

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	・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	・基準日：毎年3月末 ・更新頻度：年次 ・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	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		
	・運用損益の区分 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		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)		
	(公表イメージ)		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・ミリオンドで買い付けた投資信託は含まない。		
	【投資信託】		全体	・投資信託及びファンドラップのそれぞれについて運用損益を算出 ・外貨建て投資信託の評価金額の算出には、各社の定める手法(換算レートなど)を適用			
	【ファンドラップ】		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			
			遡及期間	・当該銘柄の購入当初まで遡及 ※ 遡及できない場合は、各社が顧客に提供している「トータルリターン通知」の手法を適用			
			分子	・基準日時点の評価金額※+累計払戻金額-累計払込金額 ※ 投資一任報酬等の損中費用控除後の金額			
			分母	・基準日時点の評価金額※ ※ 投資一任報酬等の損中費用控除後の金額			
			遡及期間	・取引開始日まで遡及			
名寄せ			・投資信託口座と金融商品仲介口座の名寄せ不要 (例えば、銀行において、1人の顧客が投資信託口座と金融商品仲介口座の両方で取引を行っている場合は、2人としてカウント)				
●投資信託の預り残高上位20銘柄のコスト・リターン	・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)	・基準日：毎年3月末 ・更新頻度：年次 ・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	対象銘柄		・預り残高上位20銘柄(設定後5年以上) ・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 ・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。 ・外貨建て投資信託は除く		
	・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)		コスト		全体	・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	
	(公表イメージ)		販売手数料率		・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)		
	リターン		信託報酬率		・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)		
			リターン		・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 = $\text{product}(60\text{ヵ月分の(月次騰落率}+1))^{(1/5)-1}$ ・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		
●投資信託の預り残高上位20銘柄のリスク・リターン	・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)	・基準日：毎年3月末 ・更新頻度：年次 ・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	対象銘柄		・預り残高上位20銘柄(設定後5年以上) ・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 ・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。 ・外貨建て投資信託は除く		
	・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)		リスク		・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 = $\text{stdev}(60\text{ヵ月分の月次騰落率}) * \text{sqrt}(12)$ ・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		
	(公表イメージ)		リターン		・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 = $\text{product}(60\text{ヵ月分の(月次騰落率}+1))^{(1/5)-1}$ ・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		

注1)上記定義に基き、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。