

ブラックロック・ジャパン株式会社

## ブラックロック、安定的で効率的なリターンを追求する ブラックロック・ベストバランス戦略ファンドを設定 各資産の価格変動要因に着目した、新しい運用戦略

2017年12月27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、世界の株式、債券および不動産等のマルチアセットに投資する追加型投資信託、ブラックロック・ベストバランス戦略ファンドを2018年1月29日に設定予定です。販売会社は静銀ティーエム証券株式会社で、当初申込期間は2018年1月15日から1月26日です。

当ファンドは資産価格の動きに影響を与えるファクター（要因）、なかでもマクロファクターに着目した新しいコンセプトの運用戦略に基づいて運用されます。資産価格の変動には一定のファクターが影響しているとされ、学術的にも有効であると考えられています。マクロファクターは経済成長、クレジット、新興国、流動性、実質金利、インフレの6つに分類され、資産における価格変動の約90%がこの要因で説明できるとブラックロックは考えています。

一般的なバランス型の運用では、投資する資産に着目し、株式や債券をはじめとする多様な資産に分散投資することで価格変動リスクを抑制しますが、当ファンドでは、各資産が内包するマクロファクターのバランスを考慮したポートフォリオ構築、価格変動要因の分散により、長期的に安定したリターンの獲得を目指します。当ファンドの運用はブラックロック・ジャパンのマルチアセット運用部門が担当します。運用においては、先進的な手法で資産価格の変動要因を研究し運用に活用するファクター投資戦略チームが算出した6つのマクロファクターの投資配分モデルを用い、各資産の配分を決定します。さらに、リスク水準を一定の範囲内にコントロールしつつ市場の混乱時には現金等への投資配分比率を増やすことで、リスクの抑制を図ります。なお、当該ファンドはマザーファンドを通じて外貨建てETFに投資を行いますが、当該ETFの基準通貨に対して対円の為替ヘッジを行うことで、為替変動リスクの低減を図ります。

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。「ブラックロックはファクター投資のパイオニアであり、テクノロジーを駆使したデータ活用によってこの分野を牽引してきました。当ファンドは、多様な資産への分散投資ではなく、マクロファクターのバランスを考慮してポートフォリオを構築する戦略に基づいています。自社が運用するETFを活用することにより、他のバランスファンドよりも比較的lowコストでの運用を実現しています。世界の株式、債券、不動産に投資するブラックロック・ベストバランス戦略ファンドは、長期運用に適した新しいタイプのバランスファンドとして、投資家の皆様の将来の資産形成のニーズにお応えできるものと確信しています」。

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ございません。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**

ブラックロックの使命は、お客様のより良い将来に向けた経済的基盤を創造することです。お客様の資金を預かり運用するフィデューシャリーとして、お客様の目標実現に必要な運用およびテクノロジー・ソリューションを提供しています。2017年9月30日現在、運用資産残高はグループ全体で総額 5.97 兆米ドル（約 673 兆円）にのぼります。詳細は、ブラックロックのグローバルウェブサイト（[www.blackrock.com](http://www.blackrock.com)）および日本ウェブサイト（<https://www.blackrock.com/jp>）をご覧ください。

**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/](http://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）