2015年9月21日

プレスリリース

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント 米国で初のスマートベータETFを設定

(2015年9月21日、ニューヨーク)ー ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(以下、GSAMあるいは弊社といいます)は、弊社初のスマートベータETF(上場投資信託)である、Goldman Sachs ActiveBeta® US Large Cap Equity ETF (ティッカー: GSLC)を設定し、9月21日にNYSEアーカ取引所に上場いたしました。本ファンドは、GSAMのスマートベータ戦略の一つである、アクティブベータ®株式投資戦略をベースにしたETFの第一弾となります。

GSAMグローバル共同責任者であるティモシー・J・オニールは、「GSAMはETF市場に参入することをとても喜ばしく思います。GSAMのETFへのアプローチは、長年にわたる投資イノベーションを発展させるものであり、コストの面ですべての投資家が利用しやすいものであると考えております。」と述べています。

アクティブベータ®ETFには、運用戦略が定義されていること、株式市場への幅広い分散投資が可能であること、また費用が低廉であるという、伝統的なETFと同様の利点があります。さらに、株式市場をアウトパフォームすることを目標として設計されたゴールドマン・サックス・アクティブベータ®・インデックスをベンチマーク・インデックスにすることにより、市場を上回るパフォーマンスを実現する可能性があります。

弊社グローバルETF戦略運用責任者であるマイケル・クリニエリは、「お客様から、GSAMの運用戦略をETFとして提供してほしいという要望はこれまでも多く寄せられていました。アクティブベータ®ETFは、投資家の皆様にGSAMの運用戦略を新たな形で提供するだけでなく、弊社がグローバルで有する運用能力への投資機会をご提供することになるでしょう。」と述べています。

アクティブベータ®ETFがベンチマークとする、GSアクティブベータ®・インデックスでは、4つのファクターに基づいて銘柄への投資比率を決定します。

1. **バリュー:** 株式市場において株価が割安となっている企業に着目します。
2. **モメンタム:** 株価収益率が相対的に高い企業に着目します。上昇している株に重点的に投資することができます。
3. **クオリティ:** 持続可能な利益を上げている企業に着目します。ファンダメンタルズが強く、株価収益率の伸びが継続する可能性の高い企業を重視します。
4. **低ボラティリティ:** 株価が急激に乱高下する銘柄の組み入れを回避します。長期間の株式投資におけるボラティリティを抑制することを目的としています。

GSAMでは、9月21日にGoldman Sachs ActiveBeta® US Large Cap Equity ETFを機関投資家からの初期投資5,000万ドルにより設定しました。運用報酬は、9ベーシス・ポイント(0.09%)と低廉な水準となっています。GSAMでは今後数か月以内に、追加のアクティブベータETFを設定する予定です。今後も皆様のご期待に添うべく、より一層の努力をいたす所存でございますので、何卒のご厚情を賜りますようお願い申し上げます。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントについて

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)はゴールドマン・サックスの資産運用グループであり、2015年6月30日現在、約1兆米ドルの資産を運用しています。GSAMは1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、世界各国の主要都市に拠点を擁しています。GSAMは世界各国の機関投資家から個人のお客様に至るまで、様々なアセットクラスにわたり投資戦略を提供しています。ゴールドマン・サックスは1869年(明治2年)の創立以来、個人のお客様から世界中の企業・金融機関・政府機関に至るまで、様々なお客様に資産運用業務・投資銀行業務・証券業務・為替商品取引等、多岐にわたる金融サービスを提供しています。