

資産運用イノベーションへの取組みを強化

アセットマネジメントOne（以下、当社）は、AI・ビッグデータを活用した資産運用の高度化・運用プロセスの向上を目的として、「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日付けで設置いたしました。

当社の強みであるクオンツ運用の高度化に向け、大学やベンチャー企業等との共同研究も視野に入れています。

運用技術の開発と融合

FITは、社内外から専門家を集め、データ分析インフラ構築やAI・ビッグデータを活用したクオンツ運用の高度化を目指します。

また、開発したビッグデータ分析技術やAIによる分析を、ファンドマネジャーやアナリストが用いることで、より高度な投資判断を行う手助けをします。

<ご参考> 当社のクオンツ運用の歩み

1990年代	株価や構造化データを用いたクオンツアクティブ運用を開始
2000年代	価格下落に対する守りを備えた「リスク制御手法」の開発
2010年代	マルチアセット運用の展開
2015年 より	<ul style="list-style-type: none"> AIの活用に向けた機械学習技術・非構造化データマイニング技術の研究を開始 研究結果をもとに公募投資信託を設定

※2016年10月以前の実績は統合各社における実績。

※上記は、過去の時点での情報または見解であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

※巻末の投資信託に係るリスクと費用およびご注意事項を必ずお読みください。

※右記は日本経済新聞社承諾を得て転載したものであり、アセットマネジメントOneの見解ではありません。

国内大手運用会社人が「運用手法の開発を加速す
工知能(AI)を活用した。アセットマネジメン
トOneは社内外から専
門家を集めた新組織を作
り、ヒトのファンドマネ
ジャーの投資判断を手助
けするシステムなどを作
成する。大和証券投資信
託委託も株価予測などを
手がける大学研究者を招
く。人材や開発環境の面
で欧米勢から大きく後れ
をとっており、外部の力
を借りながら巻き返す。
アセットマネジメントOneはAI
やビッグデータを駆使し
た運用手法を開発するた
めのチームを設けた。大
量データの解析にたけた
「データサイエンティス
ト」と呼ばれる人材を社
外から採用するなどして
まずは10人体制にする。
開発テーマには、コン
ピューター運用の強化に
加え、ファンドマネジャ
ーとAIの「協業」を挙
げる。AIに海外アナリ
ストリポートを大量に読
み込ませ、投資対象であ
る企業に対する各社の評
価の微妙な変化を察知さ
せる。これを人間の運用
者に提供し、投資判断に
役立ててもらおう。
大和投信は茨城大学の
鈴木智也教授を特任主席
研究員として招いた。A
Iを用いた株価変動予測
の仕組みを研究しており
国際テクニカルアナリス
ト連盟内で受賞歴もあ
る。今後は国内の運用会
社でも外部人材の獲得競
争が激しくなりそうだ。

AI運用の開発加速

アセットマネジメントOneなど 専門家集める

国内大手運用会社人が「運用手法の開発を加速す
工知能(AI)を活用した。アセットマネジメン
トOneは社内外から専
門家を集めた新組織を作
り、ヒトのファンドマネ
ジャーの投資判断を手助
けするシステムなどを作
成する。大和証券投資信
託委託も株価予測などを
手がける大学研究者を招
く。人材や開発環境の面
で欧米勢から大きく後れ
をとっており、外部の力
を借りながら巻き返す。
アセットマネジメントOneはAI
やビッグデータを駆使し
た運用手法を開発するた
めのチームを設けた。大
量データの解析にたけた
「データサイエンティス
ト」と呼ばれる人材を社
外から採用するなどして
まずは10人体制にする。
開発テーマには、コン
ピューター運用の強化に
加え、ファンドマネジャ
ーとAIの「協業」を挙
げる。AIに海外アナリ
ストリポートを大量に読
み込ませ、投資対象であ
る企業に対する各社の評
価の微妙な変化を察知さ
せる。これを人間の運用
者に提供し、投資判断に
役立ててもらおう。
大和投信は茨城大学の
鈴木智也教授を特任主席
研究員として招いた。A
Iを用いた株価変動予測
の仕組みを研究しており
国際テクニカルアナリス
ト連盟内で受賞歴もあ
る。今後は国内の運用会
社でも外部人材の獲得競
争が激しくなりそうだ。

出所：2017年10月13日、日本経済新聞朝刊 7面 許諾番号：30058507

投資信託に係るリスクと費用およびご注意事項

【投資信託に係るリスクと費用】

● 投資信託に係るリスクについて

投資信託は、株式、債券および不動産投資信託証券（リート）などの値動きのある有価証券等（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すべ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。

● 投資信託に係る費用について

[ご投資いただくお客さまには以下の費用をご負担いただきます。]

■ お客さまが直接的に負担する費用

購入時手数料：上限3.78%（税込）

換金時手数料：換金の価額の水準等により変動する場合がありますため、あらかじめ上限の料率等を示すことができません。

信託財産留保額：上限0.5%

■ お客さま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）：上限年率2.6824%（税込）

※ 上記は基本的な料率の状況を示したものであり、成功報酬制を採用するファンドについては、成功報酬額の加算によってご負担いただく費用が上記の上限を超過する場合があります。成功報酬額は基準価額の水準等により変動するため、あらかじめ上限の額等を示すことができません。

その他費用・手数料：上記以外に保有期間等に応じてご負担いただく費用があります。投資信託説明書（交付目論見書）等でご確認ください。その他費用・手数料については定期的に見直されるものや売買条件等により異なるため、あらかじめ当該費用（上限額等を含む）を表示することはできません。

※手数料等の合計額については、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はできません。

※上記に記載しているリスクや費用項目につきましては、一般的な投資信託を想定しております。費用の料率につきましては、アセットマネジメントOne株式会社が運用するすべての投資信託のうち、徴収するそれぞれの費用における最高の料率を記載しております。

※投資信託は、個別の投資信託ごとに投資対象資産の種類や投資制限、取引市場、投資対象国が異なることから、リスクの内容や性質、費用が異なります。投資信託をお申し込みの際は、販売会社から投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめ、または同時にお渡ししますので、必ずお受け取りになり、内容をよくお読みいただきご確認のうえ、お客さまご自身が投資に関してご判断ください。

※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。

【ご注意事項】

- 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。
- 当資料は、情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。
- 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。