

2023年11月24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

人工知能(AI)を活用した公募投資信託「ROBOPRO ファンド」届出のお知らせ ～2023年12月11日(月)より対面チャネルにて募集開始～

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」)は、2023年11月24日(金)に人工知能(AI)を活かした公募投資信託「ROBOPRO ファンド(以下「当ファンド」)」の有価証券届出書を関東財務局長に提出しました。

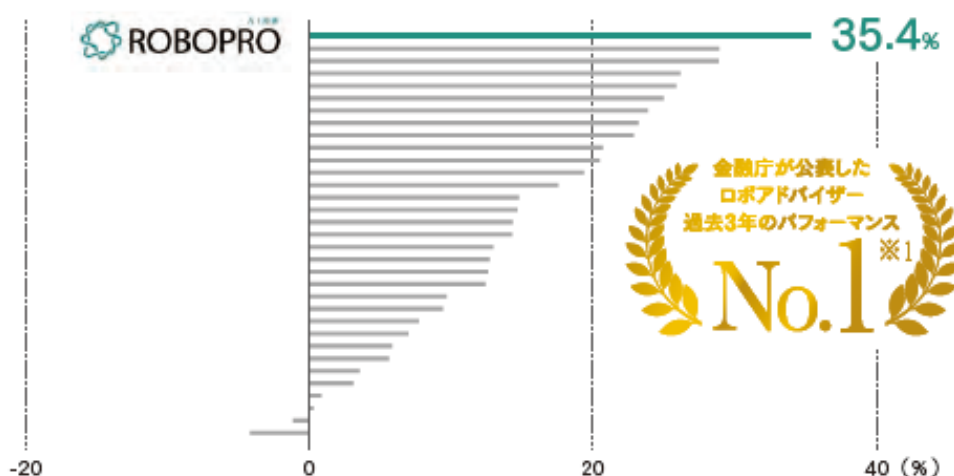
当ファンドは、株式会社 FOLIO (本社:東京都千代田区、代表取締役 CEO :甲斐真一郎、以下「FOLIO」)が提供する「ROBOPRO」の運用手法を用いたファンドであり、株式会社 SBI 証券(本社:東京都港区、代表取締役社長:高村正人、以下「SBI 証券」)の対面チャネル(SBI マネープラザ株式会社、SBI 証券の提携先金融商品仲介業者(IFA))にて2023年12月11日(月)より募集を開始します。なお、当ファンドは新 NISA(成長投資枠)に対応する予定です。



「ROBOPRO」はAIによる分析や予測を活かし、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ロボアドバイザーです。投資対象は米国株式、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、米国不動産、金の8資産となっており、それらのETFを通じて世界中に分散投資を行います。

過去3年にわたる運用実績(パフォーマンス)において「ROBOPRO」は、数あるロボアドバイザーの中で No.1 のパフォーマンスを記録しています。

■ロボアドバイザーのパフォーマンス比較(過去3年) (2020年~2022年)



※1 金融庁公表資料「国内運用会社の運用パフォーマンスを示す代表的な指標(KPI)の測定と国内公募投信についての諸論点に関する分析」別添「2022 年末(4)ファンドラップ関連」(2023 年 4 月 21 日)の「ロボアドバイザーのコース別パフォーマンス(過去3年と5年)」において、主な投資一任型ロボアドバイザー5社のうち、ROBOPRO が過去3年の累積リターンで第1位

※ 2022 年末時点

※ 当ファンドの実績ではありません。当ファンドと ROBOPRO の手数料率は異なります。

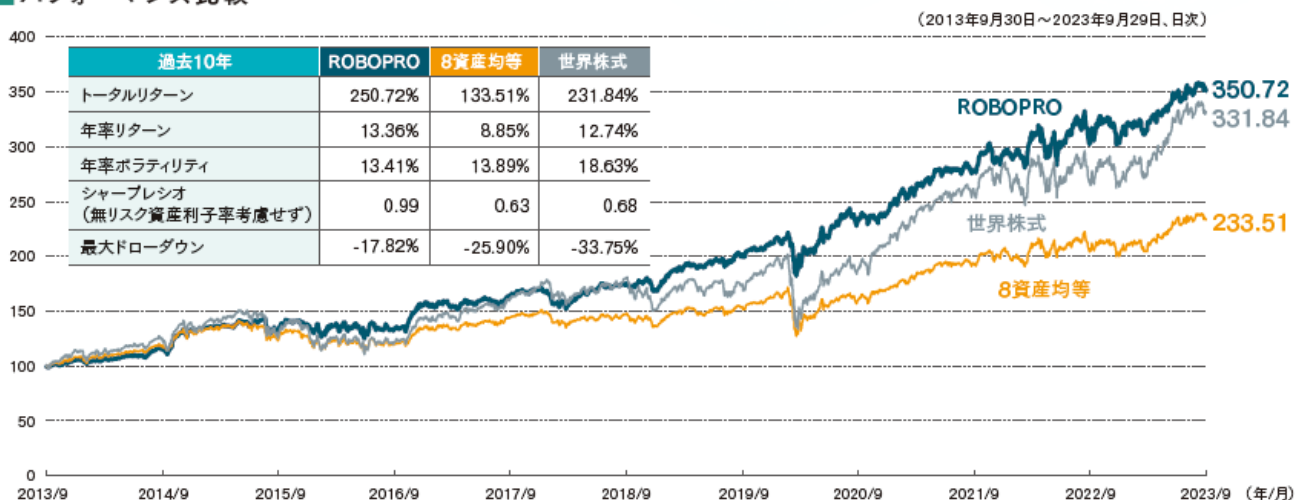
※ 主な投資一任型ロボアドバイザー5社の各コース(コスト控除後、円建て、月次データ)を対象

※ 「ROBOPRO」はサービス開始が 2020 年 1 月 15 日のため、計測期間の3年は 2020 年 1 月 15 日から 2022 年末までの約3年間で計算

※ 運用実績はあくまでも過去のものであり将来の運用成果等を示唆または保証するものではありません。

また、「ROBOPRO」の運用戦略を過去約10年にわたり使用したと仮定したシミュレーションで、「ROBOPRO」は世界株式や8資産均等の分散投資を上回る好パフォーマンスを示しています。

■パフォーマンス比較



※ 2013 年 9 月末を 100 として指数化 ※世界株式:MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み)

※ ROBOPRO:2013年9月末～2020年1月15日まで最新の運用戦略を使用したと仮定したシミュレーション、2020年1月15日以降は実績パフォーマンス(運用手数料控除前)を繋ぎ合わせた運用パフォーマンスから算出しています。

※ 8資産均等:ROBOPROの投資対象8銘柄を金額均等で保持するポートフォリオで毎月リバランスを行って運用したパフォーマンスとして算出しています。

※ 為替を用いて円建てに変換して計算しています。また、各月のリバランスは最適ポートフォリオと乖離なく行われると仮定して計算しています。運用にかかる費用及び税金は考慮していません。

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

当ファンドは、「ROBOPRO」の運用手法を用いて世界の取引所に上場されている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に分散投資します。各資産への配分にあたっては、マーケットデータ、対象資産の期待収益率、リスク、各資産間の相関等に基づくAIの将来予測を基に合理的判断によって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ヵ月ごとに行います。

SBI岡三アセットマネジメント、FOLIO、SBI証券のSBIグループ3社は総力を結集して当ファンドの組成に取り組んできました。先進的な運用手法を用いたファンドを投資家の皆さまにご提供することは日本の「資産運用立国」の実現に資す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」の経営理念のもと、長期の資産形成に資する商品・サービスを提供し、お客様のニーズに合わせて資産形成を支援していきます。

■「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される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に分散投資します。

<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。

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。

<本資料で使用しているインデックス>

●MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスは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。

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。

■購入の申込期間(予定)

当初募集期間:2023年12月11日(月)から2023年12月27日(水)まで

設定日:2023年12月28日(木)

<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。
