

各 位

会社名	ベイビュー・アセット・マネジメント株式会社
代表者名	代表取締役兼CEO 八木 健
金融商品取引業者	登録番号 関東財務局長(金商)第397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
問い合わせ先	管理部 岩田 浩明 03-5210-3342

「米国高配当株式ボラティリティ・ウェイトファンド」設定に関するお知らせ

ベイビュー・アセット・マネジメント株式会社（代表取締役 兼 CEO：八木健 以下、「当社」）は、この度、包括的な運用業務提携契約を締結している **Victory Capital Management Inc.**（以下、「**Victory Capital 社**」）傘下のブティック **CEMP**（ケンプ）に運用を再委託する、日本株式又は米国株式を投資対象としたスマートベータ戦略による運用商品の提供を開始し、先ず 2017 年 8 月 9 日に私募投資信託「米国高配当株式ボラティリティ・ウェイトファンド」（以下、「**当ファンド**」）を新規設定致しましたのでご案内申し上げます。

CEMP は、テネシー州ナッシュビル郊外のブレントウッドに拠点を構え、スマートベータ運用の黎明期である 2003 年から、独自に開発したスマートベータ指数の公表及びそれに基づく運用サービスを提供しています。また、**Victory Capital 社**傘下の **ETF** プロバイダーである **VictoryShares** を通じて、スマートベータ戦略による多数の **ETF** を **NASDAQ** に上場しています。5 名のプロフェッショナルが、米国、グローバル、及びエマージング株式等を対象にスマートベータ戦略を運用しており、運用チームを率いる最高投資責任者（**CIO**）のステイーブン・ハマーズは、ウォール・ストリート・ジャーナル、バロンズ、ブルームバーグ等多数のメディアに登場するなど、スマートベータ運用の先駆者であり第一人者です。

CEMP スマートベータ戦略は、**TOPIX** や **S&P500** 指数等の伝統的な時価総額加重株価指数が共通に抱える、“組入れ上位銘柄への過度なリスク集中”という問題への解決策提供を目的に開発されました。各組入れ銘柄の指数全体に対するリスク寄与度が均等となるようにウェイト付けする手法（ボラティリティ・ウェイトイング）で、リスク分散の最大化を目指すというポートフォリオ理論の原点に立ち返る戦略設計により、各種株価指数を大幅に上回るパフォーマンスを長年に亘り達成しております。今回、日本の投資家の皆様に当社が提供を開始する運用商品は、日本又は米国の高配当株式 100 銘柄に投資し、上記手法に基づき各銘柄のウェイトを決定します。**TOPIX** や **S&P500** 指数等のパッシブ運用の代替として、或いはベンチマークを上回るリターンを目指すアクティブ運用の代替として、金融機関や年金基金をはじめ様々な投資家にとって魅力的な投資商品であると考えております。

Victory Capital 社は、オハイオ州クリーブランドに本拠を置き、各々異なる資産クラスや戦略に特化した運用ブティックを多数抱え、2016 年バロンズ誌「全米運用会社ランキング」では 21 位にランクされる米国屈指の独立系マルチ・ブティック型運用会社です。**CEMP** が運用する当ファンドの設定は、当社が **Victory Capital 社**との間で日本における運用業務提携（再委託）契約を 2016 年 7 月に締結して以降、同社傘下のブティック **INCORE** が運用する「米国政府機関保証短期債券ファンド」（2016 年 10 月設定）、同 **RS** インベストメンツが運用する「**US** バイオ・ベンチャー（限定追加型）」（2017 年 2 月設定）に続く、第 3 弾となります。

当社は、日本株式、米国株式、マルチ・アセット等のアクティブ運用に特化した独立系ブティック・ハウスのパイオニア、そしてリーダーとして、創業以来 19 年に亘り洗練された運用商品を提供して参りました。結果として、年金基金を含む機関投資家から個人投資家に至るまで、幅広い顧客層から高い評価を頂き、約 3,300 億円（2017 年 3 月末現在）の契約資産を擁する日本最大級の独立系運用会社へと着実に成長を遂げることができました。当社は、高品質なクライアント・サービスを提供する独自のプラットフォームの上に、株式、債券、そしてマルチ・アセット分野において、自社運用商品に加え、**Victory Capital 社**をはじめ米国の秀逸な運用ブティックによる商品群を取り揃えることで、日本初の本格的なマルチ・ブティック型運用会社を目指しております。

以上