

平成24年2月28日

投資者の皆様へ

T & Dアセットマネジメント株式会社

「日本株ロボット運用投信（愛称：カプロボファンド）」における エルピーダメモリの保有状況および同銘柄の運用方針について

拝啓 時下ますますご清祥の段、お慶び申し上げます。

平素は弊社の投資信託に格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

このたび、エルピーダメモリ株式会社【コード：6665】（以下、「当銘柄」といいます。）の会社更生法の申請を受けまして、「日本株ロボット運用投信（愛称：カプロボファンド）」（以下、「当ファンド」といいます。）に組入れております当銘柄の保有状況ならびに本件を受けた今後の対応につきまして、以下ご報告申し上げます。

敬具

記

<これまでの経緯>

2011年11月に、当ファンド内で稼動するロボットのうち一体（E x a）が、当銘柄の株価に対し、ファンダメンタルズ水準から見て割安に放置されていると判断したことで、組入を開始しました。その後も同様の投資助言に基づき、当銘柄の継続保有と追加購入を実施いたしました。【実質組入比率：1.13%（2012年2月27日時点）】

しかしながら、2012年2月14日に継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められるとの注記を四半期報告書等に記載するとの取締役会決議を同社が発表したことから、翌2月15日には当銘柄をファンダメンタルズや需給関係に著しい影響を及ぼす可能性がある銘柄であると判断し、一定の変化が認められるまでの期間、ロボットの判断に関わらず、当銘柄の新規購入を見合わせるとともに、同社に関する情報収集と保有状況の検討を継続しておりました。

<今後の対応方針>

2012年2月27日の会社更生法の申請を受け、同日に当銘柄の全売却を決定いたしました。今後速やかに全ての保有株式を売却する予定です。なお、当銘柄を保有する限りにおいては市場価格にて評価を行います。

<当銘柄の評価について>

銘柄名	エルピーダメモリ株式会社 (コード：6665、市場区分：東証一部)
実質組入比率（平成24年2月27日時点）	1.13%
実質組入比率（平成24年2月28日時点）	0.86%
市場価格（平成24年2月28日時点）	254円 (騰落幅：▲80円、騰落率：▲28.25%)

以上

※ 本資料はご投資家の皆様にT&Dアセットマネジメントが情報提供を目的として作成したものであり、投資勧誘を目的とした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。また投資信託の購入をご希望の場合は、下記のご留意事項を必ずご確認ください、ご自身でご判断ください。

当ファンドのお申込みに際してのご留意事項

【当ファンドの投資リスクについて】

ファンドの基準価額は、投資を行っている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者に帰属します。

したがって、当ファンドは投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

◎当ファンドの基準価額の変動要因となる主なリスクについて

「株価変動リスク」「その他のリスク」

※基準価額の変動要因(リスク)は、上記に限定されるものではありません。

※詳細につきましては必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をお読みください。

当ファンドに係る費用について

【お客様には以下の費用をご負担いただきます。】

◇お客様に直接的にご負担いただく費用

購入時手数料…… 購入価額に、**3.15%(税抜3.0%)以内**で販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

信託財産留保額…… 換金申込受付日の翌営業日の基準価額に**0.3%**の率を乗じて得た額を、ご換金時にご負担いただきます。

◇お客様に信託財産で間接的にご負担いただく費用

運用管理費用: 毎日、ファンドの純資産総額に**年1.47%(税抜1.40%)**の率を乗じて得た額とします(信託報酬)

その他費用…… 上記以外に保有期間に応じてご負担いただく費用があります。

投資信託証券を組み入れる場合には、間接的にご負担いただく費用として、当該投資信託の資産から支払われる運用報酬、投資資産の取引費用等が発生します。これらの間接的な費用のご負担額に関しましては、その時々各投資信託証券の組入比率や取引内容等により金額が変動しますので、予めその料率、上限額等を具体的に示すことができません。

※当該手数料等の合計額については、投資者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。

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)でご確認ください。

販売会社の名称等

2012年2月1日現在

販売会社	登録番号	日本証券業協会	社団法人日本証券投資顧問業協会	社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
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	○	○	○	
あかつき証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第67号	○			
エース証券株式会社	金融商品取引業者 近畿財務局長(金商)第6号	○	○		

※ 加入協会に○印を記載しています。