

2024年8月15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
 『SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド』 当初募集額 47 億円のお知らせ**

当社子会社の SBI アセットマネジメント株式会社 (以下「SBI アセットマネジメント」) 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」) について、2024年8月1日より募集を開始し、約2週間における当初募集金額として47.2億円を超えるお申込みをいただきましたことをご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た第1弾の SBI アセットマネジメントの商品となります。

SBI アセットマネジメントは、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、世界有数のオルタナティブ運用会社であるマン 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を行い、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めざします。

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で設定されました。本ファンドと類似のマルチストラテジーに分類される日本の公募投資信託 11 本の信託報酬率は平均で 2.5093%^{※2}、となっていますが、本ファンドは、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 0.998%という最安コスト^{※2}の本格的なマルチストラテジー型オルタナティブ戦略ファンドであり、47.2 億円という当初募集金額は、同種のファンド分類として過去 10 年間で最大^{※2}であると共に、SBI アセットマネジメントの投資信託の中でも、61.5 億円であった「SBI 日本高配当株式(分配)ファンド(年4回決算型)」および 50.8 億円の「SBI・i シェアーズ・インド株式インデックス・ファンド」に次ぐ規模のお申込みをいただきましたことは、投資家の皆さまから高いご支持をいただいている結果と考えております。

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 ウェルズアドバイザー株式会社の分類および調査による。信託報酬率は年率、税込み。(2024年8月14日現在)。

【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