

2024年11月7日

Press Release

楽天証券株式会社
楽天投信投資顧問株式会社
株式会社 GCI アセット・マネジメント

楽天証券、楽天投信投資顧問、GCI アセット・マネジメント、 3者による業務提携の基本合意書締結および新商品の共同開発・提供について

楽天証券株式会社（本社：東京都港区、代表取締役社長：楠 雄治、以下「楽天証券」）と、楽天投信投資顧問株式会社（本社：東京都港区、代表取締役社長：東 眞之、以下「楽天投信投資顧問」）と株式会社 GCI アセット・マネジメント（本社：東京都千代田区、代表取締役 CEO 兼社長：山内 英貴、以下「GCI アセット・マネジメント」）は、3者間協業に係る業務提携の基本合意書を締結しましたので、お知らせします。また、本基本合意に基づく3者の協力により「システムティック・グローバル・アルファ戦略」を採用した投資信託商品を開発し、楽天証券が独立系ファイナンシャルアドバイザー（以下「IFA」）を通じて2025年から販売する計画であることを、あわせてお知らせします。

1. 基本合意の背景と目的

3者は、急速に変化する金融市場環境において、各社の強みを活かした商品開発とサービス提供を通じて個人の資産づくりの一助となることを目指し、協議を重ねてまいりました。国内証券単体（開示ベース）で最多*の顧客基盤を有する楽天証券は、「デジタル“資産づくり”プラットフォーム」でお客様の Financial Well-Being の最大化を目指しています。このたびの基本合意により、楽天証券の顧客基盤と、楽天投信投資顧問の商品開発力、GCI アセット・マネジメントのオルタナティブ投資戦略の知見を融合させ、個人がより充実した資産づくり・運用ができるような革新的な投資商品の提供を目指します。第一弾として、「システムティック・グローバル・アルファ戦略」を採用した投資信託商品を開発し、楽天証券が IFA を通じて2025年から販売する準備を進めています。今後は、さらに多くのお客様に運用の幅を広げていただけるような商品の開発・提供を進めてまいります。

2. 主な協業内容

- (1) 実績ある機関投資家向け運用商品の活用
- (2) 3者による新商品の共同開発
- (3) 楽天証券を通じた商品販売
- (4) 3者間の人材交流、専門的な知見の共有を通じた人材の能力開発

3. 「システムティック・グローバル・アルファ戦略」について

本戦略は、GCI アセット・マネジメントがこれまで機関投資家向けに提供してきた「システムティック・マクロ戦略」をベースにしたものです。昨今、個人が運用する金融資産のポートフォリオは、株式や

債券等の伝統的資産に偏る傾向があるといわれています。「システマティック・グローバル・アルファ戦略」は、幅広い資産クラスへの投資を通じて高い分散効果を発揮し、積極的にリスクをとりながらも、市場環境に左右されにくい、安定的なリターンの獲得を目指すもので、幅広い個人の資産運用の一助となることを期待します。今回の3者間協業に係る業務提携の基本合意書締結により、本戦略を採用した投資信託を開発し、楽天投信投資顧問が運用をおこなう予定です。なお、本投資信託は、2025年より楽天証券のIFAを介して購入いただくことが可能となる予定です。

楽天証券と楽天投信投資顧問は、「資産づくりの伴走者」として、お客様のFinancial Well-Beingを最大化するべく、これまで以上に幅広いお客様の資産形成・資産運用を長期的かつ包括的にサポートできる質の高いサービス提供をおこなうよう、継続的に新しい取組みを進めていきます。

GCIアセット・マネジメントは、創業来25年にわたり培ってきた知見と実績を活かし、オルタナティブを中心とした特徴ある運用戦略の提供を通して、資産運用の高度化に貢献してまいります。

■GCIアセット・マネジメントの概要（2024年11月7日現在）

| | |
|-----------------|--|
| 商号 | 株式会社 GCI アセット・マネジメント |
| 本社所在地 | 東京都千代田区大手町 2-6-4 常盤橋タワー9階 |
| 代表者名 | 代表取締役 CEO 兼社長 山内 英貴 |
| 業務内容 | 投資運用業（投資一任業及び投資信託委託業）、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業、これに付随する業務 |
| 特徴 | 2000年4月の創業以来、オルタナティブ投資を中心に、アカデミックな研究開発を活用した運用戦略を内外の機関投資家向けに提供 |
| 設立年月日 | 2000年4月13日 |
| 当グループの 主な受賞歴 | <p>【グローバルマルチ戦略（2011年運用開始）】 AsiaHedge Awards 2013、HFM European Performance Awards 2021</p> <p>【システマティック・マクロ戦略（2014年運用開始）】 The Asia Hedge Awards 2018、HFM Hedge Fund Awards Asia 2019、 HFM Asian Performance Awards 2022</p> |

※：主要ネット証券（口座数上位5社：auカブコム証券、SBI証券、松井証券、マネックス証券、楽天証券（五十音順））で比較（2024年11月7日、楽天証券調べ）

以上

【手数料等およびリスクの説明について】

楽天証券の取扱商品等にご投資いただく際には、各商品等に所定の手数料や諸経費等をご負担いただく

場合があります。また、各商品等には価格の変動等による損失を生じるおそれがあります。各商品等へのご投資にかかる手数料等およびリスクについては、楽天証券ホームページの「投資にかかる手数料等およびリスク」ページに記載されている内容や契約締結前交付書面等をよくお読みになり、内容について十分にご理解ください。

商号等：楽天証券株式会社（[楽天証券ホームページ](#)）

金融商品取引業者：関東財務局長（金商）第 195 号、商品先物取引業者

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、日本商品先物取引協会
一般社団法人第二種金融商品取引業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会