

2024年11月8日

各位

SBI 岡三アセットマネジメント株式会社
株式会社 FOLIO

AIを活用した相場予測で好パフォーマンスを目指す公募投資信託 「ROBOPRO ファンド」が純資産総額 200 億円を突破

SBI 岡三アセットマネジメント株式会社(本社:東京都中央区、代表取締役社長:塩川克史、以下「SBI 岡三アセットマネジメント」)が2023年12月28日に設定した「ROBOPRO ファンド(以下「当ファンド」)」が2024年11月7日、運用開始以来約10ヵ月で純資産総額200億円を超えることとなりましたのでお知らせいたします。

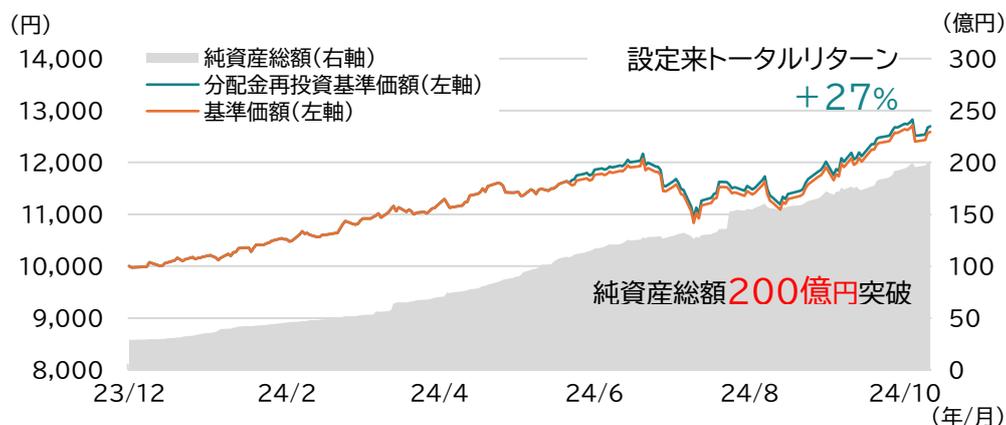
当ファンドは、株式会社 FOLIO ホールディングスの子会社である株式会社 FOLIO (本社:東京都千代田区、代表取締役:四元盛文、以下「FOLIO」)が「ROBOPRO」の運用戦略に基づいて投資助言を行い、高パフォーマンスの獲得と魅力ある商品開発でチャレンジを続ける SBI 岡三アセットマネジメントが運用を行っています。

その結果、当ファンドは2024年11月7日時点で分配金お支払い後の基準価額12,588円、純資産総額201億円と好調なパフォーマンスを見せています。(2024年6月19日、分配金100円お支払い)

当ファンドは新 NISA(成長投資枠)に対応しており、投資信託として多くの投資家の皆さまに「ROBOPRO」の運用戦略を享受していただけているものと考えています。

販売取扱い会社は証券会社8社、銀行7行に拡大するなど(2024年11月7日時点、予定含む)、大きな注目を集めており、SBI 岡三アセットマネジメントと FOLIO は、引き続き相場対応力の高い「AI投資」を実現させ、これからもより多くの皆さまの資産形成に貢献してまいります。

■ 設定来の基準価額の推移 (2023年12月28日~2024年11月7日、日次)



※基準価額は1万口当たり、年率1.562%(税抜1.42%)の信託報酬控除後です。
※グラフは過去の実績であり、将来の運用成果を示唆または保証するものではありません。

■「ROBOPRO ファンド」の特徴

当ファンドは、AI による分析や予測を活かした機動的で大胆な資産配分の変更(リバランス)を駆使して運用を行うことが特徴です。投資対象資産は米国株式、先進国株式、新興国株式、米国債券、ハイイールド債券、新興国債券、不動産、金の 8 資産で、それらの ETF*を通じて世界中に分散投資します。

* 8 資産の ETF

米国株式:バンガード・トータル・ストック・マーケット ETF 先進国株式:バンガード FTSE ディベロップド・マーケット ETF
 新興国株式:バンガード FTSE エマージング・マーケット ETF 米国債券:バンガード・トータル債券市場 ETF
 不動産:i シェアーズ米国不動産 ETF ハイイールド債券:i シェアーズ iBoxx ハイイールド社債 ETF
 金:SPDR® Gold MiniShares Trust 新興国債券:i シェアーズ JP モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券 ETF

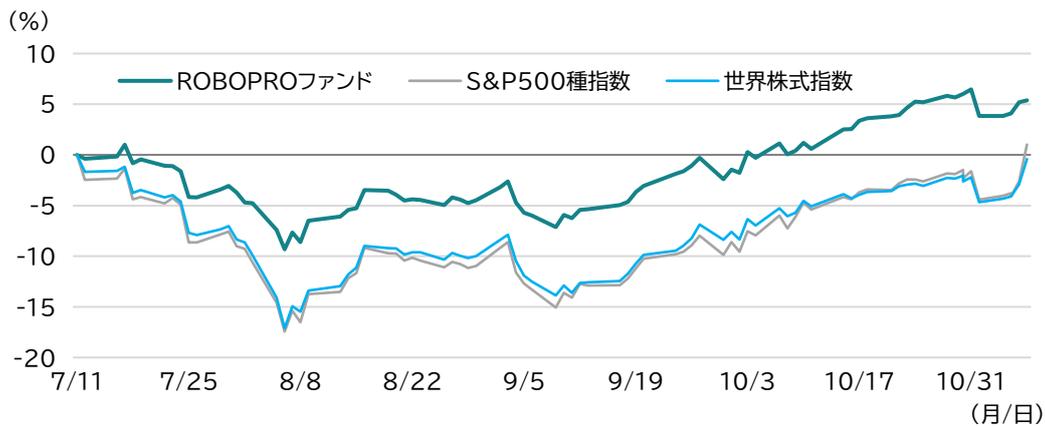
※2024 年 10 月末時点の投資対象を記載しています。特定銘柄の推奨および将来の組入れを保証するものではありません。



■ROBOPRO ファンドと主要株価指数のパフォーマンス比較 (2024 年 7 月 11 日~2024 年 11 月 7 日、日次)

S&P500 種指数や世界株式指数は今年 7 月 11 日に高値(円換算)を付けた後の株価の回復に時間がかかっています。S&P500 種指数は 11 月 7 日に 7 月高値をようやく上回ることができました(+1.0%)が、世界株式指数はまだ 7 月高値を回復できていません。

一方、ROBOPRO ファンドは、金や不動産に対する投資配分が高位だったことなどが奏功し、株式市場の下落の影響を小さく抑えることができました。ROBOPRO ファンドは、その後も堅調な戻りを見せており、10 月 3 日には 7 月高値の水準を回復し、足元は 7 月高値を 5.4%上回っています(11 月 7 日時点)。



※ROBOPRO ファンド(分配金再投資基準価額)は 2024/7/11、各指数(世界株式指数(MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス、配当込み、円換算)、S&P500 種指数(配当込み、円換算))は前営業日をそれぞれ起点として騰落率を計算しています。

※市場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。グラフは過去の実績であり、将来の運用成果を示唆または保証するものではありません。

■「ROBOPRO ファンド」の概要

ファンドの特色

- 1 世界の取引所に上場しているETFに投資することにより、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティ^(注)に分散投資します。

(注)コモディティへの投資は当面、金を対象としますが今後変更になる場合があります。

<ファミリーファンド方式で運用します>



- ETFの実質組入比率は高位を保つことを基本とします。
- ファンドは、株式会社FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する助言を受けます。
※投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無については、変更する場合があります。

- 2 ETFの選定は、流動性やコスト等を勘案して行います。また、流動性やコスト等の条件により、上場投資証券(ETN)に投資を行う場合があります。

- 3 各資産の配分にあたっては、マーケットデータ等の分析に加え、対象資産の期待収益率、リスクおよび相関等の推計値を考慮し配分比率を決定します。配分比率の見直しは、原則として1ヵ月毎に行います。

- 4 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

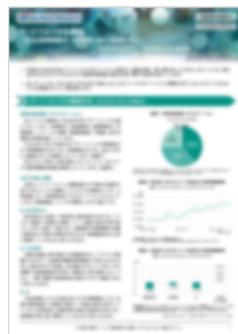
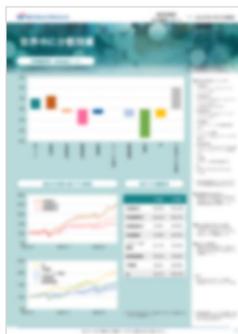
資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<本資料で使用しているインデックス>

世界株式:MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み)

●MSCI指数はMSCI Inc.が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

■充実した情報開示



リバランスレポート(2024年10月10日)

<https://www.sbiokasan-am.co.jp/data/news/4596/report.pdf>

*リバランスレポートで毎月の資産配分変更について詳しく解説しています。

<金融商品取引法等に係る表示>

商号等 SBI 岡三アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者
登録番号 関東財務局長(金商)第 370 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

商号等 株式会社 FOLIO 金融商品取引業者(第一種金融商品取引業、投資助言・代理業、投資運用業)
登録番号 関東財務局長(金商)第 2983 号
加入協会 日本証券業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

■株式会社FOLIOホールディングスについて

FOLIOホールディングスは、「明日の金融をデザインする。」をミッションとして掲げ、これからの社会に求められる金融ソリューションの創出を通じて、豊かな未来の実現を目指しています。現在は、一般のお客さまや金融機関に対して投資一任運用ソリューションを提供する株式会社FOLIOと、投資運用およびトレーディングのためのAIソリューションを開発するAlpacaTech株式会社を傘下に擁し、両社による強力な事業シナジーのもと、高度な技術力を駆使した金融ソリューションを拡充しています。今後もお客さまや社会の課題に真摯に向き合い、当社グループの強みである技術力と創造力をもって新しいソリューションを設計し、より多くのステークホルダーに対して当社グループの価値を提供してまいります。

▶URL: <https://folio-hd.com>

※本件はSBI岡三アセットマネジメント、FOLIOの2社共同のプレスリリースです。

本プレスリリースに関する報道機関からの問い合わせ先

SBI 岡三アセットマネジメント株式会社
投信マーケティング部 03-3516-1296

株式会社 FOLIO
広報担当: E-mail: folio-pr@folio-sec.com