



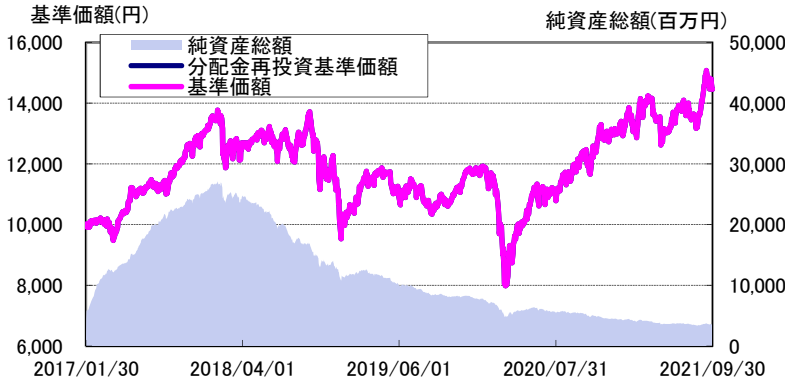
ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド

<愛称：B・D・F>

追加型投信／国内／株式
2021年9月30日基準

運用実績

運用実績の推移



(設定日:2017年1月31日)

基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。なお、信託報酬率は「ファンドの費用」をご覧ください。

分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。

分配金再投資基準価額＝前日分配金再投資基準価額×(当日基準価額÷前日基準価額)

(※決算日の当日基準価額は税引前分配金込み)

基準価額は設定日前日を10,000円として計算しています。

上記は過去の実績であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。

基準価額・純資産総額

基準価額	14,456 円
純資産総額	3,502 百万円

※ 基準価額は1万口当たり

ポートフォリオ構成

株式現物	96.06%
東証1部	82.19%
東証2部	1.24%
地方市場	0.00%
ジャスダック	0.31%
その他新興市場	12.32%
現金等	3.94%
合計	100.00%
株式先物	0.00%
株式実質組入(株式現物+株式先物)	96.06%

※ 組入比率は純資産総額に対する割合です。

騰落率(税引前分配金再投資)

1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	2年	3年
3.50%	3.77%	3.87%	20.63%	34.09%	5.78%

※1 騰落率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出していますので、実際の投資家利回りとは異なります。

※2 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。

※3 各期間は、基準日から過去に遡っています。

分配金実績(税引前) ※直近3年分

第2期(2019.01.22)	0 円
第3期(2020.01.22)	0 円
第4期(2021.01.22)	0 円
設定来累計分配金	0 円

※1 分配金は1万口当たり

※2 左記の分配金は過去の実績であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※3 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

組入上位10業種

No.	業種	組入比率(%)
1	情報・通信業	33.14
2	サービス業	11.84
3	精密機器	9.45
4	電気機器	8.21
5	化学	6.49
6	医薬品	5.47
7	小売業	4.02
8	その他製品	3.99
9	電気・ガス業	2.49
10	証券、商品先物取引業	2.37

※1 組入比率は純資産総額に対する割合です。

※2 業種は東証33業種分類によるものです。

※当資料中の各数値については、表示桁未満の数値がある場合、四捨五入して表示しています。

組入上位10投資テーマ

No.	投資テーマ	組入比率(%)
1	高齢者関連ビジネス	18.54
2	環境規制	11.22
3	エンターテインメント	10.89
4	消費回復	9.49
5	ガバナンス	7.13
6	フィンテック(金融テクノロジー)	7.11
7	最先端医療・バイオテック	5.69
8	働き方改革	5.51
9	AI・ビッグデータ	4.07
10	AR(拡張現実)・VR(仮想現実)	3.85

※ 組入比率は組入株式時価総額に対する割合です。

※ 当資料は5枚ものです。

※ P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。



アセットマネジメントOne



ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド

<愛称：B・D・F>

2021年9月30日基準

組入上位10銘柄

組入銘柄数： 67

No.	銘柄	投資テーマ	組入比率(%)
1	エムアップホールディングス	エンターテインメント	9.73
2	ノーリツ鋼機	高齢者関連ビジネス	7.49
3	そーせいグループ	最先端医療・バイオテック	3.81
4	エフピコ	環境規制	3.43
5	JMDC	高齢者関連ビジネス	2.90
6	パンダイナムコホールディングス	AR(拡張現実)・VR(仮想現実)	2.64
7	イーレックス	環境規制	2.49
8	電通国際情報サービス	ガバナンス	2.41
9	SBIホールディングス	フィンテック(金融テクノロジー)	2.37
10	フクシマガリレイ	環境規制	2.26

※ 組入比率は純資産総額に対する割合です。

マーケット動向と当ファンドの動き

9月の国内株式市場は上昇しました(TOPIX:+3.54%、日経平均株価:+4.85%)。

上旬は大幅に上昇しました。菅首相が自民党総裁選への不出馬を表明したことを受けて政局不安が後退し、新政権の政策に対する期待が高まったことから、米国株に対して出遅れていた日本株を買い戻す動きが強まりました。中旬から下旬にかけては不安定な動きとなりました。新型コロナウイルス感染者数の減少やワクチン接種率の上昇を背景に経済活動制限の緩和に向けた期待が高まり、TOPIXは約31年ぶりの高値を付けましたが、その後、中国の不動産大手「中国恒大集団」のデフォルト(債務不履行)懸念が台頭したことを受け、利益確定売りが優勢となりました。月末にかけては下落しました。FOMC(米連邦公開市場委員会)がタカ派的と受け止められ、米金融政策が引き締め方向となることに対し警戒感が高まったことや、インフレ懸念を背景に米金利が急上昇したことが嫌気され、株式市場では成長株を中心に調整色が強まる展開となりました。

当月末の基準価額は前月末比で上昇しました。エムアップホールディングス(情報・通信業)、ノーリツ鋼機(精密機器)などの保有がプラス寄与しました。

ビッグデータ解析により、個人消費の回復に期待しています。モノやサービスを提供する会社だけではなく、ITの分野でこれらをサポートする会社として、「プラスアルファ・コンサルティング」や「全研本社」を組入れています。

今後のマーケットの見通しと運用方針

今後の国内株式市場は、年末にかけて堅調な相場展開を基本シナリオとして予想しますが、リスク要因として中国経済の動向を注視していく必要があるとみています。国内では、岸田新政権による経済対策への期待のほか、緊急事態宣言の解除を受けて徐々に経済正常化が進み、旅行や飲食などを中心に個人消費の回復が見込まれる局面となります。また、新型コロナウイルスの治療薬の開発進展も引き続き期待されます。一方で、中国経済の減速リスクが高まってきていると考えます。中国恒大集団のデフォルト懸念が燃り続けるほか、電力不足問題の影響で現地生産拠点には減産やコスト増加などの悪影響が出る想定され、株式市場にとって波乱要因となる可能性が懸念されます。

運用方針ですが、ビッグデータ解析により抽出されたキーワードをもとに投資テーマを策定し、投資テーマに関連する銘柄の組入れを進めていきます。個別銘柄の選定の際には、収益性、資産価値、配当の観点から割高な銘柄の組入れを極力抑えつつ、投資テーマに関連の深い銘柄を選定します。

※上記のマーケット動向と当ファンドの動きは、過去の実績であり将来の運用成果等をお約束するものではありません。また、見通しと運用方針は、作成時点のものであり、将来の市場環境の変動等により当該運用方針が変更される場合があります。

※ 当資料は5枚ものです。

※ P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。



アセットマネジメントOne



ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド

<愛称：B・D・F>

2021年9月30日基準

ファンドの特色(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

- 主として、わが国の中小型株式に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目的として、積極的な運用を行います。
 - ビッグデータ^(*)の活用による投資テーマ選定とボトムアップアプローチによる銘柄選択を組み合わせ、ポートフォリオを構築します。
(*)一般的には、従来のシステムでは処理することが困難な膨大・複雑なデータ群を指します。なお、当ファンドでは、ビッグデータのうち、新聞やインターネット上の企業関連のニュースといった文字データを主に活用し、投資テーマ群の形成を行います。
 - 運用にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の助言を活用します。
- ※ 資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資リスクと費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

なお、基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。その他の留意点など、くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

- 株価変動リスク…………… 当ファンドは、株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。また、中小型株式は株式市場全体の動きと比較して株価が大きく変動する場合があります。当ファンドの基準価額に影響を与える可能性があります。なお、当ファンドでは業種配分等にとらわれず投資テーマ・銘柄を選定するため、株式市場全体の値動きと基準価額の値動きは大きく異なることがあります。
- 個別銘柄選択リスク…………… 当ファンドは、個別銘柄の選択による投資を行いますので、株式市場全体の動向から乖離することがあり、株式市場が上昇する場合でも当ファンドの基準価額は下がる場合があります。
- 流動性リスク…………… 当ファンドにおいて有価証券等を売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることもあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。
- 信用リスク…………… 当ファンドが投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

当ファンドへの投資に伴う主な費用は購入時手数料、信託報酬などです。
費用の詳細につきましては、当資料中の「ファンドの費用」および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

※ 当資料は5枚ものです。
※ P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。



ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド

<愛称：B・D・F>

2021年9月30日基準

お申込みメモ(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)	
購入単位	販売会社が定める単位(当初元本1口=1円)
購入価額	購入申込受付日の基準価額(基準価額は1万口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時までに販売会社が受付けたものを当日分のお申込みとします。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	2027年1月22日まで(2017年1月31日設定)
繰上償還	次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することができます。 ・信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合 ・受益権口数が10億口を下回ることとなった場合 ・やむを得ない事情が発生した場合
決算日	毎年1月22日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。 ※お申込コースには、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。詳細は販売会社までお問い合わせください。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 原則として、分配時の普通分配金ならびに換金時の値上がり益および償還時の償還差益に対して課税されます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA(ジュニアニーサ)」の適用対象です。 ※税法が改正された場合等には、上記内容が変更となる場合があります。

ファンドの費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)	
以下の手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。 ※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となる場合があります。	
●投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	購入価額に、 3.3%(税抜3.0%) を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額となります。
換金手数料	ありません。
信託財産留保額	換金申込受付日の基準価額に 0.3% の率を乗じて得た額を、換金時にご負担いただきます。
●投資者が信託財産で間接的に負担する費用	
運用管理費用(信託報酬)	ファンドの日々の純資産総額に対して 年率1.694%(税抜1.54%)
その他の費用・手数料	その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。 ・組入価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等 ※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

※ 当資料は5枚ものです。
※ P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。



アセットマネジメントOne



ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド

＜愛称：B・D・F＞

2021年9月30日基準

投資信託ご購入の注意

投資信託は、

- ① 預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ② 購入金額については元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ③ 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

当資料のお取扱いについてのご注意

- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成した販売用資料です。
- お申込みに際しては、販売会社からお渡しする投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認ください。
- 当ファンドは、株式等の値動きのある有価証券に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。
- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データは過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 当資料における内容は作成時点(2021年10月11日)のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

◆収益分配金に関する留意事項◆

- 収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
- 分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

◆委託会社およびファンドの関係法人◆

＜委託会社＞アセットマネジメントOne株式会社
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第324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
 ＜受託会社＞みずほ信託銀行株式会社
 ＜販売会社＞販売会社一覧をご覧ください

◆委託会社の照会先◆

アセットマネジメントOne株式会社
 コールセンター 0120-104-694
 (受付時間: 営業日の午前9時～午後5時)
 ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

販売会社(お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください)

○印は協会への加入を意味します。

2021年10月11日現在

商号	登録番号等	日本証券業協会	一般社団法人日本投資顧問業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会	備考
アイザワ証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第3283号	○	○			
池田泉州TT証券株式会社	金融商品取引業者 近畿財務局長(金商)第370号	○				
永和証券株式会社	金融商品取引業者 近畿財務局長(金商)第5号	○				
株式会社SBI証券	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第44号	○		○	○	
岡三オンライン証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第52号	○	○	○		
島大証券株式会社	金融商品取引業者 北陸財務局長(金商)第6号	○				
楽天証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○	
東海東京証券株式会社	金融商品取引業者 東海財務局長(金商)第140号	○		○	○	
東洋証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第121号	○			○	
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	○	

●その他にもお取扱いを行っている販売会社があります。

また、上記の販売会社は今後変更となる場合がありますため、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

＜備考欄について＞

※1 新規募集の取扱いおよび販売業務を行っておりません。

※2 備考欄に記載されている日付からのお取扱いとなりますのでご注意ください。

※3 備考欄に記載されている日付からお取扱いを行いませんのでご注意ください。

(原則、金融機関コード順)

※ 当資料は5枚ものです。



アセットマネジメントOne