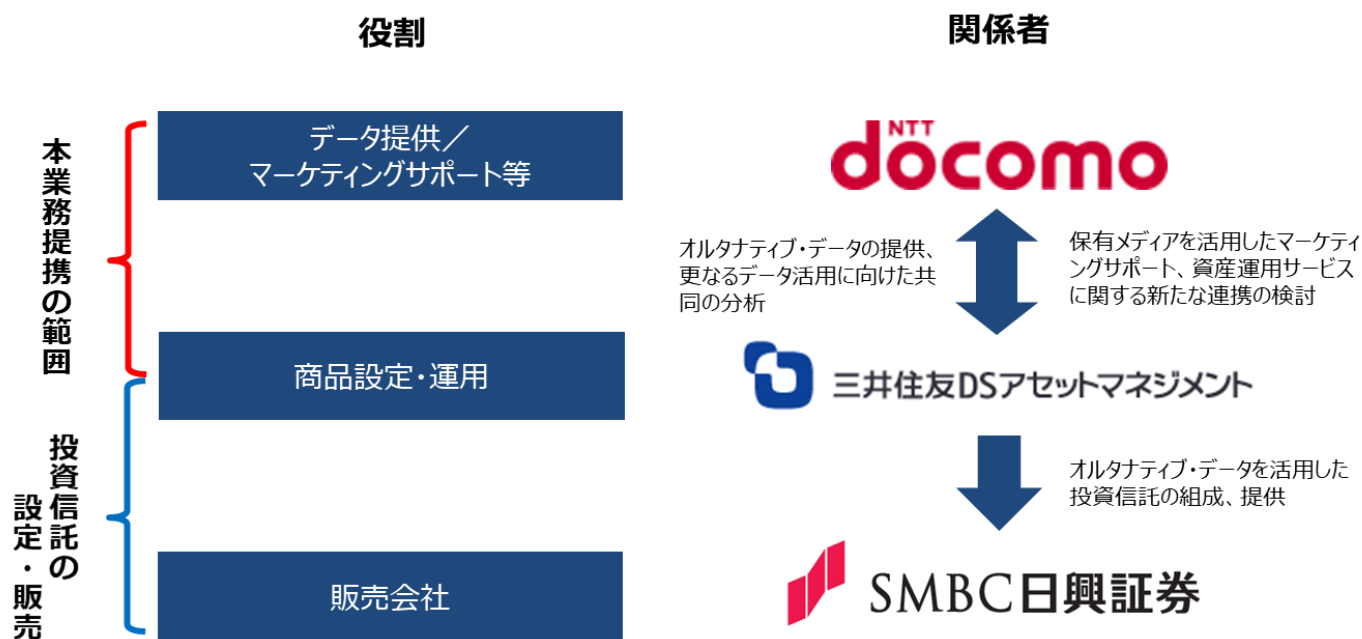


2020年12月1日

三井住友 DS アセットマネジメントと NTT ドコモの業務提携契約締結について ～NTT ドコモのオルタナティブ・データを活用した国内初の投資信託を設定～

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社（所在地：東京都港区、代表取締役社長 兼 CEO：猿田隆、以下「当社」）は、株式会社 NTT ドコモ（所在地：東京都千代田区、代表取締役社長：井伊基之、以下「ドコモ」）と業務提携契約を締結したことをお知らせいたします。当社は12月17日に、ドコモが保有するオルタナティブ・データ^{*1}を活用した国内初の投資信託を設定するとともに、同社メディア上でのマーケティングを実施します。

当社は従来より、AI・ビッグデータを活用した運用手法の高度化に取り組んでいます。昨年秋からは、ドコモと共同で、同社オルタナティブ・データを活用した新たな運用モデルの開発と協業に関するプロジェクトを実施してきました。そして、その新たな運用モデルの有効性が確認できたことから、12月17日に、同運用モデルを活用した投資信託『データ戦略分散ファンド 愛称：d インパクト』を設定し、SMBC日興証券（ダイレクトコース）で販売を開始します。



『データ戦略分散ファンド 愛称：d インパクト』は日米の株式・債券、金を投資対象とするバランス型ファンドで、資産配分を調整する際にドコモのオルタナティブ・データを活用し、経済指標の先行予測を通じてリターンの獲得を目指します。なお、ドコモのオルタナティブ・データを活用した投資信託は、国内初となります。

2020年12月1日

当ファンドでは、人口の統計情報である「モバイル空間統計®^{※2}」などを活用しております。「モバイル空間統計」は、ドコモの携帯電話ネットワークの運用データを利用して、エリアごとの人口分布や年代別構成などを把握することができます。「モバイル空間統計」のデータ分析を通じて、例えば商業施設エリアの人口増減データから個人消費の動向などの予測に活用することが考えられます。人の動きは、経済活動との関連性が高いため、経済指標や統計データの先行推測に有効と考えられ、これらのデータを活用することで、投資信託のパフォーマンス向上を目指します。今後は、更なるオルタナティブ・データの活用も目指し、ドコモと共同で分析を進めてまいります。

[モバイル空間統計®の活用イメージ]

商業施設エリアの人口の増減で、
個人の消費の動向を推測できます。

消費 ↓



消費 ↑



工業用地人口の増減で、
企業の生産活動の動向を推測できます。

生産活動 ↓



生産活動 ↑



当社では、資産形成を必要とする方々のお役にたてるよう、今後も運用高度化に向けた様々な取り組みを行ってまいります。

※1 従来投資判断に活用されてきた経済統計や財務情報等のような一般的な公開情報以外のデータのことを指します。ドコモから提供を受けるデータは統計データであり、個人を特定できるものではありません。

※2 「モバイル空間統計®」は、株式会社 NTT ドコモの登録商標です。「モバイル空間統計」は、プライバシーを保護するため、運用データに、非識別化処理、集計処理、秘匿処理を行うことにより作成されます。集団の人数のみを表す人口統計情報であるため、モバイル空間統計からお客さま個人を特定することはできません。ドコモは、お客さまのプライバシーを厳重に保護するべく、「モバイル空間統計」を作成・提供する際に遵守する基本事項をまとめたガイドラインを公表しています。

■『データ戦略分散ファンド 愛称：d インパクト』の概要については、別紙をご確認ください。

2020年12月1日

重要な注意事項

- 当資料は、情報提供を目的として、三井住友 DS アセットマネジメントが作成したものです。特定の投資信託、生命保険、株式、債券等の売買を推奨・勧誘するものではありません。
- 当資料に基づいて取られた投資行動の結果については、当社は責任を負いません。
- 当資料の内容は作成基準日現在のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 当資料に市場環境等についてのデータ・分析等が含まれる場合、それらは過去の実績及び将来の予想であり、今後の市場環境等を保証するものではありません。
- 当資料は当社が信頼性が高い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。
- 当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

HP : <https://www.smd-am.co.jp/>

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 399 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、
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

本件に関するお問い合わせ先

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社 営業企画部 広報チーム
松嶋 Tel : 03-6205-1539
Mail : pr@smd-am.co.jp

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

当ファンドは、データ戦略分散マザーファンドへの投資を通じて、日本および米国の株式、債券、金に分散投資することにより、安定的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

ファンドの特色

マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下のような運用を行います。

1 日本および米国の株式、債券、金に分散投資することにより、安定的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

■主として、日本および米国の株価指数先物取引、債券先物取引ならびに金価格に連動する上場投資信託証券(ETF)等に投資を行います。また日本の短期公社債、短期金融商品にも投資を行います。

2 ポートフォリオの構築に当たっては、独自性の高いオルタナティブ・データ等を活用するとともに、ポートフォリオ全体の目標リスク水準が年率5%程度となるように行います。

■運用にあたっては、以下の順でポートフォリオを構築します。

①ポートフォリオにおける各資産のリスク寄与度が概ね均等となるよう調整するとともに、主要なファクター(株式、金利、インフレ等)間での影響度合いも勘案して資産配分を決定します。

②上記①の資産配分に対して、独自性の高いオルタナティブ・データ等を計量的に分析して調整を行い、基本資産配分を決定します。

※オルタナティブ・データは、NTTドコモおよびその関連会社等が提供するデータ等を活用します。

※NTTドコモおよびその関連会社は投資行動に関与するものではありません。また、NTTドコモおよびその関連会社が提供するデータは、有価証券の価値やそれを示唆する情報等を含まず、投資助言に該当しません。

③ポートフォリオ全体の目標リスク水準が年率5%程度となるように、基本資産配分を等倍に投資割合を調整して各資産の組入比率を決定しポートフォリオを構築します。目標リスク水準の調整のため、ETFの組入総額と、株価指数先物取引および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額の最大で3.5倍まで投資を行う場合があります。

※目標リスク水準は中長期的なリスク水準の目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることを約束するものではありません。

3 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し為替変動リスクの低減を図ります。

※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。

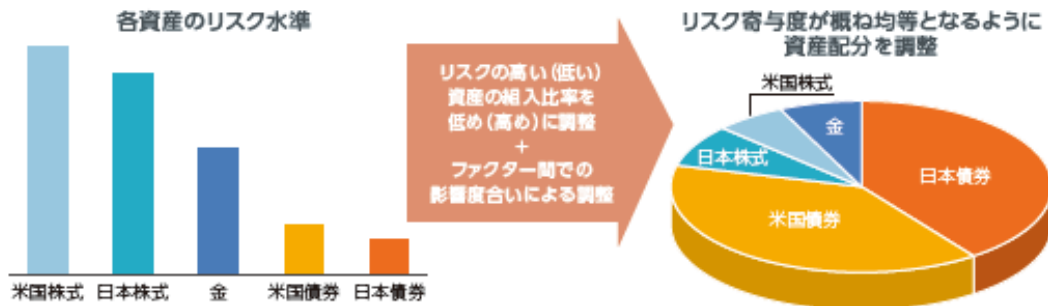
ファンドの目的・特色

▶ ポートフォリオ構築プロセス

STEP1 分散投資でリスクを低減

ポートフォリオにおける各資産のリスク寄与度が概ね均等となるよう調整するとともに、主要なファクター（株式、金利、インフレ等）間での影響度合いも勘案して資産配分を決定します。

[各資産のリスク寄与度を均等化するイメージ]



STEP2 オルタナティブ・データを活用しリターンの向上を目指す

STEP1の資産配分に対して、オルタナティブ・データ等を計量的に分析して調整を行い、基本資産配分を決定します。

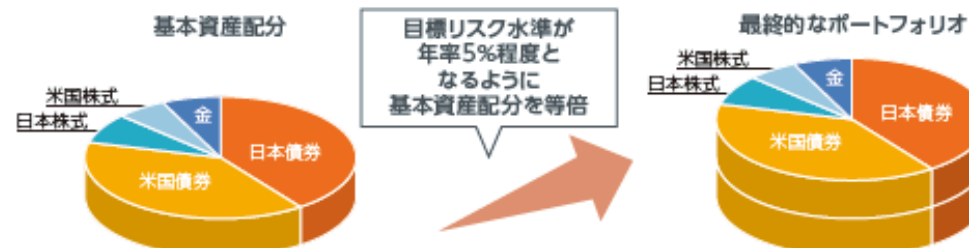
[オルタナティブ・データ等を活用し資産配分を調整するイメージ]



STEP3 ポートフォリオ全体の目標リスク水準を年率5%程度にコントロール

ポートフォリオ全体の目標リスク水準が年率5%程度となるように基本資産配分を等倍に投資割合を調整してポートフォリオを構築します。

[基本資産配分を等倍するイメージ]



※目標リスク水準は中長期的なリスク水準の目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることを約束するものではありません。

※銘柄の選定にあたっては、サステナビリティ（ESG要素を含む中長期的な持続可能性）について、社会的信用に関する行為等、重大な問題が生じた銘柄は除外します。

※上記の運用プロセスは有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更される場合があります。

基準価額の変動要因

- 当ファンドは、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、投資者の**投資元本は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。
- 運用の結果として信託財産に生じた**利益および損失は、すべて投資者に帰属**します。
- 投資信託は**預貯金と異なります**。また、一定の投資成果を保証するものではありません。
- 当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。



価格変動リスク

株式市場リスク…株価の下落は、基準価額の下落要因です

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

債券市場リスク…債券価格の下落は、基準価額の下落要因です

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、債券の種類や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

金に関するリスク…金の価格の下落は、基準価額の下落要因です

ファンドは金の指標価格に連動することを旨とした上場投資信託証券に投資します。一般に、金価格は、金の需給の変化や為替・金利動向等の様々な要因の影響を受けて変動します。金価格が下落した場合、組入上場投資信託証券の価格も下がり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。



信用リスク…債務不履行の発生等は、基準価額の下落要因です

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。



為替変動リスク…円高が基準価額に与える影響は限定的です

外貨建資産に対し原則として対円での為替ヘッジを行うため、為替変動による影響を受けませんが、限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。



流動性リスク…市場規模の縮小・取引量の低下により、不利な条件での取引を余儀なくされることは、基準価額の下落要因です

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

その他の留意点



ファンド固有の留意点

レバレッジに関する留意点

当ファンドでは、株価指数先物取引や債券先物取引等を積極的に用いてレバレッジ取引を行うことがあります。したがって、株式や債券等の価格変動の影響を大きく受け、ファンドの基準価額の変動が大きくなる場合があります。



投資信託に関する留意点

- 当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。
- ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- 投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

手続・手数料等

ファンドの費用・税金

■ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

購入時・換金時

購入時手数料	ありません。
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

保有時

運用管理費用（信託報酬） ファンドの純資産総額に**年1.353%（税抜き1.23%）**の率を乗じた額とします。運用管理費用（信託報酬）は日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払われます。

<運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜き)>

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.70%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.50%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

※上記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 ファンドが組み入れるETFの銘柄は将来にわたって固定されているものではなく、ファンドの投資者が間接的に支払う費用として、これらETFの資産から支払われる運用報酬、投資資産の取引費用等の上限額または予定額を表示することはできません。また、以下のその他の費用・手数料について信託財産からご負担いただきます。

- 監査法人等に支払われるファンドの監査費用
- 有価証券の売買時に発生する売買委託手数料
- 資産を外国で保管する場合の費用 等

※上記の費用等については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※監査費用の料率等につきましては請求目論見書をご参照ください。

※上記の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。