

2024年7月8日

各位

会社名 SBIグローバルアセットマネジメント株式会社
(コード番号 4765)

(上場取引所 東京証券取引所 プライム市場)

代表者 代表取締役社長 朝倉 智也

開示責任者 執行役員 CFO 小笠原 靖行

SBIアセットマネジメント初の 公募オルタナティブ戦略ファンド設定のお知らせ

当社子会社のSBIアセットマネジメント株式会社(以下「SBIアセット」)は、同社初のオルタナティブ戦略^{*1}を採用したファンドとなる「SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド」(愛称:リキッド・トレンド)(以下「本ファンド」)を設定いたしますので、お知らせいたします。

「SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド」は、2023年7月に発表したSBIホールディングスと英国の大手運用会社であるMan Group plc(以下「マン・グループ」)との合弁会社による商品提供に先駆け第1弾のSBIアセットの商品となります。SBIアセットは、マン・グループとの合弁会社であるSBI-Manアセットマネジメント株式会社から、オルタナティブ市場や同資産に関する一般的な情報提供を受けつつ、マン・グループのAHL Partners LLP(以下「マンAHL」)が運用するアイルランド籍投資法人「Man Funds XVI ICAV-Man AHL Trend Core Class A (JPY) (Unhedged)」(以下「投資先ファンド」)への投資を行い、投資先ファンドを通じて、先進国の株式や債券、金利、為替、コモディティなどの先物等を実質的な投資対象とします。(次頁ご参照)

本ファンドの投資対象市場

出所:マン・グループ

投資対象市場	国債	ドイツ国債(5年)	ドイツ国債(10年)	英国債(10年)	米国債(5年)	米国債(10年)	米国債(20年)	米国債(30年)
	通貨(対米ドル)	オーストラリアドル	カナダドル	ユーロ	日本円	ニュージーランドドル	スイスフラン	イギリスポンド
株式	DAX指数	ユーロストックス指数	FTSE100指数	TOPIX指数	Nasdaq100指数	Russell2000指数	S&P500指数	
商品	ブレント原油	WTI原油	金	銀	銅	現在は上記26市場ですが、将来変更されることもあります。		

本ファンドの主要投資対象である投資先ファンドは、世界有数のオルタナティブ運用会社であるマン・グループのマンAHLが長期にわたって培ってきたトレンド・フォロー戦略を用いて運用します。株式市場や債券市場の大きな下落局面を含め、市場の上昇・下落に関わらず収益を獲得することを目指します。

日本の公募投資信託市場では、オルタナティブ戦略を含むマルチストラテジーに分類されるファンドは、ファンド数で11本、純資産総額合計で186億円存在し、その信託報酬率は平均で2.5093%、最低でも年率1.210%^{*2}と、一般に普及しているとは言えない状況ですが、本ファンドは、個人投資家にシンプルなオルタナティブ投資商品をわかりやすく提供するというコンセプトの下、投資先ファンドを含めて成功報酬が課されないだけでなく、投資先ファンドの運用管理報酬を含めた実質的な信託報酬が1%を下回る(0.998%)という点で、最安コストの本格的なオルタナティブ戦略ファンドとして、個人投資家の皆様の投資ポートフォリオの安定化と資産形成に寄与できるものと確信しております。

今後も「顧客中心主義」のもと、良質かつ低コストの運用商品を提供すると共に、画期的な仕組みによるファンドのパフォーマンス向上を目指すことを通じて、投資家の皆さまの最適な資産形成に貢献してまいります。

以上

^{*1} オルタナティブ(代替)戦略とは、伝統的な運用手段である現物の株式や債券等の購入だけでなく、有価証券の他、為替、商品やそれらの先物、オプションなど幅広い商品について空売りを含めた多様な運用手法を用いる戦略を指します。

^{*2} 信託報酬率は年率。税込み。ウエルスアッドバイザー株式会社による分類および調査による(2024年7月5日時点)。

****【本件に関するお問い合わせ先】*****

SBIグローバルアセットマネジメント株式会社 管理本部 電話:03(6229)0812 メールアドレス:sbigam@sbiglobalam.co.jp

SBIアセットマネジメント株式会社 商品企画部 電話:03(6229)0170

■ 「SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド」(愛称：リキッド・トレンド)の仕組み(概略図)



■ 投資対象ファンドである外国投資法人の運用会社「マン AHL」およびマン・グループのご紹介

ファンドの実質的な運用会社：マン AHL

- 1987年に設立され、債券、株式、為替、商品等を対象とするトレンド・フォロワー戦略/クオンツマルチ戦略のパイオニアとして30年以上の運用実績を有する。1989年にマン・グループの傘下に
- 130名を超える研究者(数学、物理学博士等)を擁し、優れたリサーチ体制、先進的なトレーディングテクノロジーによって運用パフォーマンスの向上を目指す
- 2007年にオックスフォード大学と共同で研究機関Oxford-Man Instituteを設立し、アカデミアとビジネスの融合を通して高度な運用戦略・運用手法の開発に取り組む
- 運用資産残高：638億ドル(約9.6兆円) (2024年3月末時点；1米ドル=151.35円)



マン・グループ

- マン・グループは、ロングオンリー戦略とヘッジファンド戦略及びプライベートマーケットにおける先進的かつ革新的投資機会を提供する資産運用会社
- 傘下の運用マネジャーを通じて、広範な地域/資産クラスを対象に定量および定性の様々な投資手法による戦略を展開
- 世界中の調査拠点、確立されたリスク/オペレーション・インフラ、最近のテクノロジーと強固な財務基盤を活用
- ロンドンに本社を置き、世界の主要都市に拠点を構える。運用資産残高1,757億ドル(約26兆円)、(2024年3月末時点；1米ドル=151.35円)

出所：マン・グループのデータベース。