

2025 年 1 月吉日

各位

SBI 岡三アセットマネジメント株式会社
株式会社 FOLIO

AI を活用した相場予測で好パフォーマンスを目指す公募投資信託 「ROBOPRO ファンド」が純資産総額 300 億円を突破

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」)」が 2025 年 1 月 21 日、運用開始以来約 12 ヶ月半で純資産総額 300 億円を超えることとなりましたのでお知らせいたします。昨年 11 月 7 日に純資産総額 200 億円を突破してから約 2 ヶ月半での 300 億円到達となりました。

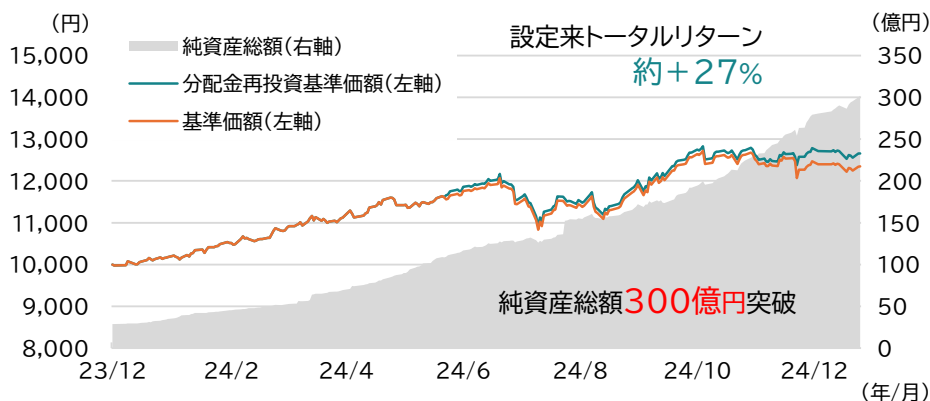
当ファンドは、株式会社 FOLIO ホールディングスの子会社である株式会社 FOLIO (本社:東京都千代田区、代表取締役:四元盛文、以下「FOLIO」)が「ROBOPRO」の運用戦略に基づいて投資助言を行い、高パフォーマンスの獲得と魅力ある商品開発でチャレンジを続ける SBI 岡三アセットマネジメントが運用を行っています。

その結果、当ファンドは 2025 年 1 月 21 日時点で分配金お支払い後の基準価額 12,344 円、純資産総額 301 億円と好調なパフォーマンスを見せています。(分配金設定来合計 300 円お支払い)

当ファンドは新 NISA(成長投資枠)に対応しており、投資信託として多くの投資家の皆さまに「ROBOPRO」の運用戦略を享受していただけているものと考えています。

販売取扱い会社は証券会社 12 社、銀行 9 行に拡大するなど(2025 年 1 月 21 日時点、予定含む)、大きな注目を集めており、SBI 岡三アセットマネジメントと FOLIO は、引き続き相場対応力の高い「AI 投資」を実現させ、これからもより多くの皆さまの資産形成に貢献してまいります。

■ 設定来の基準価額の推移 (2023 年 12 月 28 日~2025 年 1 月 21 日、日次)



※基準価額は 1 万口当たり、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、将来の運用成果を示唆または保証するものではありません。

■「ROBOPRO ファンド」の特徴

当ファンドは、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
 不動産:i シェアーズ米国不動産 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
 金:SPDR® Gold MiniShares Trust 新興国債券:i シェアーズ JP モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券 ETF

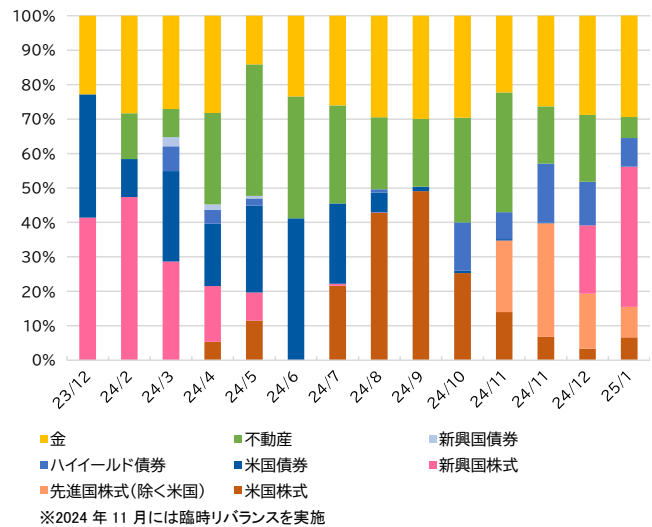
※2024 年 12 月末時点の投資対象を記載しています。特定銘柄の推奨および将来の組入れを保証するものではありません。



■ROBOPRO ファンドはダイナミックなリバランスで好パフォーマンスの獲得を目指します

右図は ROBOPRO ファンド設定(2023 年 12 月)以降の月次リバランスおよび臨時リバランス時における投資対象資産の組入比率の推移です(2023 年 12 月データは設定時、初回リバランスは 2024 年 2 月)。

ROBOPRO ファンドは AI による相場予測に基づき、非常に機動的かつ大胆に投資対象資産の組入比率を変動させております。この点が他のバランス型ファンドとの大きな違いであり、好パフォーマンス獲得の源泉となっています。また、このような相場状況に応じた機動的な投資配分の変更とバランス型ファンド本来の分散投資の効果を発揮した結果、最大ドローダウンの抑制、リスク・リターン特性に優れた運用を実現しています。



	ROBOPROファンド	世界株式指数	S&P500種指数
年率リターン	★ 24.8%	28.8%	★ 36.0%
年率リスク	★ 11.6%	15.0%	17.3%
リターン/リスク	★ 2.13	1.92	2.08
最大ドローダウン	★ -10.2%	-17.1%	-17.4%

※期間:2023 年 12 月 28 日~2025 年 1 月 15 日

※ROBORPO ファンド:分配金再投資基準価額、世界株式指数:MSCI ACWI Gross Total Return USD Index(円換算)、S&P500 種指数:トータルリターン(円換算ベース)
 ※市場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。グラフは過去の実績であり、将来の運用成果を示唆または保証するものではありません。

■「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^(注)に分散投資します。

(注)コモディティへの投資は当面、金を対象としますが今後変更になる場合があります。

<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>

世界株式:MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(配当込み)

●MSCI指数は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



リバランスレポート(2025年1月16日)

<https://www.sbiokasan-am.co.jp/data/news/4632/report.pdf>

*リバランスレポートで毎月の資産配分変更について詳しく解説しています。

<金融商品取引法等に係る表示>

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(第一種金融商品取引業、投資助言・代理業、投資運用業)
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

本プレスリリースに関する報道機関からの問い合わせ先

SBI 岡三アセットマネジメント株式会社
投信マーケティング部 03-3516-1296

株式会社 FOLIO
広報担当: E-mail: folio-pr@folio-sec.com



SBI 岡三アセットマネジメントの企業理念

Challenge&Uniqueness

～資産運用の未来に貢献し、お客さまの期待をこえてゆく～

SBI岡三アセットマネジメントはお客様の大事な資産運用をサポートします。

SBI岡三アセットマネジメント株式会社は、SBIホールディングス株式会社の連結子会社です。