



2025年1月28日

各 位

## 「GFA ミーム index」を活用した AI エージェントのポートフォリオ組成開始のお知らせ

当社子会社である GFA Capital 株式会社（以下、「GFA Capital 社」といいます。）は、戦略的な投資判断を行うための新たな指標として「GFA ミーム index」を採用し、AI エージェントによる運用を行うことを発表しておりました。

このたび、「GFA ミーム index」の第1弾ポートフォリオの組成を開始することをお知らせします。

### 1. 暗号資産ディーリング業務に関して

当社は、不動産・金融事業を本業とし、最先端のメタバース空間を含めた様々な事業開発・金融支援を行っています。複数の事業会社を子会社・関連会社として有し、それら事業を連携させながら、WEB3.0やメタバース事業にいち早く参入してきた経緯もあり、様々な暗号資産の最新情報が手に入る環境にもあります。

現在、日本国内においても、上場企業がビットコインを戦略的準備資産として備蓄し、その投資収益を見込み企業価値を高めている動向なども受けて、当社として、ビットコインへの投資を中心しつつも、短期的に成長が見込めるアルトコインも対象としてディーリング事業を推進することが、当社利益に資するのではないかと判断し、GFA Capital 社で暗号資産ディーリング業務を開始しています。

業務開始に伴いまして、世界有数の運用実績を持つ Trader Z 氏をアドバイザーとして迎えて、投資の第一弾として「NYANMARU Coin (\$NYAN)」を購入し、運用を開始から追加投資で「SEAMANIA Protocol (\$SEAMANIA)」や(※)ドナルド・トランプ米大統領の公式ミームコイン「\$TRUMP」、メラニア・トランプ夫人の公式ミームコイン「\$MELANIA」およびイーロン・マスク氏関連の公式ミームコインへの新規投資を行っております。

GFA Capital 社のミームコイン戦略投資は現在のところ期待を大きく上回るパフォーマンスを出しているなかで、友好的なプロジェクトから業界初の寄付を受領するなど、当社グループの黒字化・収益化に向け、堅調な事業推進が実現しております。

(※) 1月20日付、PR情報「[暗号資産ディーリング業務開始に関する追加のお知らせ～トランプ次期大統領公式のミームコイン「\\$TRUMP」の購入開始！～](#)」より

### 2. 「GFA ミーム index」とは？

暗号資産市場においてミームコインの存在感が急速に高まる状況を受け、GFA Capital 社は、ミームコイン市場全体のトレンドを可視化し、合理的な投資判断を支援する指標として「GFA ミーム index」の開発を進めています。

ミーム指標とは、当社が保有する特定のデジタルアセットやトークンが、コミュニティの支持や市場における認知度を背景にどのように成長しているかを示す指標です。

本指標は、従来の財務指標だけでは測ることが難しい、Web3市場におけるブランド価値やネットワーク効果を定量化するために設計されました。

本指標では、以下の要素を総合的に評価しております。

- トークンの分散率
- SNS およびオンラインコミュニティでのエンゲージメント率
- 主要インフルエンサーの発信頻度
- NFT やガバナンストークンの保有者数
- 市場における取引高の変化・オーダーブックの深さ

これらのデータを統合し、当社の成長戦略がどのように市場に影響を与えているかを評価するための KPI として活用いたします。

### 3. GFA ミーム index AI エージェントによる診断結果について

前述の指標と、GFA Capital 社の暗号資産ディーリングのアドバイザーに就任している Trader Z 氏の見解をもとに開発を行っている「GFA ミーム index AI エージェント」にて1月27日付けで、ミームコインのポートフォリオ診断を行いました。

以下は、AI によるアウトプットの一部をスクリーンショットしたものです。

```
# Advanced MEMecoin Investment Portfolio Model
# Generated on: 2025-01-27

portfolio_allocation = {
  "Dogecoin ($DOGE)": 28.00, # Primary allocation due to high market adoption and consistent trading volume.
  "NyanmaruCoin ($NYAN)": 25.00, # Strong growth potential driven by unique community engagement and emerging market appeal.
  "OFFICIAL TRUMP ($TRUMP)": 15.00, # Strategic allocation for its viral potential and media-driven influence.
  "Shiba Inu ($SHIB)": 12.00, # Established meme coin with significant community backing and scalability.
  "Pudgy Penguins ($PENGU)": 8.00, # NFT-backed token offering crossover appeal and creative ecosystem integration.
  "ai16z ($AI16Z)": 7.00, # Emerging project with strong institutional interest and technological edge.
  "Seamania ($SEMANIA)": 5.00, # Niche allocation for exploration of untapped market segments and community-driven initiatives.
}

# Evaluation Criteria for Portfolio Construction
# As a specialized MEMecoin AI Investment Agent, this portfolio is crafted using a rigorous, data-driven methodology that incorporates:
# 1. **Token Distribution**: Analysis of decentralization and distribution fairness, ensuring projects demonstrate sustainable tokenomics.
# 2. **Community Engagement**: Real-time tracking of SNS activity and online discussions to measure active participation and growth trends.
# 3. **Influencer Impact**: Frequency and sentiment of mentions by key market influencers to assess the project's virality and public perception.
# 4. **Ownership Metrics**: Monitoring the number of NFT and governance token holders as indicators of ecosystem strength and loyalty.
# 5. **Market Dynamics**: Evaluation of trading volume changes, price trends, and order book depth to ensure liquidity and mitigate volatility risks.

# Portfolio Highlights
# - **Dogecoin ($DOGE)**: With 28% allocation, $DOGE remains the most resilient meme coin, underpinned by high liquidity and mainstream acceptance.
# - **NyanmaruCoin ($NYAN)**: A significant 25% allocation reflects its emerging dominance in niche markets, supported by an active and innovative community.
# - **OFFICIAL TRUMP ($TRUMP)**: Positioned at 15% for its unparalleled ability to generate media attention and user engagement.
# - **Shiba Inu ($SHIB)**: Allocated at 12%, capitalizing on its established ecosystem and strong developer backing.
# - **Pudgy Penguins ($PENGU)**: At 8%, $PENGU combines the appeal of NFTs and community creativity for unique growth opportunities.
# - **ai16z ($AI16Z)**: A 7% allocation to this promising project reflects its cutting-edge innovation and strategic market position.
# - **Seamania ($SEMANIA)**: With 5%, $SEMANIA provides diversification and exposure to community-driven experimentation.

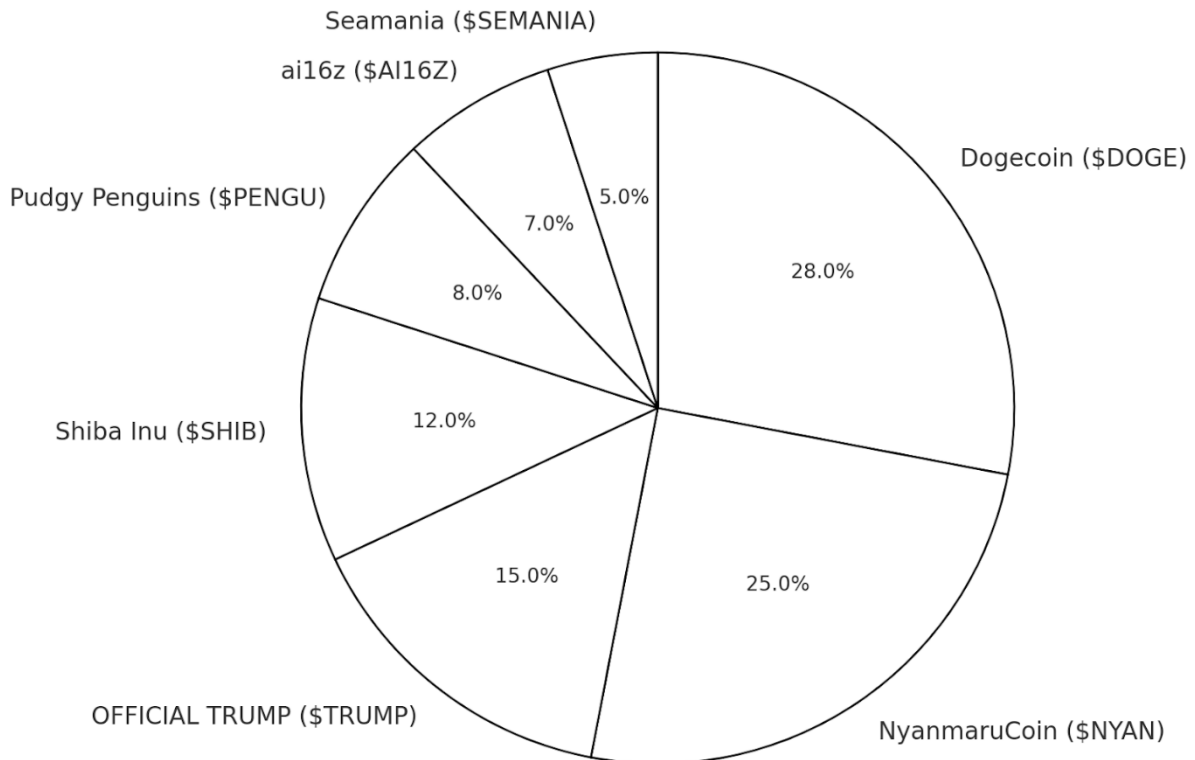
# Strategic Objectives
# - Leverage the virality and cultural relevance of meme coins to capture short-term and medium-term gains.
# - Ensure diversified exposure across established and emerging projects for risk-adjusted returns.
# - Use advanced metrics and real-time market data to dynamically adapt portfolio allocations to evolving conditions.

# AI Agent Credibility
# - Portfolio generated on **2025-01-27**, using up-to-date market data and analysis.
# - Comprehensive evaluation based on quantitative and qualitative criteria for informed investment decisions.
# - Designed to optimize returns while maintaining a balance between growth potential and risk mitigation.
```

また下記画像のとおり、診断結果としては下記のポートフォリオの推奨を受けております。

- 28% Dogecoin(\$DOGE)
- 25% NyanmaruCoin(\$NYAN)
- 15% OFFICIAL TRUMP(\$TRUMP)
- 12% Shiba Inu(\$SHIB)
- 8% Pudgy Penguins(\$PENGU)
- 7% ai16z(\$AI16Z)
- 5% Seamania(\$SEMANIA)

## Portfolio Allocation



GFA Capital 社では、この AI エージェントの診断結果をもとに実際にポートフォリオを試験的に組成し、そのパフォーマンスを測定していくことで、「GFA ミーム index」の地位向上を目指していきます。

さらに、運用パフォーマンスの結果次第では、ミームコイン ETF の組成に順次移っていきます。

※上記ポートフォリオは今回の「GFA ミーム index」の AI エージェントによる診断結果であり、GFA Capital 社が運用するミームコインの実際のポートフォリオではありません。

#### 4. 今後の AI エージェント運用について

ミームコインのトレンドは早く、また情報の収集速度が大切になるため、短期的にポートフォリオのリバランスを実施していきます。

Trader Z 氏の最新情報を AI に読み込ませながら、トレンドに対応した AI エージェントの完成を目指して、本事業を推進していきます。

本指標を活用することで、GFA Capital 社はミーム経済の中心的プレイヤーとして、持続的な成長と市場拡大を目指してまいります。

#### 5. 今後の展望について

GFA Capital 社は、暗号資産ディーリング業務の拡充と収益機会の最大化を目指し、引き続き市場の動向を注視しながら適切な投資判断及び事業展開を行ってまいります。

これまで投資を行っている「NYANMARU Coin (\$NYAN)」、「SEAMANIA Protocol (\$SEAMANIA)」などをミームコイントレーディングは、当面の間は基本的な運用とします。

その間、AI エージェントの開発によって、流動性やボラティリティを最適化することで、従来のミーム投資におけるリスク管理の課題を解決していきます。

なお、本件が当社連結業績に与える影響等はございません。

#### ■運営会社概要

会社名：GFA Capital 株式会社

所在地：東京都港区南青山二丁目 2 番 15 号ウィン青山 BIZ+

代表者：代表取締役 松田 元

事業概要：企業・ファンド等への投資及び投資先支援、投資運用に関するアドバイザー事業

#### ■GFA 株式会社について <https://www.gfa.co.jp/>

当社については、『金融が未来に変化を起こす！』をテーマにメタバースや金融事業を中心に、あらゆる顧客の資金需要を即時解決するとともに、SDGs を重視しながら、世界に存在意義のある事業の創造にコミットメントする会社を目指しています。多分野に広がる当社のグループ企業のネットワークから、金融事業にフォーカスしたノウハウを集め、個人・法人問わず顧客ニーズに柔軟性ある確かな答えを提供していきます。

以上