

2020年3月30日

お客さま第一宣言の実践に向けた 運用力に関する定量指標（KPI）の公表について

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社（取締役社長：小嶋 信弘、以下「当社」）は、「日本一お客さまのことを考える資産運用会社」を目指す企業像として掲げた「お客さま第一宣言」を策定し、公表しております。

また、2017年3月に金融庁より公表された「顧客本位の業務運営の原則」の採択にあわせて、「お客さま第一宣言」の実践に向けたアクションプランを策定・公表しております。

今般、当社日本株ファンドに対する外部評価会社のレーティング^(*)、長期的ビジョンに基づく運用体制、ESG要素を投資価値分析に織り込んだ日本株運用商品の投資残高を、当社運用力に関する、定量評価（KPI）として、新たに策定・公表します。

当該KPIは、お客さま目線からの分かりやすさ、継続性、客観性を有しており、当社の運用力の特徴について、従来以上にご理解を深めていただけるものと考えております。

また、当該KPIは、今後のアクションプランの取組状況におけるPDCAサイクルの中で、適切にフォローし、定期的に公表してまいります。

(*) モーニングスター社のレーティングを使用し、モーニングスターの資産分類で国内株式となる当社が設定した公募投信を対象としております。

1. 当社日本株ファンドに対する外部評価会社のレーティング

- ・当社が設定している日本株の公募投信のパフォーマンスを評価するにあたり、モーニングスターレーティングの残高加重スコアと、4★以上獲得率について時系列比較しております。
- ・当社の日本株運用は、中長期の運用目的に適した、ファンダメンタルズに基づくアクティブ・バリューの運用スタイルを貫きます。
- ・運用パフォーマンスは、当社がお客さまに提供する付加価値そのものを定量的に示しており、当社がお客さまに中長期的に良好なパフォーマンスを提供しているかを測る重要な指標と考えております。

＜国内株式＞				
	残高加重スコア	ファンド数	*モーニングスター 4★ファンド数	*モーニングスター 4★以上獲得率
2017年度	3.91	10	6	60%
2018年度	3.96	9	7	78%
2019年12月	3.43	11	4	36%

(注)モーニングスターによる評価は、運用期間3年以上のファンドを対象として、1つ星から5つ星まで5段階でランクを付与。ファンドが属するカテゴリーの中で、リスク調整後のパフォーマンスが相対的にどのランクに位置するのか星の数で表しています。

- 5★ 上位10.0%以下
- 4★ 上位10.0%超～32.5%以下
- 3★ 上位32.5%超～67.5%以下
- 2★ 上位67.5%超～90.0%以下
- 1★ 上位90.0%超～100.0%以下

2. 長期的ビジョンに基づく運用体制

- ・ 当社の運用プロフェッショナル人材に係る各種指標について時系列比較しております。
- ・ 当社では、資産形成のパートナーとしてお客さまに安心してお取引いただくために、長期的ビジョンのもとで運用体制の強化に取り組んでおります。
- ・ 運用プロフェッショナル人材に係る各種指標は、当社が安定した運用パフォーマンスをお客さまに提供することができる運用体制を構築するための重要な指標と考えております。

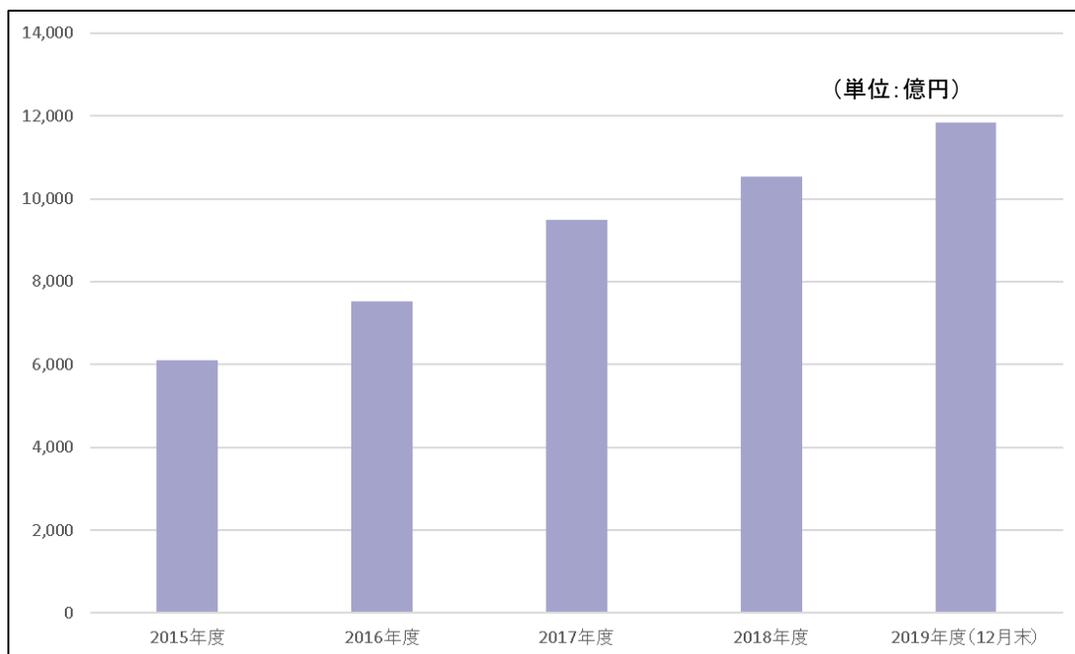
	2017年4月	2018年4月	2019年4月
運用プロフェッショナル人材	54人	56人	55人
平均運用経験年数	14.2年	13.8年	13.9年
平均在籍年数	7.3年	7.5年	8.0年
シニアマネージャー定着率	85%	88%	89%

(注)運用プロフェッショナル人材とは、当社の運用部門で運用業務に従事する従業員を指します。

3. ESG要素を投資価値分析に織り込んだ日本株運用商品の投資残高

- ・ 当社が自主運用する株式運用では、企業のESG（環境・社会・ガバナンス）情報を継続的にモニターし、投資価値に統合的に評価することで、運用プロセスにESG要因を織り込んでいます。
- ・ 当社は、エコファンドのパイオニアとして、ESGの観点をより強調した運用商品も積極的に展開し、ESG投資の普及に努めています。
- ・ 運用残高は、より多くのお客さまから信頼を頂き、中長期的な資産形成のお役に立っていることを測ることができる重要な指標と考えております。

<ESG要素を投資価値分析に織り込んだ日本株運用商品の投資残高>



以上