

2015年9月25日

各位

株式会社 GCI アセット・マネジメント
代表取締役 CEO 山内 英貴**当社初の公募株式投資信託 “GCI エンダウメントファンド(成長型/安定型)” 設定のお知らせ**

下記の通り、楽天証券株式会社を販売会社として、当社初の公募株式投資信託である“GCI エンダウメントファンド(成長型/安定型)” が本日設定の運びとなりましたので、お知らせ申し上げます。

記

1. GCI エンダウメントファンド(成長型/安定型)の設定額について

- (1) 成長型 : 163,901,223円
- (2) 安定型 : 108,052,606円

*当初元本額となります。

2. “GCI エンダウメントファンド”(以下、当ファンド)について

当ファンドは、ハーバード大学やイエール大学等、米国名門大学の大学財団(エンダウメント)が寄付金等の運用において実践してきた投資手法・スタイルを模範とし、日本の個人投資家が長期にわたり、安心して投資していただけるように考えて作られた投資信託です。

実質的に世界の株式・債券・REIT(不動産投資信託)・オルタナティブ戦略に分散投資を行いつつ、オルタナティブ戦略以外の資産クラスについては上場投資信託(ETF)を組み入れることにより、ファンドの信託報酬を低位に抑えています。

加えて、ファンドの純資産総額が一定以上に拡大すると、信託報酬が低減する仕組みを採用しているため、長期的にさらなる運用成果の向上を図ることが期待されます。

また、個人投資家のみなさまは、ご自身のニーズやリスク許容度によって、<成長型>と<安定型>の2つのタイプからお選びいただけます。当ファンドは、個人投資家の主要資産として、NISA 口座での運用対象としても適したものであると考えております。

2. 当ファンドの概要ファンド名:GCI エンダウメントファンド(成長型/安定型)
商品分類:追加型投信/内外/資産複合

継続申込期間:平成 27 年 9 月 25 日(火)から平成 28 年 12 月 21 日(木)まで
 信託期間:原則として無期限
 委託会社:GCI アセット・マネジメント
 販売会社:楽天証券(販売会社は今後順次追加予定)

3. 当ファンドの特色

(1)「エンダウメント」(米国名門大学財団)の投資手法を模範とした長期運用を行います。



当ファンドの投資対象

資産クラス一覧	
日本株	海外債券 (グローバル 除く米ドル建て)
先進国株 (米国)	REIT (日本)
先進国株 (除く北米)	REIT (米国)
新興国株	オルタナティブ戦略
先進国債券 (米国)	

※投資対象とその比率については、必要に応じて見直します。
 また、ETFなど市場流動性の高い商品に投資することにより、ファンドの流動性を確保します。
 外貨建資産については、投資判断により対円での為替ヘッジを行うことがあります。

(3)オルタナティブ戦略を組み入れます。

当社の「GCI システムティック・マクロファンドクラス A」(外国投信)および日本短期債券(適格機関投資家限定)をオルタナティブ戦略として組み入れることで、さらなる分散効果とパフォーマンスの向上を図ります。

(4)運用コストを抑制します。

信託報酬を上限年率 0.65%(税抜)と低く抑えることで、長期投資に際して継続的に発生する運用コストを抑制します。また、投資信託の規模が一定程度にまで拡大すると信託報酬が低減する仕組みを採用しております。

伝統資産への投資に際しては、さまざまな上場投資信託(ETF)を活用することで運用コストの抑制を図ります。各国市場へ上場しているETFのうち、流動性などを考慮しながら、より低コストの銘柄を選別します。

＜オルタナティブ投資の運用報酬等について＞

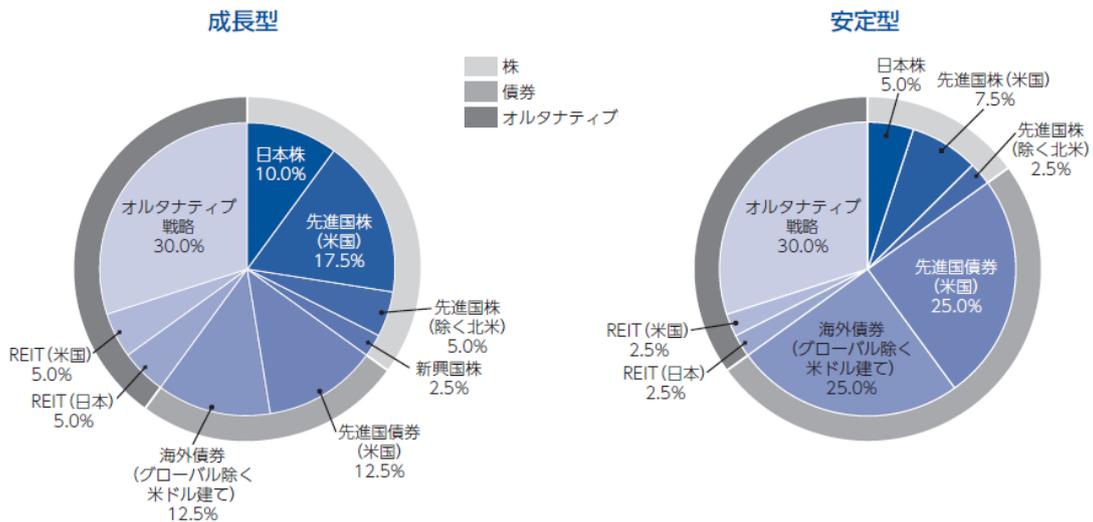
オルタナティブ戦略部分の運用報酬等については、GCI システムティック・マクロファンドクラス A の管理報酬が年 3.0%/成功報酬 20%、日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)の信託報酬が年 0.1404%(税抜 0.13%)となっています。実際の運用では、それぞれの投資対象ファンドを一定の比率で組み合わせることを想定しているため、同戦略部分の実質的な運用報酬率は年率 1.28%程度となります。

また、オルタナティブ戦略を含む投資対象ファンドの運用報酬等とGCIエンダウメントファンドの信託報酬を合わせた投資者が実質的に負担する額の合計は、年率 1.152%(税込)程度となっています。

(注)投資対象ファンドにおいては、運用報酬(管理報酬や信託報酬)の他に成功報酬がかかる場合があります。成功報酬は運用状況などにより変動するものであり、事前に上限額などを表示することができません。そのため、上記記載のオルタナティブ戦略部分の実質的な運用報酬率および投資者が実質的に負担する額の合計には、成功報酬は含まれていません。

(5)「成長型」「安定型」2つのコースをご提供いたします。

各ファンドの基本資産配分



※各資産クラスへの配分ターゲットは、30%以内を基本とします。
 ※各資産クラスへの配分がターゲット・ポートフォリオから3%以上乖離した場合にはリバランスを実行します。
 ※運用にあたりレバレッジは用いません。
 ※基本資産配分は、1年に一回程度検証を行い、必要に応じて見直しを行います。
 ※上記は、平成27年6月末時点で作成した当面のイメージであり、実際の資産配分比率とは異なる場合があります。
 ※オルタナティブ戦略については、投資信託証券により想定されるリスク水準(リターン)の振れの度合いが異なることから、年率標準偏差10%程度を基準として当該資産クラスの基本資産配分比率を決定します。オルタナティブ戦略として組み入れる投資信託証券の想定リスク水準が基準値(年率10%)より高い場合は、実際の投資組入比率を引き下げて調整を図ります。

株式会社 GCI アセット・マネジメントについて

- 2000 年創業の本邦独立系運用会社
 - オルタナティブ投資を専門として事業展開
 - 国内大学と共同での金融教育関連産学連携アプローチ
 - 海外ヘッジファンドメディア「アジア・ヘッジ」や「ユーレカ・ヘッジ」等でのアワード受賞実績
 - 運用資産残高:1,096 億円(2015 年 6 月末時点)
- 金融商品取引業者関東財務局長(金商)第 436 号
 一般社団法人日本投資顧問業協会加入 一般社団法人投資信託協会加入
<http://www.gci.jp/index2.html>

当社サービスについて

当社はヘッジファンドあるいはファンド・オブ・ファンズへのご投資にあたり、以下のサービスをご提供しています。



以上
IT150907-02

【お問い合わせ先】

株式会社 GCI アセット・マネジメント
 チーフ・マーケティング・オフィサー 太田 創(おおた つくる)
 TEL:03-3556-5574 E-mail: tsukuru.ota@gci.jp