

2024 年 3 月 1 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」 SBI 証券のインターネットコースでの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 2023 年 12 月 28 日に設定した「ROBOPRO ファンド(以下「当ファンド」)」について、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))に加えて、2024 年 3 月 1 日(金)よりインターネットコースでの取扱いを開始します。

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、AI による分析や予測を活かした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ことが特徴です。投資対象資産は米国株式、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、不動産、金の 8 資産で、それらの ETF*を通じて世界中に分散投資します。



* 8 資産の ETF

米国株式:バンガード・トータル・ストック・マーケット ETF 先進国株式:バンガード FTSE ディベロップド・マーケット ETF

新興国株式:バンガード FTSE エマージング・マーケット ETF 米国債券:バンガード・トータル債券市場 ETF

ハイイールド債券:i シェアーズ iBoxx ハイイールド社債 ETF

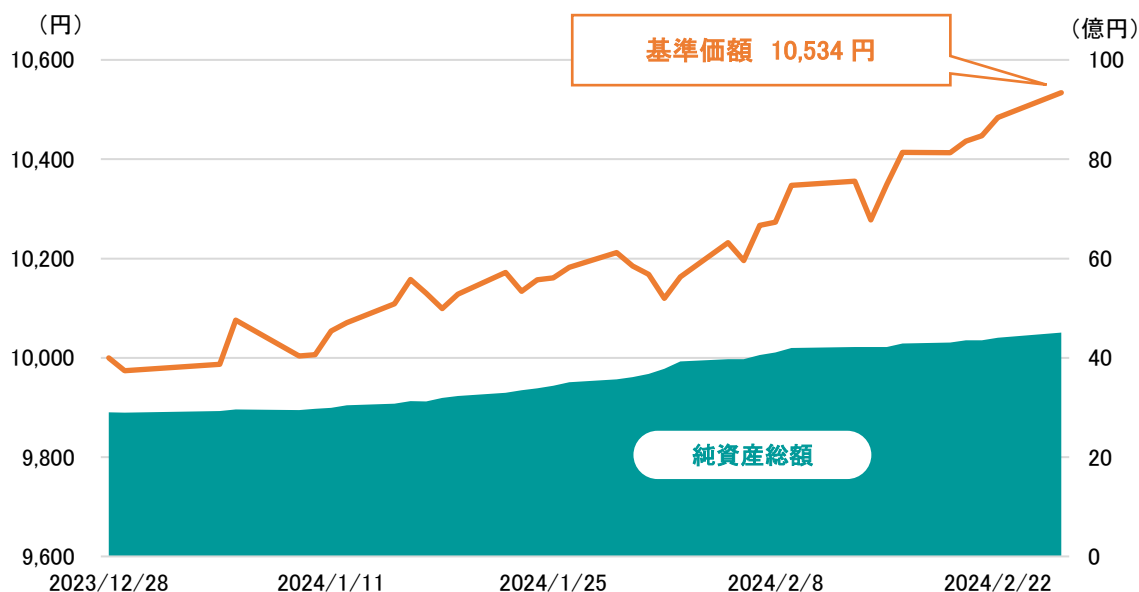
新興国債券:i シェアーズ JP モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF 不動産:i シェアーズ米国不動産 ETF

金:SPDR Gold MiniShares Trust

※2024 年 1 月末時点の投資対象を記載しています。特定銘柄の推奨および将来の組入れを保証するものではありません。

当ファンドは、運用を開始して約 2 ヶ月が経過し、基準価額は 10,534 円(2024 年 2 月 26 日時点)、純資産総額は約 45 億円となっており、順調な滑り出しを見せています。

■ 設定来の基準価額の推移 (2023 年 12 月 28 日～2024 年 2 月 26 日、日次)



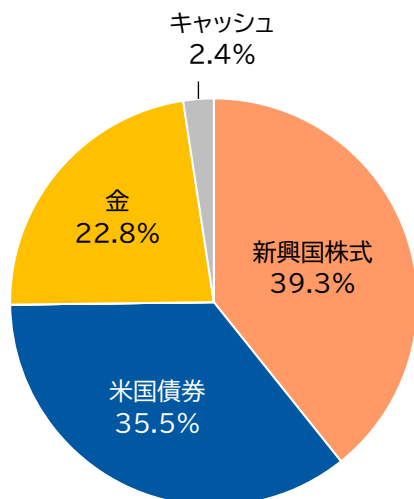
※基準価額は 1 万口当たり、作成基準日現在、年率 1.562% (税抜 1.42%) の信託報酬控除後です。

※グラフは過去の実績であり、将来の成果を示唆または保証するものではありません。

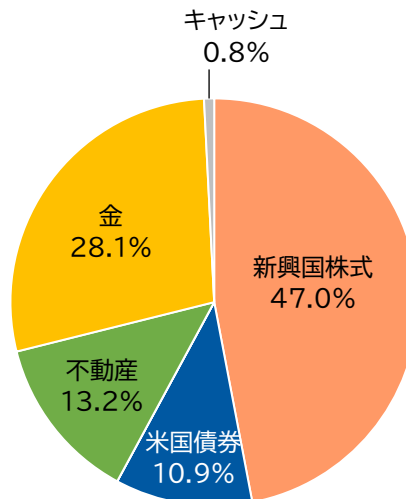
各投資対象資産への資産配分比率は、ファンド設定時から足元にかけて大きく変化しています。

■ 資産別構成比率

(2024 年 1 月 31 日時点)



(2024 年 2 月 13 日時点)



※各比率はマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※投資対象資産クラスおよび ETF は、作成基準日現在のものです。

当ファンドでは、マーケットデータ等を基にした AI の予測を活用しながら、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合理的判断により、資産配分比率の見直しを行っています。

なお、資産配分比率の見直しは原則として 1 ヶ月毎に行います。

今回 SBI 証券のインターネットコースでの取扱いが開始されることで、SBI 岡三アセットマネジメント、FOLIO、SBI 証券の SBI グループ 3 社が総力を結集した「ROBOPRO ファンド」を通じて、さらに多くの投資家の皆様にロボアド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。

■「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している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。

<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。
 - ファンドは、株式会社FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する助言を受けます。
- ※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。

- 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 各資産の配分にあたっては、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。

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。

<本資料で使用しているインデックス>

●MSCI オール・カンントリー・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。

■充実した情報開示



月次レポート(2024 年 1 月 31 日)

https://www.sbiokasan-am.co.jp/data/fund_pdf/monthly/m553175_20240131.pdf

<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。
