



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

足元の相場動向と今後の見通しについて

足元の米国株式の大幅下落の影響などから国内株式市場も大きく調整しています。
つきましては、運用主担当者より当ファンドの状況および今後の見通しについてご案内します。

運用実績

基準価額の推移



騰落率

(基準日: 2018年12月28日)

	当ファンド
過去1ヵ月	-15.9%
過去3ヵ月	-25.5%
過去6ヵ月	-20.2%
過去1年	-22.5%
設定来	1.8%

期間: 2017年1月30日(設定日前日) ~ 2018年12月28日(日次)

基準価額は1万口当たり、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。

当ファンドの騰落率実績は、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。各期間は基準日から過去に遡っています。2018年12月28日時点でファンドの分配実績はありません。

運用主担当者からのコメント

年末年始における株式市場の乱高下は、世界経済の先行き不透明感、米国金融政策・米中貿易問題に対する懸念等が市場参加者の中で高まったことが原因であると考えています。また、年末年始で市場が休みに入る中、上述のような市場環境を取り巻く外部環境の不透明感から、一時的にポジションを圧縮する市場参加者の影響もあったと考えております。市場参加者の市場環境に対する懸念や一時的な需給が主な原因と考えられ、年が変わり、市場参加者が冷静になり落ち着きを取り戻すにつれ株式市場も安定してくると思っています。

当ファンドは、ビッグデータ解析を通じて、今後、株式市場で注目を集める可能性のあるキーワードを投資の切り口に活用するファンドです。足元では高齢者の消費に関連する銘柄、AR(拡張現実)・VR(仮想現実)に関連する銘柄などの組入れを行っています。これらの銘柄は世界経済の動向に左右されにくい、言い換えると独自の成長ストーリーを持った会社、中長期的に高い成長が期待される会社が多いといえます。今回の株価下落を投資機会と捉え運用していく所存です。引き続きよろしくごお願い申し上げます。

上記の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予告なく変更される場合があります。

上記は過去の運用実績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。

巻末の「投資信託ご購入の注意」を必ずお読みください。



アセットマネジメントOne

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



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。



ファンドの投資リスク

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。

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。

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。

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）をご確認ください。）

購入単位	販売会社が定める単位（当初元本1口＝1円） 「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。）
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。
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	2022年1月24日まで（2017年1月31日設定）
繰上償還	受益権口数が10億口を下回ることとなった場合等には、償還することがあります。
決算日	毎年1月22日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配	毎決算日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、購入金額や保有期間等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を乗じて得た額となります。 購入時手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。 くわしくは販売会社にお問い合わせください。		
ご換金時			
換金時手数料	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とします。		
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）	ファンドの日々の純資産総額に対して 年率1.6632%（税抜1.54%）		
	支払先	内訳（税抜）	主な役務
	委託会社	年率0.75%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
	販売会社	年率0.75%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価	
その他の費用・手数料	組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、外国での資産の保管等に要する費用、監査費用等が信託財産から支払われます。 その他の費用・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ものがあるため、事前に料率、上限額等を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になることがあります。

投資信託ご購入の注意

- 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のうえ、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。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。
- 投資信託は
 - 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。
 - 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。
 - 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。

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。
- 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、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。

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T T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	○				
高木証券株式会社	金融商品取引業者 近畿財務局長（金商）第20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>

- 新規募集の取扱いおよび販売業務を行っておりません。
- 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。
- 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。

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