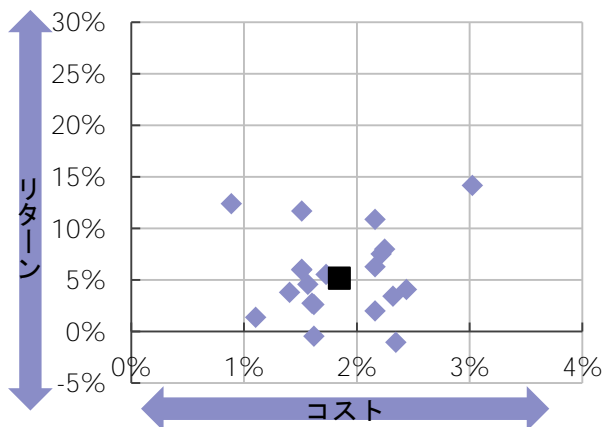


三菱UFJ信託銀行～比較可能な共通 KPI 取組状況(2018年9月末時点)～

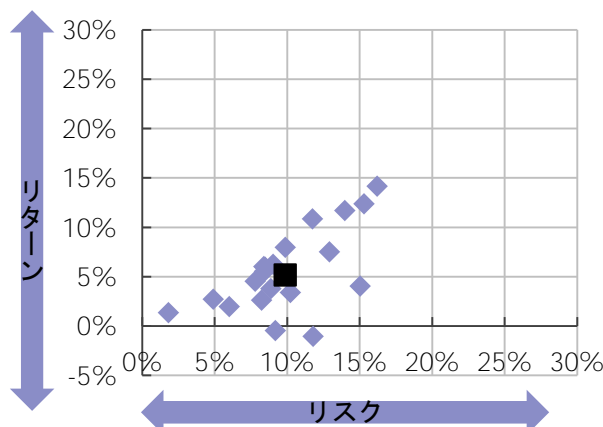
安定した運用成果の提供①

■ 設定期間5年を越える投資信託の残高上位20銘柄中、17銘柄でリターンがコストを上回っております。比較的安定的な値動きをする債券ファンドが残高上位の多くを占めております。

【図1】投資信託預かり残高上位20銘柄¹の
コスト・リターン²



【図2】投資信託預かり残高上位20銘柄¹の
リスク・リターン²



(注)1. 2018年9月末時点で、設定期間5年を越えるファンドのみに限った投資信託の預かり残高上位20銘柄

(注)2. コスト: 販売手数料率/5+信託報酬率、リスク: 過去5年間の月次リターンの標準偏差(年率換算)、
リターン: 過去5年間のトータルリターン(年率換算)

銘柄名	コスト	リスク	リターン
1 三菱UFJグローバル・ボンド・オープン(毎月決算型)	1.62%	8.25%	2.60%
2 フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	2.25%	9.88%	7.97%
3 ワールド・リート・オープン(毎月決算型)	2.21%	12.92%	7.52%
4 豪ドル毎月分配型ファンド	1.62%	9.20%	-0.47%
5 ニッセイJ-REITファンド(毎月決算型)	1.51%	8.41%	6.03%
6 トレンド・アロケーション・オープン	1.60%	4.91%	2.71%
7 優良日本株ファンド	1.51%	13.99%	11.68%
8 ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド(毎月決算型)	2.44%	15.05%	4.06%
9 三菱UFJ Jリートオープン(3ヵ月決算型)	1.51%	8.49%	5.97%
10 GSエマージング通貨債券ファンド	2.34%	11.79%	-1.05%
11 東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)	1.10%	1.82%	1.36%
12 三菱UFJインデックス225オープン	0.89%	15.32%	12.38%
13 ノムラ日米REITファンド(毎月決算型)	2.16%	11.76%	10.86%
14 UBS公益・金融社債ファンド(為替ヘッジなし)	1.57%	7.80%	4.54%
15 グローバル・ヘルスケア&バイオ・ファンド	3.02%	16.22%	14.17%
16 LM・米ドル毎月分配型ファンド	1.40%	8.88%	3.78%
17 三菱UFJバランスインカムオープン(毎月決算型)	1.73%	8.46%	5.52%
18 欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	2.32%	10.24%	3.41%
19 ビムコ・エマージング・ボンド・オープンBコース(為替ヘッジあり)	2.16%	6.02%	1.98%
20 ビムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	2.16%	9.04%	6.26%
残高加重平均(■)	1.84%	9.86%	5.17%
【ご参考】ファンドラップ安定収益追求コース ³	1.51%	2.61%	2.54%

(注)3. 三菱UFJ信託銀行で取扱っている投資一任運用商品(MUFGファンドラップ、資産運用口座)を掲載。MUFGファンドラップの公表数値は契約者数が最も多い「安定収益追求コース」とする。「金融庁 比較可能な共通な KPI」算出定義による算出が不可能であるため、以下算出定義に基づき算出

①リスク、リターン:

MUFGファンドラップは取扱いから5年未経過のため、安定収益追求コースと同様の手法で運用した場合のシミュレーションを使用。尚、当該リターンは以下の②コストを控除

②コスト: 以下をコストとして定義

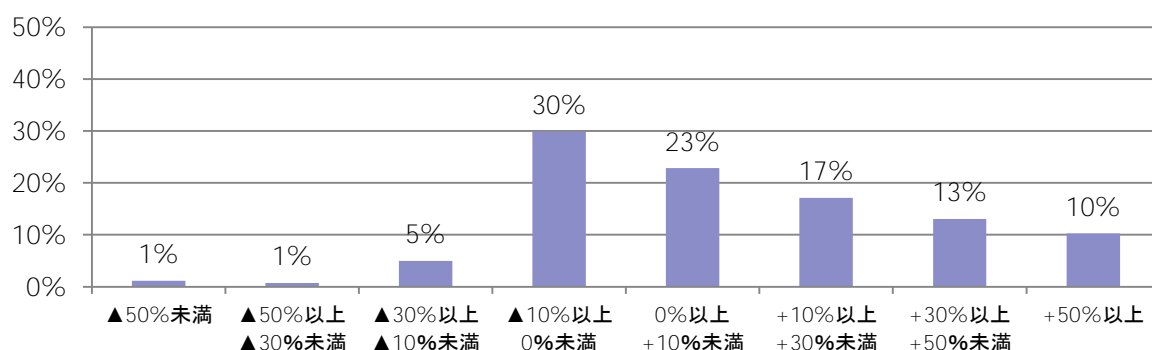
【信託報酬】シミュレーションをもとに、各資産の平均組み入れ比率を算出し、現在投資している投資信託の信託報酬を加重平均して算出

【投資一任報酬】固定報酬の最も高い料率とし、3年目以降は長期保有割引率70%を適用させ算出

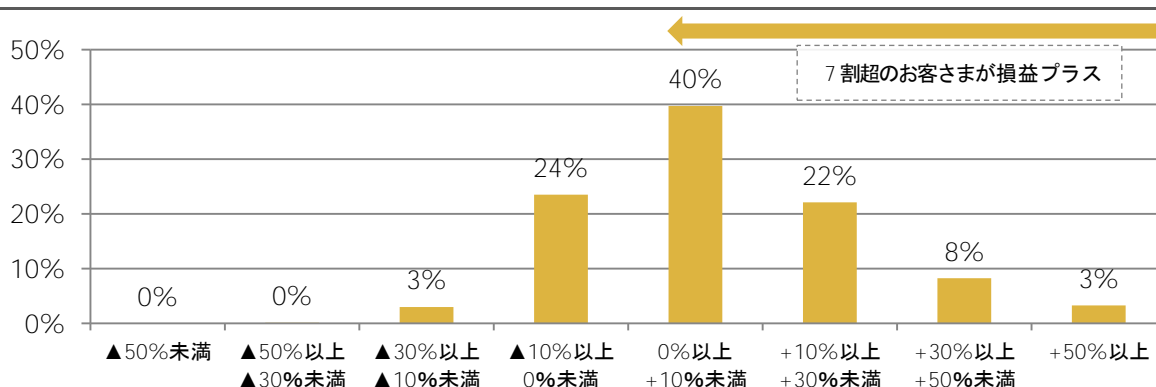
安定した運用成果の提供②

- 2018年9月末時点で投資信託をお持ちのお客さまの7割超が、過去の売却・償還済商品を含めた運用開始時からの累積損益状況がプラスとなっています。

【図3】投信運用損益別顧客比率⁴



【図4】実現損益を含む投信運用損益別顧客比率⁴



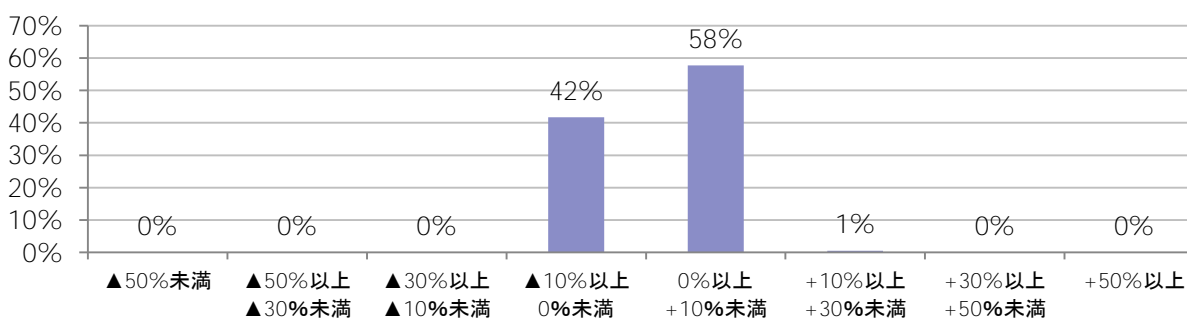
(注)4. 2018年9月末時点。運用損益別顧客比率計算上の分母は【図3】時価評価額、【図4】累積買付額。

【図4】2006年6月以降に売却または償還となった投資信託の実現損益が対象

安定した運用成果の提供③

- 相場変動時においても「守る投資」を継続した結果、実現運用損益がプラスのお客さまは全体の6割程度となっております

【図5】ファンドラップ運用損益別顧客比率⁵



(注)5.2018年9月末時点

①MUFG ファンドラップトータルリターン

【計算式】(1) 月次収益率 = $(1+r_1)(1+r_2)\cdots(1+r_n)-1$ ※ $r_1\sim r_n$: 各日次収益率

(2) 上記(1)を運用期間の月数分乗算

期間の収益率 $(1+R_1)(1+R_2)\cdots(1+R_N)-1$ ※ $R_1\sim R_N$: 各月次収益率

②資産運用口座トータルリターン

【計算式】基準日時価評価金額 ÷ 投資元本 ※投資元本: 一部出金、追加増額を考慮