

～ NPM関連データサービス ～

— 日本公募投信リターンデータ(日次) —

データ仕様書

※本資料は、「日本公募投信リターンデータ(日次)」の仕様書です。提供する各種加工データは、信頼できると思われるデータソースから十分な注意を払い、加工・作成しておりますが、その完全性・正確性を保証するものではありません。また、本情報の利用によって生じた直接的又は間接的な損害については、その内容、態様の如何を問わず、弊社はその一切の責任を負うものではありません。

2021年11月

株式会社金融データソリューションズ

～ NPM関連データサービス ～

日本公募投信リターンデータ (日次)

株式会社金融データソリューションズ

本資料は、NPM 関連データサービス「日本公募投信リターンデータ(日次)」に収録されるデータ項目の一覧になります。

本サービスでは、日本の公募投信に関する、以下 3 種類のデータをご提供します。

- 1、日本公募投信 日次リターンデータ
- 2、日本公募投信 ファンド情報データ
- 3、日本公募投信 取扱販売会社データ

本データの仕様作成ならびに本データの出所は「エム・ピー・アイ・ジャパン株式会社」となります。

1、日本公募投信 日次リターンデータ**ご提供データの概要**

信託報酬控除後・税引前分配金再投資の追加型日本公募投資信託（単位型は除く）の収益率（リターン）、基準価額、純資産総額、分配金などの日次データを、ファンドの各種属性とともに収録し、Excel シートと CSV ファイルの 2 通りにてご提供します。

対象ファンド総数は、およそ 11,300 本（既に償還されたおよそ 5,600 本を含む）となります。ETF（上場投資信託）につきましては、日本籍の ETF が収録対象となります。

ご提供ファイル 1、「日本公募投信 日次リターンデータ(yyyyymmdd-yyyyymmdd).xlsx」

- ※ ファイル名の()内の yyyyymmdd-yyyyymmdd は、収録期間の FROM 日付-TO 日付を表します。原則として、半年ごと(1～6 月、7 月～12 月)に分割して、Excel ファイルを作成しています。
- ※ Excel は、Excel2007 のファイル形式です。

2、「日本公募投信 日次リターンデータ カンマ区切り全データ.csv」

- ※ 全公募投信、全期間のデータを 1 つのファイルにカンマ区切りで格納したものです。
- ※ 次ページに示す「データフォーマット」の項目の順で収録されています。

収録期間 1997 年 4 月 1 日 ～ 2021 年 10 月 29 日 (日次)

ご提供形態 50 個の Excel ファイル（データ期間別）と 1 個の CSV ファイルをご提供

データ出所 エム・ピー・アイ・ジャパン株式会社

ご留意点

- (1) 2009 年 12 月以前に償還したファンドの「ISIN コード」「商品分類」「属性区分」及び「協会分類」は NA（欠損値）となります。
- (2) 日次の「収益率」は、すべて分配金込みのリターンとなります。
- (3) 「分配金」は日本の証券休日に支払われるケースがあり、その場合、土日祝日のレコードが発生します。このとき、当該休日の「収益率」は欠損値となり、翌営業日の「収益

率」に、休日に支払われた「分配金」を考慮したリターンが収録されます。

- (4) 「基準価額」は、各運用会社が、信託報酬およびファンドに係る必要経費を日々控除して算出したデータ（これを投資信託協会が各運用会社から集約したもの）を収録しております（決算日などでの信託報酬一括控除などは行っておりません）。「収益率」もこの「基準価額」を使用して算出されます。

データフォーマット（CSV ファイルでは、①「投信協会コード」→②「年月日」の順でソート済）

データ名称	データ長	単位	備考
1 年月日	8		yyyymmdd の形式、CSV ファイルの第 2KEY
2 投信協会コード	8		8 桁コード、CSV ファイルの第 1KEY
3 ISIN コード	12		12 桁コード
4 ファンド名	110 (55 文字)		
5 運用会社名	60 (30 文字)		
6 収益率	可変長	[%]	信託報酬控除後、税引前分配金再投資
7 基準価額	(同上)	[円]	信託報酬控除後、税引前分配金再投資
8 純資産総額	(同上)	[百万円]	
9 設定額	(同上)	[百万円]	
10 解約額	(同上)	[百万円]	
11 分配金	(同上)	[円]	
12 協会大分類	40 (20 文字)		
13 協会小分類	(同上)		
14 投資対象地域	(同上)		商品分類 (国内/海外/内外)
15 投資対象資産分類	(同上)		商品分類 (株式/債券/不動産投信/その他資産/資産複合)
16 補足分類	(同上)		商品分類 (インデックス型/特殊型)
17 株式属性	(同上)		属性区分 (一般/大型/中小型株)
18 債券属性 1	(同上)		属性区分 (一般/国債/社債)
19 債券属性 2	(同上)		属性区分 (格付等クレジットによる属性)
20 資産複合属性	(同上)		属性区分 (資産配分固定型/資産配分変更型)
21 投資対象地域属性 1	(同上)		属性区分 (投資対象地域: グローバル)
22 投資対象地域属性 2	(同上)		属性区分 (投資対象地域: 日本)
23 投資対象地域属性 3	(同上)		属性区分 (投資対象地域: 北米)
24 投資対象地域属性 4	(同上)		属性区分 (投資対象地域: 欧州)
25 投資対象地域属性 5	(同上)		属性区分 (投資対象地域: アジア)
26 投資対象地域属性 6	(同上)		属性区分 (投資対象地域: オセアニア)
27 投資対象地域属性 7	(同上)		属性区分 (投資対象地域: 中南米)
28 投資対象地域属性 8	(同上)		属性区分 (投資対象地域: アフリカ)
29 投資対象地域属性 9	(同上)		属性区分 (投資対象地域: 中近東)
30 投資対象地域属性 10	(同上)		属性区分 (投資対象地域: エマージング)
31 投資形態属性	(同上)		属性区分 (ファミリーファンド/ファンド・オブ・ファンズ)
32 為替ヘッジ属性	(同上)		属性区分 (為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)
33 インデックス属性	(同上)		属性区分 (日経 225/TOPIX/その他)
34 特殊型属性	(同上)		属性区分 (ブル・ベア型/条件付運用型/ロング・ショート型/ 絶対収益追求型/その他型)

2、日本公募投信 ファンド情報データ

ご提供データの概要

追加型日本公募投資信託（単位型は除く）の信託報酬、購入時手数料を含むファンド情報データを、ファンド別に収録し、Excelシートにてご提供します。

対象ファンド総数は、およそ 11,300 本（既に償還されたおよそ 5,600 本を含む）となります。ETF（上場投資信託）につきましては、日本籍の ETF が収録対象となります。

ご提供ファイル 「日本公募投信 ファンド情報データ.xlsx」（Excel2007 のファイル形式）

収録基準日 2021 年 10 月 29 日

ご提供形態 Excel ファイル 1 個に収録してご提供

データ出所 エム・ピー・アイ・ジャパン株式会社

ご留意点

- (1) 2009 年 12 月以前に償還したファンドの「信託報酬」「信託報酬(委託)」「信託報酬(証券)」「信託報酬(受託)」及び「決算頻度」は空白（未収録）となります
- (2) 2013 年 5 月以前に償還したファンドの「購入時手数料」は空白（未収録）となります。
- (3) 「確定拠出年金」の項目は、一般向けと確定拠出年金向けが共用となっているファンドに関しては、その旨の情報がほとんど無く、明確な区別が困難な場合があります。共用が認められるファンドは「確定拠出年金」=1（一般・確定拠出年金共用）に区分しておりますが、「確定拠出年金」=0（一般）との区別は明確にはなっておりません。一方で、確定拠出年金専用ファンド（「確定拠出年金」=2）は明確に区分されます。

データフォーマット

	データ名称	データ長	単位	備 考
1	投信協会コード	8		8 桁コード
2	ファンド名	110 (55 文字)		
3	信託報酬	可変長	[%]	税抜
4	信託報酬(委託)	(同上)	[%]	税抜
5	信託報酬(証券)	(同上)	[%]	税抜
6	信託報酬(受託)	(同上)	[%]	税抜
7	購入時手数料	(同上)	[%]	上限・税抜
8	株式比率	(同上)	[%]	
9	債券比率	(同上)	[%]	
10	設定日	8		yyyymmdd の形式
11	当初設定額	可変長	[百万円]	
12	決算頻度	40 (20 文字)		
13	運用中	1		Y:運用中、N:償還
14	確定拠出年金	1		0:一般、1:一般・確定拠出年金共用、2:確定拠出年金専用
15	ETFのFDS会社コード	7		ETFについてのFDS会社コード(7桁コード)
16	ETFの証券コード	4		ETFについての証券コード(4桁コード)

3、日本公募投信 取扱販売会社データ

ご提供データの概要

追加型日本公募投資信託（単位型、上場投信、SMA ファンドは除く）の取扱販売会社のデータを、Excel シートにてご提供します。

対象ファンド総数は、およそ 4,900 本となります。

ご提供ファイル「日本公募投信 取扱販売会社データ.xlsx」（Excel2007 のファイル形式）

収録基準日 2021 年 10 月 29 日

ご提供形態 Excel ファイル 1 個に収録してご提供

データ出所 エム・ピー・アイ・ジャパン株式会社

データフォーマット

	データ名称	データ長	単位	備考
1	投信協会コード	8		8 桁コード
2	ファンド名	110 (55 文字)		
3	販売会社名	110 (55 文字)		
4	販売会社区分 1	60 (30 文字)		銀行、証券会社、保険会社、等
5	販売会社区分 2	60 (30 文字)		販売会社区分 1 を分類(都市銀行、地方銀行、等)

【ご利用上のご注意】

- 2015 年 7 月 1 日、三菱 UFJ 投信株式会社 と 国際投信投資顧問株式会社 が合併し、「三菱 UFJ 国際投信株式会社」となりましたが、このとき、旧国際投信投資顧問株式会社の運用ファンドの投信協会コードが新しい投信協会コードに変更されました。「日本公募投信リターンデータ(日次)」(本サービス)では、旧協会コードと旧運用会社名(国際投信投資顧問)は、過去に遡って新協会コードと新運用会社名(三菱 UFJ 国際投信)ですべて上書きされていますので、この点ご注意ください。
- 2016 年 10 月 1 日、DIAM アセットマネジメント、みずほ信託銀行の資産運用部門、みずほ投信投資顧問、及び新光投信が合併し、「アセットマネジメント One 株式会社」となりましたが、このとき、旧みずほ投信投資顧問と旧新光投信の運用ファンドの投信協会コードが新しい投信協会コードに変更されました。「日本公募投信リターンデータ(日次)」では、旧投信協会コードと旧運用会社名(みずほ投信投資顧問と新光投信)は、過去に遡って新投信協会コードと新運用会社名(アセットマネジメント One)ですべて上書きされていますので、この点ご注意ください。
- 2019 年 4 月 1 日、三井住友アセットマネジメントと大和住銀投信投資顧問が合併し、「三井住友DSアセットマネジメント」となりましたが、このとき、旧大和住銀投信投資顧問の運用ファンドの投信協会コードが新しい投信協会コードに変更されました。「日本公募投信リターンデータ(日次)」では、旧投信協会コードと旧運用会社名(大和住銀投信投資顧問)は、過去に遡って新投信協会コードと新運用会社名(三井住友DSアセットマネジメント)ですべて上書きされていますので、この点ご注意ください。

「日本公募投信リターンデータ(日次)」

- 2021年4月1日、レグ・メイソン・アセット・マネジメントとフランクリン・templton・インベストメンツが合併し、「フランクリン・templton・ジャパン」となりましたが、このとき、旧フランクリン・templton・インベストメンツの運用ファンドの投信協会コードが新しい投信協会コードに変更されました。「日本公募投信リターンデータ(日次)」では、旧投信協会コードと旧運用会社名(フランクリン・templton・インベストメンツ)は、過去に遡って新投信協会コードと新運用会社名(フランクリン・templton・ジャパン)ですべて上書きされていますので、この点ご注意ください。
- 具体的な投信協会コードの新旧対応に関しましては、上記の合併に拠る場合のほか、ファンドの移管に伴うコード変更も含め、「合併・ファンド移管に伴う新旧協会コード対比表.xls」をご参照ください。

以上。