

ブラックロック・ジャパン株式会社

ブラックロック・米国小型株式ビッグデータ戦略ファンドを設定 ビッグデータの分析を運用に活用し、広範な投資機会の発掘を目指す

2017年4月21日（東京） - ブラックロック・ジャパン株式会社（本社東京、代表取締役会長 CEO 井澤吉幸）は、ビッグデータの分析を運用に活用した追加型投信、ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド（為替ヘッジあり/ 為替ヘッジなし）を2017年5月22日に設定予定です。販売会社は野村証券株式会社で、当初申込期間は2017年5月8日から5月19日です。

当投資信託は主として米国の小型株式に投資します。米国の小型株は、大型株と比較して米国内での事業割合が高い企業が多く、好調な米国経済の恩恵を受けやすいと考えられます。また、米国小型株は相対的に上場銘柄数が多い一方で投資に関する情報は少ない傾向にあります。

ブラックロックが約30年にわたり培ってきた計量運用戦略を活用し、運用を行います。米国小型株市場における広範な銘柄の投資機会にビッグデータ戦略を適用し、銘柄評価の一部に人工知能も活用することで、多くの投資家に見過ごされている投資機会の発掘を目指します。

米国には小型株式が約3,350銘柄上場されていますが、その中から市場での流動性等を考慮した約2,500銘柄を投資候補ユニバースとします。計量運用モデルは、投資ユニバースに関連する情報を取り込んだ上で、投資魅力度を分析し、250-500銘柄の最適なポートフォリオを算出します。最終的に運用担当者が計量運用モデルの算出結果の妥当性を検証し、実際のポートフォリオ構築を行います。なお投資魅力度分析にあたっては、企業の決算発表など一般的な投資関連情報だけでなく、ソーシャルメディア、インターネット検索データ、クレジットカード決済データなど、数値化されていないビッグデータ等の情報も活用します。また、膨大なビッグデータを分析する際は、人工知能など、最先端のテクノロジーも活用します。¹

ブラックロック・ジャパンの浜田直之取締役リテール営業部門長は次のように述べています。「米国の小型株は、銘柄数の多さに比し投資情報が少ないことを背景に、優良な銘柄が投資されないまま放置されているケースが多いと言われており、そうした情報の非効率性が高いと考えられる市場では、ビッグデータの分析を用いた運用が有効であると考えられます。ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンドは、ブラックロックが誇る最先端のテクノロジーを駆使して、膨大な情報をいち早く入手するとともに、様々な観点から多面的に銘柄を評価・分析し、投資機会の発掘を目指すものです。世界最先端の運用ソリューションを活用し、投資家の皆様の資産形成のニーズにお応えできるよう、尽力してまいります」。

¹ 銘柄の投資魅力度分析は、人工知能のみによって決定されるものではありません。

以上

本資料に関するご留意事項

本資料は、報道機関向けのプレスリリースとして作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。また、投資勧誘を目的として作成したものではありません。本資料は、信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。

投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客さまに帰属します。投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。投資信託の取得のお申込みを行う場合は、最新の投資信託説明書（交付目論見書）の内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。投資信託説明書（交付目論見書）につきましては、販売会社にご請求ください。

ブラックロックについて

ブラックロックは、グローバルに資産運用、リスク・マネジメント、アドバイザー・サービスを提供している世界有数の資産運用会社です。2017年3月31日現在、運用資産残高はグループ全体で総額約5.4兆米ドル（約604兆円）にのぼります。ブラックロックでは、お客様のニーズに応じて、アクティブ、エンハンスド、インデックス等の戦略を駆使して市場や資産クラスを跨いだ様々な運用サービス及び商品をご提供しています。そうした運用サービスや商品は、投資一任口座、 뮤チュアル・ファンド、iShares® ETF（上場投資信託）等、多様なスキームで運営されます。また、ブラックロックは、ブラックロック・ソリューションズ®を通じて、リスク・マネジメント、アドバイザー・サービス、全社的資産運用プラットフォーム提供サービスを機関投資家にご提供しています。ブラックロックは、ニューヨークを本拠として北米、南米、欧州、アジア、オーストラリア、中東、アフリカ等、世界30カ国以上の拠点と従業員約13,000名で事業を展開しています。詳細は、ブラックロックのグローバルウェブサイトをご覧ください。 www.blackrock.com

ブラックロック・ジャパン株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第375号

加入協会 / 一般社団法人 日本投資顧問業協会、一般社団法人 投資信託協会、日本証券業協会、一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

ホームページ www.blackrock.com/jp/

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号 丸の内トラストタワー本館

Tel. 03-6703-4100（代表）