

2018年6月20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・公募株式投資信託 “マルチアセット・ストラテジーファンド” 愛称「なごみの杜^{もり}」
新規設定のお知らせ

下記の通り、本日、“マルチアセット・ストラテジーファンド” 愛称「なごみの杜^{もり}」が設定されましたので、
ここにお知らせ申し上げます。

記

1. ファンド名

“マルチアセット・ストラテジーファンド” 愛称「なごみの杜^{もり}」 追加型投信／内外／資産複合
(日本経済新聞 オープン基準価格表記名: なごみの杜)

2. 助言会社: **株式会社和キャピタル**

3. 販売会社: **岡崎信用金庫** (当初は本店営業部のみでの取扱い。7月5日(木)から全店舗取扱い。)

4. 当ファンドの特徴と類似戦略の運用実績

<ファンドの特徴>

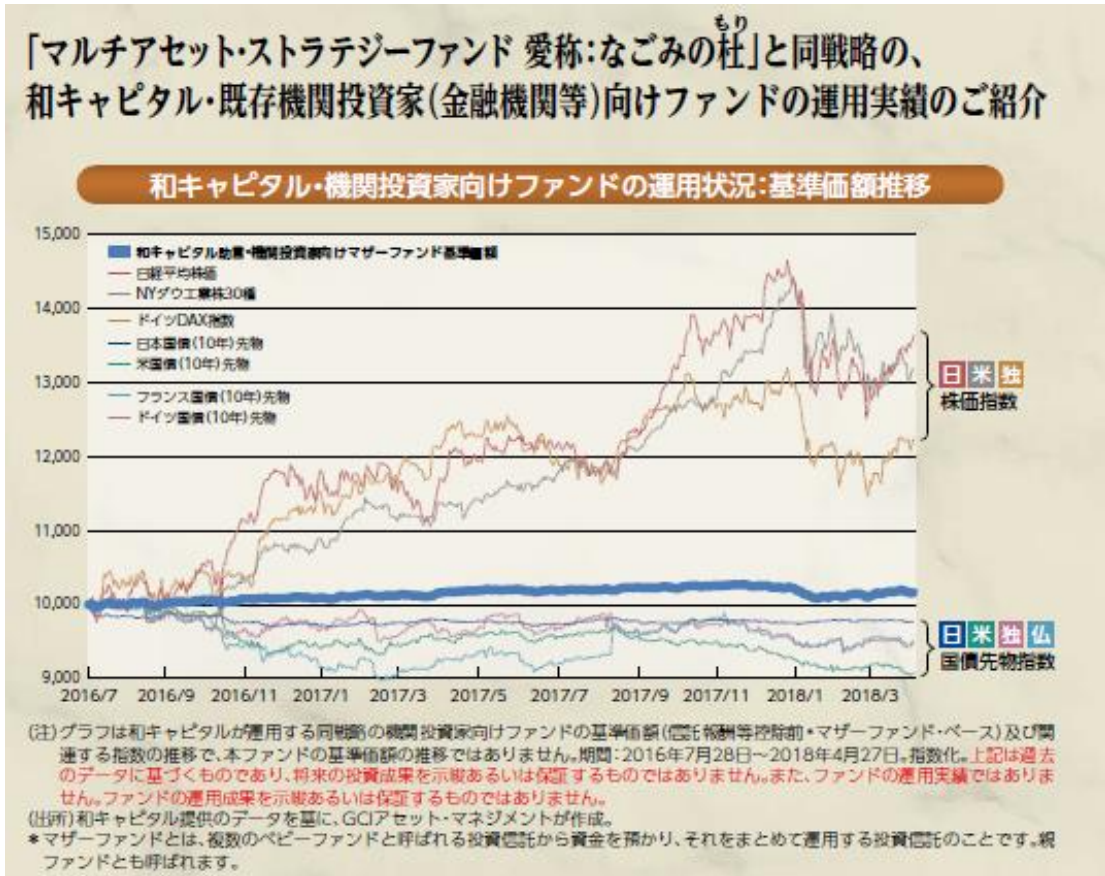
特徴1 流動性の高い資産に限定した投資
日米欧の国債、日米欧の株式指数インデックスを中心とした運用を行います。

特徴2 機動的な運用による市場のリスクに備えた安定的な収益の確保
中長期のファンダメンタル分析に加え、短期の価格変動を機敏にとらえリスク量を管理しつつ収益機会の確保を目指します。

特徴3 資産クラス横断的投資判断によるポートフォリオ管理
現金も含めて戦略資産と位置付けて、市場動向に応じて最適な資産に投資を行うことで全資産でリスク量を抑えた安定収益を目指します。

特徴4 為替ヘッジを行います。
実質外貨建て資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。

＜類似戦略の運用実績＞



5. お申し込みメモ

購 入 単 位	販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購 入 価 額	当初申込期間:1口当たり1円とします。 継続申込期間:購入申込受付日の登営業日の基準価額とします。 (ファンドの基準価額は1万口あたりで表示しています。)
購 入 代 金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換 金 単 位	販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
換 金 価 額	換金申込受付日の登営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した額とします。
換 金 代 金	原則として、換金申込受付日から起算して6営業日目から販売会社を通じてお支払いします。
申 込 締 切 時 間	原則として午後3時までに販売会社を受け付けた分を当日のお申込み分とします。
購 入 の 申 込 期 間	当初申込期間:2018年6月8日から2018年6月19日まで 継続申込期間:2018年6月20日から2019年5月10日まで ※申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。
購 入 ・ 換 金 の 申 込 受 付 不 可 日	ニューヨークの銀行休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日およびロンドンの銀行休業日 ※詳しい申込受付不可日については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。
換 金 制 限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には別途制限を設ける場合があります。
購 入 ・ 換 金 申 込 受 付 の 中 止 お よ び 取 消 し	金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金のお申込みを取り消すことがあります。
信 託 期 間	2018年6月20日(設定日)から2023年2月27日 ※受益者に有利であると認められたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。
繰 上 償 還	受益権の総口数が10億口を下ることとなった場合等は、償還となる場合があります。
決 算 日	原則、毎年2月および8月の各10日(休業日の場合は登営業日)
収 益 分 配	年2回決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。 収益分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
信 託 金 の 限 度 額	1兆円
公 告	原則として電子公告の方法により行い、委託会社のホームページにて行います。 URL : http://www.gci.jp/index2.html
運 用 報 告 書	毎決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に交付します。
課 税 関 係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度(NISA)および未成年者少額投資非課税制度(ジュニアNISA)の適用対象です。 配当控除・益金不算入制度の適用はありません。

6. ファンドの費用と税金

ファンドの費用					
投資者が直接的に負担する費用					
購入時手数料	購入申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間は1口につき1円）に 2.16%（税抜2.0%） を上限として、販売会社が定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。	購入時手数料は、商品説明、募集・販売の取扱事務などの対価として、販売会社にお支払いいただくものです。			
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に 0.05% の率を乗じて得た額を、ご換金時にご負担いただきます。				
投資者が信託財産で間接的に負担する費用					
運用管理費用 （信託報酬）	純資産総額に対し 年率0.864%（税抜0.80%）以内 運用管理費用（信託報酬）は毎日計算し、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。信託報酬率の配分はファンドの純資産総額の残高に応じて変更します。 信託報酬の配分ならびにこれらに対価とする役務の内容は以下のとおりです。				
	純資産総額	運用管理費用 （信託報酬）<合計>	運用管理費用（信託報酬）<内訳>		
			委託会社	販売会社	受託会社
	～100億円以下 部分	0.864% （税抜0.80%）	0.6156% （税抜0.57%）	0.216% （税抜0.20%）	0.0324% （税抜0.03%）
100億円超 部分～	0.810% （税抜0.75%）	0.5616% （税抜0.52%）	0.216% （税抜0.20%）	0.0324% （税抜0.03%）	
役務の対価	運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率	委託した資金の運用、基準価額の算出、開示資料の作成などの対価	購入後の情報提供、運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、各種事務手続きなどの対価	信託財産の管理、委託会社からの指図の実行など	
※投資助言会社である株式会社和キャピタルに対する報酬は、委託者報酬の中から支弁されます。					
その他の費用・手数料	<売買委託手数料など> 有価証券売買時の売買委託手数料、立替金の利息、ファンドに関する租税などが信託財産から支払われます。これらの費用は運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することができません。 <信託事務の諸費用> 監査費用、印刷費用、計理業務およびこれに付随する業務に係る費用などの諸費用が信託財産の純資産総額の年率0.1%を上限として日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。				
※投資者の皆さまにご負担いただく手数料等の合計額については、当ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。					

税金		
税金は下記の表に記載の時期に適用されます。 下記の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法などにより異なる場合があります。		
時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金（解約）時 および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して20.315%

7. 投資リスク

基準価額の変動要因

当ファンドは、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、**投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者の皆さまに帰属します。なお、投資信託は預貯金とは異なります。**

当ファンドが有する主なリスク要因は以下の通りです。

株価変動リスク	株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢などにより変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
金利変動リスク	債券などの価格は、一般的に金利低下(上昇)した場合は値上がり(値下がり)します。なお、債券などが変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者などの財務状況の変化などおよびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢などにより変動します。債券などの価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
為替変動リスク	為替相場は、各国の経済状況、政治情勢などの様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、当ファンドおよび投資信託証券において、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図りますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分等のコストがかかることにご留意ください。
信用リスク	投資対象となる債券等の発行体において、万一、元利金の債務不履行や支払い遅延(デフォルト)が起きると、債券価格は大幅に下落します。この場合、当ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。また、格付機関により格下げされた場合は、債券価格が下落し、当ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。
カントリーリスク	投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化などにより市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、方針に沿った運用が困難となり、基準価額が下落することがあります。
流動性リスク	時価総額が小さい、取引量が少ないなど流動性が低い市場、あるいは取引規制などの理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

●ファミリーファンド方式に関する留意事項

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行うため、マザーファンドにおいて他のペーパーファンドによる追加設定、一部解約等に伴う有価証券の売買等が行われた場合、当ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

●収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は、前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

●当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

リスクの管理体制

運用リスクの管理については、運用部門から独立したリスク・マネジメント・グループが日々運用状況の分析およびモニタリングを行い、原則として週次で開催される運用リスク管理会議にて運用リスクの適切性を検証・評価し、リスク管理会議および運用政策会議に報告されます。また、問題が生じた場合には速やかに臨時で招集される運用政策会議に報告が行われ、その対応策が検討・決定される体制となっています。

事務リスク等の管理については、原則として月次で開催される事務リスク等管理会議において、運用に係る業務運営の適切性が検証され、リスク管理会議に報告される体制となっています。

そして、リスク管理会議において、各リスクの発生の有無・状況の把握、対応方針の検討・決定および進捗状況の管理などを行い、重要な事項はさらに運用政策会議に報告される体制となっています。

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投資運用会社
- 日本におけるオルタナティブ投資の黎明期から、オルタナティブ投資を専門として事業展開
- 絶対リターン型の特色あるインハウス運用にフォーカスし、国産運用の強化に最注力
- 東京大学との共同研究に基づく産学連携アプローチ
- Asia Hedge Awards や Eureka Hedge Awards などでの受賞実績(2012 年から 3 カ年連続)
- モーニングスター ファンド オブ ザ イヤー2017 及び 2016 の最優秀及び優秀ファンド賞受賞：
GCI エンダウメントファンド(成長型/安定型)
- 契約資産 1,528 億円(2018 年 3 月末現在:グループ全体)

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>

株式会社和キャピタルについて

■ 投資助言業

地域金融機関を始めとする機関投資家(特定投資家)に対して、流動性を確保しながら機動的運用を行うことで、安定的かつ持続的な収益を確保することを目指す投資助言サービスを提供しています。

■ 投資人材開発支援

トレーニーの「場」を通じて、弊社の投資実践の考え方や手法等を参考にしながら貴社に最も適した運用手法を自ら考えていただきます。それを現場で実践し再度集合して課題を議論し、再度実践して改善につなげるという議論⇔実践の人材開発を支援します。

■ 投資組織開発支援

投資の組織は預貸業務の延長線上にはありません。我々は、投資の意思決定における責任と権限を明確にし、一方でリスク管理のプロセスを見直すことによって、より迅速で効果的な判断ができるような組織構築を支援します。

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 2924 号

加入協会:一般社団法人 日本投資顧問業協会

<http://www.nagomicap.com>

以上

【お問合わせ先】

株式会社 GCI アセット・マネジメント

執行役員 投資信託事業グループ

太田 創(おおた つくる)

TEL:03-3556-5574 E-mail: tsukuru.ota@gci.jp

IT180620-1