

2018年7月20日

各位

三菱UFJ信託銀行株式会社

「人工知能（A I）を用いたファンド運用システム」に関する特許取得 および「先端金融工学運用室」の設置について

三菱UFJ信託銀行株式会社（取締役社長 ^{いけがや} ^{みきお} 池谷 幹男）は、人工知能（以下、「A I」）を用いたファンド運用システム（以下、「本運用システム」）に関する特許を取得しました。

また、A Iやビッグデータを活用した資産運用手法高度化（本運用システム含む）および運用商品開発体制強化を目的として、7月2日付で先端金融工学運用室を資産運用部内に設置しましたので、併せてお知らせいたします。

■ A I を用いたファンド運用システムに関する特許取得

特許取得対象である本運用システムは、高配当株式の保有をベースに株価指数先物による価格変動リスクのコントロール（以下、「アクティブヘッジ」）を組み合わせ安定収益を追求する仕組みで、2016年の開発・導入以降、現在に至るまで法人・個人の多くのお客さまに本運用システムを組込んだ商品をご提供いたしております。

今回の特許の申請は、株価指数先物によるアクティブヘッジ部分にA Iを用いることその他、A Iを含む複数の特徴の異なるモデルを組み合わせること、およびその組み合わせ方法に独自性・先進性があると考えたものです。

■ 先端金融工学運用室の設置

A Iやビッグデータを活用した資産運用手法高度化・運用商品開発体制強化を企図し、資産運用部において従来より国内株式・海外株式に係るシステムアクティブ運用を担ってきた国内株式クオンツ運用課、外国株式クオンツ運用課に、A I等の新技術を活用した運用商品の開発を担う先端運用開発課を新たに加え、同部内に先端金融工学運用室を設置しました。

今後の資産運用においては、F i n T e c hに代表される情報通信技術（I C T）の発達とともに、分析力で競う時代が到来するものと思われま。従来のマクロ経済データや企業決算データといった集計加工された金融・財務情報に加え、消費行動等のより詳細で直接的な経済活動に関する多種・多量でリアルタイム性の高いデータ、いわゆるビッグデータを分析・活用する技術として、A I等の先端金融技術の開発、運用領域の強化・拡大がますます重要になってくると考えております。

今後、先端金融工学運用室を中心に、弊社グループ企業であり金融工学に係る研究開発や運用領域への応用において先駆的な取り組みを続けてきた三菱UFJトラスト投資工学

研究所の他、三菱UFJ国際投信およびエム・ユー投資顧問等の弊社グループ運用会社が保有するノウハウ・機能・ネットワークを活用し、国内外のお客さまの様々なニーズにこれまで以上にお応えできるよう、資産運用分野におけるAIやビッグデータ活用に関する調査研究・商品開発について一体で取組んで参ります。

以 上