

2025年6月

お客さま各位

アセットマネジメント One 株式会社

「PayPay 投信 AI プラス」
弊社移管後の運用プロセスに関するお知らせ

拝啓 時下ますますご清栄のこととお慶び申し上げます。
平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、ご愛顧いただいております「PayPay 投信 AI プラス」(移管後名称:「AI プラスファンド」)について、運用会社である PayPay アセットマネジメント株式会社(以下、「PPAM」といいます。)の事業終了に伴い実施した書面決議手続きにて、2025年8月12日よりアセットマネジメント One 株式会社(以下、「弊社」といいます。)への移管が決定し、弊社が当ファンドの運用を継続することとなりました。本対応に伴い、運用プロセス等の一部変更を行いますので、お知らせいたします。

なお、運用プロセス等の変更に関しましては、既存の信託約款の範囲内で実施するもので、受益者のみなさまに特段のお手続きを求めるものではございません。

何卒ご理解・ご協力を賜り、今後とも弊社および当ファンドをお引き立ていただきますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

1. 対象ファンド

PayPay 投信 AI プラス
(移管後は「AI プラスファンド」に名称変更予定)

2. 運用プロセス変更の背景

これまで当ファンドでは PPAM 独自の運用プロセスおよび AI モデルにて運用が行われてきましたが、シミュレーション等の結果から弊社の AI モデルの活用により、更に良好なパフォーマンスが得られると判断し、運用プロセスの変更を実施することといたしました。

新しい運用プロセスにおいてもビッグデータ解析および AI を活用しており、対象ファンドのファンドコンセプト(運用哲学)を大きく変更することなく、パフォーマンスの改善を図ることができるものと考えております。なお、運用プロセスの変更は、対象ファンドの弊社への移管後速やかに実施する予定です。

3. 変更日

2025年8月12日以降速やかに

4. 運用プロセスの主な変更点

| | 移管後 | 移管前 |
|---------|---|---|
| 運用プロセス | <ul style="list-style-type: none"> 時価総額、流動性などを考慮して投資ユニバースを決定し、それらの銘柄群に対しアセットマネジメントOneのAIモデルがスコアリングした魅力度をベースに、ポートフォリオ最適化手法にて推奨銘柄とその保有ウェイトを決定します。 | <ul style="list-style-type: none"> PayPayアセットマネジメントのAIモデルのスコアリングに基づく魅力度をベースに銘柄を評価し、時価総額、流動性などを考慮して推奨銘柄とその保有ウェイトを決定します。 |
| 想定組入銘柄数 | <ul style="list-style-type: none"> 120～200 銘柄程度 | <ul style="list-style-type: none"> 200～270 銘柄程度 |
| 運用の特色 | <ul style="list-style-type: none"> 委託会社が有効と考えるビッグデータの解析やAIの活用等を通じて、今後の株価の上昇(市場平均を上回る上昇を含みます。)が高い確度で予測される銘柄の組入れを行なうことを基本とします。 委託会社が有効と考えるビッグデータの解析やAIの活用等を通じて、継続的な運用の強化・充実を図ります。 | <ul style="list-style-type: none"> 委託会社が有効と考えるビッグデータの解析等を通じて市場の歪み(マーケットアノマリー)を見出し、今後の株価の上昇(市場平均を上回る上昇を含みます。)が高い確度で予測される銘柄の組入れを行なうことを基本とします。 人工知能(AI)を活用した委託会社が有効と考えるビッグデータの解析、株価の予測等を通じて、継続的な運用の強化・充実を図ります。 |

以上

- 本件に関してご不明な点は、下記までお問い合わせください。
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

※お客さまの残高などお取引に関するお問い合わせは、お取引いただいている販売会社までお願いいたします。