KPIの定義は次頁をご覧ください。  
 ・ 共通KPIの各数値は過去の一時点における実績に基づくものであり、将来の運用損益、コスト・リターン、リスク・リターンをお約束するものではありません。

投資信託の販売会社における比較可能な共通KPIの定義

項目名	公表内容	基準日・頻度など	算出方法														
●投資信託・ファンドラップの運用損益別顧客比率	<p>・対象顧客全体を100%とし、それぞれの運用損益に該当する顧客数比率の棒グラフ</p> <p>・運用損益の区分</p> <p>① +50%以上 ② +30%以上+50%未満 ③ +10%以上+30%未満 ④ 0%以上+10%未満 ⑤ -10%以上0%未満 ⑥ -30%以上-10%未満 ⑦ -50%以上-30%未満 ⑧ -50%未満</p> <p>(公表イメージ)</p>  <p>【投資信託】</p> <p>【ファンドラップ】</p>	<p>・基準日: 毎年3月末</p> <p>・更新頻度: 年次</p> <p>・初年度は1年分、次年度は過去2年分、3年度以降は、過去3年分を公表</p>	対象顧客	・基準日時点で投資信託及びファンドラップを保有している個人の顧客													
			対象取引	・自社の投資信託口座による取引 ・他社の金融商品仲介口座による取引(以下、仲介取引)													
			対象商品	・基準日時点で対象顧客が保有している投資信託(公募の国内株式投資信託・外国投資信託)及びファンドラップ ・投資信託には、ETF、上場REIT、公社債投信(MRF、MMF等)、私募投信、確定拠出年金・財形・ミリオンで買い付けた投資信託は含まない。													
			運用損益計算	<table border="1"> <tr> <th></th> <th>全体</th> <th></th> </tr> <tr> <td rowspan="2">投資信託</td> <td>分子</td> <td>・基準日時点の評価金額+累計受取分配金額(税引後)+累計売付金額-累計買付金額(含む消費税込の販売手数料) ・基準日時点までに全部売却・償還された銘柄は対象外</td> </tr> <tr> <td>分母</td> <td>・基準日時点の評価金額</td> </tr> <tr> <td rowspan="2">ファンドラップ</td> <td>分子</td> <td>・基準日時点の評価金額※+累計払戻金額-累計払込金額 ※投資一任報酬等の期中費用控除後の金額</td> </tr> <tr> <td>分母</td> <td>・基準日時点の評価金額※ ※投資一任報酬等の期中費用控除後の金額</td> </tr> <tr> <td>名寄せ</td> <td>・取引開始日まで遡及</td> <td>※左記方法で算出できない場合、各社がファンドラップの運用損益計算に使用している手法を適用</td> </tr> </table>		全体		投資信託	分子	・基準日時点の評価金額+累計受取分配金額(税引後)+累計売付金額-累計買付金額(含む消費税込の販売手数料) ・基準日時点までに全部売却・償還された銘柄は対象外	分母	・基準日時点の評価金額	ファンドラップ	分子	・基準日時点の評価金額※+累計払戻金額-累計払込金額 ※投資一任報酬等の期中費用控除後の金額	分母	・基準日時点の評価金額※ ※投資一任報酬等の期中費用控除後の金額
	全体																
投資信託	分子	・基準日時点の評価金額+累計受取分配金額(税引後)+累計売付金額-累計買付金額(含む消費税込の販売手数料) ・基準日時点までに全部売却・償還された銘柄は対象外															
	分母	・基準日時点の評価金額															
ファンドラップ	分子	・基準日時点の評価金額※+累計払戻金額-累計払込金額 ※投資一任報酬等の期中費用控除後の金額															
	分母	・基準日時点の評価金額※ ※投資一任報酬等の期中費用控除後の金額															
名寄せ	・取引開始日まで遡及	※左記方法で算出できない場合、各社がファンドラップの運用損益計算に使用している手法を適用															
●投資信託の預り残高上位20銘柄のコスト・リターン	<p>・預り残高上位20銘柄のコスト(横軸)とリターン(縦軸)の散布図(※20銘柄のコスト、リターンを残高加重平均した値をプロットし、数値を記載)</p> <p>・預り残高上位20銘柄の目論見書上の正式名称(当年度分のみ)</p> <p>(公表イメージ)</p>  <p>※ グラフ目盛は0%を起点とし、コストを1%、リターンを5%間隔とする。</p>	<p>・基準日: 毎年3月末</p> <p>・更新頻度: 年次</p> <p>・初年度は1年分、次年度は過去2年分、3年度以降は、過去3年分を公表</p>	対象銘柄	<p>・預り残高上位20銘柄(設定後5年以上)</p> <p>・自社取引、他社への仲介取引・紹介取引による残高を同一銘柄について合算のうえ、上位20銘柄を抽出</p> <p>・DC専用、ファンドラップ専用投信、ETF、上場REIT、公社債投信(MRF、MMF等)、私募投信は除く。単位型は含む。</p> <p>・外貨建て投資信託は除く</p>													
			コスト	<p>・基準日時点の販売手数料率(消費税込み)の1/5と信託報酬率(同左)の合計値</p> <p>・目論見書上の上限ではなく、取扱い時の最低販売金額での料率(自社取引、他社への仲介取引・紹介取引のうち、最も高い料率を使用)</p> <p>・目論見書上の実質的な信託報酬率の上限(その他の費用・手数料は含まず)</p>													
			リターン	<p>・過去5年間のトータルリターン(年率換算) ※ 例えば、Excelで算出する場合のトータルリターンの算出式 = <math>product(60\text{ヵ月分の}(月次騰落率+1))^{(1/5)-1}</math></p> <p>・騰落率算出の際に用いる基準価額は分配金再投資後(税引前)の基準価額を使用</p>													
			リターン	<p>・過去5年間のトータルリターン(年率換算) ※ 例えば、Excelで算出する場合のトータルリターンの算出式 = <math>product(60\text{ヵ月分の}(月次騰落率+1))^{(1/5)-1}</math></p> <p>・騰落率算出の際に用いる基準価額は分配金再投資後(税引前)の基準価額を使用</p>													
●投資信託の預り残高上位20銘柄のリスク・リターン	<p>・預り残高上位20銘柄のリスク(横軸)とリターン(縦軸)の散布図(※20銘柄のリスク、リターンを残高加重平均した値をプロットし、数値を記載)</p> <p>・預り残高上位20銘柄の目論見書上の正式名称(当年度分のみ)</p> <p>(公表イメージ)</p>  <p>※ グラフ目盛は0%を起点とし、リスクを5%、リターンを5%間隔とする。</p>	<p>・基準日: 毎年3月末</p> <p>・更新頻度: 年次</p> <p>・初年度は1年分、次年度は過去2年分、3年度以降は、過去3年分を公表</p>	対象銘柄	<p>・預り残高上位20銘柄(設定後5年以上)</p> <p>・自社取引、他社への仲介取引・紹介取引による残高を同一銘柄について合算のうえ、上位20銘柄を抽出</p> <p>・DC専用、ファンドラップ専用投信、ETF、上場REIT、公社債投信(MRF、MMF等)、私募投信は除く。単位型は含む。</p> <p>・外貨建て投資信託は除く</p>													
			リスク	<p>・過去5年間の月次リターンの標準偏差(年率換算) ※ 例えば、Excelで算出する場合の月次リターンの標準偏差の算出式 = <math>stdev(60\text{ヵ月分の月次騰落率}) * \text{sqrt}(12)</math></p> <p>・騰落率算出の際に用いる基準価額は分配金再投資後(税引前)の基準価額を使用</p>													
			リターン	<p>・過去5年間のトータルリターン(年率換算) ※ 例えば、Excelで算出する場合のトータルリターンの算出式 = <math>product(60\text{ヵ月分の}(月次騰落率+1))^{(1/5)-1}</math></p> <p>・騰落率算出の際に用いる基準価額は分配金再投資後(税引前)の基準価額を使用</p>													
			リターン	<p>・過去5年間のトータルリターン(年率換算) ※ 例えば、Excelで算出する場合のトータルリターンの算出式 = <math>product(60\text{ヵ月分の}(月次騰落率+1))^{(1/5)-1}</math></p> <p>・騰落率算出の際に用いる基準価額は分配金再投資後(税引前)の基準価額を使用</p>													

注1)上記定義に基づき、各項目を公表する場合は、「共通KPI」である旨を記載。  
 注2)持株会社傘下に複数の販売会社がある場合は、個社毎に「共通KPI」を公表。  
 注3)運用損益別顧客比率の運用損益計算に関し、外貨建て投資信託の評価金額の算出方法(概要)を記載。  
 注4)運用損益別顧客比率の運用損益計算に関し、投資信託の遡及期間やファンドラップの運用損益計算が上記「算出方法」と異なる場合、その旨、及び算出方法(概要)を記載。  
 注5)投資信託の預り残高上位銘柄のコスト・リターン、リスク・リターンのグラフ目盛の間隔については、来年度以降、変更が生じる可能性あり。