

2024年8月1日

各位

SBI アセットマネジメント株式会社  
SBI-Man アセットマネジメント株式会社  
株式会社 SBI 証券

SBI グループによる「オルタナティブ投資の民主化」商品の第1弾  
「SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド」  
SBI 証券での募集取り扱い開始のお知らせ

SBI アセットマネジメント株式会社（以下「SBI アセット」）が2024年8月16日（金）に設定する「SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド（以下「当ファンド」）」について、本日8月1日（木）より、株式会社 SBI 証券（本社：東京都港区、代表取締役社長：高村 正人）での募集取扱いを開始しますのでお知らせします。

当ファンドは、2023年7月に発表した SBI ホールディングスと世界有数のオルタナティブ運用会社である英国 Man Group plc（以下「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（以下「SBI-Man アセットマネジメント」）による商品提供に先駆けて、SBI アセットが提供します。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 AHL Trend Core Class A (JPY) (Unhedged)」(以下「投資先ファンド」)を通して、株式、債券・金利、為替、コモディティなど26の先物等に実質的に投資を行います。また、商品提供にあたって SBI アセットは、SBI-Man アセットマネジメントから、オルタナティブ市場や同資産に関する情報提供を受けます。

当ファンドの投資先ファンドは、マン AHL が長期の運用実績を誇るトレンド・フォロワー戦略を用いて運用し、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<sup>\*1</sup>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186億円にとどまり（信託報酬率は平均<sup>\*2</sup>で年率2.5093%、最低でも年率1.210%（いずれも税込））、一般に普及しているとは言えない状況です。当ファンドは、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「オルタナティブ投資の民主化」というコンセプトの下、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（年率0.998%（税込））という点で、最安コスト<sup>\*2</sup>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効率化と資産形成に寄与できるものと期待しております。

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 ウェルスア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）。



マン・グループ  
CEO  
ロビン・グリュー

この度は、我々として高い確信度を有する戦略を、透明性やコストにも配慮したかたちで、日本の幅広い投資家にお届けできる機会を頂いたことに心より感謝致します。

また、日本における「オルタナティブ投資の民主化」という壮大な目標に向けた取組みの第一歩に参画できることを大変誇りに思います。

マン・グループおよびマン AHL は、長い運用経験と先端的な調査・研究を背景に、これからも日本の投資家の皆様に、様々な投資機会を提供してまいります。

## ■ 「SBI-Man リキッド・トレンド・ファンド」（愛称：リキッド・トレンド）の魅力と特長

- |  |
|--|
| 1. 経済、金融市場の先行きが見通しにくい時代に新たな分散投資手法、上げ相場でも下げ相場でも収益の追求が可能な運用戦略を提供します。           |
| 2. マン AHL の伝統を受け継ぐトレンド・フォロワー戦略で、市場の大幅下落局面でも収益獲得の可能性（クライシス・アルファ）を追求する運用を行います。 |
| 3. 伝統資産との相関が低いことから、例えば、世界株式と組み合わせることで運用効率の改善が期待できます。                         |
| 4. 本格的なオルタナティブ投資商品を低コスト（実質的な負担は年率 0.998%（税込））で提供します。また、日次で設定・解約を受け付けます。      |

## ■ 投資先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

### 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的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25兆円）

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

<金融商品取引法等に係る表示>

商号等 株式会社 SBI 証券 金融商品取引業者、商品先物取引業者  
登録番号 関東財務局長(金商)第44号  
加入協会 日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会、一般社団法人第二種金融商品取引業協会、一般社団法人日本 STO 協会、日本商品先物取引協会

商号等 SBI アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者  
登録番号 関東財務局長(金商)第311号  
加入協会 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

商号等 SBI-Man アセットマネジメント株式会社

<SBI証券における手数料等及びリスク情報について>

SBI証券の証券総合口座の口座開設料・管理料は無料です。

SBI証券で取り扱っている商品等へのご投資には、商品毎に所定の手数料や必要経費等をご負担いただく場合があります。また、各商品等は価格の変動等により損失が生じるおそれがあります(信用取引、先物・オプション取引、商品先物取引、外国為替保証金取引、取引所CFD(くりっく株365)では差し入れた保証金・証拠金(元本)を上回る損失が生じるおそれがあります)。各商品等への投資に際してご負担いただく手数料等及びリスクは商品毎に異なりますので、詳細につきましては、SBI証券WEBサイトの当該商品等のページ、金融商品取引法等に係る表示又は契約締結前交付書面等をご確認ください。

\*\*\*\*\*

本プレスリリースに関する報道機関からの問い合わせ先

経営企画部 広報担当 栗津・上村(うわがき)・森田・緒方 03-5562-7215