

2018年8月21日

各位

三菱UFJ信託銀行株式会社

## 人工能を活用したグローバル株式に関する資産運用モデルの共同開発およびスタンダード・ライフ・アバディーン社によるグローバル株式ファンド設定等について

三菱UFJ信託銀行株式会社（取締役社長 池谷 幹男<sup>いけがや みきお</sup>）は、弊社子会社である株式会社三菱UFJトラスト投資工学研究所（取締役社長 成川 順一<sup>なりかわ じゅんいち</sup>、以下、「MTEC」）および資本・業務提携先であるスタンダード・ライフ・アバディーン社（代表者Co-CEO Martin Gilbert/Keith Skeoch、以下、「SLA社」）とともに、人工能（以下、「AI」）を活用したグローバル株式に関する資産運用モデルを共同開発いたしました。

併せて当該モデルを組込んだグローバル株式ファンドがSLA社により設定されましたので、お知らせいたします。

### ■人工能を活用したグローバル株式に関する資産運用モデルの共同開発

SLA社とは、弊社が2008年10月に同社の前身にあたるアバディーン・アセット・マネジメント社と資本・業務提携契約を締結して以来、同社の運用商品を日本のお客さま向けに提供するなど、親密な協力関係を構築しています。

今回共同開発した資産運用モデルは、日本を含む全世界の株式を投資対象とし、「バリュー」、「ボラティリティ」、「クオリティ」といった複数のファクターをローテーションするモデルです。これは、AI技術によって、現在の相場局面が過去のどのような局面と類似しているかを探索し、得られた類似局面のデータを用いて将来有効となるファクターを予測のうえ、そのファクターに投資するというものです。

本件はMTECにとって自社の持つ金融工学のノウハウを、欧州を拠点とする資産運用会社に提供する初のケースとなります。MTECは1988年の設立以来、金融・投資業務、リスクマネジメント業務で世界トップレベルの研究を行って来ており、AIを活用した運用についても他社に先駆けて研究を進めて参りました。今般の取組みは、欧州有数の資産運用会社であるSLA社がMTECの持つノウハウを高く評価したものです。

### ■SLA社によるグローバル株式ファンドの設定等

2018年8月20日、上記資産運用モデルが組込まれたグローバル株式ファンド（Aberdeen Global - Artificial Intelligence Global Equity Fund）がSLA社によりルクセンブルクで設定されました。ベンチマークはMSCI All Country World Index、日本を含む全世界の株式へ投資し、中長期的にベンチマークを上回ることを目指します。

ファンドの設定・運用等はSLA社およびそのグループ会社が行い、弊社およびMTECは共同開発した資産運用モデルの改良・調整等に係るアドバイスを提供いたします。

ファンドの販売については、欧州を皮切りにSLAグループが有するグローバルネットワークを活用していく予定であり、多くのお客様にご利用いただけることが可能となるものと期待されます。

弊社およびMTECは、今後も国内外のお客様のニーズにこれまで以上にお応えできるよう、先進的な金融工学とAI等の新技術を活用しつつ、資産運用能力向上および、競争力ある運用商品開発・提供に努めて参ります。

以上

#### <ファンド概要>

(名称) Aberdeen Global - Artificial Intelligence Global Equity Fund  
(ルクセンブルク籍投資信託)

(投資対象) 日本を含む世界株式

#### <株式会社三菱UFJトラスト投資工学研究所 (MTEC) 概要>

1988年に三菱信託銀行(現三菱UFJ信託銀行)100%出資により設立。  
金融工学に特化したシンクタンク。

#### <スタンダード・ライフ・アバディーン社概要>

英国スタンダード・ライフ・アバディーン社は、2017年8月に英国アバディーン・アセット・マネジメント社と英国スタンダード・ライフ社の合併により発足した資産運用グループです。

弊社は2008年10月にアバディーン・アセット・マネジメント社と資本・業務提携契約を締結して以来、同社の運用商品を国内のお客様向けに提供しております。