

Fund Monitor®

投信評価分析データサービス

◆投資信託のパフォーマンス分析やモニタリングに◆

- ◆ Fund Monitor®「投信評価分析データサービス」は、投信会社の販売・選定・評価・分析等の業務に従事する方を対象としたデータ提供サービスです。
- ◆ 投資信託のパフォーマンス分析・評価、商品企画、販売銘柄の選定や、営業支援資料の作成といった様々な業務の効率化に役立ちます。
- ◆ Fund Monitor®の「投信評価分析データ」は、国内で公募設定・販売される投資信託の定量評価データのほか、運用方針や投信分類等の属性情報、組入有価証券に関する情報等、投資信託の評価・分析に必要な情報があります。
- ◆ Fund Monitor®は、お客様のニーズに応じて様々な形式で「投信評価分析データ」の提供を行います。

取り扱いデータ一覧（一部）

基本属性	分類	コスト	運用実績	運用実績順位
- ファンドID - ファンド名 - ファンド名（略称） - 投信会社 - 設定年月日 - 信託期間（満期日） - 決算回数 - 当初一口元本 - 商品 - 投資先国 - 投資手法 - 業種 - 規模 - 為替 - ベンチマーク（公表） - ベンチマーク（評価） - 成長枠NISA - つみたて枠NISA - お取り扱い対象	- モニター分類（大分類） - モニター分類（中分類） - モニター分類（小分類） - ファンド分類 - ファンド分類_詳細 - 協会分類（大分類） - 協会分類（小分類） - 協会RR分類 - モニターRR - クラスター分類	- 信託報酬(基準報酬) - 信託報酬(条件等) - 信託報酬内訳(委託) - 信託報酬内訳(販売) - 信託報酬内訳(受託) - 実質コスト - 信託財産留保額 - 信託財産留保額区分	- 年間収益率1,3,5,10年 - 年間標準偏差1,3,5,10年 - 通算分配金1,3,5,10年 - 資金流入1,3,5,10年 - 純資産額1,3,5,10年 - シャープレシオ1,3,5,10年 - リスク・リターンの移動 - アルファ - ベータ - 元本割リスク - 元本割頻度 - 分配性向(1,2,3,4,5年) - 平均分配性向 - 年間収益率最大 - 年間収益率最小 - 収益率変動幅	- 総合順位_1,3,5,10年 - 母数 - 収益率 - 標準偏差 - 通算分配金 - 資金流入 - 純資産額 - シャープレシオ - 総合順位_5年 - リスク・リターン移動 - コスト率 - 平均分配性向 - 元本割リスク - 元本割頻度 - 収益率変動幅

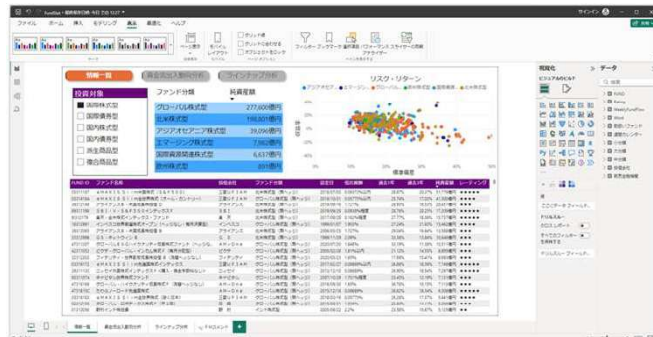
投信評価分析データサービス Fund Monitor®

国内公募投信の評価分析用データをお客様の用途やニーズに合わせて様々な形式・形態でご提供いたします。

Fund Monitor® BI

国内公募投信の評価分析用データをクラウド上で日次更新し、Microsoft PowerBI*による分析機能を提供します。

*Microsoft PowerBIはMicrosoft社の製品です。



Fund Monitor® RP

ファンド毎の月次ベースの投信評価レポートをPDFファイル形式で提供します。



※上記出力イメージは開発中のものです

Fund Monitor® DF

国内公募投信の評価分析用データをCSVファイル（四半期ベース2期分）で提供します。

Fund Monitor®活用例

- 基準価額・純資産額の定点観測、ファンドの収益率や対ベンチマーク超過収益率等の計測のモニタリング
- 資金流入入額に関する調査、要因分析の研究
- 確定拠出年金業務における運用商品モニタリング、商品追加提案、社内報告資料等の作成
- 注目トレンドファンドと同一分類ファンドとの収益率、分類平均に対する超過収益率等の比較分析
- 顧客本位の業務運営共通KPI作成用のファンドデータ（正式名称、コスト、リスク、リターン）を抽出
- 投資家への周知の為、基準価額騰落率の下落率5%超（日次）ファンドを抽出

NTT DATA

株式会社NTTデータ・エービック

株式会社 NTTデータ・エービック 金融サービス推進部

gp-sales@nttdata.abic.co.jp <https://www.nttdata.abic.co.jp/>

TEL 03-6435-5980 受付時間 9:00~17:00(土日祝日を除く)

〒107-0052 東京都港区赤坂4-15-1 赤坂ガーデンシティ 6階