

UCITS ファンドの新規設定 国内株式アクティブ運用をさらに強化

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、2024年10月10日に当社のロンドン現地法人にて、UCITS^{※1} ファンド「SMD-AM Japan Mid Small Cap Value」（以下「当ファンド」）を新規設定したことをお知らせいたします。当ファンドは、当社における UCITS ファンドとして7本目の設定となります。そのうち、日本株ファンドとしては3本目の設定となります。今後も UCITS の商品ラインナップを拡充していきます。

※1 譲渡可能証券の集団投資事業（Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities）の略であり、欧州委員会（European Commission）が制定した指令に準拠するファンド。

本件設定の経緯

当社は2013年から、UCITSを通じて、強みのひとつであるアクティブ運用を海外の投資家様にご提供しております。このたび、長年にわたり好パフォーマンスを達成してきた PBR-ROE モデル（ROE を考慮し適正 PBR に注目した割安度判断）を用いた当ファンドを新たに設定します。海外での日本株投資に対する関心の高まりのなかで、より幅広い選択肢をご提案してまいります。

運用の特徴

当ファンドは、国内の中小型株式を投資対象とし、バリューを重視したアクティブ運用を行います。

運用手法には2つのユニークな特徴があります。

- ①長年の実績がある PBR-ROE モデルを採用
- ②銘柄発掘に独自の AI（人工知能）を活用

これらの特徴により、効率的かつ精度の高い投資判断を実現することで、類似戦略では設定来良好な運用実績を誇ります。

当ファンドの運用チーム

当ファンドを運用する主担当者は、シニアファンドマネージャー・部奈和洋（以下「SFM・部奈」）です。SFM・部奈が属する運用チームは、豊富な経験を基に優れた運用実績をあげ、担当するファンドにおいて数々のアワードを受賞しています。今後も SFM・部奈と運用チームが一丸となって、投資家様のご期待に応える運用を続けてまいります。

2024年10月11日

当ファンドの主運用担当者
運用部
シニアファンドマネージャー
部奈和洋（べな かずひろ）



当社は今後も、アクティブ運用力を一層強化し、お客様の Quality of Life (QOL) の向上に貢献することを目指します。世界の投資家様の多様なニーズに応えられるよう、当ファンドをはじめとする高品質の商品ラインナップを拡充し、資産運用の新たな価値を創造してまいります。

投資リスク（詳しくは目論見書等をご覧ください。）

- 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、純資産価格は変動します。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、純資産価格の下落により、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。
- ファンド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、為替変動リスク、信用リスク、流動性リスク等があります。

重要な注意事項

- 当資料は三井住友 DS アセットマネジメントが作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- 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。また、当資料は三井住友 DS アセットマネジメント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。
- ファンドは、値動きのある証券（外国証券には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、リスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動します。したがって元本や利回りが保証されているものではありません。
- ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また登録金融機関でご購入の場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

住所：〒105-6426 東京都港区虎ノ門 1-17-1 虎ノ門ヒルズビジネスタワー 26 階

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



2024年10月11日

【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

プロダクトマネジメント部ブランドマネジメント室 E-Mail : pr@smd-am.co.jp

松嶋 (03-6205-1539) / 永澤 (03-6205-1862) / 水谷 (03-6205-1341)