

2010年6月10日

ヘッジファンド運用に特化した独立系運用会社GCIアセット・マネジメント株式会社(本社:東京都千代田区、社長末永孝彦、以下「GCI」)は、オリックスグループの運用会社オリックス・インベストメント株式会社(本社:東京都港区、社長伏谷清、以下「OIC」)と世界の金融・コモディティー市場に投資するオリックス・コモディティーズ・ファンド(ORIX COMMODITIES Fund)(以下「OCF」)をこのたび共同でローンチいたしました。

OICは、オリックスグループの中でオルタナティブ投資を専門に担当する運用会社であり、米国のコモディティーズ・コーポレーション(1997年にゴールドマン・サックスが買収)との合併会社として1990年に設立され、以来、先物運用に関するノウハウ、ビジネスネットワークを蓄積してきました。金融・コモディティー市場のトレンドを分析するシステム運用をおこなうCTA(コモディティー・トレーディング・アドバイザー)として定評があり、今般立ち上げましたOCFのベースとなる自社開発システム運用では過去15年間平均年間リターン10%超と良好な運用成績をあげています。

OCFは、OICが10年以上にわたり培ってきた自社開発モデルに基づく運用を発展させた複数の運用モデルを運用エンジンとしたCTAファンドです。10余年のトラックレコードを有する同社トレーディング・グループ長の森敦仁氏がOCFの運用戦略の立案、投資助言を担当、GCIのシンガポール現地法人GCI Investment Management Singapore Pte., Ltd.(以下「GCIIMS」)が外部投資家の資金を運用していく同ファンドの運営を担当いたします。10余年のトラックレコードを有するCTAは世界でも稀有、日本でも最長の部類に入ります。トラックレコードの長さはCTA運用の世界ではロバストネスの一つのプルーフとなりますがそれを既に証明しており、過去、幾度にわたる金融危機下で優れた運用成績を発揮してまいりました。

OCFは世界の主要取引所に上場される80以上の上場先物商品に分散投資しますが、アジアの割合が2~3割程度ある点に特色があります。ストップロス等、厳格なリスクマネジメント手法をシステムに内包しております。

GCIは2000年に旧日本興業銀行出身の山内英貴氏により設立されたヘッジファンド投資に特化した独立系の運用会社で、企業の資本構成に着目した独自の運用手法を持ち高い運用実績を持つGCIジャパンハイブリッドファンド、日本並びにアジアの新興マネジャーに着目したファンド・オブ・ヘッジファンド、サザンクロス・ファンド等ユニークなファンドを運営しています。

OCFはGCIが日本の優秀な運用者を発掘し、内外の機関投資家からの投資資金で育成していく目的で設定したジャパン・アルファ・トラスト傘下の第一号ファンドとなります。OCFの当初運用資

金額は約 40 億円で、将来的に 200 億円から 300 億円程度の運用資産規模をめざしてまいります。

ジャパン・アルファ・トラストは永井晋一郎インベストメント・グループ・シニアマネジャー(旧富士銀行出身)並びにGCIIMSの青木哲也マネージング・ディレクター(丸紅出身)が運営を担当しており、優れた運用手法を持つマネジャーのファンド設立を支援するとともに、新興マネジャーが運営する既存ファンドへの投資も行っていく予定です。

(終わり)