

2026 年 1 月 30 日

バーテックス・インベストメント・ソリューションズ株式会社

AlpacaTech 株式会社

第一生命ホールディングスのイノベーションファンド出資による

運用商品の共同研究・開発を開始

～金融工学と AI を融合した、次世代の革新的な運用商品を開発～

第一生命ホールディングス株式会社の 100%子会社であるバーテックス・インベストメント・ソリューションズ株式会社（本社：東京都千代田区、代表取締役社長：星野元伸、以下「バーテックス」）と、SBI グループで革新的な金融ソリューションを提供する株式会社 FOLIO ホールディングスの子会社である AlpacaTech 株式会社（本社：東京都千代田区、代表取締役 CEO：四元 盛文、以下「AlpacaTech」）は、2026 年 2 月から、第一生命ホールディングスの「デジタルイノベーションファンド^(注)」をスポンサーとして、金融工学と AI を融合した革新的な運用商品の開発を開始いたします。

資産運用業界において AI の役割が急速に重要性を増す中、両社は「金融工学と AI の融合による革新的な投資商品の提供」をミッションに掲げ、共同研究プロジェクトを 2025 年 9 月に立ち上げました。本プロジェクトでは、バーテックスが長年培ってきたアカデミックな理論に基づくクオンツ運用モデルと、AlpacaTech の持つ最先端の AI 機械学習アルゴリズムおよび予測モデリング技術を統合し、従来の枠組みを超えた革新的な投資戦略の構築を目指しておりました。本プロジェクトを通じて、金融工学と最新 AI 技術の融合による新たな収益機会の発掘・革新的な戦略開発が十分に実現可能であるとの評価に至りました。これらの成果を踏まえて、2026 年 2 月からは、第一生命ホールディングスの「デジタルイノベーションファンド」を活用し、シングルアセットからマルチアセットまで様々なアセットに渡る概念実証を研究し、商品開発を開始することを決定しました。本研究・開発では、AI と従来運用手法を掛け合わせることで優れた運用パフォーマンスを達成できる戦略策定を目指しております。

両社は、この革新的な共同研究・開発を通じて、日本の資産運用業界における AI 活用のスタンダードをリードし、より高度な運用手法により、高いパフォーマンスの実現に貢献してまいります。

(注) デジタルイノベーションファンド：デジタルイノベーションの実現を目的に、第一生命グループ全体に裨益しうる革新的なビジネスアイデアに対して資金面の支援を行う取組み

■ 各社コメント

バーテックス・インベストメント・ソリューションズ株式会社 代表取締役社長 星野 元伸

「資産運用業界において AI の役割は急速に拡大しており、もはや不可欠な要素となっています。当社が長年培ってきた金融工学をベースとした実践的なクオンツ運用モデルと、AlpacaTech 社の最先端 AI 技術を融合させる本プロジェクトは、これまでになく革新的な運用商品を生み出す大きな挑戦です。このプロジェクトを通じて得られる知見を第一生命グループ全体で共有し、金融商品を通じて、個人・機関投資家の皆様へ新たな価値をご提供してまいります。」

第一生命ホールディングス株式会社 執行役員

Group Chief Data and AI Officer フィゲン・ウルゲン

「AI は、資産運用分野においても、従来の経験や勘に基づく投資判断から、データに裏付けられた精緻な判断プロセスへと変革をもたらしています。この分野における AI の真価は、大規模なシナリオ分析に基づくリスク管理をかつてない粒度で行いながら投資リターンの最大化を実現可能とする点にあります。このことは、市場の変動性が高い投資環境下において、投資家の皆さまに信頼をご提供する上で極めて重要であると考えています。バーテックスと AlpacaTech による本共同研究・開発がもたらす可能性に、大いに期待しております。」

AlpacaTech 株式会社 代表取締役 CEO 四元 盛文

「当社の使命は、AI によるデータを駆使した予測モデルとオートメーションを通じて、お客様の運用高度化に貢献することです。昨年開始した本共同研究では実りのある結果が得られ、今回は実用化も視野に入れた実験・開発フェーズへと入っていくことを大変喜ばしく思っております。高度な金融工学の専門知見を持つバーテックス社との共同プロジェクトは、当社の AI モデリング能力を最大限に発揮できる絶好の機会であると考えています。『金融工学と AI の融合』という共通のビジョンのもと、両社の強みを結集し、日本の資産運用業界における新たなスタンダードとなるソリューションを創出してまいります。」

■バーテックスについて

バーテックスは第一生命グループで培われた長期投資の知見と、最先端の金融テクノロジーを活かし、資産運用のパートナーとしてお客さまの期待を超えるソリューションを提供することを使命としています。独創性ある投資アイデアの実現を通じて、お客さまの豊かな未来に向けた資産運用の伴走者となることを目指しています。

■AlpacaTech について

AlpacaTech は、「データサイエンスで金融のリミットを超える」を掲げ、最先端の AI リサーチを活用した独自開発のアルゴリズムや AI スコア生成により、中長期にわたる様々なモデリングを実現しています。AlpacaTech の AI 技術は、AI 投資「ROBOPRO」の運用エンジンにも採用されているほか、Google Cloud 主催の「生成 AI Innovation Awards」で最優秀賞を受賞するなど、高い技術力を有しています。

■第一生命ホールディングス株式会社について

第一生命ホールディングスは、生命保険事業を中心に、資産形成・承継事業、さらに非保険事業へと事業領域を拡大しています。今後、社業を生命保険領域にとどまらない「保険サービス業」へと進化させ、一人ひとりに寄り添い「人生」の可能性をひらく企業へと変革を遂げることで、「グローバルトップティアに伍する保険グループ」へと大きな成長を実現していくことを目指しています。2026 年 4 月には社名を「株式会社第一ライフグループ」へ変更し、グループブランドも「Daiichi Life」へ刷新します。

所在地：東京都千代田区有楽町一丁目 13 番 1 号

事業内容：生命保険会社、損害保険会社その他の保険業法の規定により子会社とした会社の経営管理および付帯業務のほか、保険業法により保険持株会社が行うことができる業務

代表者：代表取締役社長 グループ CEO 菊田 徹也

創立：1902 年 9 月 15 日

URL：<https://www.dai-ichi-life-hd.com>

■株式会社 FOLIO ホールディングスについて

FOLIO ホールディングスは、「明日の金融をデザインする。」をミッションとして掲げ、これからの社会に求められる金融ソリューションの創出を通じて、豊かな未来の実現を目指しています。現在は、一般のお客さまや金融機関に対して投資一任運用ソリューションや投資助言サービスを提供する株式会社 FOLIO と、金融業界向けの投資・運用・調査・分析・システム連携に係るソリューションを開発する AlpacaTech 株式会社を傘下に擁し、両社による強力な事業シナジーのもと、高度な技術力を駆使した金融ソリューションを拡充しています。なお、FOLIO ホールディングスは東京証券取引所プライム市場に上場し SBI 証券を傘下に擁する SBI ホールディングス株式会社のグループ会社です。

所在地：東京都千代田区一番町 16-1 共同ビル一番町 4 階

事業内容：グループ会社の経営管理および付帯業務

代表者：代表取締役社長 兼 CEO 甲斐 真一郎

設立：2019 年 4 月 1 日

URL：<https://folio-hd.com>

■バーテックス・インベストメント・ソリューションズ株式会社 会社概要

所在地：東京都千代田区有楽町一丁目 13 番 1 号

事業内容：投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

登録番号：金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 3355 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

代表者：代表取締役社長 星野 元伸

設立：2022 年 8 月 1 日

URL：<https://www.vtx-is.com/>

■AlpacaTech 株式会社 会社概要

所在地：東京都千代田区平河町 1-6-4 H1O 平河町 703

事業内容：AI 技術を用いた金融市場予測・データマネージメント・システム開発等のソリューション、投資助言・代理業

登録番号：金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 3453 号

加入協会：一般社団法人日本投資顧問業協会

代表者：代表取締役 CEO 四元 盛文

設立：2022 年 7 月 8 日

URL：<https://www.alpaca-tech.ai/>

本件に関するお問い合わせ先

バーテックス・インベストメント・ソリューションズ株式会社 広報担当

E-mail：ml_plan-mng@vtx-is.com