



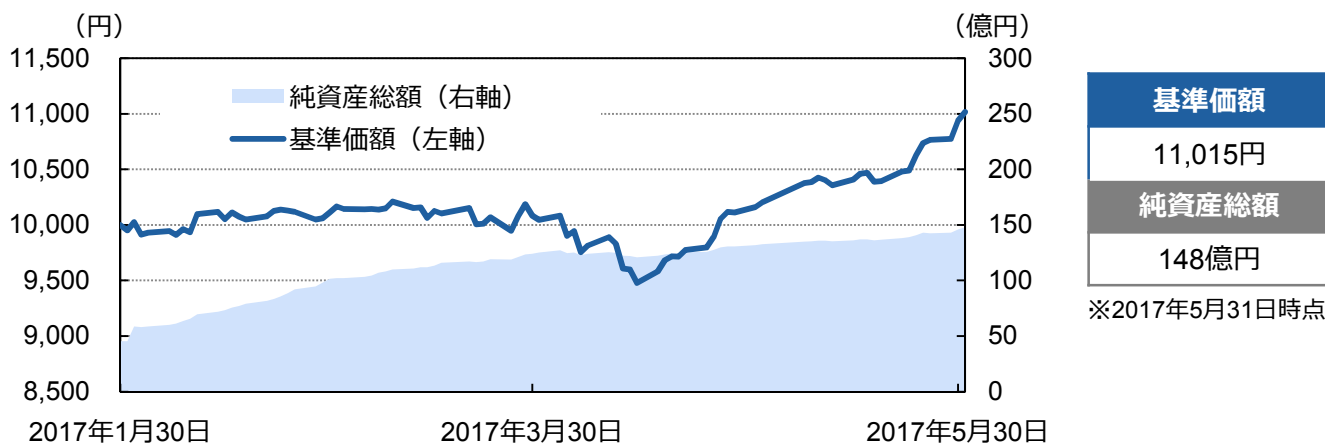
# ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド

(愛称: B・D・F)  
追加型投信/国内/株式

## 足元の運用状況と投資テーマについて

平素は、「ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド (愛称: B・D・F) 」(以下、当ファンド) をご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。当ファンドは、2017年1月31日に設定以降、着実に純資産残高を積み上げており、5月31日時点で148億円となっています。今後とも信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行ってまいりますので、引き続きお引き立てを賜りますよう、何卒よろしくお願い申し上げます。

### 運用実績 (期間: 2017年1月30日 (当ファンド設定日の前営業日) ~2017年5月31日)



※基準価額は1万口当たり、分配金を含まず、信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。



### ポートフォリオ構成

|         |         |
|---------|---------|
| 株式      | 80.53%  |
| 東証1部    | 62.34%  |
| 大型      | 3.09%   |
| 中型      | 15.99%  |
| 小型      | 43.27%  |
| 東証2部    | 1.38%   |
| ジャスダック  | 7.57%   |
| その他新興市場 | 9.24%   |
| 先物      | 18.04%  |
| 現金等     | 19.47%  |
| 合計      | 100.00% |
| 組入銘柄数   | 80      |



### 組入上位10業種

| No. | 業種     | 組入比率(%) |
|-----|--------|---------|
| 1   | 情報・通信業 | 28.91   |
| 2   | サービス業  | 11.65   |
| 3   | 電気機器   | 7.28    |
| 4   | 小売業    | 5.33    |
| 5   | 機械     | 3.13    |
| 6   | 電気・ガス業 | 2.79    |
| 7   | 化学     | 2.66    |
| 8   | 非鉄金属   | 2.24    |
| 9   | 医薬品    | 2.20    |
| 10  | 不動産業   | 1.83    |

※2017年5月31日時点

※比率は純資産総額に対する割合です。また、業種は東証33業種分類によるものです。

※上記は過去の運用実績であり、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「当資料のお取り扱いについてのご注意」を必ずお読みください。

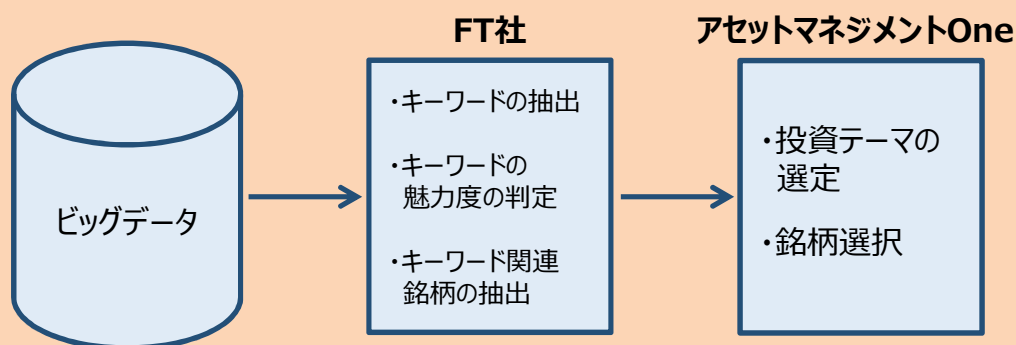


## ビッグデータを活用した投資テーマの選定／銘柄選択のイメージ

ビッグデータの集計・分析により投資テーマを選定し、それに従来の株式調査を加えて銘柄選択を行う画期的な日本中小型株式戦略です。

一般的に、大企業（大型株）や小売業はニュースの登場回数が多い傾向にあるなど、ニュースにおける情報量は必ずしも全銘柄で均等ではありません。そこで、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社（以下、FT社）がニュースから抽出されたキーワードとアニュアルレポートのテキスト情報を紐付け、主に中小型株の情報の補完を行います。ファンドマネジャーは、業種配分等にとらわれず、割安で今後高い成長が期待できると考えられる最終的な投資テーマおよび銘柄の組入比率を決定します。

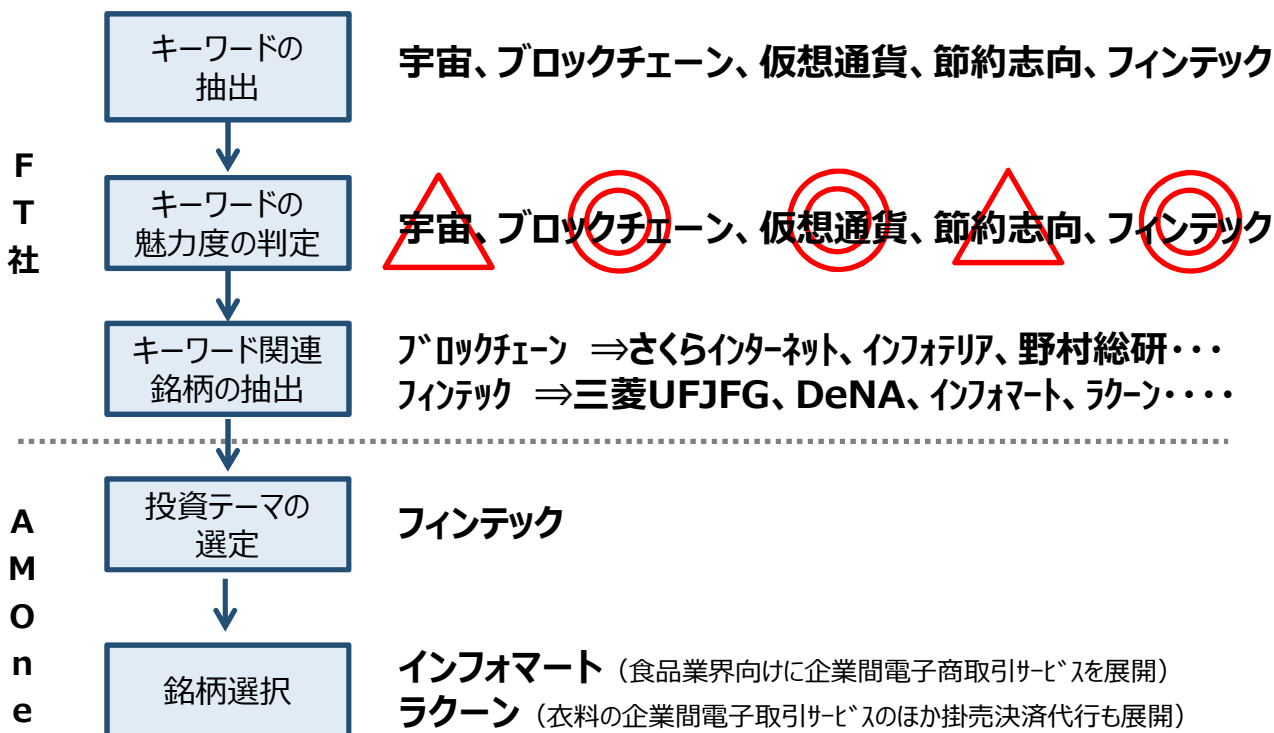
### 銘柄選択のイメージ



※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。



### 銘柄選択事例



※上記は過去の投資事例であり、保有の継続または将来における当ファンドへの組入を示唆、保証するものではありません。また、個別銘柄の推奨を目的としたものではありません。



## ビッグデータを活用した投資テーマの選定

| キーワード  | 投資テーマ      | 銘柄コード                                | 関連銘柄   |
|--|------------|--------------------------------------|--|
| 薬局 + 調剤<br>薬価 + 改定<br>余暇 + 高齢<br>DHA*<br>EPA*              | 高齢者関連ビジネス  | 1332<br>2398<br>3341<br>3981<br>4224 | 日本水産<br>ツクイ<br>日本調剤<br>ビーグリー<br>ロンシール工業              |
| プレミアム + アフター<br>アフター + フライデー<br>プレミアムフライデー<br>イベント + フライデー | プレミアムフライデー | 3073<br>3271<br>6048<br>9603         | ダイヤモンドダイニング<br>THEグローバル社<br>デザインワン・ジャパン<br>エイチ・アイ・エス |
| AR（拡張現実）<br>VR（仮想現実）<br>仮想                                 | AR・VR      | 3661<br>3689<br>3907<br>6594         | エムアップ<br>イグニス<br>シリコンスタジオ<br>日本電産                    |

\*DHA：ドコサヘキサエン酸、EPA：エイコサペンタエン酸。魚の脂肪に多く含まれる脂肪酸の一種で、食品から補給する必要がある栄養素。



## 投資銘柄のご紹介

当ファンドは、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。銘柄選択のポイントとして、ビッグデータを活用した投資テーマの選定に加え、社内アナリストやファンドマネジャー独自のボトムアップリサーチを加味し、割安で成長期待の大きいと考えられる銘柄を中心にポートフォリオを構築しています。

以下、2017年5月31日時点の組入銘柄の中から3銘柄をご紹介します。

### 3981 ビーグリー（業種：情報・通信業）

#### 【会社概要】

#### スマートフォンやタブレット向けに電子コミックを配信する「まんが王国」を運営

#### 【投資理由】

「高齢者関連ビジネス」というと医療や健康関連などが真っ先に想像されますが、アクティブシニアが増加しているなか、お金をあまりかけない余暇の過ごし方には、大きな需要があり、シニア向けのスポーツジム、カラオケなどは底堅い成長を見せています。

現在はスマートフォンを保有するシニアが増加しており、その使い方も注目を集めるなか、同社の主力事業である「電子コミック」市場は、今後数年は高い成長が期待されており、その恩恵を享受できると考えています。

#### 【株価の推移】



※期間：2017年3月16日～2017年5月31日（日次）

出所：ブルームバーグのデータをもとにアセットマネジメントOne作成

※上記は過去の情報または作成時点の見解であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。また、上記は過去の投資事例であり、保有の継続または将来における当ファンドへの組入を示唆・保証するものではありません。また、個別銘柄の推奨を目的としたものではありません。

### 3073 ダイヤモンドダイニング（業種：小売業）

#### 【会社概要】

**東京を中心に居酒屋を中心とした複数業態の飲食店を経営**

#### 【投資理由】

「プレミアムフライデー」は、経済産業省と経済界の団体が個人消費の喚起や、長時間労働の是正などを目的として、毎月最終金曜日は午後3時を目途に仕事を終えるよう企業に対応を呼びかけるキャンペーンです。プレミアムフライデーの導入により、人々の行動パターンに変化が生じる可能性から、旅行やエステ、習い事などの市場拡大や、広告を展開する会社への恩恵が考えられます。中でも外食産業への恩恵が大きいと考えています。同社は「DDマイル」を発行し、顧客の囲い込みにも成功しており一段の業績拡大が期待されます。

#### 【株価の推移】



### 3661 エムアップ（業種：情報・通信業）

#### 【会社概要】

**アーティスト等のファンサイト運営、携帯電話向けにコンテンツ配信などを展開**

#### 【投資理由】

「VR（仮想現実）」は、コンピューター上に人工的な環境を作り出し、あたかもそこにいるような感覚を体験できる技術です。子会社の社長に元ソニー・ミュージックアーティストの社長を招聘するとともに、VRコンサートを新規事業として位置づけ、既存事業との相乗効果を図ろうとしています。同社長の人脈を生かしてアーティスト開拓にも注力しているため、グループ全体での業績拡大が期待されます。

#### 【株価の推移】



※期間：2016年5月31日～2017年5月31日（日次）

出所：ブルームバーグのデータをもとにアセットマネジメントOne作成

※上記は過去の情報または作成時点の見解であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。また、上記は過去の投資事例であり、保有の継続または将来における当ファンドへの組入を示唆・保証するものではありません。また、個別銘柄の推奨を目的としたものではありません。



## ファンドの特色

1

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。

- ◆ 国内の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)\*を主要投資対象とします。  
\* 中小型株式以外の国内株式にも投資する場合があります。
- ◆ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。

2

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。

- ◆ ニュースフロー等のビッグデータから抽出したキーワードをもとに、今後株式市場で拡大余地が大きいと考えられる投資テーマをトップダウンにより選定します。
- ◆ 選定した投資テーマをもとに、社内アナリストやファンドマネジャー独自のボトムアップリサーチを加味し、割安で成長期待の大きいと考えられる銘柄を中心に、ファンドマネジャーが投資魅力度の高いと考える銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。

3

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。

- ◆ みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社より、ビッグデータ解析を活用した投資テーマや当該関連銘柄に関する助言を受けます。

### みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社（FT社）について

- FT社は数理科学をベースとした総合リスク管理やデリバティブズおよび投資・運用手法などの金融技術の開発を総合的に行う会社です。

資産運用に関連した業務としては、先端的な金融工学技術を活用し、精緻なリスク制御手法に基づいて資産運用商品の開発、コンサルティング、投資助言などを行っています。

□投資顧問契約数\*：30 □助言残高\*：約1兆7,682億円  
\*顧客の資産の額を前提とした契約

2016年3月末現在

出所：FT社の情報をもとにアセットマネジメントOne作成

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。



## ファンドのリスク

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き等により影響を受けますが、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、下記の変動要因により基準価額が下落し、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。

**基準価額の変動要因** ※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。

|                                     |  |
|-------------------------------------|--|
| <p><b>株 価 変 動 リ ス ク</b></p>         | <p>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。<br/>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。</p> |
| <p><b>個 別 銘 柄<br/>選 択 リ ス ク</b></p> | <p>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。</p>   |
| <p><b>流 動 性 リ ス ク</b></p>           | <p>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があり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。</p>   |
| <p><b>信 用 リ ス ク</b></p>             | <p>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。</p>  |

## 分配方針

- 年1回の決算日（毎年1月22日（休業日の場合は翌営業日））において、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。

※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。

※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。

## 分配金に関する留意点

- 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となります。

お申込みメモ（ご購入の際は、投資信託説明書（交付目論見書）ご確認ください。）

■ **購入単位**（当初元本1口=1円）

販売会社が定める単位

※「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみのお取扱いとなります。購入単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

■ **購入価額**

購入申込日の基準価額

■ **換金単位**

販売会社が定める単位

■ **換金価額**

換金申込日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額

■ **換金代金**

原則として換金申込日から起算して5営業日目からお支払いします。

■ **申込制限**

大口の換金請求に制限を設ける場合や、購入、換金の受付を中止する場合等があります。

■ **信託期間**

2022年1月24日までです。

（当初設定日：2017年1月31日）

■ **繰上償還**

受益権口数が10億口を下回る事となった場合等には、償還することがあります。

■ **決算日**

原則として毎年1月22日（休業日の場合には翌営業日）

■ **収益分配**

毎決算時に収益分配方針に基づき、収益分配を行います。「分配金受取コース」原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。

※分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

■ **課税関係**

◆当ファンドは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「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」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。

■ **お客さまにご負担いただく手数料等について**

下記手数料等の合計額等については、保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。詳細については、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

● **ご購入時**

■ **購入時手数料**

購入価額に**3.24%（税抜3.0%）**を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

※くわしくは販売会社にお問い合わせください。

● **ご換金時**

■ **換金手数料**

ありません。

■ **信託財産留保額**

換金申込日の基準価額に**0.3%**を乗じて得た額とします。

※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。

● **保有期間中（信託財産から間接的にご負担いただきます。）**

■ **運用管理費用（信託報酬）**

信託財産の純資産総額に対して年率**1.6632%（税抜1.54%）**を日々ご負担いただきます。

■ **その他費用・手数料**

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用等が信託財産から支払われます。

（その他費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。）

### 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。

### 当資料のお取り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、販売会社からお渡す投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認ください。ご自身でご判断ください。
- 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すべて投資者のみなさまに帰属します。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のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

### 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。

| 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 |
|--------------|--------------------------|---------|-----------------|-----------------|--------------------|----|
| 藍澤証券株式会社     | 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第6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   | ○       |                 |                 |                    |    |
| 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る場合があります。

また、上記の販売会社は今後変更となる場合があるため、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。

### 委託会社その他関係法人の概要

- **委託会社** **アセットマネジメントOne株式会社**  
信託財産の運用指図等を行います。
- **受託会社** **みずほ信託銀行株式会社**  
信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、受託会社は信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
- **販売会社**  
募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

### 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

・ホームページアドレス URL <http://www.am-one.co.jp/>