

2017年10月13日

## 資産運用イノベーションへの取組み強化（AI・ビッグデータ活用） - 「フィナンシャル・イノベーション・チーム」の設置 -

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 西恵正、以下「AM-One」）は、資産運用の高度化と運用プロセスの向上を目的とした専門組織「フィナンシャル・イノベーション・チーム（以下「FIT」）」を2017年10月1日付で新設しました。

AM-Oneは2014年にイノベーションタスクフォースを結成、2017年4月からは「AIタスクフォース」を発足し、AI及びビッグデータに関する知見・技術の蓄積と $\alpha$ （アルファ）創出能力の向上に取り組んできました。当テクノロジーの資産運用分野への有効性が認められたことから、本取り組みの加速度的強化を企図し、FITを組織化することとなりました。多様化する投資家のニーズに対応するため、高い競争力を持つ商品の開発ならびに提供のためにデータ分析インフラの構築やAI・ビッグデータを活用したファンドの開発・組成を行います。

FITは、長期のクオンツ運用実績・多様な運用商品を持つ「運用本部運用ソリューショングループ」に属し、当グループの運用残高は約4兆円を誇ります。<sup>1</sup>開発した各種技術により、クオンツ運用の高度化への活用やファンドマネジャー・アナリストとの高次元での融合による $\alpha$ 創出能力の向上等、AM-Oneが機関投資家ならびに個人投資家にとって、より高度な運用サービスを提供できるよう貢献していきます。なお、FITでは、みずほグループとの連携により相乗効果を発揮するとともに、大学やベンチャー企業等との共同研究による最先端技術の獲得も視野に入れていきます。

AM-Oneでは1990年代の株価や財務の構造化データを用いたクオンツアクティブ運用を皮切りに、2000年代には価格下落に対する守りを備えた「リスク制御手法」を開発、2010年代には、マルチアセット運用を展開してきました。そして2015年からはAI活用に向けた機械学習の技術や非構造化データマイニング技術の研究に注力、その成果を活用して個人投資家向けに「ビッグデータ日本株ファンド（愛称「B・D・F」）」や「AI（人工知能）活用型世界株ファンド（愛称：ディープAI）」といった公募投資信託を組成しています。<sup>2</sup>

AM-Oneはこれからも、業界のリーディングカンパニーとして機関投資家ならびに個人投資家の長期的な資産運用に資する商品の開発のために努力してまいります。

1. 2017年9月末時点。2. 2016年10月以前の実績は統合各社における実績。

以上

## 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

【ファンドの費用】 購入時手数料: 上限3.24% (税込) ■換金手数料: なし ■信託財産留保額: 0.3%  
運用管理費用 (信託報酬): 年率1.6632% (税込) ■その他費用・手数料: 売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用等

【ファンドの投資リスク】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。基準価額の変動要因は、次に限定されるものではありません。株価変動リスク、個別銘柄選択リスク、流動性リスク、信用リスク。当ファンドは株式などの値動きのある有価証券等に投資します。このため、ファンドは株式市場の変動、個別銘柄の選択による投資を行うことによる株式市場全体の動向からの乖離、市場に十分な需要や供給がないため取引を行えないまたは取引が不可能となること、組入有価証券等の発行者にかかる信用状況の変化等の影響により、組入れた有価証券等の価値が下落し、基準価額が下落することがあります。これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、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。また、投資信託は預貯金と異なります。

## AI(人工知能)活用型世界株ファンド(愛称: ディープAI) 追加型投信 / 海外 / 株式

【ファンドの費用】 購入時手数料: 上限3.24% (税込) ■換金手数料: なし ■信託財産留保額: 0.3% ■  
運用管理費用 (信託報酬): 年率1.5552% (税込) ■その他費用・手数料: 売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用等

【ファンドの投資リスク】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。基準価額の変動要因は、次に限定されるものではありません。株価変動リスク、為替変動リスク、リートの価格変動リスク、信用リスク、流動性リスク、カントリーリスク。当ファンドは株式やリートなどの値動きのある有価証券等に投資します。このため、ファンドは株式・リート市場の変動、不動産等の価値や賃貸収入等の変動、為替相場の変動、組入有価証券等の発行者にかかる信用状況の変化、市場に十分な需要や供給がないため取引を行えないまたは取引が不可能となること、投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等の影響により、組入れた有価証券等の価値が下落し、基準価額が下落することがあります。これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、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。また、投資信託は預貯金と異なります。

当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。お申込に際しては、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のうえ、ご自身でご判断ください。当ファンドは、株式やリート等の値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります)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(2017年10月12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。

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ではありません。2. 購入金額について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。

## 【アセットマネジメント One について】

アセットマネジメントOne株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約54兆円とアジアトップクラスの規模を誇ります。

統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。

HP : <http://www.am-one.co.jp/>

運用資産残高は2017年6月末時点。

商号等 / 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