

2021年6月25日

受益者のみなさまへ

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)
投資対象ファンド追加のお知らせ

拝啓 時下ますますご清栄のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「GCI エンダウメントファンド(成長型/安定型)」(以下「当ファンド」といいます。)は、ファンド・オブ・ファンズ方式により、投資資産のうち伝統的資産に加えてオルタナティブ投資(以下「ヘッジファンド」といいます。)を活用したバランス型運用を行っております。

この度、当ファンドの投資対象資産クラスのヘッジファンドに従来の「GCI システマティック・マクロファンド Vol10 クラス A」に加え、自社開発のシステム運用である「GCI ディバーシファイダルファファンド クラス A」を新たな収益源の確保ならびに分散効果の追求を目的として、追加させていただくことになりましたので、お知らせ申し上げます。

なお、当ファンドの運用の基本方針、運用体制等につきましては、実質的な変更はありません。また本お知らせに関しまして、受益者のみなさまのお手続きは不要です。

今後も、お客様の長期資産形成に貢献できるよう、不断の努力を続けてまいります。

引き続きご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

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. 変更内容

当ファンドの投資対象ファンドに、「GCI ディバーシファイダルファファンド クラス A」の追加を行いました。

<概要>

資産クラス	ヘッジファンド
投資対象ファンドの名称	GCIディバーシファイダルファファンド クラスA
ファンド形態	外国籍投資信託
主要な投資対象	世界各国の株式、債券、商品、通貨、為替等
運用の基本方針	システム運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
運用手法	機械学習等の金融技術を駆使し、モデルベースのシステマティックな複数のアプローチを組み合わせた戦略で、流動性の高い上場先物等への投資を通じて、投資対象や地域のみならず、複数のモデルの運用に分散投資を行うことにより、絶対収益の獲得を目指します。
運用目標	目標リターン:年率10%超 目標リスク(標準偏差):年率10%程度
ベンチマーク	ベンチマークなし
運用報酬等	管理報酬年1.2%、成功報酬20% 上記以外にその他の費用等がファンドから支払われます。
委託会社(運用会社)の名称	株式会社GCIアセット・マネジメント

3. 変更日

2021年6月25日

以上

<本件に関するお問い合わせ>

株式会社 GCI アセット・マネジメント

TEL 03-3556-5040

受付時間:午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

株式会社 GCI アセット・マネジメント

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 436 号

加入協会: 一般社団法人日本投資顧問業協会/一般社団法人投資信託協会

当資料は情報提供を目的として株式会社 GCI アセット・マネジメントが作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。投資信託のお申込みに当たっては、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧の上、ご自身でご判断ください。投資信託説明書(交付目論見書)は販売会社までご請求ください。

投資リスクについて

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。**

■投資信託は、購入・保有・換金時に手数料や費用等をご負担いただくことがあります。■投資信託は、預金または保険契約ではないため、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。■証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の保護の対象になりません。■お申込みの際は、必ず最新の投資信託説明書(交付目論見書)で商品内容を確認の上、ご自身でご判断ください。■当ファンドが有するリスク要因には○株価変動リスク○金利変動リスク○リーットの価額変動リスク○為替変動リスク等があります。ただし、以上の説明はすべてのリスクを表したものではありません。その他の項目に関しては、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

ファンドの費用について

■購入時手数料:

購入価額に **1.1%(税抜 1.0%)** 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々営業日の基準価額に **0.1%** の率を乗じて得た額を、ご換金時にご負担いただきます。

■運用管理費用(信託報酬):

純資産総額に対し **年率 0.715%(税抜 0.65%)** 以内。運用管理費用(信託報酬)は毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および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。信託報酬率およびその配分は、ファンドの純資産総額の残高に応じて変更します。

〈投資対象ファンド(投資信託証券)における運用報酬等〉

・成長型: **年率 0.477%程度(税抜 0.476%程度)+成功報酬**

・安定型: **年率 0.468%程度(税抜 0.467%程度)+成功報酬**

※当ファンドにおいては成功報酬はかかりませんが、指定投資信託証券(GCI システムティック・マクロファンド Vol10 クラス A および GCI ディバーシファイダルファファンド クラス A)においては20%の成功報酬がかかる場合があります。

〈実質的な負担〉

・成長型: **年率 1.192%程度(税抜 1.126%程度)+成功報酬**

・安定型: **年率 1.183%程度(税抜 1.117%程度)+成功報酬**

※当ファンドの運用管理費用(信託報酬)に投資対象ファンド(投資信託証券)の運用報酬等を合わせた、投資者が実質的に負担する額の合計です。

※投資対象ファンド(投資信託証券)における運用報酬等ならびに実質的な負担の値はあくまで目安であり、指定投資信託証券の実際の組入れ状況等により変動する場合があります。

※指定投資信託証券(GCI システムティック・マクロファンド Vol10 クラス A および GCI ディバーシファイダルファファンド クラス A)において20%の成功報酬がかかる場合、上記実質的な負担も相応分上がります。

■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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および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。