

平成21年6月25日

各 位

マ ネ ッ ク ス グ ル ー プ 株 式 会 社
代 表 取 締 役 社 長 C E O 松 本 大
(コ ー ド 番 号 8 6 9 8 東 証 第 一 部)

本日、当社の子会社であるマネックス証券株式会社（代表取締役社長 CEO 松本 大）より、下記プレスリリースを発表いたしましたのでお知らせいたします。

記

マネックス証券株式会社 プレスリリース（添付）

「日本株ロボット運用投信（愛称：カプロボファンド）」新規募集開始のお知らせ

以 上

【お問合せ先】

マネックスグループ株式会社

社長室 コーポレートコミュニケーション担当 久保田・福井 電話 03-6212-3750

平成 21 年 6 月 25 日

各 位

マ ネ ッ ク ス 証 券 株 式 会 社
代 表 取 締 役 社 長 C E O 松 本 大

「日本株ロボット運用投信（愛称：カブロボファンド）」

新規募集開始のお知らせ

マネックス証券株式会社（代表取締役社長 CEO 松本 大、以下「マネックス証券」）は、アルゴリズム運用を用いた新たな投資信託の募集を開始いたしますのでお知らせいたします。この投資信託は、T&D アセットマネジメント株式会社（本社：東京都中央区 代表取締役社長 荒尾 耿介、以下「T&D アセットマネジメント」）が運用を行い、マネックスグループ株式会社の子会社であるトレード・サイエンス株式会社（代表取締役社長 加藤 浩一、以下「トレード・サイエンス」）が投資助言を行います。

記

投資信託名： 「日本株ロボット運用投信（愛称：カブロボファンド）」（以下「当ファンド」）

商品分類： 追加型投信／国内／株式／特殊型

当初募集期間： 2009 年 7 月 10 日（金）から 2009 年 7 月 27 日（月）まで

設定日： 2009 年 7 月 29 日（水）

信託期間： 原則無期限

委託会社： T&D アセットマネジメント

受託会社： 三菱 UFJ 信託銀行

投資顧問会社： トレード・サイエンス（投資助言）

当ファンドの特徴：

- (1) 日本の株式を実質的な主要投資対象とし、複数のカブロボ（注 1）が機動的な売買を行うことで、中長期的な投資信託財産の成長を目指します。
- (2) ファンド内で稼働するカブロボは、カブロボ・コンテスト（注 2）で優秀とされたカブロボ等の中から、投資顧問会社トレード・サイエンス（注 3）が選定し、同社がカブロボの指示に基づき投資助言を行います。
- (3) 投資環境の変化等に応じて、採用するカブロボおよび各カブロボへの投資配分等の変更を行い、その局面で最適と考えられる運用を行います。

詳細はマネックス証券ホームページ (<http://www.monex.co.jp/>) をご覧ください。

<ご留意事項> (販売用資料に基づき作成)

当ファンドのお申込みの際は、「投資信託説明書 (交付目論見書)」で必ず内容をご確認の上、ご判断いただきますようお願い申し上げます。「投資信託説明書 (交付目論見書)」は、7月10日よりマネックス証券のホームページでご確認いただけます。

当ファンドの手数料等について	
※ 当該手数料等の合計額については、ご投資家の皆様がファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。	
お申込手数料	お申込価額に対して上限3.15% (税抜3.00%) ※ マネックス証券でお申込の際は、申込手数料はございません。
信託報酬	投資信託財産の純資産総額に対して年 1.47% (税抜 1.40%) の率を乗じて得た額
監査報酬	投資信託財産の純資産総額に対して年 0.00525% (税抜 0.005%) の率を乗じて得た額
信託財産留保額	換金申込日の基準価額に対して 0.3%の率を乗じて得た額
ご換金手数料	ありません。
※ その他の費用・手数料として売買時の売買委託手数料等がかかります。その他費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 ※ 詳細につきましては、必ず「投資信託説明書 (交付目論見書)」をお読み下さい。	
当ファンドの投資リスクについて	
<p>当ファンドは、直接あるいはマザーファンドを通じて、株式など値動きのある有価証券に投資しますので基準価額は変動します。したがって、当ファンドは投資元本 (申込金額に所定の申込手数料 (税込) を加えた額で、投資家が当ファンドの取得時に支払う受渡金額の総額をいいます。) が保証されているものではありません。また、収益や投資利回り等も未確定の商品です。当ファンドは、預貯金や保険契約とは異なります。当ファンドは預金保険および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で当ファンドを購入した場合は、投資者保護基金による支払対象ではありません。当ファンドの投資信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。当ファンドの基準価額の変動要因となる主なリスクは次の通りです。</p> <p>(1) 株式の価格変動リスク</p> <p>当ファンドは、マザーファンドを通じての投資を含めて、主として株式に投資します。一般に、株式の価格は大きく変動します。株式市場が下落した場合、または当ファンドが保有する株式の価格下落等の場合には基準価額が値下がりし、その結果、投資元本に欠損を生じる恐れがあります。</p> <p>(2) 金利変動リスク</p> <p>当ファンドは、マザーファンドを通じての投資を含めて、公社債等にも投資することがあります。一般に、金利が上昇すると公社債等の価格は下落します。この場合には基準価額が値下がりし、</p>	

その結果、投資元本に欠損を生じる恐れがあります。

(3) 信用リスク

当ファンドは、マザーファンドを通じての投資を含めて、株式、公社債等の有価証券および金融商品に投資します。一般に、有価証券の発行者、または金融商品の運用先に経営不振もしくは債務不履行等が生じた場合、有価証券または金融商品等の価格は下落し、もしくは価値が無くなる場合があります。この場合には基準価額が値下がりし、その結果、投資元本に欠損を生じる恐れがあります。

(4) 流動性リスク

解約による当ファンドの資金流出に対応し、解約資金を手当てするために、通常よりも著しく低い価格での保有有価証券の売却を余儀なくされる可能性があります。当ファンドの解約による資金流出のみならず、マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの解約による資金流出に対応し、その解約資金を手当てするために、マザーファンドにおいて通常よりも著しく低い価格での保有有価証券の売却を余儀なくされる可能性もあります。また、市場の混乱等のために、市場において取引ができなかったり、通常よりも著しく不利な価格での取引を余儀なくされる可能性があります。これらの場合には、基準価額が値下がりし、その結果、投資元本に欠損を生じる恐れがあります。

(5) その他のリスク

上記のほか、投資家が当ファンドの取得時に支払う所定の申込手数料、一部解約時に控除される信託財産留保額、当ファンドの投資信託財産から支弁する信託報酬および証券取引に伴う手数料等の管理費用も、投資家が支払った投資元本に欠損を生じる要因となります。

株式市場の状況によっては、株式の売買が数多く発生し（売買回転率の上昇）、多額の売買コストが発生する可能性があります。

ロボットが機能しない等システム運用関係の不慮の出来事に起因するリスクが生じる可能性があります。

マネックス証券について

商号等	マネックス証券株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 165 号
-----	--

加入協会	日本証券業協会及び社団法人金融先物取引業協会
------	------------------------

T&D アセットマネジメントについて

商号等	T&D アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 357 号
-----	---

加入協会	社団法人投資信託協会及び社団法人日本証券投資顧問業協会
------	-----------------------------

トレード・サイエンスについて

商号等	トレード・サイエンス株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 909 号
-----	---

加入協会	社団法人日本証券投資顧問業協会
------	-----------------

(注1)

カブロボについて

カブロボとは、複数のマーケットデータを取り込んだ後、株式の売買注文を自動生成するコンピュータ・プログラムのことです。

(1) カブロボのしくみ

- ・カブロボは、予め組み込まれたプログラミングにより分析を行い、ポートフォリオや個別銘柄（売買銘柄・数量・売買価格・売買方法など）を決定します。
- ・カブロボは、前・後場ごとに東証第一部上場のうち、投資ユニバースとなる約 500 銘柄の取引データを取り込み、自動的に売買注文を作成します。
 - ※ 空売りは行いません。
 - ※ カブロボのしくみは、今後変更となる可能性があります。

(2) カブロボの特徴

- ・株式の売買において、定性的な判断を排除し、機械的な運用を行うことで、どのような相場状況においても、収益チャンスをとらえて機動的な運用を行うことができます。
- ・人間の心理的な要因による機会損失を回避することが可能と考えられます。
 - ※ 相場状況等によっては上記のような運用ができなかったり、期待した運用収益を得られなかったりする可能性があります。
 - ※ 株式市場の状況によっては、株式の組入比率がゼロまたは数%の水準で、ある程度の期間続くことがあります。この場合、余資の効率運用の観点から、短期債券などを組み入れることがあります。

(注2)

カブロボ・コンテストについて

(1) カブロボ・コンテストとは、過去のデータおよび日々のリアルタイムデータによる仮想の運用成績等を競うカブロボのコンテストで、常時開催されています。

- ・大学の研究プロジェクトからスタートしたカブロボ・コンテストは、企画運営を行うトレード・サイエンス、およびマネックス証券をはじめ、多くの大学や企業が協力・協賛する産学連携プロジェクトです。
- ・カブロボ・コンテストは、「プログラム・トレードの技術的向上および普及への貢献」や、「一般投資家の投資活動への貢献」などを目指して運営されています。
- ・2004年から運営されており、参加者は既に 19,000 人を超え、4,000 体以上のロボットが現在も稼働中です。(2009年6月現在)

(2) 定期的な審査を行い、常に優秀なロボットの開発・改良に努めています。

※ご参考：カブロボホームページ <http://www.kaburobo.jp/>

(注3)

トレード・サイエンスの概要

トレード・サイエンスは2006年に、マネックス・ビーンズ・ホールディングス株式会社（現マネックスグループ株式会社）および株式会社早稲田情報技術研究所により設立されました。2007年にはカブロボによる投資助言サービスを開始し、2008年にマネックスグループ株式会社の完全子会社となりました。

トレード・サイエンスでは、推論アルゴリズム*やニューラルネットワーク*等の情報系の先端研究を金融工学に応用することを標榜して、大学や研究機関と共に、多様なアプローチによるカブロボの研究開発を行っています。

*推論アルゴリズム： 音声認識、ゲノミクス、自然言語方法などで使用される情報処理技術を活用した推論方法

*ニューラルネットワーク：人間の脳の仕組みを模倣した情報処理演算モデル

以 上