

# Fund Monitor<sup>®</sup>

## 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<sup>®</sup>「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<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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>設定年月日</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>お取り扱い対象</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>年間収益率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>年間収益率最大</li> <li>年間収益率最小</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>母数</li> <li>収益率</li> <li>標準偏差</li> <li>通算分配金</li> <li>資金流入</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> |

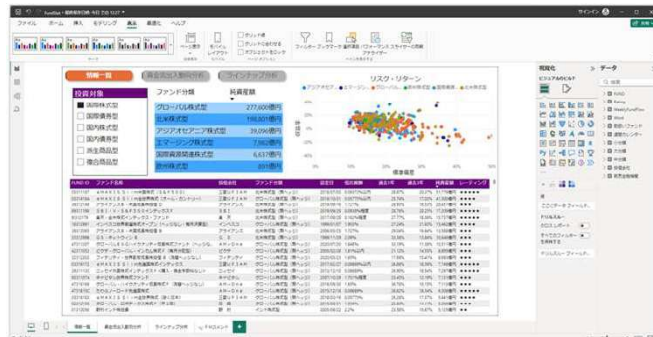
# 投信評価分析データサービス Fund Monitor®

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。

### 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

