Press Release

各位

三菱 UFJ国 際 投 信 株 式 会 社 東京都千代田区有楽町一丁目 12番 1号 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 404号 加入協会 -般社団法人投資信託協会、-般社団法人日本投資顧問業協会

『AI日本株式オープン(絶対収益追求型)〈愛称:日本AI〉』募集・設定について

追加型投信/国内/株式/特殊型(絶対収益追求型)

١J٥

この度、三菱UFJ国際投信は、『AI日本株式オープン(絶対収益追求型)〈愛称:日本AI〉』を新規に設定いたしますので、お知らせいたします。

当ファンドは、AI等を活用したモデルを用いる2つの運用戦略、株式個別銘柄戦略と先物アロケーション戦略を組み合わせることで、絶対収益の追求を目指します。

	商品分類			
	単位型・ 追加型	投資対象 地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
ì	追加型	国内	株式	特殊型 (絶対収益追求型)

属性区分				
投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	特殊型
その他資産	年2回	日本	ファミリー ファンド	絶対収益追求型

[※]属性区分の「投資対象資産」に記載されている「その他資産」とは、投資信託証券(株式 一般)です。

[※]商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(http://www.toushin.or.jp/)でご覧いただけます。

もう迷わない、AI

AIとは人工知能のことです。

人は脳で物事を認識し、分析し、 その結果を行動に反映させます。

ところが、

人の行動は情報が多くなることで迷いが生じ、 行動するタイミングが遅れてしまうこと等があります。

一方、

AIは膨大な情報を短時間で分析し「最適解」を生み出すので、 迷うことなくタイムリーに行動することが、まさに得意です。

さらにAIは人が育つのと同じように AI自身が新たな情報を吸収して 日々成長していきます。

今回ご用意したファンドは、 人とAIが協力し、ポートフォリオを決定する 絶対収益追求型の投資信託です。

安定的な運用成果を期待して 債券を中心に投資を行っている方等は、 株式への投資を敬遠されることもあると思います。

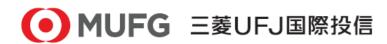
しかし、

株式を投資対象としている投資信託の中でも、 AIを用いた絶対収益追求型である当ファンドは、 そんな方にお勧めしたい商品の一つです。

あなたの資産運用の一つとして、 先進的であり、情報の網羅性を追求している Alを活用した投資信託を検討してみてはいかがでしょうか。

2017年1月

三菱UFJ国際投信



ファンドの目的・特色

ファンドの目的

わが国の株式に投資を行うと同時に株価指数先物取引等を行い、特定の市場に左右されることなく収益の獲得をめざします。

ファンドの特色



AI等を活用した投資助言を基に運用を行います。

- ◆ ファンドの運用は三菱UFJ信託銀行から投資助言を受け行います。
- ◆ AI等を活用したモデルの開発は三菱UFJ信託銀行及び三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC) が 行います。
- ◆ 三菱UFJ信託銀行は、国内有数の資産運用会社の一つです。
- ◆ MTECは、日本を代表する最先端の金融工学研究所です。

AIとは

AI(人工知能)とは、Artificial Intelligenceの略で、

「見る・聞く・話す・考える・学ぶ」等の人間が行う知的な作業をコンピュータを 用いて模倣したソフトウェアやシステムのことです。

情報処理能力の著しい進化やネットワーク環境の高速化によって、リアルタイム に日々蓄積された大量かつ多種多様なデータ (いわゆる、ビッグデータ) が普及 しました。

このような環境面が整備されたことで、AI技術の発展と実用化が期待されています。





株式個別銘柄戦略と先物アロケーション戦略の2つを組み合わせることで、絶対収益の追求をめざします。

絶対収益追求とは

特定の市場の動向に左右されにくい収益の追求をめざすことをいいます。必ず収益を得られることを意味するものではありません。

◆株式個別銘柄戦略では、わが国の株式への投資に加え株価指数先物を売建てることで収益の獲得をめざします。

株式の組入比率は株価指数先物取引にかかる証拠金の水準や株式の投資銘柄選択の結果等を勘案し決定されます。また、組入株式における株式市場に対する感応度を排除できると考える量の株価指数 先物の売建てを行うことを基本とします。

◆ 先物アロケーション戦略では、株式相場が上昇局面であると判断した場合に、株価指数先物の売建ての量を減らすことで実質株式組入比率を引き上げることを基本とし、株式相場の上昇による収益も一部獲得することをめざします。なお、株価指数先物の売建ての量の減少は、組入株式における株式市場に対する感応度の半分程度を限度とします。

運用プロセスのイメージ (2016年11月末現在)

三菱UFJ信託銀行



MTEC

AI等の研究 AI等の改良、新規AI等の開発等

モデルの選定、モニタリング

- ●各運用戦略で採用するモデルはファンド全体のリスク・リターンに配慮して選定し、モニタリングと必要な見直し等を定期的に行います。
- ●投資環境の変化や技術の進歩等が生じ、モニタリング等において、より適切と判断した場合には新たなモデルの採用や入れ替え等を行います。



AI等を活用したモデルを用いる2つの運用戦略

株式個別銘柄戦略

わが国の株式への投資に加え、組入株式に おける株式市場に対する感応度を排除できる と考える量の株価指数先物の売建てを行う ことで収益の獲得をめざします。

先物アロケーション戦略

株式相場が上昇局面であると判断した場合に、株価指数先物の売建ての量を減らして 実質株式組入比率を引き上げることにより、 株式相場の上昇による収益も一部獲得する ことをめざします。

投資助言

三菱UFJ国際投信

ポートフォリオの構築・リスク管理等

- ●投資助言に基づき売買を執行し、ポートフォリオを構築
- ●リスク管理モニタリング等のポートフォリオ管理を実施
- ※上記は運用プロセスの概要を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドの将来の運用 成果等を示唆・保証するものではありません。上記プロセスは、今後変更されることがあります。
- ※上記各運用戦略の収益の源泉については後掲「追加的記載事項」の「ファンドの損益のイメージ」をご確認ください。
- ※委託会社の「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ (http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html) でご覧いただけます。





各運用戦略で採用するモデルはファンド全体のリスク・リターンに配慮 して選定し、モニタリングと必要な見直し等を定期的に行います。

◆ 投資環境の変化や技術の進歩等が生じ、モニタリング等においてより適切と判断した場合には、新たなモデルの採用や入れ替え等を行います。



年2回の決算時(1月・7月の各31日(休業日の場合は翌営業日))に分配を 行います。

- ◆ 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- ◆ 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、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。

(初回決算日は、2017年7月31日です。)

■ ファンドのしくみ

- ◆ファミリーファンド方式により運用を行います。
 - *ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



■ 主な投資制限

株式への投資	株式への実質投資割合に制限を設けません。	
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。	
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。	

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

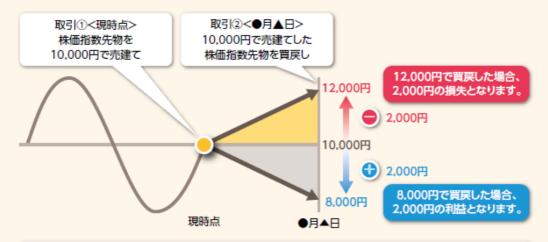
追加的記載事項

■ 株価指数先物の「売建て」について

株価指数先物の「売建て」とは・・・

先物取引とは、将来のあらかじめ定められた期日に、特定の商品(原資産)を、現時点で取り決めた価格(先物価格)で売買する事を約束する取引で、値動きのある資産の不確実な値動きに備えるための手段の一つとして、広く活用されています。

株価指数先物の「売建て」とは、将来時点の株価指数について、現時点の先物価格で「売る」取引のことです。 例えば、原資産を保有していた場合、株価指数先物の「売建て」を行っておけば仮に将来、資産の価格が下落した 場合でも、値下がりした時点で株価指数先物を買戻すことによって、損失を回避することが期待されます。



株価指数先物を売建てた場合、株価指数先物の価格が上昇すればファンドにとってマイナス、 下落すればファンドにとってプラスの影響が期待されます。

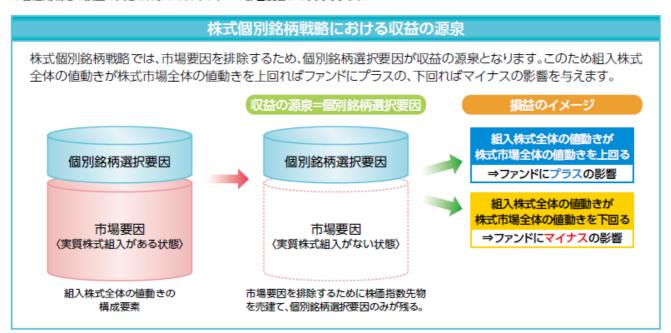
※上記は株価指数先物の概要を説明するために表したものであり、将来の市場環境の変動や運用状況・成果を示唆・保証するものではありません。
※株価指数先物は、買う約束をすることも可能です。また、期日まで待たずに反対売買を行うことにより、損益を確定することもできます。

■ ファンドの損益のイメージ -

◆ファンドの損益は主に①個別銘柄選択要因*1と②市場要因*2によって決まります。



- *1「個別銘柄選択要因(個別銘柄特有の要因)」とは、組入株式全体の値動きが株式市場全体の値動きを上回る(下回る)部分(市場非運動部分)です。
- *2「市場要因(株式市場の感応度)」とは、株式市場全体の値動きの影響を受ける部分(市場連動部分)です。
- ※各運用戦略の損益の大きさによって、ファンドへの影響度合いが異なります。



先物アロケーション戦略における収益の源泉

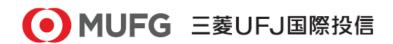
先物アロケーション戦略により、ファンドに実質株式組入がある場合、株式相場が上昇すればファンドにプラスの、 下落すればマイナスの影響を与えます。



※ファンドは特定の市場の動向に左右されにくい収益の追求をめざしますが、先物アロケーション戦略を行うことにより、株式市場の動向に 左右されることになります。

※上記はあくまでもイメージであり、実際のリターンを示すものではありません。

- ※上記はファンドの損益のイメージをご理解いただくために簡易的に表したものです。このため、全てを網羅できていない、または実際とは 異なる場合があります。また上記は将来の市場環境の変動や運用状況・成果を示唆・保証するものではありません。
- ※上記は便宜上、株式個別銘柄戦略で市場要因を全て排除し、先物アロケーション戦略で実質株式組入比率を新たに保有し直した説明としていますが、実際には両運用戦略を勘案してポートフォリオを構築します。





■ 基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの **運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します**。したがって、**投資者のみなさまの投資元本が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、投資元本を割り込むことがあります。**

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

価格変動リスク

株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。

流動性リスク

有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合 や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な 数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果 として不利な価格での取引となる場合があります。

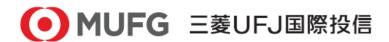
株価指数先物に 関するリスク

株価指数先物は株価変動等の影響を受けて価格が変動するため、ファンドはその 影響を受けます。なお、需給や当該株価指数に対する期待等により、理論上期待 される水準とは大きく異なる価格となる場合があります。また、株価指数先物を 売建てている場合に、株価指数先物価格の上昇により損失が発生すると、基準 価額の下落要因となります。

株式個別銘柄 戦略と先物 アロケーション 戦略を用いる ことによるリスク 株式個別銘柄戦略では、株式の投資に加え、組入株式における株式市場に対する 感応度を排除できると考える量の株価指数先物を売建てることで、収益の獲得を めざします。ただし、完全に株式市場に対する感応度を排除することはできません。 一般的に、株式の投資は株式市場の感応度(市場要因)による影響のほか個別銘柄 特有の要因(個別銘柄選択要因)の影響を受けます。このため、株式個別銘柄戦略 では、組入株式全体の株式市場全体に対する相対的なパフォーマンスが投資成果と なり、組入株式全体が株式市場全体を下回るパフォーマンスとなった場合には 基準価額の下落要因となります。

先物アロケーション戦略では、株式相場が上昇局面であると判断した場合に株価 指数先物の売建て量を減らして実質株式組入比率を引き上げることにより、株式 相場の上昇も一部獲得することをめざします。このため、ファンドに実質株式組入 がある場合は株式市場全体の値動きの影響を受けることとなり、株式相場が下落 した場合には基準価額の下落要因となります。

上記は主なリスクであり、これらに限定されるものではありません。



■その他の留意点

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。 収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、 収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後 の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払い は、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。

■リスクの管理体制

ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

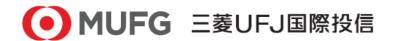
また、定期的に開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。



手続·手数料等

■ お申込みメモ

	購入単位	販売会社が定める単位 販売会社にご確認ください。
購入時	購入価額	当初自己設定:1口当たり1円 継続申込期間:購入申込受付日の基準価額 ※基準価額は1万口当たりで表示されます。基準価額は委託会社の照会先でご確認ください。
	購入代金	販売会社が指定する期日までにお支払いください。
	換金単位	販売会社が定める単位 販売会社にご確認ください。
	換金価額	換金申込受付日の基準価額
換金時	換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目から販売会社においてお支払いします。
	申込締切時間	原則として、午後3時までに販売会社が受付けたものを当日の申込分とします。
	購入の申込期間	当初自己設定:2017年2月1日 継続申込期間:2017年2月1日から2018年4月27日まで ※申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。
	換金制限	当ファンドの資金管理を円滑に行うため、大口の換金のお申込みに制限を設ける場合があります。
申込について	購入・換金申込受付 の中止及び取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取消すことがあります。 また、下記の信託金の限度額に達しない場合でも、当ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、購入の申込みの受付を中止することがあります。
	信託期間	2027年1月29日まで(2017年2月1日設定)
	繰上償還	以下の場合等には、信託期間を繰上げて償還となることがあります。 ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・当ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき ・やむを得ない事情が発生したとき
	決算日	毎年1·7月の31日(休業日の場合は翌営業日) ※初回決算日は2017年7月31日
- 12	収益分配	年2回の決算時に分配を行います。 販売会社との契約によっては、収益分配金の再投資が可能です。
	信託金の限度額	3,000億円
その他	公告	原則として、電子公告の方法により行い、ホームページ (http://www.am.mufg.jp/) に掲載 します。
	運用報告書 	毎決算後および償還後に交付運用報告書が作成され、販売会社を通じて知れている受益者に 交付されます。
	課税関係	課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は税法上、「NISA (少額投資非課税制度) およびジュニア NISA (未成年者 少額投資非課税制度) 」の適用対象です。 配当控除の適用があります。益金不算入制度の適用はありません。



■ ファンドの費用・税金



投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	支払先	購入時手数料	対価として提供する役務の内容
	販売会社	購入価額に対して、 上限3.24%(税抜3.00%) (販売会社が定めます)	当ファンドおよび投資環境の説明·情報提供、購入に 関する事務手続等
	(購入される販売会社により異なります。くわしくは、販売会社にご確認ください。)		
信託財産留保額	ありません。		

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

日々の純資産総額に対して、**年率1.296%(税抜 年率1.200%)**をかけた額

1万口当たりの信託報酬: 保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (保有日数/365)

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

各支払先への配分(税抜)は、次の通りです。

運用管理費用 (信託報酬)

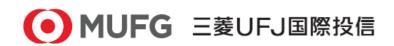
支払先	配分(税抜)	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.66%	当ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、 目論見書等の作成等
販売会社	0.50%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客□座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.04%	当ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

その他の費用・ 手数料

以下の費用・手数料についても当ファンドが負担します。

- ・監査法人に支払われる当ファンドの監査費用・有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
- ・有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
- ・その他信託事務の処理にかかる諸費用 等
- ※上記の費用・手数料については、売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。
- ※運用管理費用(信託報酬)および監査費用は、日々計上され、毎決算時または償還時に当ファンドから支払われます。
- ※上記の費用(手数料等)については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、 当ファンドが負担する費用(手数料等)の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。





手続·手数料等



税 金

税金は、以下の表に記載の時期に適用されます。この表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により 異なる場合があります。

時 期	項目	税 金	
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%	
換金(解約) 時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%	

[※]上記は、2016年10月末現在のものです。

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。くわしくは、販売会社にお問合わせください。

- ※法人の場合は、上記とは異なります。
- ※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等に確認されることをお勧めします。

^{※「}NISA(少額投資非課税制度) およびジュニア NISA(未成年者少額投資非課税制度)」をご利用の場合

■委託会社(ファンドの運用の指図等)

■受託会社(ファンドの財産の保管・管理等)

■販売会社(購入・換金の取扱い等)

三菱UFJ国際投信株式会社

三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託:日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

三菱UFJ信託銀行株式会社

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

ひろぎんウツミ屋証券株式会社

SBI証券株式会社

楽天証券株式会社(平成 29 年2月3日より取扱開始)

カブドットコム証券株式会社(平成29年2月6日より取扱開始予定)

■当資料は、プレスリリースとして三菱UFJ国際投信が作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料は投資勧誘を目的とするものではありません。投資信託をご購入の場合は、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書(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。■当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。■当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・完全性等を保証するものではありません。■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。銀行等の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の補償の対象ではありません。■投資信託は、販売会社がお申込みの取扱いを行い委託会社が運用を行います。■当ファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成29年1月11日に関東財務局長に提出しておりますが、届出の効力は生じておりません。したがって、当該届出の効力が発生するまでに、当資料の記載内容が訂正される場合があります。

以上