

2024 年 6 月 17 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

株式会社 SBI 証券

好評の AI 運用アクティブファンド、第 2 弾！
人工知能(AI)を活用した公募投資信託「SBI 岡三 NASDAQ AI アクティブファンド」
SBI 証券での募集取扱い開始のお知らせ

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 2024 年 6 月 28 日(金)に設定する「SBI 岡三 NASDAQ AI アクティブファンド(以下「当ファンド」)」について、本日 6 月 17 日(月)より、株式会社 SBI 証券(本社:東京都港区、代表取締役社長:高村正人、以下「SBI 証券」)での募集取扱いを開始しますのでお知らせします。

当ファンドは、NASDAQ 市場上場銘柄を投資対象とし、その中から流動性や信用リスクを勘案のうえ選定された投資候補銘柄群に関して、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 AI による各投資候補銘柄のリターンのランキング予測を活用して投資配分等の助言を行い、その助言を参考にして SBI 岡三アセットマネジメントがクオンツ・アプローチによってリスクコントロールとポートフォリオ構築を行います。AI を用いて長期と短期の視点で分析・予測を行い、NASDAQ 総合指数を凌駕するリターンの獲得を目指すことを特徴とする投資信託です。

当ファンドは AI 予測を活用した資産運用サービスで豊富な実績を誇る FOLIO と、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、そして革新的で良質な金融商品の提供に努める SBI 証券の 3 社が総力を結集し、「ROBOPRO ファンド(2023 年 12 月 28 日設定、以下「ROBOPRO ファンド」)」に続き、2 本目の AI 運用アクティブファンド(AI を活用し運用を行うアクティブファンド)を設定するものです。1 本目の「ROBOPRO ファンド」においては、基準価額は概ね堅調に推移し、純資産総額は 2024 年 6 月 7 日(金)に 100 億円を突破しました。2 本目となる当ファンドにおいても、AI 運用ならではの好パフォーマンスを目指します。当ファンドは、新 NISA(成長投資枠)にも対応する予定です。

当ファンド募集取扱い開始にあたり、SBI 証券では日頃のご愛顧への感謝を込めて、インターネットコースの個人のお客さまを対象に、AI 活用ファンドによる資産形成を応援すべく「総額 300 万円！AI 運用ファンド購入応援キャンペーン」を開催します。また、6 月 28 日(金)には SBI 岡三アセットマネジメント、FOLIO、SBI 証券の 3 社にて「AI 運用」の魅力などを紹介するセミナーの開催を予定しています。当ファンドと「ROBOPRO ファンド」を通じて、多くの投資家の皆さまに AI を活用した運用のメリットを享受していただけるものと考えています。

SBI 岡三アセットマネジメント、FOLIO、SBI 証券は、今後も「顧客中心主義」のもと、長期の資産形成に資する商品・サービスを提供し、お客さまのニーズに合わせて資産形成を支援していきます。



■「SBI 岡三 NASDAQ AI アクティブファンド」の概要

ファンドの特色

- 1 米国の NASDAQ* 上場株式(これに準ずるものを含みます。)を投資対象とします。
* NASDAQ は 1971 年に開設された米国にある新興企業向けの株式市場です。
●実際の運用は SBI 岡三 NASDAQ AI アクティブマザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)を通じて行います。
- 2 運用にあたっては、NASDAQ 上場株式の中から流動性や信用リスクを勘案の上、投資候補銘柄を抽出したのち、ファンダメンタルズ指標やテクニカル指標から人工知能(AI)が投資候補銘柄の予測リターン順位を推定します。
- 3 銘柄の選定にあたっては、予測リターン順位を基に、定量アプローチによるリスクコントロールを行い、ポートフォリオを構築します。
- 4 投資候補銘柄の予測リターン順位、投資銘柄および投資比率の見直しは、原則として月次で行います。
- 5 株式の実質組入比率は高位を保つことを基本とします。
- 6 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。

マザーファンドの運用にあたり、株式会社 FOLIO から投資候補銘柄のリターンのランキング予測や投資配分等に関する助言を受けます。

株式会社 FOLIO は 2015 年 12 月に設立され、一般投資家および金融機関向けに AI やテクノロジーを活用した資産運用等にかかるサービス・システム等を提供しています。

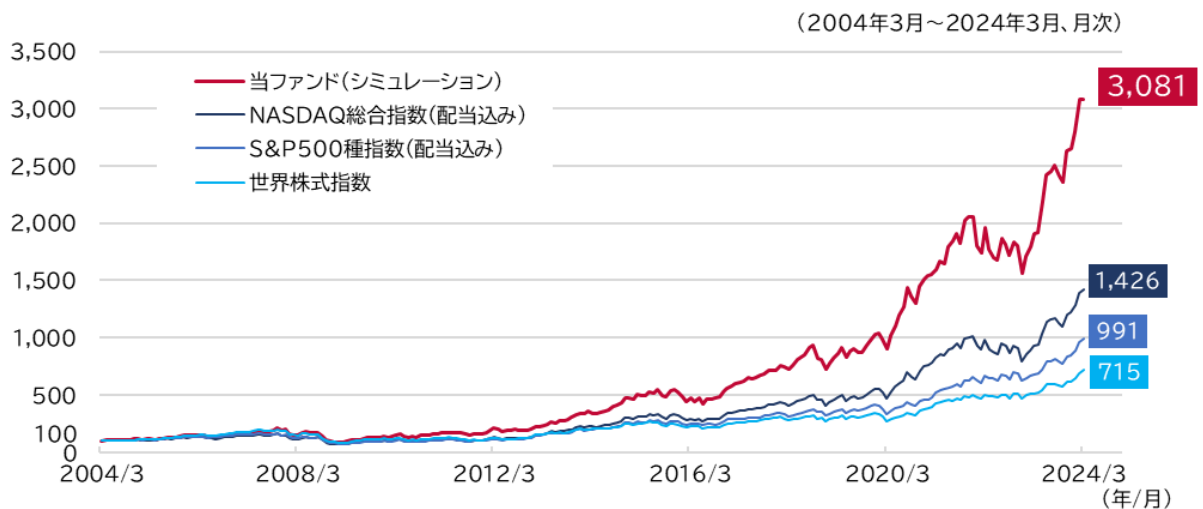
※投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無については、変更する場合があります。

NASDAQ の著作権等について

Nasdaq®は、Nasdaq, Inc. またはその関連会社（以下、Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「Nasdaq 社」と総称します）の登録商標であり、SBI 岡三アセットマネジメント株式会社が使用許諾を受けています。Nasdaq 社は、SBI 岡三アセットマネジメント株式会社が設定するアクティブ・ファンドの運用プロセス、または当該ファンドのマーケティングまたは取引に関連して、いかなる関係も責任も負いません。当該アクティブ・ファンドとその運用プロセスの合法性または適格性は Nasdaq 社によって保証されたものではありません。当該ファンドは、Nasdaq 社によって発行、承認、販売、または販促されるものではありません。また、Nasdaq 社は、当該ファンドに関していかなる保証も行わず、責任を負いません。

■AIを活用し NASDAQ 総合指数を凌駕するパフォーマンスを目指します

世界株式指数、S&P500 種指数、NASDAQ 総合指数と当ファンド(シミュレーション)



※2004年3月末=100として指数化、各指数は円換算したもの。

※当ファンド(シミュレーション)は資料作成時点の運用およびリスクコントロール手法に基づき算出したシミュレーション（信託報酬相当額を控除）です。

※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)

※市場環境等についての評価、分析等は将来の運用成果を保証するものではありません。上記は当ファンドの運用実績ではありません。

(出所) Bloomberg のデータを基に SBI 岡三アセットマネジメント作成

■「総額 300 万円！ AI 運用ファンド購入応援キャンペーン」で、最大 10 万円獲得のチャンス



キャンペーン 内容	キャンペーン期間中にエントリーをして、「SBI 岡三 NASDAQ AI アクティブファンド」または「ROBOPRO ファンド」をいずれか合計 1 万円以上買付された方から抽選で 215 名に現金最大 10 万円をプレゼント(5 名様に 10 万円、10 名様に 5 万円、200 名様に 1 万円)
キャンペーン 対象者	インターネットコースの個人のお客さま
キャンペーン 期間	2024 年 6 月 17 日(月)から 2024 年 7 月 31 日(水)まで
キャンペーン URL	https://www.sbisec.co.jp/ETGate/WPLETmgR001Control?OutSide=on&getFlg=on&burl=search_home&cat1=home&cat2=campaign&dir=campaign&file=home_campaign_240617fund_ai.html

■「AI運用って実際どう？」AI運用ファンドセミナー



AI 運用に興味はあるが、一步を踏み出しにくい…といったお客さまのために、AI 運用の魅力や注目集まる AI 運用ファンドをご紹介しますオンラインセミナーを開催します。

申込はこちら(事前申込制)

https://www.sbisec.co.jp/ETGate/WPLETmgR001Control?OutSide=on&getFlg=on&burl=search_home&cat1=home&cat2=seminar&dir=seminar&file=home_seminar_240617_fund_ai.html

<金融商品取引法等に係る表示>

商号等 株式会社 SBI 証券 金融商品取引業者、商品先物取引業者
登録番号 関東財務局長(金商)第 44 号
加入協会 日本証券業協会、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、一般社団法人日本 STO 協会、日本商品先物取引協会

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
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

<SBI証券における手数料等及びリスク情報について>

SBI証券の証券総合口座の口座開設料・管理料は無料です。

SBI証券で取り扱っている商品等へのご投資には、商品毎に所定の手数料や必要経費等をご負担いただく場合があります。また、各商品等は価格の変動等により損失が生じるおそれがあります(信用取引、先物・オプション取引、商品先物取引、外国為替保証金取引、取引所CFD(くりっく株365)では差し入れた保証金・証拠金(元本)を上回る損失が生じるおそれがあります)。各商品等への投資に際してご負担いただく手数料等及びリスクは商品毎に異なりますので、詳細につきましては、SBI証券WEBサイトの当該商品等のページ、金融商品取引法等に係る表示又は契約締結前交付書面等をご確認ください。
