

受益者の皆様へ

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）』 月次レポートにおけるお詫びと訂正のお知らせ

平素は当社投資信託に格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「GCIエンダウメントファンド（成長型/安定型）」の月次レポートにつきまして、記載内容に一部誤りがございました。誤記載についてお詫びを申し上げますとともに、訂正内容に関して、以下の通りご報告申し上げます。

今後、一層の業務管理体制の向上に努めて参りますので、何卒ご高察賜りますようお願い申し上げます。

### 記

#### 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. 対象レポート

月次レポート（2024年7月31日基準）

#### 3. 訂正内容

- 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I システムティック・マクロファンドVol10クラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（8ページ）
- 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I ディバーシファイドアルファファンドクラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（9ページ）

※詳細は次項以降をご覧ください。

< 本件に関するお問い合わせ先 >

株式会社GCIアセット・マネジメント

TEL : 03-6665-6952（受付時間：9時～17時 ※土日祝・年末年始を除く）

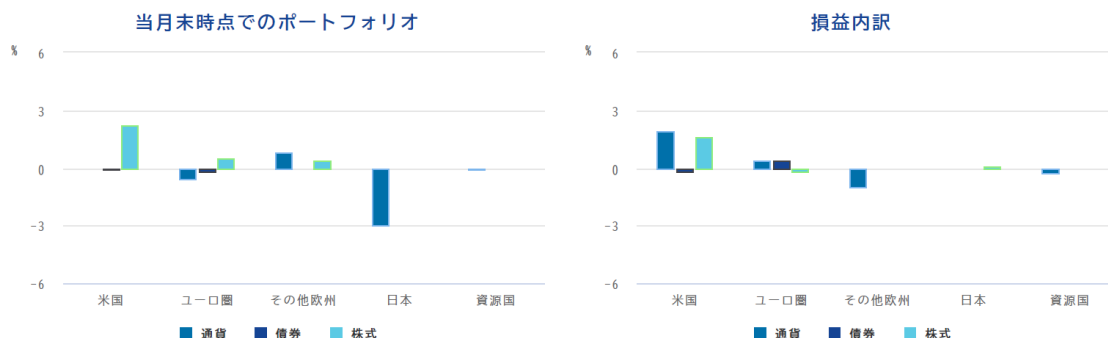
< お客さまの個別のお取引内容についてのお問い合わせ >

お取引先の販売会社にお問い合わせください。

## 4. 訂正内容詳細

- 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I システムティック・マクロファンドVol10クラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（8ページ）

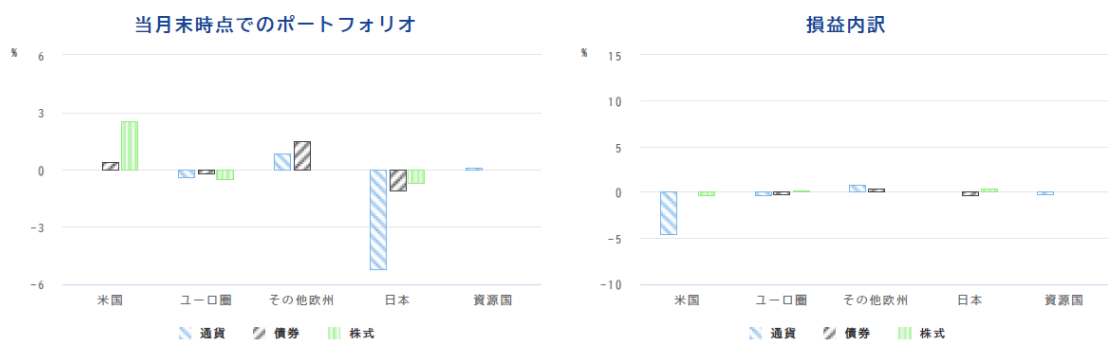
### 【誤】



※ 上記ポートフォリオ断面のグラフは、ポジションを構築するにあたって差し入れる証拠金の対純資産総額比率です。マイナスはショートポジションを意味します。証拠金はリスク見合いで差し入れるものであるため、当該指標はポートフォリオにおけるリスクをより実態に近い形で表すものと考えられています。

※ 上記損益内訳は信託報酬、成功報酬等控除前のものです。

### 【正】

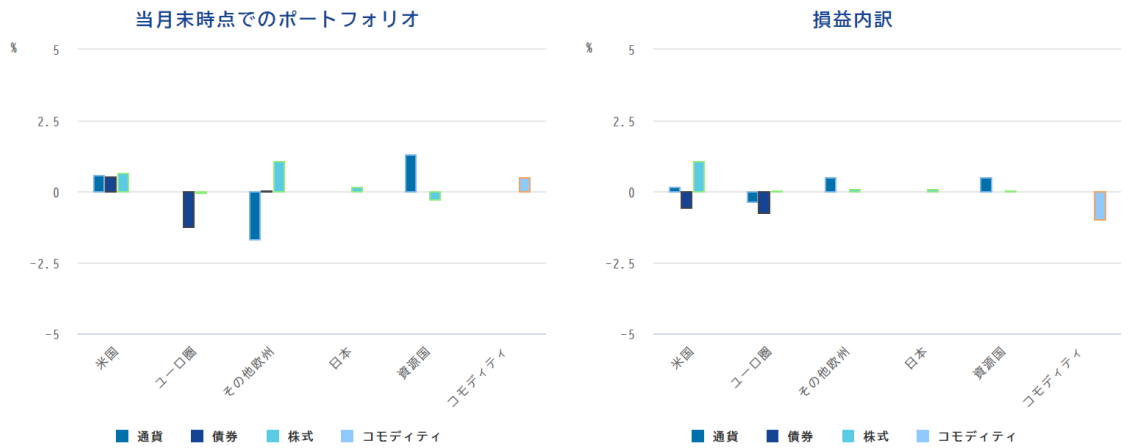


※ 上記ポートフォリオ断面のグラフは、ポジションを構築するにあたって差し入れる証拠金の対純資産総額比率です。マイナスはショートポジションを意味します。証拠金はリスク見合いで差し入れるものであるため、当該指標はポートフォリオにおけるリスクをより実態に近い形で表すものと考えられています。

※ 上記損益内訳は信託報酬、成功報酬等控除前のものです。

・ 投資対象ファンド（投資信託証券）－ G C I ディバーシファイドアルファファンドクラスAの資産の状況内「当月末時点でのポートフォリオ」「損益内訳」（9ページ）

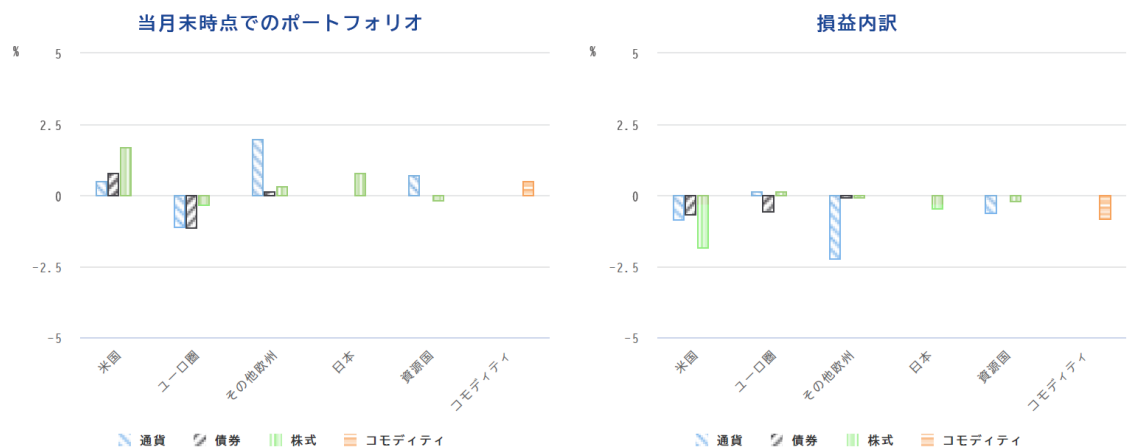
【誤】



※ 上記ポートフォリオ断面のグラフは、ポジションを構築するにあたって差し入れる証拠金の対純資産総額比率です。マイナスはショートポジションを意味します。証拠金はリスク見合いで差し入れるものであるため、当該指標はポートフォリオにおけるリスクをより実態に近い形で表すものと考えられています。

※ 上記損益内訳は信託報酬、成功報酬等控除前のものです。

【正】



※ 上記ポートフォリオ断面のグラフは、ポジションを構築するにあたって差し入れる証拠金の対純資産総額比率です。マイナスはショートポジションを意味します。証拠金はリスク見合いで差し入れるものであるため、当該指標はポートフォリオにおけるリスクをより実態に近い形で表すものと考えられています。

※ 上記損益内訳は信託報酬、成功報酬等控除前のものです。

この資料は情報提供を目的として作成したものであり、特定の商品の投資勧誘を目的として作成したものではありません。投資判断の最終決定は、お客様ご自身の判断でなさるようお願いいたします。

**金融商品取引法に基づきお客様にご留意いただきたい事項を以下に記載させていただきます。**

## むさし証券の概要

商号等：むさし証券株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第105号

加入協会：日本証券業協会、一般社団法人第二種金融商品取引業協会

### リスクについて

国内外の金融商品取引所に上場されている有価証券(上場有価証券等)の売買等に当たっては、株式相場、金利水準等の変動や、投資信託、投資証券、受益証券発行信託の受益証券等の裏付けとなっている株式、債券、投資信託、不動産、商品等(裏付け資産)の価格や評価額の変動に伴い、上場有価証券等の価格等が変動することによって損失が生じるおそれがあります。

◎ 上場有価証券等の発行者等の業務や財産の状況等に変化が生じた場合や、裏付け資産の発行者等の業務や財産の状況等に変化が生じた場合、上場有価証券等の価格が変動することによって損失が生じるおそれがあります。

◎ 新株予約権、取得請求権等が付された上場有価証券等については、これらの権利を行使できる期間に制限がありますのでご注意ください。

◎ 上場有価証券等が外国証券である場合、為替相場(円貨と外貨の交換比率)が変化することにより、為替相場が円高になる過程では外国証券を円貨換算した価値は下落し、逆に円安になる過程では外国証券を円貨換算した価値は上昇することになります。したがって、為替相場の状況によっては為替差損が生じるおそれがあります。

※ 裏付け資産が、投資信託、投資証券、預託証券、受益証券発行信託の受益証券等である場合には、その最終的な裏付け資産を含みます。

※ 新規公開株式、新規公開の投資証券及び非上場債券等についても、上記と同様のリスクがあります。

### 手数料等諸費用について

当社取り扱いの商品等にご投資いただく場合

各商品毎の所定の手数料をご負担いただく場合がありますが、商品毎に異なるため、ここでは表示することができません。

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。

投資信託につきましては、手数料の他、信託報酬等・その他の費用(監査費用、運営・管理費用等)等を御負担いただきますが、これらの費用等は、事前に計算できませんので表示しておりません。

当該商品等の契約締結前交付書面や目論見書またはお客さま向け資料等をよくお読みください。

**【広告審査済】**