

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

**「CEMP/AAA 米国高配当株式ダイナミックヘッジファンド」及び
「CEMP/AAA 日本高配当株式ダイナミックヘッジファンド」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）が運用する株式スマートベータ戦略と、当社グローバル資産運用部によるクオンツ戦略を融合した私募投資信託「CEMP/AAA 米国高配当株式ダイナミックヘッジファンド」並びに「CEMP/AAA 日本高配当株式ダイナミックヘッジファンド」を、2017年8月9日、8月10日に各々新規設定致しましたのでご案内申し上げます。

上記2つのファンドは、当社及び Victory Capital 社がマルチ・ブティック型運用会社としての強みを活かし、日米の専門チームが共同で運用します。CEMP は独自開発したスマートベータ戦略に基づく米国・日本株式の運用を担当し、当社は「アクティブ・アセット・アロケーションファンド」シリーズ（以下、「AAA」）で採用する独自開発したクオンツ戦略に基づき、米国・日本の株価指数先物取引を用いて株式エクスポージャーを機動的に調整します。上記の共同運用により、ドローダウンの低減を図り、パフォーマンスの飛躍的向上を目標とします。高配当株式からのインカム・ゲインと同時に、リスク水準を抑制し安定したキャピタル・ゲイン獲得を狙う当ファンドは、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。

CEMP スマートベータ戦略は、S&P500 指数や TOPIX 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。

また、当社グローバル資産運用部によるクオンツ戦略は、過去のデータのみに基づいて構築される一般的な計量モデルとは大きく一線を画し、価格変動の背景にある各種事象を考慮した、現実のマーケット動向に即した独創的で堅実なモデルに基づく運用提供を目的に開発されました。同戦略を採用する AAA は、日本・米国・欧州の株式・債券・通貨を対象とする絶対収益型ファンドとして、2013年の設定以来優れた運用実績を有しております。

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