

2024年7月31日

関係各位

野村アセットマネジメント株式会社

**「第22回 マーサーMPA(Japan)アワード2024」
国内株式大型部門(5年)で日本株運用戦略が2年連続受賞**



野村アセットマネジメント株式会社(CEO兼代表取締役社長:小池広靖、以下「当社」)は、世界的な資産運用コンサルタントであるマーサーの日本法人(以下「マーサージャパン」)が表彰する「第22回 マーサーMPA(Japan)アワード2024」の国内株式大型部門(5年)において、当社が運用する「日本株式アドバンスト・アルファ」が受賞したことをお知らせします。本戦略の受賞は昨年に続き、2年連続となりました。

部門	受賞運用戦略名
国内株式大型(5年)	日本株式アドバンスト・アルファ

「マーサーMPA[※](Japan)アワード」は、マーサージャパンが企業年金コンサルティング・サービスのためにデータを収集する運用商品の中から、特に優れた成績を上げた戦略を表彰するものです。

「日本株式アドバンスト・アルファ」はファンダメンタルズ分析と独自の定量モデルによるバリュエーション評価を重視した伝統的な運用手法にショート(売り持ち)を組み合わせることで、スタイル格差など株式市場の動向に関わらず安定的な超過収益の獲得を目指す戦略です。本戦略は、国内外の機関投資家の資産運用に貢献しています。

日本政府が「資産運用立国実現プラン」を掲げ、資産運用ビジネスの高度化が求められる中、当社は今後も、世界のお客様から選ばれる、日本を代表する運用会社になることを目指して、競争力のある商品・サービスを投資家の皆様に提供していきます。

※ 運用リターンを分析するマーサーのソフトウェアの名称「Manager Performance Analytics」の略。

以上

マーサーMPAアワードについて

マーサーMPAアワードは、部門毎に5年(あるいは3年)で、トータル・リターンと代表的なインデックスに対するインフォメーション・レシオをそれぞれ基準化した数字を合計し、カテゴリ内の上位 10%(但し、最大8プロダクトまで)あるいは上位3位のファンドの多い方を選定しています。

マーサーMPAアワードは過去の定量結果だけによる表彰であり、マーサーがマーサーの顧客に運用商品を推薦する場合に利用する定性評価とは何の関係もないものです。運用商品のリターン・データは運用報酬控除前であり、顧客が利用する際には、運用報酬の違いを考慮する必要がありますので、表彰対象と同じ期間に表彰された運用商品を使っても、表彰と同一の結果を得られるわけではありません。また、表彰に利用した評価基準が適切な方法であると保証するものではなく、表彰のために使ったデータや計算が正しいものであると保証するものでもありません。マーサーはこのアワードを受けた運用会社について何の保証をするものでも責任を持つわけではありません。過去の実績は将来のリターンを保証するものではありません。詳細については、マーサーのホームページをご覧ください。

<https://www.mercer.com/ja-jp/>

<野村アセットマネジメントからのお知らせ>

■投資顧問サービス(投資助言業および投資運用業)に係るリスク・費用

【投資顧問サービスに係るリスクについて】

お客様のために行なう金融商品取引行為については、株式、新株予約権付社債、公社債等に投資します(投資信託・リミテッドパートナーシップ等を通じて投資する場合を含みます)ので、国内外の経済・政治情勢、金利変動、発行体の業績や財務状況の変化等の影響により、投資する株式、通貨等の価格が下落し、損失が生ずるおそれがあります。

また、当商品ではデリバティブ取引を使用することがあります。同取引は証拠金の金額以上のレバレッジを活用して行なうことから、原資産となる有価証券や指数等の変動によって価格も変動し、差し入れた証拠金を上回る損失が生じる可能性があります。またこのレバレッジの比率は投資方針や国内外の市場環境の変化等により、随時変わっていきますので事前に表示することができません。証拠金はデリバティブ取引を行なう期間、発注先証券会社の計算に基づき当社が妥当であると判断した金額を契約資産から預託いたします。

【投資顧問サービスに係る費用について】

当資料は、直接的な勧誘を目的としたものではありません。将来的に運用商品を提供した場合、以下の諸費用が発生します。一般的な計算方法の概要は以下のとおりになりますが、お客様との契約内容によって料率は異なり、具体的な提示をすることはできません。

- 投資顧問サービスの対価として、一般に、契約資産額に対して予め定めた料率(a%)の投資顧問報酬が契約期間に応じたかかります。

計算方法: 契約資産額 × (a%) × 契約期間日数/365 = 該当期間の投資顧問報酬

- 投資一任契約内で、弊社の投資判断として投資信託を購入する場合があります。この場合は当該投資信託の購入にかかる費用(投資信託の運用報酬、及び販売会社・管理会社の費用の他、投資信託の換金に際し、信託財産留保額がかかる場合があります)が発生いたします。ただし、投資信託を購入する場合のうち、当該投資信託が当社並びに当社グループが設定するものである場合、運用報酬の重複を防ぐために上記の投資顧問

報酬の調整を行います。調整の計算方法は個別の契約で別途定めますが、投資顧問報酬金額から当該投資信託に係る運用報酬金額を控除することにより調整をいたします。

- お客様との取り決めにより投資顧問報酬を成功報酬とする場合があります(また、上記との組み合わせとする場合もあります)。なお、成功報酬については、予め定めた基準等にもとづき実際の運用実績等に応じて投資顧問報酬が変動するほか、お客様と別途協議により取り決めさせていただくことから、事前に計算方法、上限額等を示すことができません。
- 投資顧問報酬とは別に、有価証券売買委託手数料や、有価証券の保管等に係る諸費用が費用として発生し、契約資産から控除されます。またこれらの費用は運用状況により変動するため事前に具体的な料率・上限額等を表示することができません。

■当資料について

当資料は、運用戦略に関する参考情報の提供を目的として野村アセットマネジメントが作成したものです。

当資料は信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。

当資料中の記載事項は、すべて当資料作成時以前のものであり、事前の連絡なしに変更されることがあります。

当資料中のいかなる内容も将来の運用成果または投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。

上記は過去の一定期間の実績が評価されたものであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

商 号：野村アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第373号

加入協会：一般社団法人投資信託協会／一般社団法人日本投資顧問業協会

／一般社団法人第二種金融商品取引業協会