



Robot Fund Co., Ltd.
Robot as a Service

2017年9月6日
ロボット投信株式会社

ロボット投信、カブドットコム証券に 投資信託の基準価額変動要因分析ツールを提供

<報道関係者各位>

ロボット投信株式会社(代表取締役社長 野口哲、以下、「ロボット投信」)は、カブドットコム証券株式会社(取締役代表執行役社長 齋藤正勝、以下、「カブドットコム証券」)と資産運用フィンテック分野での協業を強化し、2017年9月下旬(予定)より、投資信託の基準価額の変動要因分析をシミュレーションできるツールの提供を開始いたします。

ロボット投信は2017年3月、MUFG主催のデジタル・アクセラレータ・プログラム参加企業に選定され、MUFGグループ各社と具体的な協業案件について協議を進めて参りました。既にカブドットコム証券に対しては、国内の金融機関では初めて(※弊社調べ)となる、仮想ファンドによる投資信託の信託報酬実額をシミュレーションできるツールを提供しておりますが、今般の基準価額変動要因分析ツールは、その第二弾となるものです。

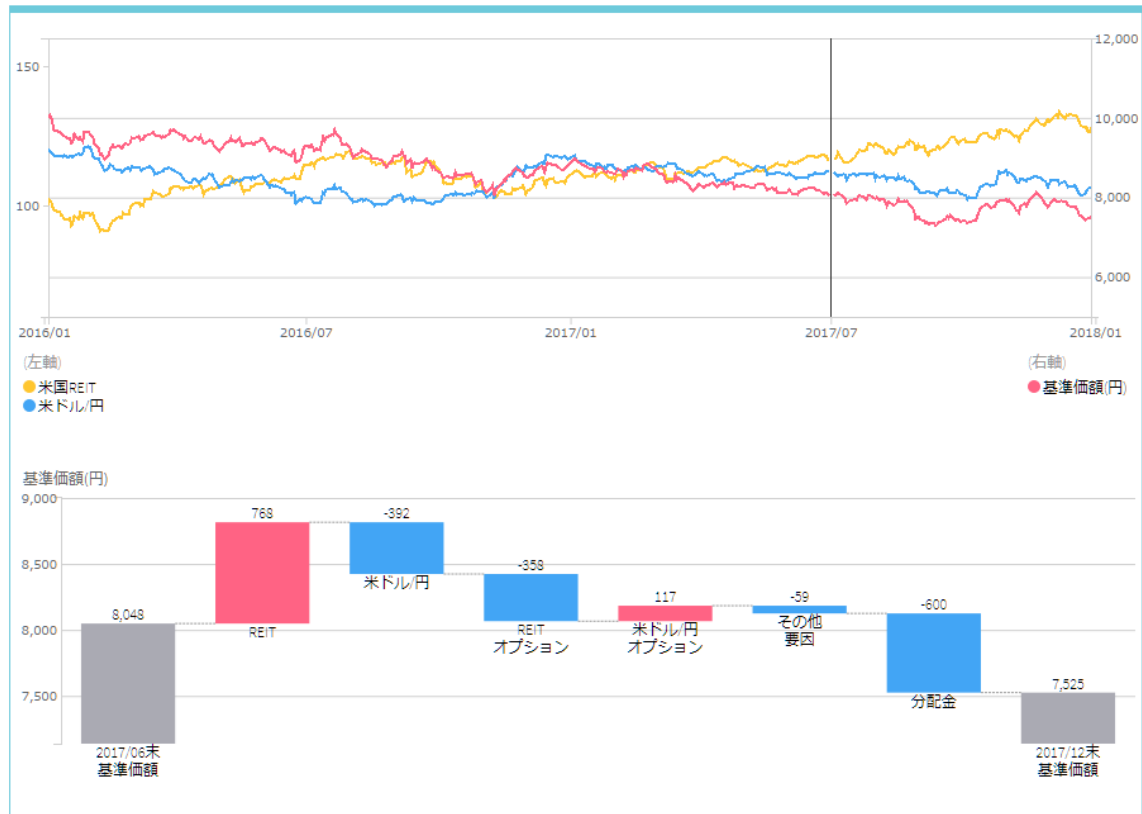
●基準価額の変動要因分析シミュレーションツールについて

投資信託の基準価額は、株式や不動産、債券、金利、為替相場や、オプション取引、分配金の支払いなどの様々な要因によって変動します。近年の投資信託の傾向として、様々な資産を投資対象としていることに加え、仕組みが複雑になってきているため、保有している投資信託の基準価額がどのように変動するのか把握することが難しくなっています。

本ツールは、一定条件のもとに生成した仮想ファンドに対して、それぞれの要因の変動が、投資信託の基準価額、すなわち運用成績に与える影響をシミュレーション出来るものです。仮想ファンドとしては、主に投資対象とする金融資産(米国REIT、豪州株式)の値動きに加え、為替レートの影響及びそれらを参照するオプション取引を組み込んだファンドを想定したものとしています。仮想ファンドの値動きは、本邦において組成されたファンドの過去のパフォーマンスを参考に、ロボット投信が作成しています。

注)過去の値動き及び運用成績のシミュレーションとしては、簡略的な計算方法により行っているため、あくまでも概算金額を求めているものであり、実際の数値とは異なります。また、本シミュレーションツールは、それぞれの要因の変動による将来の値動きへの影響を把握することのみを目的とするものであり、将来の価格を予想・保証するものではありません。

<米国 REIT ファンドに投資するファンドの変動要因分析（イメージ）>



※画像は開発中のものであり、サービス提供開始の時点で変更される場合がございます。

カブドットコム証券は、投資信託のコスト透明化の一環として、2016年12月より信託報酬控除前トータルリターンの開示や、ロボット投信との協業により信託報酬の実額をシミュレーションできるツールの開発を行ってきております。今般のシミュレーションツールは、お客さまにとってより分かり易く投資信託の仕組みについてご理解いただくためのソリューションとして、投資信託の基準価額がどのような要因によって変動するのか、市場の変化が与える運用成績への影響を可視化するものであり、従来からの取組の新たな事例となるものです。

ロボット投信はこれからも、テクノロジーを活用した資産運用ビジネスの革新を積極的に展開し、資産運用業の競争力の向上、個人投資家の利便性向上に資するサービスを提供すべく取り組んで参ります。



Robot Fund Co., Ltd.
Robot as a Service

ロボット投信株式会社について

“金融の「読む、書く、話す」を自動化する”をミッションにして2016年5月に創業。投資信託を始めとするアセットマネジメント分野において、以下の業務を展開している。

▼主要業務

①RPA（Robotic Process Automation）ソリューションの提供

- IVR（電話自動応答システム）、AIスピーカーによる金融コミュニケーション・ツールの開発、チャットボット等

②資産運用サポート

- ロボアドバイザー等

③投資信託・インデックス・マクロ指標等の金融・経済データの提供

- 投資信託基準価額、各種インデックス等データの提供、及びその分析

▼会社概要

社名 : ロボット投信株式会社

所在地 : 東京都中央区日本橋茅場町 1-6-16 KKビル 5F

代表者 : 代表取締役社長 野口 哲

URL : <https://robotfund.co.jp/>

本件に関するお問合せ先

ロボット投信株式会社

コーポレート・コミュニケーションズ

info@robotfund.co.jp