

## 「ゴールドマン・サックス社債／FOLIO・AIマルチアセット戦略ファンド2025-05」 FOLIOのAI運用戦略を活用した新たな単位型公募投資信託が誕生

SBIグループで革新的な金融ソリューションを提供する株式会社 FOLIO ホールディングスの子会社である株式会社 FOLIO（東京都千代田区、代表取締役：四元 盛文、以下 FOLIO）は、三井住友 DS アセットマネジメント株式会社により新たに設定された公募投資信託「ゴールドマン・サックス社債／FOLIO・AIマルチアセット戦略ファンド2025-05」に関連する指数において、投資助言業務としてゴールドマン・サックス・インターナショナルへ資産配分比率の指定を行います。当ファンドについては、有価証券届出書が2025年3月28日に関東財務局長に提出されており、2025年4月15日（火）から募集が開始されます。

当ファンドは、ゴールドマン・サックス社債に投資を行い、設定日より約5年後の満期償還時の当ファンドの償還価額について、元本を上回る投資成果を目指します。また、ゴールドマン・サックス社債の利金（固定クーポン）と、FOLIO-AIマルチアセット分散投資VT3指数（以下、「戦略指数」）の累積収益率により決定される実績連動部分の獲得を目指すことを特徴とする投資信託です。

### ■ FOLIO-AIマルチアセット分散投資VT3指数（戦略指数）とは

この戦略指数では、投資助言業者であるFOLIOが、グループ会社であるAlpacaTech株式会社（以下「AlpacaTech」）のAIテクノロジーを活用し、金融工学モデルにより算出した資産配分比率を指定します。

- ・ FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する指定を受けて、ゴールドマン・サックス・インターナショナル社が戦略指数を算出します。
- ・ 戦略指数は、先進国株式のETF、米国および新興国の株式指数先物、米国国債先物、CDS指数を活用した米国ハイイールド債券、米国不動産ETF、金先物等で構成されます。
- ・ AIを用いた資産配分の最適化に基づき、所定のリスクコントロールによりパフォーマンスの安定化を目指します。

FOLIOはAI投資「ROBOPRO」を皮切りに、AI予測を活用した資産運用サービスで実績を積み重ねてまいりました。公募投資信託におけるAI活用も進んでおり、SBI岡三アセットマネジメント株式会社が設定した公募投資信託「ROBOPROファンド」および「SBI岡三NASDAQ AIアクティブファンド」は、AlpacaTechとともにFOLIOが提供するAI運用エンジンを活用したファンドです。今後もFOLIOとAlpacaTechによる強力な事業シナジーのもと、AIを活用した資産運用の拡充・高度化を進めると共に、多面的なアプローチで金融ソリューションを拡充し、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。

### 【金融商品取引法等に係る表示】

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

### <手数料等及びリスク情報について>

FOLIOの証券総合口座の口座開設料・管理料は無料です。

FOLIO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、金融商品の取引においては、株価、為替、金利、その他の指標の変動等により損失が生じ、投資元本を割り込むおそれがあります。ご契約の際は契約締結前交付書面等の内容を十分にご確認ください。

手数料等及びリスクの詳細はこちら（以下のリンクに記載される手数料は「ゴールドマン・サックス社債／FOLIO・AIマルチアセット戦略ファンド2025-05」、「ROBOPROファンド」および「SBI岡三NASDAQ AIアクティブファンド」とは異なります。）

<https://folio-sec.com/support/terms/transaction-fees>

### ■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。なお、FOLIO ホールディングスは東京証券取引所プライム市場に上場し SBI 証券を傘下に擁する SBI ホールディングス株式会社のグループ会社です。

▶URL : <https://folio-hd.com>

### ■株式会社 FOLIO 会社概要

本社所在地：東京都千代田区一番町 16-1 共同ビル一番町 4 階

事業内容：第一種金融商品取引業、投資運用業、投資助言・代理業

登録番号等：金融商品取引業者 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

代表者：代表取締役 四元 盛文

設立：2015 年 12 月 10 日

URL : <https://folio-sec.com>

<本件に関する報道関係者さまからのお問合せ先>

株式会社 FOLIO 広報担当：武藤  
TEL : 080-4583-1433 E-mail : [folio-pr@folio-sec.com](mailto:folio-pr@folio-sec.com)