

# 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
<ul style="list-style-type: none"><li>・ ファンドID</li><li>・ ファンド名</li><li>・ ファンド名（略称）</li><li>・ 投信会社</li><li>・ 設定期間</li><li>・ 信託期間（満期日）</li><li>・ 決算回数</li><li>・ 当初一口元本</li><li>・ 商品</li><li>・ 投資先国</li><li>・ 投資手法</li><li>・ 業種</li><li>・ 規模</li><li>・ 為替</li><li>・ ベンチマーク（公表）</li><li>・ ベンチマーク（評価）</li><li>・ 成長枠NISA</li><li>・ つみたて枠NISA</li><li>・ お取扱い対象</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>・ モニター分類（大分類）</li><li>・ モニター分類（中分類）</li><li>・ モニター分類（小分類）</li><li>・ ファンド分類</li><li>・ ファンド分類_詳細</li><li>・ 協会分類（大分類）</li><li>・ 協会分類（小分類）</li><li>・ 協会RR分類</li><li>・ モニターRR</li><li>・ クラスター分類</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 信託報酬（基準報酬）</li><li>・ 信託報酬（条件等）</li><li>・ 信託報酬内訳（委託）</li><li>・ 信託報酬内訳（販売）</li><li>・ 信託報酬内訳（受託）</li><li>・ 実質コスト</li><li>・ 信託財産留保額</li><li>・ 信託財産留保額区分</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 年間收益率1,3,5,10年</li><li>・ 年間標準偏差1,3,5,10年</li><li>・ 通算分配金1,3,5,10年</li><li>・ 資金流入出1,3,5,10年</li><li>・ 純資産額1,3,5,10年</li><li>・ シャープレシオ1,3,5,10年</li><li>・ リスク・リターンの移動</li><li>・ アルファ</li><li>・ ベータ</li><li>・ 元本割リスク</li><li>・ 元本割頻度</li><li>・ 分配性向(1,2,3,4,5年)</li><li>・ 平均分配性向</li><li>・ 年間收益率最大</li><li>・ 年間收益率最小</li><li>・ 収益率変動幅</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 総合順位_1,3,5,10年</li><li>・ ム数</li><li>・ 収益率</li><li>・ 標準偏差</li><li>・ 通算分配金</li><li>・ 資金流入出</li><li>・ 純資産額</li><li>・ シャープレシオ</li><li>・ 総合順位_5年</li><li>・ リスク・リターン移動</li><li>・ コスト率</li><li>・ 平均分配性向</li><li>・ 元本割リスク</li><li>・ 元本割頻度</li><li>・ 収益率変動幅</li></ul>

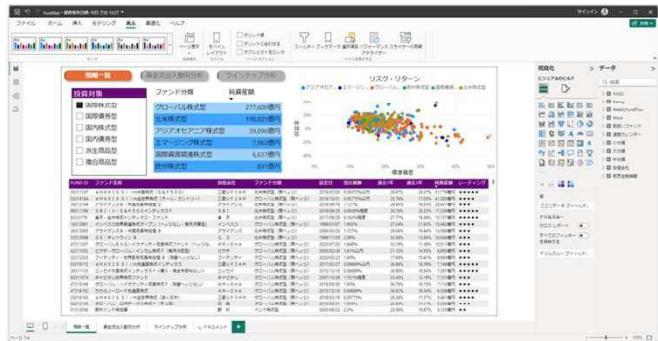
# 投信評価分析データサービス Fund Monitor®

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。

レコード番号	レコード名	レコード値
1	レコード1	レコード1の値
2	レコード2	レコード2の値
3	レコード3	レコード3の値
4	レコード4	レコード4の値
5	レコード5	レコード5の値
6	レコード6	レコード6の値
7	レコード7	レコード7の値
8	レコード8	レコード8の値
9	レコード9	レコード9の値
10	レコード10	レコード10の値
11	レコード11	レコード11の値
12	レコード12	レコード12の値
13	レコード13	レコード13の値
14	レコード14	レコード14の値
15	レコード15	レコード15の値
16	レコード16	レコード16の値
17	レコード17	レコード17の値
18	レコード18	レコード18の値
19	レコード19	レコード19の値
20	レコード20	レコード20の値
21	レコード21	レコード21の値
22	レコード22	レコード22の値
23	レコード23	レコード23の値
24	レコード24	レコード24の値
25	レコード25	レコード25の値
26	レコード26	レコード26の値
27	レコード27	レコード27の値

## 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
- 資金流入出額に関する調査、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

株式会社 NTTデータ・エービック 金融サービス推進部

**NTT Data**

株式会社NTTデータ・エービック

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