

※当ファンドは2019年3月13日に繰上償還いたしました。これまでのご愛顧に対しまして、厚く御礼申し上げます。

受益者向け資料



【マンスリーレポート】



日本株ロボット運用投信

愛称：カブロボファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型

作成基準日：2019年2月28日

※本資料は、原則として表示桁数未満を四捨五入していますので、合計の数値とは必ずしも一致しません。

※運用実績および分配実績は過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。

商品概要

設定日	2009年7月29日
信託期間	2019年3月13日まで
決算日	6月15日 (休業日の場合は翌営業日)
信託報酬率	年 1.512% (税抜 1.40%)
基準価額	10,835円
純資産総額	764百万円

分配実績 (1万口当たり、税引前)

第6期	2015年6月15日	500円
第7期	2016年6月15日	0円
第8期	2017年6月15日	500円
第9期	2018年6月15日	500円
設定来分配金合計		1,500円

期間別騰落率

過去1カ月	1.7%
過去3カ月	-2.3%
過去6カ月	-3.8%
過去1年間	-5.4%
過去3年間	10.6%
設定来	23.1%

※収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

基準価額の推移 (設定来:日次)

※分配金再投資基準価額は収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。なお、基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後です。



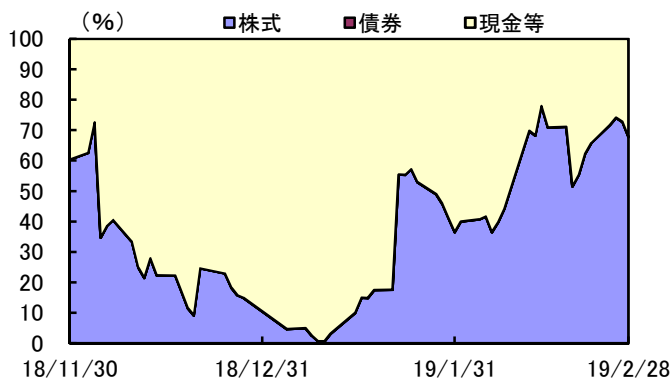
資産配分

株式	67.7%
債券	—
現金等	32.3%

※ベビーファンドの実質組入比率です。

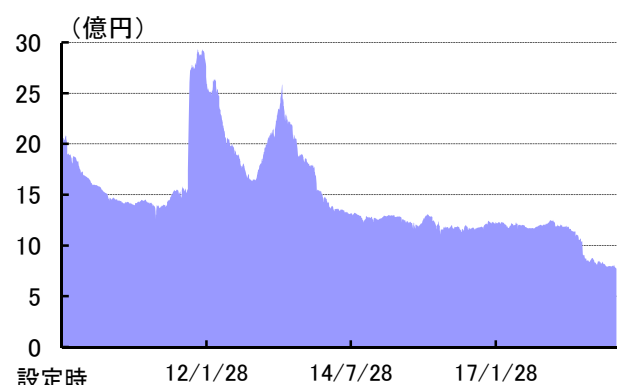
※債券には現先取引により取得したものを含まず。

資産配分の推移 (直近3カ月:日次)



※ベビーファンドの実質組入比率です。

純資産総額の推移 (設定来:日次)



※本資料をご覧くださいにあたっては、4ページの「ご留意いただきたい事項」を必ずご確認ください。

■ 設定・運用は

T&Dアセットマネジメント

電話番号 03-6722-4810 (受付時間は営業日の午前9時～午後5時)
インターネットホームページ <http://www.tdasset.co.jp/>

※当ファンドは2019年3月13日に繰上償還いたしました。これまでのご愛顧に対しまして、厚く御礼申し上げます。

受益者向け資料

組入上位10銘柄

◆ 株式

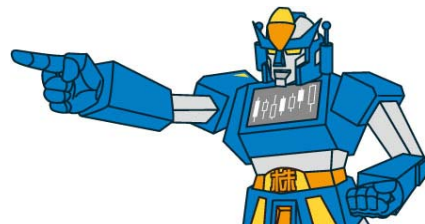
No.	コード	銘柄名	業種	組入比率
1	4661	オリエンタルランド	サービス業	4.5%
2	2371	カカクコム	サービス業	2.6%
3	4768	大塚商会	情報・通信業	2.5%
4	7459	メディopalホールディングス	卸売業	2.5%
5	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	化学	2.5%
6	2127	日本M&Aセンター	サービス業	2.5%
7	6856	堀場製作所	電気機器	2.4%
8	9984	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.4%
9	6723	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	2.4%
10	6963	ローム	電気機器	2.3%

◆ 債券

No.	銘柄名	組入比率
1	—	—
2	—	—
3	—	—

その他

※ベビーファンドの実質組入比率です。
※現先取引により取得したものを含みます。



その他 23銘柄 41.1%

※ベビーファンドの実質組入比率です。

運用コメント

【国内株式市場】

当月の国内株式市場は、先月に引続き、米国の金融政策の引き締め停止と米中の貿易摩擦解消の期待が材料となり、上昇しました。

こうした動きにより、TOPIXは前月末比2.6%上昇し、1607.66ポイントとなりました。

【運用概況】

当月末の基準価額は、前月末比で1.7%上昇し、10,835円となりました。当月中の売買件数は164件、売買代金は約17億8千万円となりました。株式の実質組入比率は、月初の約40%の水準から35~80%程度の範囲で推移し、月末時点では67.7%となっています。

各ロボットの投資基本配分比率は、NtRider-Exp 20%、Mikazuki 30%、SD 40%、Event Catcher 10%で運用しました。基準価額変動の主な要因ですが、プラス面として、全てのロボットの成績がプラスになったことが挙げられます。なお、投資比率を考慮した基準価額への貢献度は、SD、Mikazuki、Event Catcher、NtRider-Expの順となりました。

※当ファンドの投資顧問会社であるトレード・サイエンス株式会社より入手した運用コメントをもとに作成しています。

※各ロボットが同一銘柄の売り買いを同タイミングで行った場合、相殺して発注を行いますので、文中の売買件数および売買代金は、各ロボットの合計と相違する場合があります。

各ロボットの運用概況

◆ 各ロボットへの投資比率

No.	ロボット名	基本配分比率		実績比率
		前月末	当月末	当月末
1	NtRider-Exp	20.0%	20.0%	19.4%
2	Mikazuki	30.0%	30.0%	31.6%
3	SD	40.0%	40.0%	40.2%
4	Event Catcher	10.0%	10.0%	8.8%
合計		100.0%	100.0%	100.0%

※「各ロボットの運用概況」の表中の数値および運用コメントは、当ファンドの投資顧問会社であるトレード・サイエンス株式会社より入手しております。

* 左記の投資比率は、対マザーファンド純資産総額です。なお、各ロボットの投資比率には、株式以外(債券・現金等)も含まれます。

※本資料をご覧くださいにあたっては、4ページの「ご留意いただきたい事項」を必ずご確認ください。

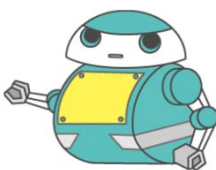
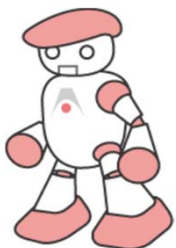

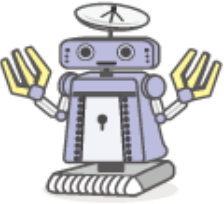
■ 設定・運用は

T&Dアセットマネジメント

電話番号 03-6722-4810 (受付時間は営業日の午前9時~午後5時)
インターネットホームページ <http://www.tdasset.co.jp/>

受益者向け資料

◆ 各ロボットのパフォーマンスおよび運用コメント

1. NtRider-Exp		採用日: 2009年7月29日				
	ロボットの特徴 上昇相場では、遅れている銘柄群、下げ相場では、下げ過ぎている銘柄群に逆張り仕掛けの汎用性の高さが特徴。トムソン・ロイター社製のテキストマイニングAI「THOMSON REUTERS MARKETPSYCH INDICES」を搭載。	運用コメント 当ロボットは、中旬に組入機会を持ちました。短期的な売買を中心に取引しました。売買代金は約9千万円でした。ロボットの成績は+0.6%となりました。個別銘柄では、セガサミーホールディングスやニフコなどがプラスに寄与し、大陽日酸やZOZOなどがマイナスに寄与しました。				
	期間別騰落率					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>過去1カ月</th> <th>過去3カ月</th> <th>採用日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>0.6%</td> <td>-7.7%</td> <td>46.1%</td> </tr> </tbody> </table>		過去1カ月	過去3カ月	採用日	0.6%
過去1カ月	過去3カ月	採用日				
0.6%	-7.7%	46.1%				
2. Mikazuki		採用日: 2009年7月29日				
	ロボットの特徴 米相場から生まれた伝統的なローソク足分析を基にしたパターン認識の堅牢性と高い再現性が特徴。トムソン・ロイター社製のテキストマイニングAI「THOMSON REUTERS MARKETPSYCH INDICES」を搭載。	運用コメント 当ロボットは、ほぼ月間を通じて組入機会を持ちました。短期的な売買を中心に取引しました。売買代金は約7億7千万円でした。ロボットの成績は+1.8%となりました。個別銘柄では、サイバーエージェントや古河電気工業などがプラスに寄与し、しまむらとNOKがマイナスに寄与しました。				
	期間別騰落率					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>過去1カ月</th> <th>過去3カ月</th> <th>採用日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1.8%</td> <td>-1.6%</td> <td>81.0%</td> </tr> </tbody> </table>		過去1カ月	過去3カ月	採用日	1.8%
過去1カ月	過去3カ月	採用日				
1.8%	-1.6%	81.0%				
3. SD		採用日: 2016年8月1日				
	ロボットの特徴 決算発表後の値動きに注目し、保有株を替える。市場全体の変動率を監視して組入比率を変えていく機動性が特徴。トムソン・ロイター社製のテキストマイニングAI「THOMSON REUTERS MARKETPSYCH INDICES」を搭載。	運用コメント 当ロボットは、月間を通じて高い保有比率を維持しつつ、保有していた銘柄を中心に取引しました。売買代金は約5億2千万円でした。ロボットの成績は+2.3%となりました。個別銘柄では、エーザイやイオンなどがプラスに寄与し、国際石油開発帝石や大和ハウス工業などがマイナスに寄与しました。				
	期間別騰落率					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>過去1カ月</th> <th>過去3カ月</th> <th>採用日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2.3%</td> <td>1.1%</td> <td>17.4%</td> </tr> </tbody> </table>		過去1カ月	過去3カ月	採用日	2.3%
過去1カ月	過去3カ月	採用日				
2.3%	1.1%	17.4%				
4. Event Catcher		採用日: 2017年7月1日				
	ロボットの特徴 決算発表と出来高の急増を監視し、ポジティブなイベント発生後のトレンドに乗ることを繰り返す回復性が特徴。トムソン・ロイター社製のテキストマイニングAI「THOMSON REUTERS MARKETPSYCH INDICES」を搭載。	運用コメント 当ロボットは、月間を通じて組入機会を持ちました。短期的な売買を中心に取引しました。売買代金は約4億1千万円でした。ロボットの成績は+2.0%となりました。個別銘柄では、アンリツやZOZOなどがプラスに寄与し、日本通運やニフコなどがマイナスに寄与しました。				
	期間別騰落率					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>過去1カ月</th> <th>過去3カ月</th> <th>採用日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2.0%</td> <td>-4.4%</td> <td>-12.0%</td> </tr> </tbody> </table>		過去1カ月	過去3カ月	採用日	2.0%
過去1カ月	過去3カ月	採用日				
2.0%	-4.4%	-12.0%				

* 各ロボットの期間別騰落率は、各ロボットに属する株式、債券、現金等を合計した時価評価額をもとに算出しています。

※本資料をご覧いただくにあたっては、4ページの「ご留意いただきたい事項」を必ずご確認ください。

■ 設定・運用は

T&Dアセットマネジメント

電話番号 03-6722-4810 (受付時間は営業日の午前9時~午後5時)
 インターネットホームページ <http://www.tdasset.co.jp/>

受益者向け資料

ご留意いただきたい事項

- 本資料はT&Dアセットマネジメントが当ファンドの受益者に運用状況をご報告するために作成した運用レポートであり、当ファンドを含む有価証券の売買の勧誘を目的とするものではありません。
- 本資料は当社が信頼性が高いと判断した情報等により作成したものです。その正確性・完全性を保証するものではありません。また、本資料に掲載されているグラフ、パフォーマンス等の内容は過去の実績を示したものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。本資料に記載されている意見・見通しは表記時点での当社の判断を反映したものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 投資信託はリスクを含む商品であり、株式および公社債等値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。これら運用による損益は全て投資者に帰属します。
- 投資信託は預貯金や保険契約と異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。
- 本資料の様式、表示項目等は将来、予告なく変更される場合があります。