

2019年9月27日

プレスリリース

日興アセットマネジメント株式会社

ビッグデータ運用でこれまで難しかった新興国の小型株投資への扉を開く

## 「ビッグデータ新興国小型株ファンド(1年決算型)」を設定

～ 岡三証券が10月15日取り扱い開始 ～

日興アセットマネジメント株式会社(以下、「日興アセット」)は、主に新興国の小型株に投資する追加型投信「ビッグデータ新興国小型株ファンド(1年決算型)」を10月31日に設定、運用を開始します。岡三証券株式会社が10月15日から取り扱いを開始します。

「ビッグデータ新興国小型株ファンド(1年決算型)」は、主として新興国の小型株式に投資し、実質的な運用はビッグデータを活用した計量モデル運用に強みを持つアクサ・インベストメント・マネージャーズが行ないます。原則として為替ヘッジは行ないません。

新興国は先進国を上回る経済成長を続け、その存在感を高めています。成長の原動力を外需から内需へと広げながら、産業構造を変化させており、活躍する企業も大型企業から中小型企业へと広がりを見せています。

ただ、新興国の小型株は魅力的な投資対象と考えられるものの、国・地域や調査対象企業が広範囲に及び、情報量も少なく、国ごとに異なるビジネス風土の多様性などもあって、すべての国や企業をアナリストが調査することは極めて困難です。そのため、先進国株式や新興国の大型株などに比べて十分な調査が行われず、投資対象が一部の銘柄に偏ってしまったり、有望な成長銘柄が見過ごされてしまっているケースが数多くみられます。

当ファンドでは、ファンダメンタルズに関するビッグデータを活用することにより、従来なら不可能だった領域まで幅広く分析対象範囲を拡大して、これまで見過ごされてきた新興国小型株の新たな投資機会を追求します。

実質的な運用を行うアクサ・インベストメント・マネージャーズは、世界最大級の保険・資産運用グループであるアクサ・グループの資産運用部門です。同社のローゼンバーグ株式チームは、膨大なビッグデータを最大限に活用したシステム運用を行っている、ビッグデータ運用の先駆的存在です。当ファンドの運用にあたっては、約5,500銘柄の新興国小型株をカバーし、個々の企業の200超に及ぶ財務項目を分析します。

日興アセットは今後も、質の高い商品の開発と優れた運用パフォーマンスのご提供に努めてまいります。

以上

## ■手数料等の概要

投資者の皆様には、以下の費用をご負担いただきます。

### <申込時、換金時にご負担いただく費用>

- 購入時手数料： 購入時の基準価額に対し 3.3%(税抜 3%)以内  
※購入時手数料は販売会社が定めます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
※収益分配金の再投資により取得する口数については、購入時手数料はかかりません。
- 換金手数料： ありません。
- 信託財産留保額： ありません。

### <信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用>

- 運用管理費用(信託報酬)：純資産総額に対し年率 1.892%(税抜 1.72%)程度が実質的な信託報酬となります。
- その他の費用・手数料：目論見書などの作成・交付および計理等の業務に係る費用(業務委託する場合の委託費用を含みます。)、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率 0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限とする額が信託財産から支払われます。  
組入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息および立替金の利息などが、その都度、信託財産から支払われます。  
※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。

※投資者の皆様にご負担いただくファンドの費用などの合計額については、保有期間や運用の状況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。

※詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

## ■リスク情報

投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

【価格変動リスク】【流動性リスク】【信用リスク】【為替変動リスク】【カントリーリスク】

※ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## ■その他の留意事項

- 当資料は、投資者の皆様にご理解を高めることを目的として、日興アセットマネジメントが作成した資料です。
- 当ファンドをお申込みの際には、投資信託説明書(交付目論見書)などを販売会社よりお渡ししますので、内容を必ずご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。

## 日興アセットマネジメントについて

日興アセットマネジメントは、日本そしてアジアを代表する資産運用会社です。株式、債券、オルタナティブ、マルチアセットなど多様な資産クラスを対象とするアクティブ運用や ETF(上場投資信託)を含むパッシブ運用など、革新的な投資ソリューションを提供しています。

55年を超える実績を誇り、30以上の国・地域から集まる人材を世界11カ国・地域に擁して、約200名の運用プロフェッショナルが約24.1兆円の資産を運用しています。グローバルな視点を活かし、お客様のニーズにお応えする様々な商品の開発を推進するとともに、優れた運用パフォーマンスの実現を常に追求しています。銀行などの金融機関、証券会社、生命保険・損害保険、ファイナンシャルアドバイザーなど、国内外の計300社超の販売ネットワークを通じ、個人投資家の皆様や年金基金や金融機関など世界中の機関投資家のお客様に対して幅広いサービスを提供しています。

詳しくは、日興アセットマネジメントの [HP](#) をご覧ください。

\* 日興アセットマネジメント株式会社および連結子会社の役社員を含む。

\*\* 日興アセットマネジメント株式会社および海外子会社の連結運用資産残高(投資助言を含む)の2019年6月末現在のデータ。

### 日興アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第368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