

ビッグデータ活用 日本中小型株式ファンド (愛称：B・D・F)

追加型投信／国内／株式



ビッグデータ*時代の到来



情報通信の発達により、私たちの身の回りの情報量は飛躍的に増加しています。

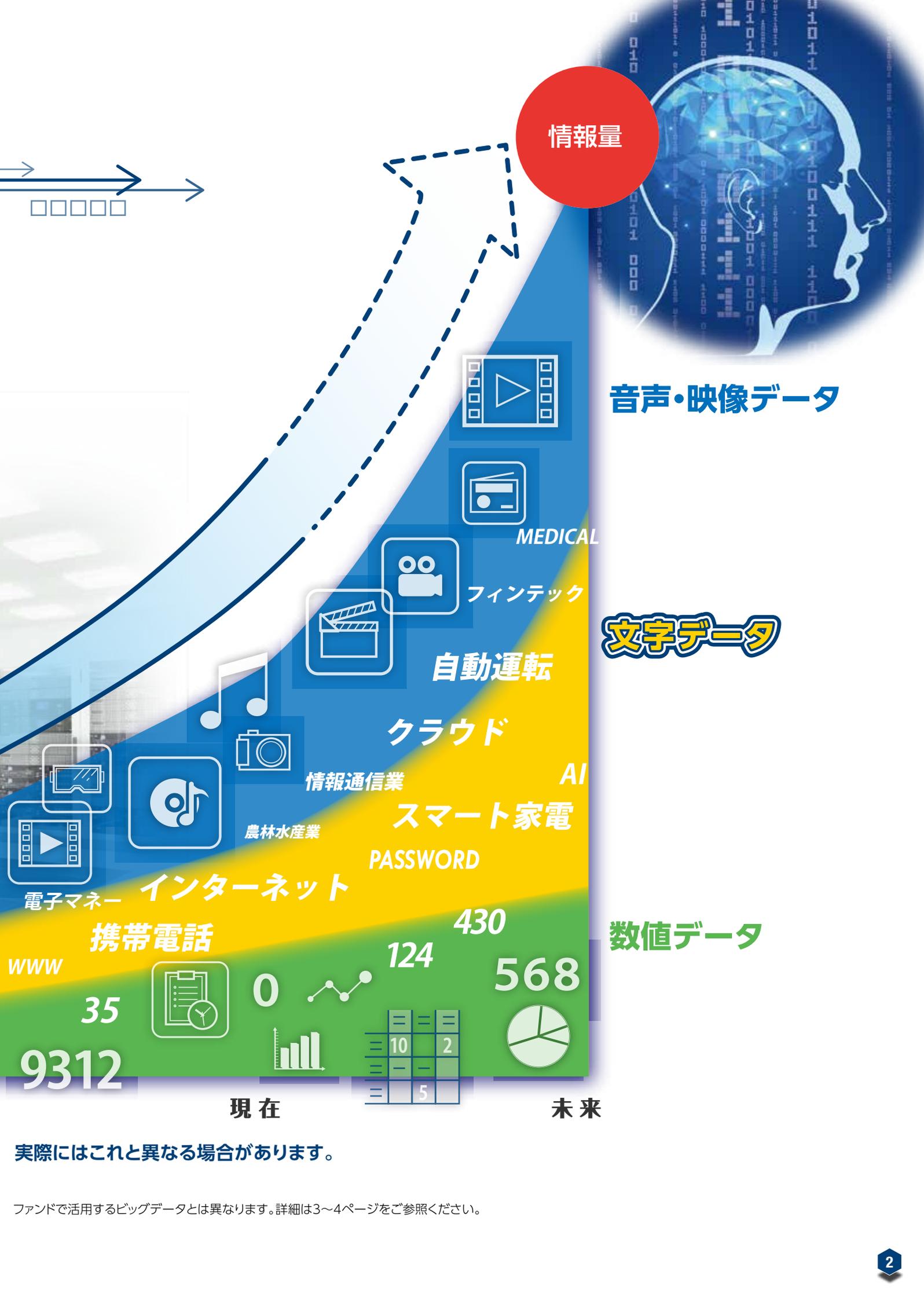
ブログやSNSなどのソーシャルメディアを通じて、企業業績・経済指標などの「**数値データ**」を上回る大量の「**文字データ**」や「**音声・映像データ**」などが発信され、その社会における影響度は高まっています。

しかし、私たちはそのほとんどを消化できずに日々見過ごしています。



上記はビッグデータ時代の到来のイメージであり、

*一般的に、従来のシステムでは処理することが困難な膨大・複雑なデータ群を指しています。このため、1~2ページで表示しているビッグデータの範囲は当



実際にはこれと異なる場合があります。

ファンドで活用するビッグデータとは異なります。詳細は3~4ページをご参照ください。



ビッグデータを活用した投資テーマ

ビッグデータ(企業関連のニュースなど)の集計・分析により投資テーマを選定戦略です。

ビッグデータを活用した新たな投資テーマの選定



新聞やインターネット上の企業関連のニュースなど

特定のキーワードが含まれるニュースの

登場件数などを集計・分析

**投資
テーマ群***

(経済情勢などにより変化)

*当ファンドでは、文字データの中でも新聞やインターネット上の企業関連のニュースを主に活用し、投資テーマ群の形成を行います。このため、原則

の選定 / 銘柄選択のイメージ

し、それに従来の株式調査を加えて銘柄選択を行う画期的な日本中小型株式

綿密な株式調査

ファンドマネジャー・調査アナリストなどがファンダメンタルズ分析などにより銘柄を評価

定性分析

経営戦略、差別化要因などの調査



定量分析

企業業績、市場規模などの調査



IoT※ (モノのインターネット)

※IoTとは、あらゆるものがインターネットにつながって相互に情報交換をする仕組みを指しています。



新素材



一億総活躍社会

投資魅力が
高いと考えられる
投資テーマ
および銘柄

情報セキュリティ



最先端医療



健康高齢者



など

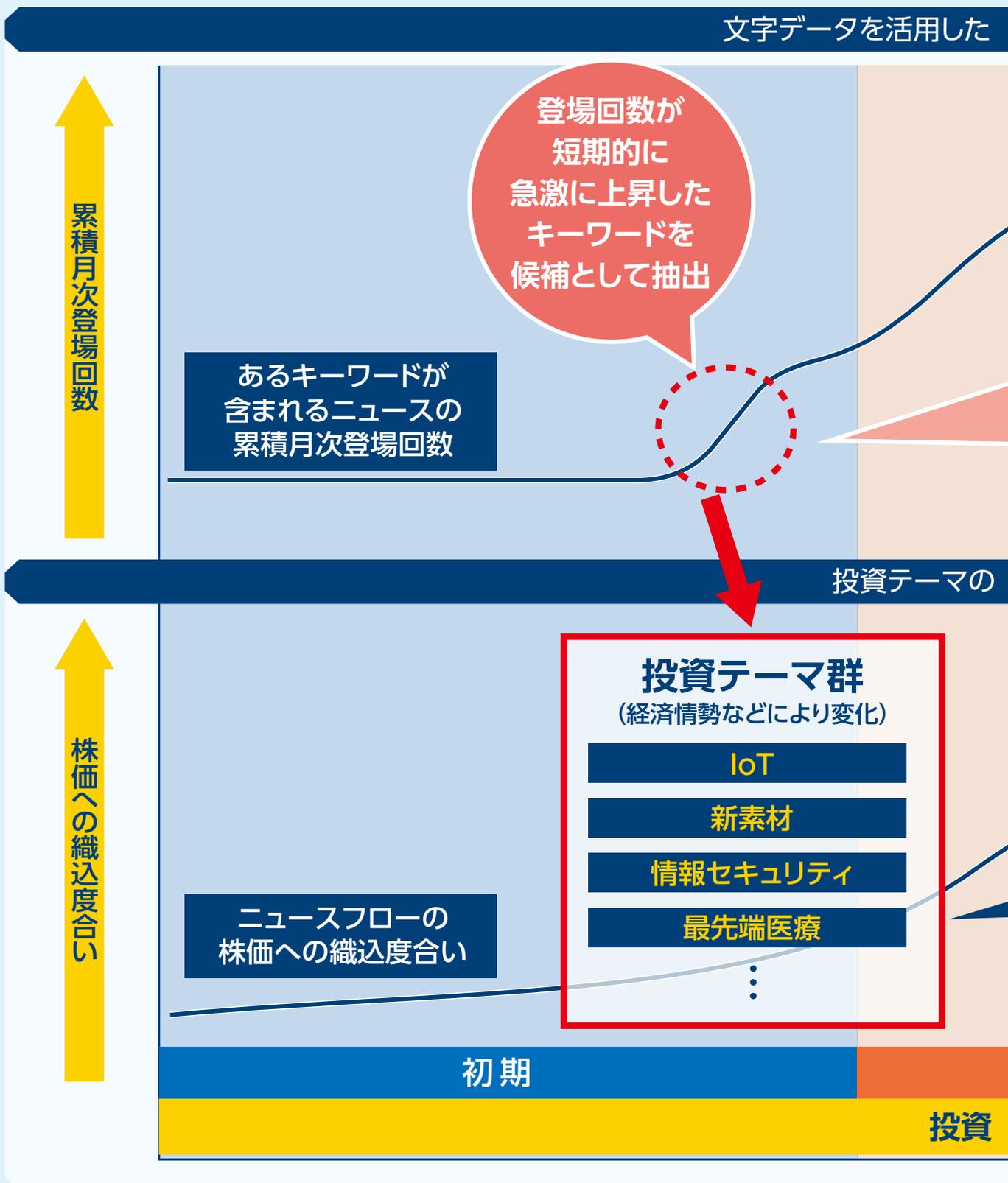
として、数値データ、音声・映像データは投資テーマの選定に活用しません。また、投資テーマはあくまでも例示であり、実際とは異なる場合があります。

異なる場合があります。また、今後予告なく変更される場合があります。



投資テーマの発展段階と当ファンドの

企業の株価にプラスとなるニュースが出ても株価が変動していなければ、ニュース当ファンドでは、ビッグデータの活用により**発展段階が初期から中期にある投資**また、当ファンドでは、選定された投資テーマが投資対象企業のコアビジネスとに特化した中小企業の株式を中心に投資することになります。



投資イメージ

フローが株価に十分に織り込まれないまま、割安な水準にある可能性があります。
テーマに関連する企業群を中心に組み入れます。
合致しているかを重視するため、多角化している大企業よりも、特定のビジネス

キーワードの抽出イメージ



発展段階 と株価への織込度合いの関係性のイメージ

発展段階が
初期から中期にある
投資テーマに関連する
企業群を中心に
組み入れ

中期

後期

テーマの発展段階

これと異なる場合があります。

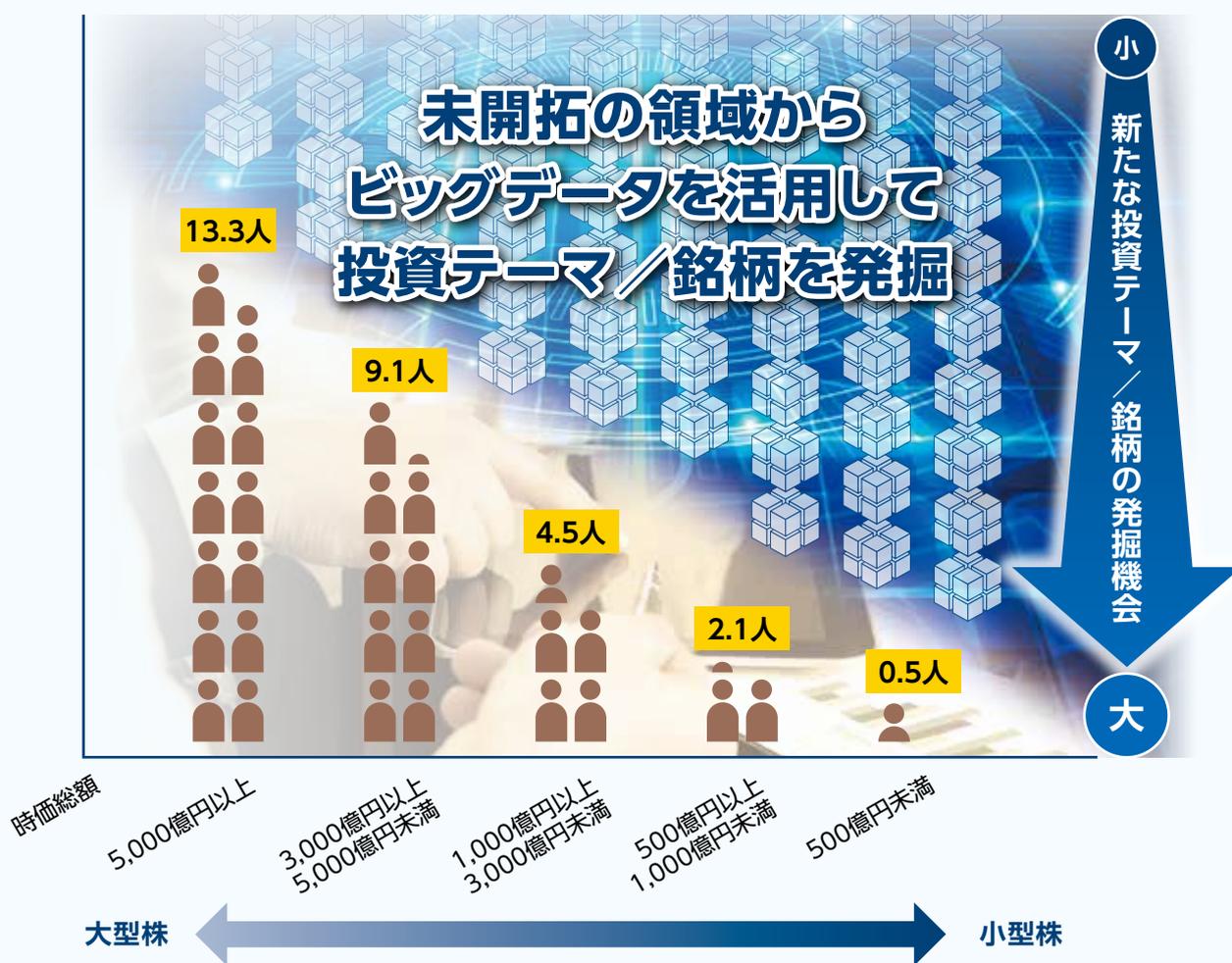


ビッグデータを活用するメリット

調査アナリストの時間やコストなどの制約から、株式時価総額が小さい企業ほど、調査されずに放置されている傾向が見られます。

ビッグデータの活用により、大量のニュースの中に埋もれ、見過ごされている有望な投資テーマに関連する企業を、「効率的」かつ「網羅的」に「いち早く」見つけ出すことが可能と考えられます。

1社あたりの調査アナリストの平均カバー人数と
新たな投資テーマ／銘柄の発掘イメージ



※平均カバー人数は、2016年9月末時点の東証1部の構成銘柄に基づき算出(2016年10月27日)しています。
出所:Quick、ブルームバーグのデータをもとにアセットマネジメントOne作成

上記はイメージ図であり、実際にはこれとは異なる場合があります。
また、上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

当資料は、アセットマネジメントOneが信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。
当資料の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。



ファンドの特色

1

主として、わが国の中小型株式に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目的として、積極的な運用を行います。

- ◆国内の金融商品取引所に上場する株式(上場予定を含みます。)*を主要投資対象とします。
*中小型株式以外の国内株式にも投資する場合があります。
- ◆株式の組入比率は、原則として高位を維持します。

2

ビッグデータの活用による投資テーマ選定とボトムアップアプローチによる銘柄選択を組み合わせ、ポートフォリオを構築します。

- ◆ニュースフロー等のビッグデータから抽出したキーワードをもとに、今後株式市場で拡大余地が大きいと考えられる投資テーマをトップダウンにより選定します。
- ◆選定した投資テーマをもとに、社内アナリストやファンドマネジャー独自のボトムアップリサーチを加味し、割安で成長期待の大きいと考えられる銘柄を中心に、ファンドマネジャーが投資魅力度の高いと考える銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。

3

運用にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の助言を活用します。

- ◆みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社より、ビッグデータ解析を活用した投資テーマや当該関連銘柄に関する助言を受けます。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社(FT社)について

- FT社は数理科学をベースとした総合リスク管理やデリバティブズおよび投資・運用手法などの金融技術の開発を総合的に行う会社です。

資産運用に関連した業務としては、先端的な金融工学技術を活用し、精緻なリスク制御手法に基づいて資産運用商品の開発、コンサルティング、投資助言などを行っています。

投資顧問契約数*:30 助言残高*:約1兆7,682億円

*顧客の資産の額を前提とした契約

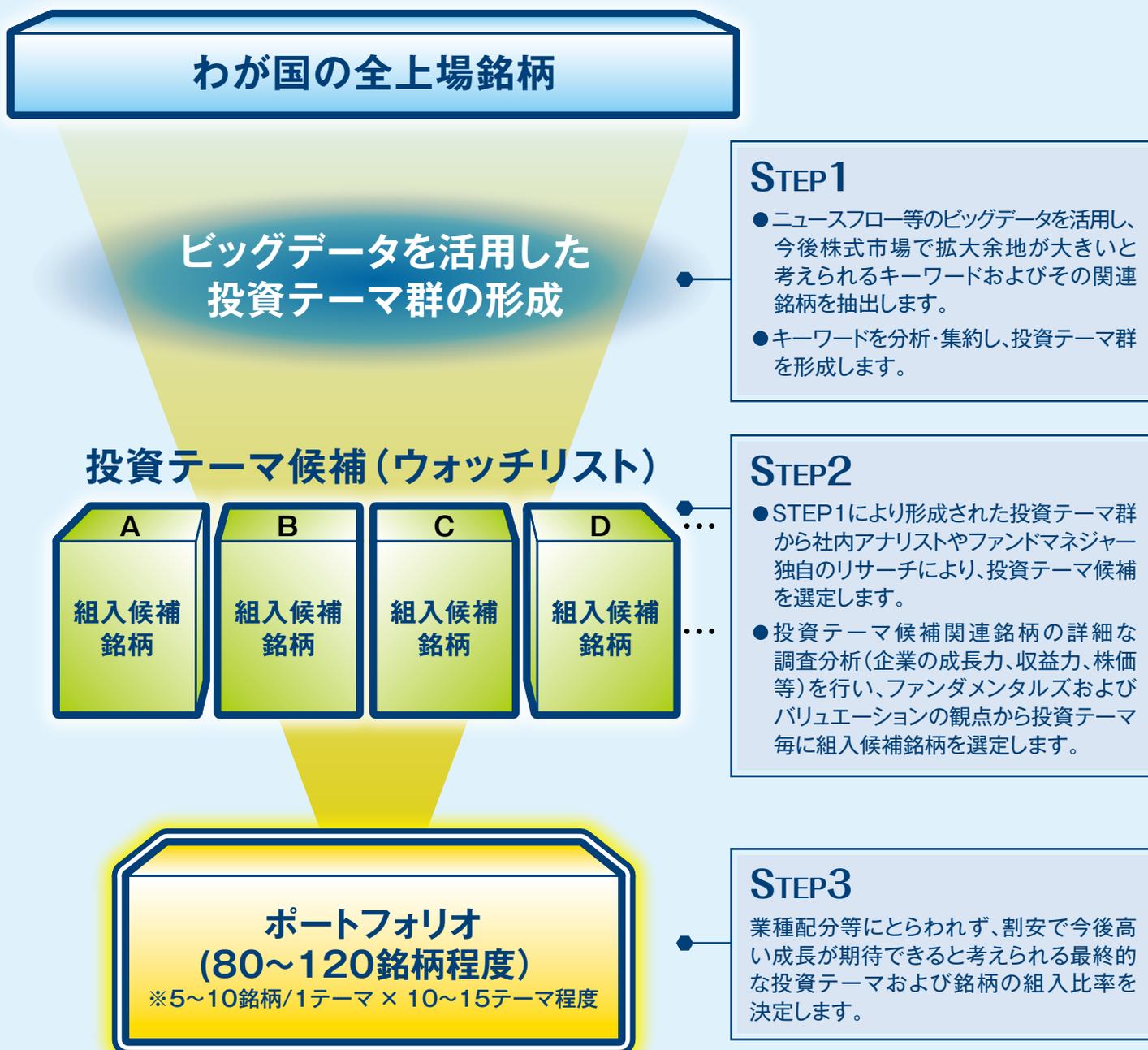
2016年3月末現在

出所:FT社の情報をもとにアセットマネジメントOne作成

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。



運用プロセス



※2016年11月末時点のものであり、今後変更される可能性があります。

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。



運用会社について

当ファンドの運用はアセットマネジメントOneが行います。

アセットマネジメントOneは、DIAMアセットマネジメント、みずほ投信投資顧問、新光投信およびみずほ信託銀行(資産運用部門)の4社が統合し、2016年10月に新会社として発足しました。

日本で最大の運用資産規模を誇る資産運用会社で、国内外のお客さまからお預かりしている運用資産総額は50兆円超にのびります。

国内系資産運用会社の運用資産残高ランキング

順位	社名	運用資産残高(単位:兆円)
1	アセットマネジメントOne	51.5(38.6)
2	野村アセットマネジメント	39.2(13.0)
3	大和証券投資信託委託	14.9(0.5)
4	日興アセットマネジメント	14.9(3.9)
5	三菱UFJ国際投信	12.6(0.4)
6	三井住友アセットマネジメント	12.0(6.5)
7	ニッセイアセットマネジメント	9.8(4.3)
8	三井住友トラスト・アセットマネジメント	8.2(0.0)
9	大和住銀投信投資顧問	6.1(2.8)
10	東京海上アセットマネジメント	6.0(4.2)

※2016年3月末時点、時価ベース。
 ※信託銀行を除きます。
 ※括弧内の数値は運用資産残高のうち、年金運用資産残高等を表しています。
 ※アセットマネジメントOneは、統合各社の2016年3月末時点の合算値。旧みずほ信託銀行の資産運用部門の年金信託等の運用資産残高を含んでいます。
 出所: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のデータをもとにアセットマネジメントOne作成

アセットマネジメントOneのグローバルネットワーク



※2016年12月1日時点





参考ポートフォリオのご紹介 (2016年)

参考ポートフォリオは、これから運用を開始する当ファンドのイメージをつかんでいただくためのものです。参考ポートフォリオは、当ファンドの運用方針に基づいて2016年11月末時点で作成したものです。実際のポートフォリオや運用実績ではありませんのであくまでご参考としてお考えください。特定の銘柄の推奨を目的としたものではありません。また将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。

組入上位10業種

順位	業種	2016年11月末現在
		組入比率(%)
1	情報・通信業	28.6
2	サービス業	11.3
3	電気機器	9.5
4	機械	9.2
5	食料品	6.6
6	医薬品	4.8
7	小売業	4.6
8	化学	4.4
9	ガラス・土石製品	4.3
10	建設業	3.4

※組入比率は、参考ポートフォリオ全体を100%として算出しています。
※業種は東証33業種分類によるものです。

個別銘柄のご紹介



IoT(モノのインターネット)に着目した銘柄例:ダイドードリンコ(業種:食料品)

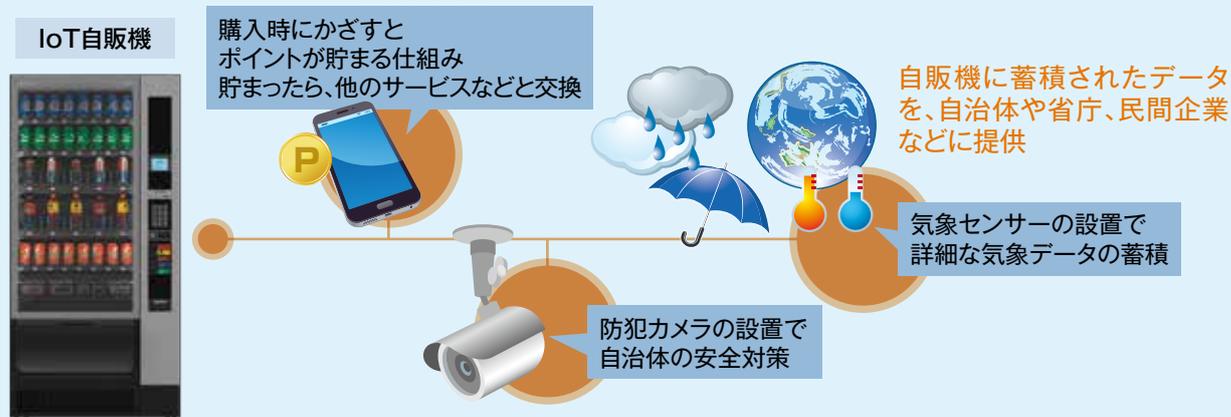
事業内容

主力ブランドである缶コーヒーの「ダイドーブренд」を筆頭に、自販機などで飲料を販売している飲料販売会社。全国に約28万台の自販機を保有しており、飲料業界でのシェアは第3位。

ポイント

自販機がインターネット機能を備えることで、スマートフォンと連携したサービスが利用者の集客に繋がるだけでなく、自販機で収集されたデータを活用したマーケティングの強化や、データ販売による新たな収益源の獲得機会を生み出すことが考えられます。

意外と知られていないIoT活用事例



出所：各種資料をもとにアセットマネジメントOne作成

上記の個別銘柄はあくまでも一例であり、当ファンドへの組入れを示唆・保証する

上記は過去の情報であり、将来の運用



仮想現実 (VR) に着目した銘柄例: ソニー (業種: 電気機器)

事業内容

家庭用ゲーム機や音楽プレイヤー、携帯電話端末や半導体を提供する総合電機メーカー。仮想現実 (VR) 関連では、子会社が家庭用ゲーム機PlayStation 4 (PS4) 向けのVR機器『PlayStation VR』(PS VR)を発売、既存ユーザー層向けに多くのコンテンツを開発。

ポイント

コンピュータが作り出した仮想世界を現実の様に疑似体験できる仮想現実 (VR) の技術により、これまでとは全く異なるレベルの臨場感で楽しめるゲーム体験を提供しています。また、PS VRと組み合わせて使用するPS4の販売拡大も期待されています。

仮想現実 (VR) とは



ゲームの世界の中に自分が実際に存在しているかのようなリアルな体験が可能

© Sony Interactive Entertainment Inc. All rights reserved.
Design and specifications are subject to change without notice.

出所：各種資料をもとにアセットマネジメントOne作成



一億総活躍社会に着目した銘柄例: アトラ (業種: サービス業)

事業内容

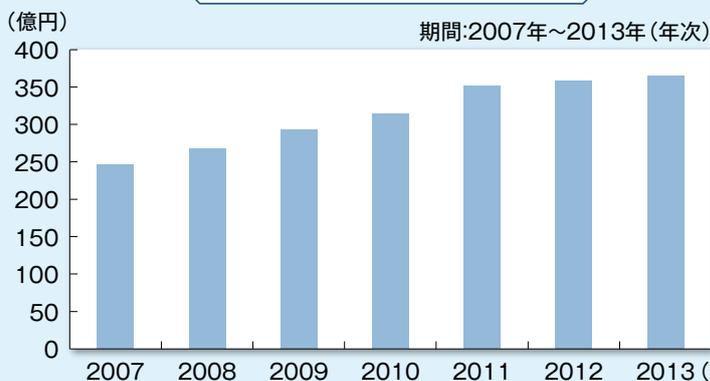
全国に70以上の店舗を持つ鍼灸接骨サービス「ほねつぎ」をチェーン展開するほか、事務代行サービス、研修事業、予約システムなどの関連サービスを提供。「ほねつぎ」をチェーン運営する店舗へ向け、効率化のための事務やIT、研修サービスを提供することにより、加盟店の収益を改善させながら同社の収益性を高める。

ポイント

日本政府が掲げる一億総活躍社会の実現が進むことで、今後より多くの労働力活用が見込まれます。これに伴い、仕事で疲れた時に癒しを求める労働者の増加が予想され、その需要を満たすことができるサービスとして、伝統的な治療法である鍼灸の拡大が期待されています。

高まる鍼灸サービスへの需要

鍼灸に係る療養費の推移



鍼灸に係る療養費は増加傾向



出所：厚生労働省のデータ、各種資料をもとにアセットマネジメントOne作成

ものではありません。また掲載した個別銘柄の売買を推奨するものではありません。

成果等を示唆・保証するものではありません。

を保証するものではありません。当資料の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。



ファンドのリスク

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き等により影響を受けますが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因 ※基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

株価変動リスク	当ファンドは、株式に投資をします。株式市場の変動により基準価額が上下します。また、中小型株式は株式市場全体の動きと比較して株価が大きく変動する場合があります。当ファンドの基準価額に影響を与える可能性があります。なお、当ファンドでは業種配分等にとらわれず投資テーマ・銘柄を選定するため、株式市場全体の値動きと基準価額の値動きは大きく異なることがあります。
個別銘柄選択リスク	当ファンドは、個別銘柄の選択による投資を行います。株式市場全体の動向から乖離することがあり、株式市場が上昇する場合でも当ファンドの基準価額は下がる場合があります。
流動性リスク	当ファンドにおいて有価証券等を売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなること、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。
信用リスク	当ファンドが投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

分配方針

●年1回の決算日(毎年1月22日(休業日の場合は翌営業日))において、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

分配金に関する留意点

●収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

●受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

●分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

投資信託ご購入の注意

投資信託は、

- (1) 預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- (2) 購入金額については、元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- (3) 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

■当資料はアセットマネジメントOne株式会社が作成した販売用資料です。当ファンドのお申込みに際しては、販売会社からお渡しする投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。

お申込みメモ(ご購入の際は、投資信託説明書(交付目論見書)をご確認ください。)

■ 購入の申込期間

当初申込期間:2017年1月11日~2017年1月30日
継続申込期間:2017年1月31日以降

■ 購入単位 (当初元本1口=1円)

販売会社が定める単位
※「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみのお取扱となります。購入単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

■ 購入価額

当初申込期間:1口=1円
継続申込期間:購入申込日の基準価額

■ 換金単位

販売会社が定める単位

■ 換金価額

換金申込日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額

■ 換金代金

原則として換金申込日から起算して5営業日目からお支払いします。

■ 申込制限

大口の換金請求に制限を設ける場合や、購入、換金の受付を中止する場合等があります。

■ 信託期間

2022年1月24日までです。(当初設定日:2017年1月31日)

■ 繰上償還

受益権口数が10億口を下回ることとなった場合等には、償還することがあります。

■ 決算日

原則として毎年1月22日(休業日の場合には翌営業日)

■ 収益分配

毎決算時に収益分配方針に基づき、収益分配を行います。「分配金受取コース」原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。「分配金自動けいぞく投資コース」税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。※分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

■ 課税関係

◆当ファンドは課税上は株式投資信託として取り扱われます。原則として、分配時の普通分配金ならびに換金時の値上がり益および償還時の償還差益に対して課税されます。※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。※税法が改正された場合等には、上記内容が変更となる場合があります。

■ お客さまにご負担いただく手数料等について

下記手数料等の合計額等については、保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。詳細については、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

● ご購入時

■ 購入時手数料

購入価額に3.24%(税抜3.0%)を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。※くわしくは販売会社にお問い合わせください。

● ご換金時

■ 換金手数料

ありません。

■ 信託財産留保額

換金申込日の基準価額に0.3%を乗じて得た額とします。

※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となる場合があります。

● 保有期間中(信託財産から間接的にご負担いただきます。)

■ 運用管理費用(信託報酬)

信託財産の純資産総額に対して年率1.6632%(税抜1.54%)を日々ご負担いただきます。

■ その他費用・手数料

組入価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用等が信託財産から支払われます。(その他費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。)

委託会社その他関係法人の概要

- 委託会社 アセットマネジメントOne株式会社
信託財産の運用指図等を行います。
- 受託会社 みずほ信託銀行株式会社
信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、受託会社は信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
- 販売会社 募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

照会先

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時から午後5時
・ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

お申込みに当たっては、販売会社からお渡する投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください。

■ 投資信託説明書(目論見書)のご請求・お申込みは

■ 設定・運用は



池田泉州TT証券

S I H D



アセットマネジメントOne

商号等 / 池田泉州TT証券株式会社
金融商品取引業者 近畿財務局長(金商)第370号
加入協会 / 日本証券業協会

商号等 / アセットマネジメントOne株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第324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