

受益者の皆様へ

株式会社GCIアセット・マネジメント

『GCIエンダウメントファンド（成長型/安定型）』 月次レポートにおけるお詫びと訂正のお知らせ

平素は当社投資信託に格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「GCIエンダウメントファンド（成長型/安定型）」の月次レポートにつきまして、記載内容に一部誤りがございました。誤記載についてお詫びを申し上げますとともに、訂正内容に関して、以下の通りご報告申し上げます。

今後、一層の業務管理体制の向上に努めて参りますので、何卒ご高察賜りますようお願い申し上げます。

記

1. 対象ファンド

GCIエンダウメントファンド（成長型/安定型）

2. 対象レポート

月次レポート（2024年7月31日基準）

3. 訂正内容

- 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I システムティック・マクロファンドVol10クラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（8ページ）
- 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I ディバーシファイドアルファファンドクラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（9ページ）

※詳細は次項以降をご覧ください。

< 本件に関するお問い合わせ先 >

株式会社GCIアセット・マネジメント

TEL : 03-6665-6952（受付時間：9時～17時 ※土日祝・年末年始を除く）

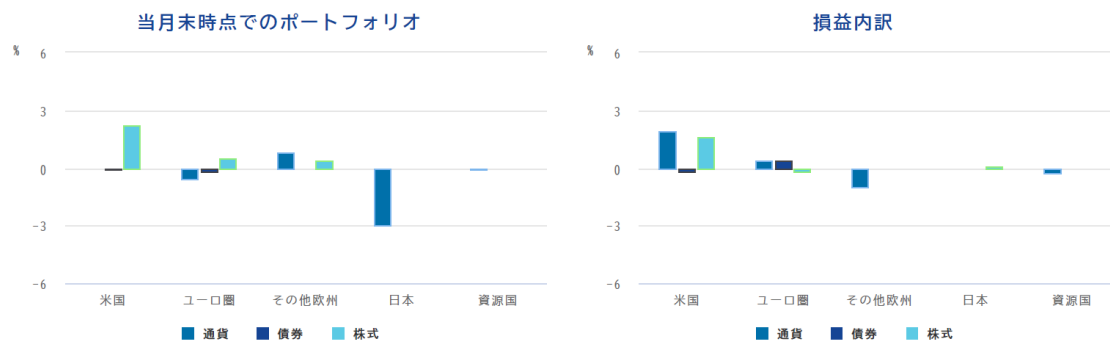
< お客さまの個別のお取引内容についてのお問い合わせ >

お取引先の販売会社にお問い合わせください。

4. 訂正内容詳細

- 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I システムティック・マクロファンドVol10クラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（8ページ）

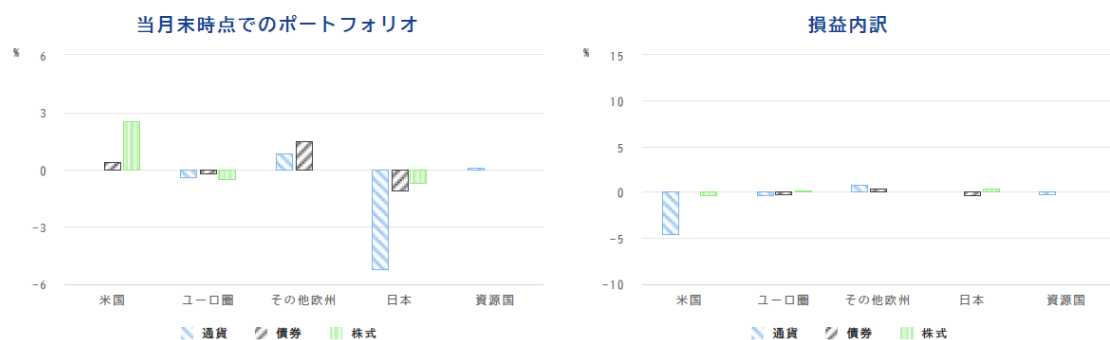
【誤】



※ 上記ポートフォリオ断面のグラフは、ポジションを構築するにあたって差し入れる証拠金の対純資産総額比率です。マイナスはショートポジションを意味します。証拠金はリスク見合いで差し入れるものであるため、当該指標はポートフォリオにおけるリスクをより実態に近い形で表すものと考えられています。

※ 上記損益内訳は信託報酬、成功報酬等控除前のものです。

【正】

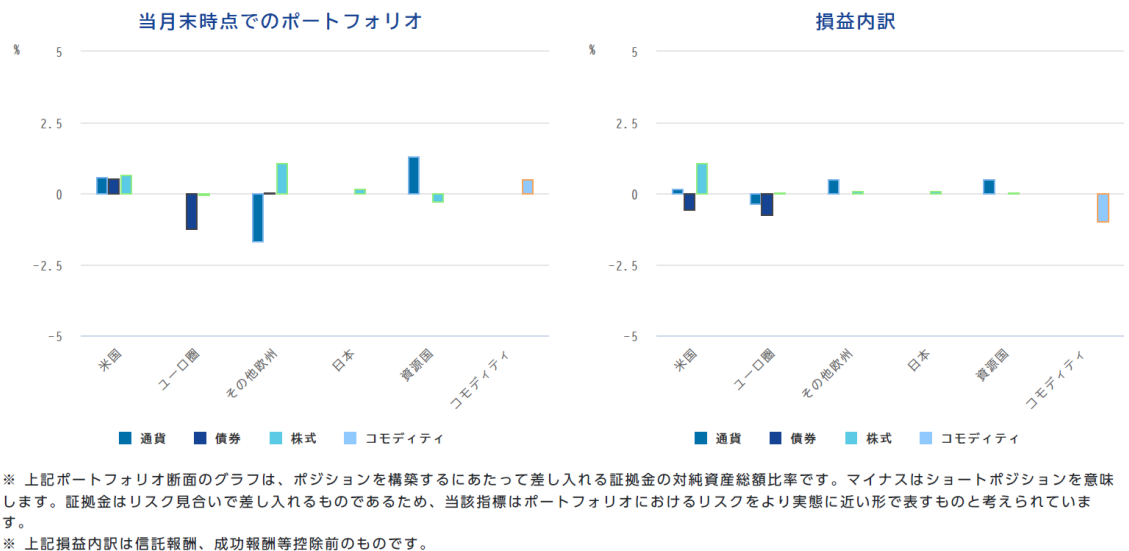


※ 上記ポートフォリオ断面のグラフは、ポジションを構築するにあたって差し入れる証拠金の対純資産総額比率です。マイナスはショートポジションを意味します。証拠金はリスク見合いで差し入れるものであるため、当該指標はポートフォリオにおけるリスクをより実態に近い形で表すものと考えられています。

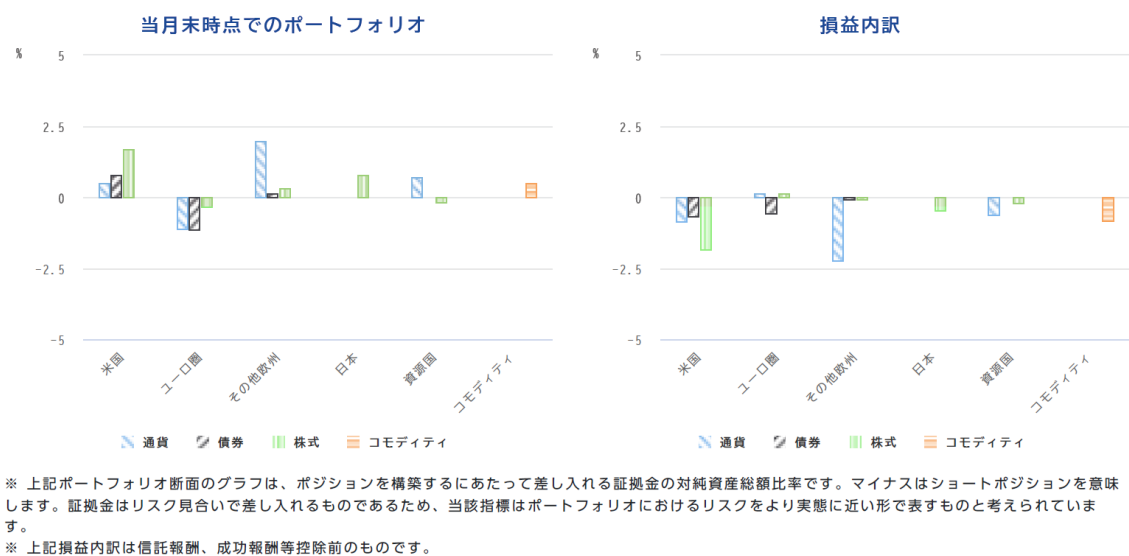
※ 上記損益内訳は信託報酬、成功報酬等控除前のものです。

・ 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I ディバーシファイドアルファファンドクラスAの資産
の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（9ページ）

【誤】



【正】



以上