

私募投資信託「AMOne 国内株式セクターローテーションファンド(適格機関投資家限定)」 において、新たな AI 予測モデルを活用した投資助言業務を開始

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、アセットマネジメント One 株式会社により 2025 年 8 月 19 日に設定された私募投資信託「AMOne 国内株式セクターローテーションファンド（適格機関投資家限定）」において、新たな AI 予測モデルを活用した投資助言業務を開始しました。

新たなAI予測モデルで 投資助言を開始

 | **AlpacaTech**

日本株式 AI モデルは、FOLIO のグループ会社である AlpacaTech 株式会社（以下「AlpacaTech」）が開発した予測モデルです。「AMOne 国内株式セクターローテーションファンド（適格機関投資家限定）」は、本モデルを活用した FOLIO の投資助言を通じて、TOPIX のパフォーマンスを上回るパフォーマンスを目指します。

今日、本邦の資産運用において、AI を活用した投資ソリューションには個人投資家のみならず機関投資家からも注目が集まっています。FOLIO と AlpacaTech 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を他の金融機関と連携しながら拡充し、投資一任運用サービスや投資信託における AI 活用を進めています。

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」、三井住友 DS アセットマネジメント株式会社が設定した単位型公募投資信託「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」においては、AlpacaTech の AI 運用エンジンを活用して FOLIO が助言業者として関与しています。今後も両社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 会社概要

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や投資助言サービス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。

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：グループ会社の経営管理および付帯業務

代表者：代表取締役社長 兼 CEO 甲斐 真一郎

設立：2019 年 4 月 1 日

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、関谷、下村
E-mail：pr@folio-group.com