

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成29年 4 月14日

【発行者名】 大和住銀投信投資顧問株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 後藤 正明

【本店の所在の場所】 東京都千代田区霞が関三丁目 2 番 1 号

【事務連絡者氏名】 植松 克彦

【電話番号】 03-6205-0200

【届出の対象とした
募集内国投資信託
受益証券に係る
ファンドの名称】 エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド（マネープールファンド）

【届出の対象とした
募集内国投資信託
受益証券の金額】 各々につき、2兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年10月19日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。なお、平成29年1月4日付および平成29年3月31日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。）の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正箇所および訂正事項】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

- ① 各ファンド(マネープールファンドを除く)は、主に米ドル建ての新興国の政府および政府機関等の発行する債券を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。

(以下略)

- グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンドは、T.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドが運用を行います。キャッシュ・マネジメント・マザーファンドは、大和住銀投信投資顧問が運用を行います。

T.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドの概要

同社(所在地:英国ロンドン)は、米国T.ロウ・プライス・グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるT.ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。T.ロウ・プライス・アソシエイツ・インクの親会社であるT.ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P500インデックスの採用銘柄です。T.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドは、T.ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。

(以下略)

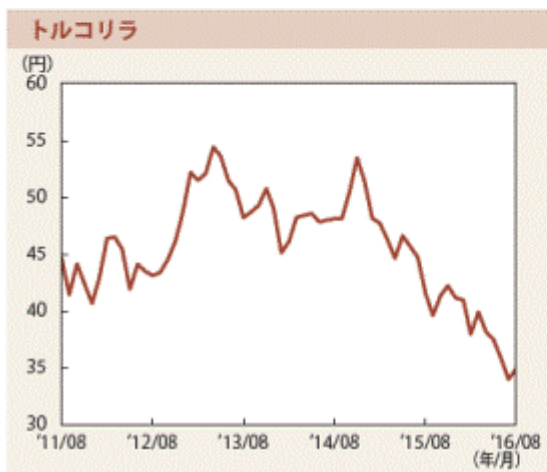
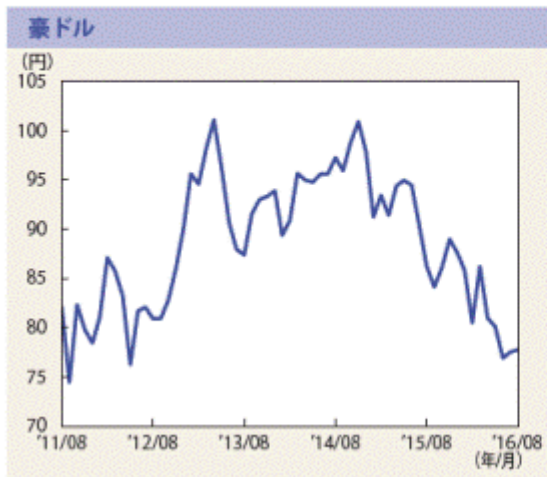
① エマージング債券への投資について



(以下略)

3 主要通貨の為替レート(対円)の推移について

(2011年8月末～2016年8月末)



(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成28年8月末現在）

(以下略)

<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの特色

① 各ファンド(マネーパブルファンドを除く)は、主に米ドル建ての新興国の政府および政府機関等の発行する債券を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。

(以下略)

- グローバル・エマージング・マーケット・ファンドは、ティール・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドが運用を行います。キャッシュ・マネジメント・マザーファンドは、大和住銀投信投資顧問が運用を行います。

ティール・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドの概要

同社(所在地:英国ロンドン)は、米国ティール・ロウ・プライス・グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるティール・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。ティール・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクの親会社であるティール・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P500インデックスの採用銘柄です。ティール・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドは、ティール・ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。

(以下略)

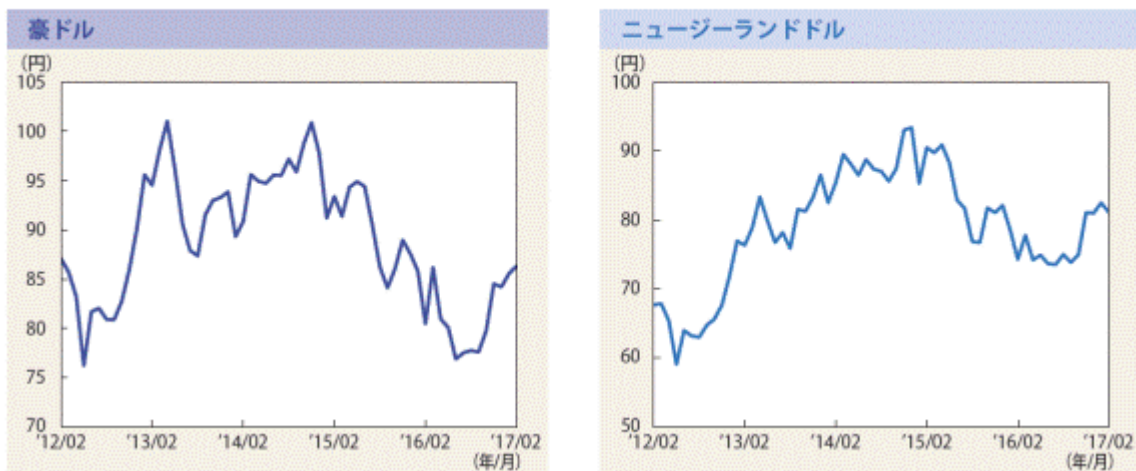
① エマージング債券への投資について



(以下略)

③ 主要通貨の為替レート(対円)の推移について

(2012年2月末～2017年2月末)





(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成29年2月末現在）

(以下略)

2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券等の概要

(以下略)

指定投資信託証券等の概要は、平成28年8月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。

< 指定投資信託証券の概要 >

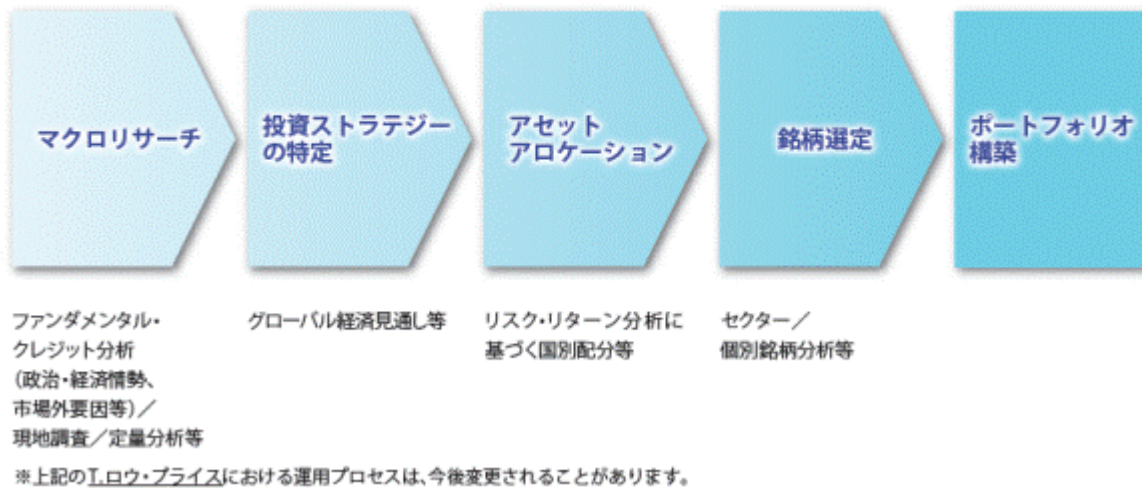
(以下略)

投資運用会社

T. ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド
(T. Rowe Price International Ltd)

(以下略)

I.ロウ・プライスにおけるエマージング債券運用プロセス

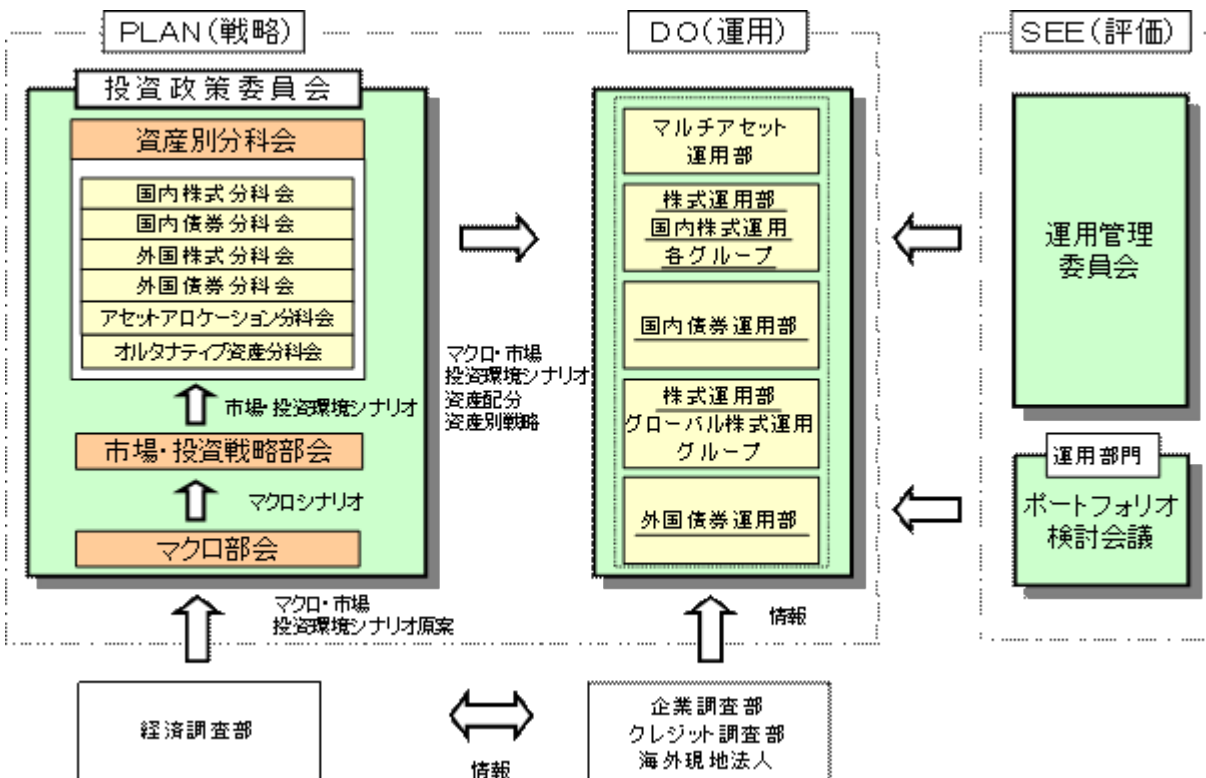


< T . ロウ ・ プライス ・ インターナショナル ・ リミテッドの概要 >

同社（所在地：英国ロンドン）は、米国T . ロウ ・ プライス ・ グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるT . ロウ ・ プライス ・ アソシエイツ ・ インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。T . ロウ ・ プライス ・ アソシエイツ ・ インクの親会社であるT . ロウ ・ プライス ・ グループ ・ インクは、米国の上場会社であり、また、S & P 500インデックスの採用銘柄です。T . ロウ ・ プライス ・ インターナショナル ・ リミテッドは、T . ロウ ・ プライス ・ グループの運用技術および調査能力を活用することができます。

(以下略)

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成28年8月末現在で約100名です。

(以下略)

< 訂正後 >

(2)投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券等の概要

(以下略)

指定投資信託証券等の概要は、平成29年2月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。

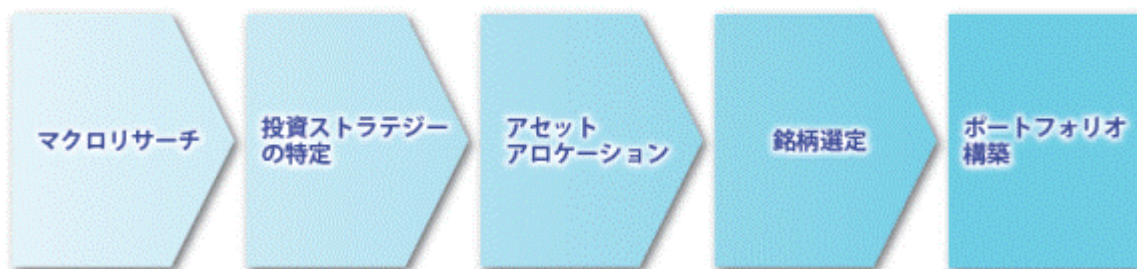
<指定投資信託証券の概要>

(以下略)

投資運用会社	ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド (T. Rowe Price International Ltd)
--------	--

(以下略)

ティー・ロウ・プライスにおけるエマージング債券運用プロセス



ファンダメンタル・クレジット分析
(政治・経済情勢、市場外要因等) /
現地調査 / 定量分析等

グローバル経済見通し等

リスク・リターン分析に
基づく国別配分等

セクター /
個別銘柄分析等

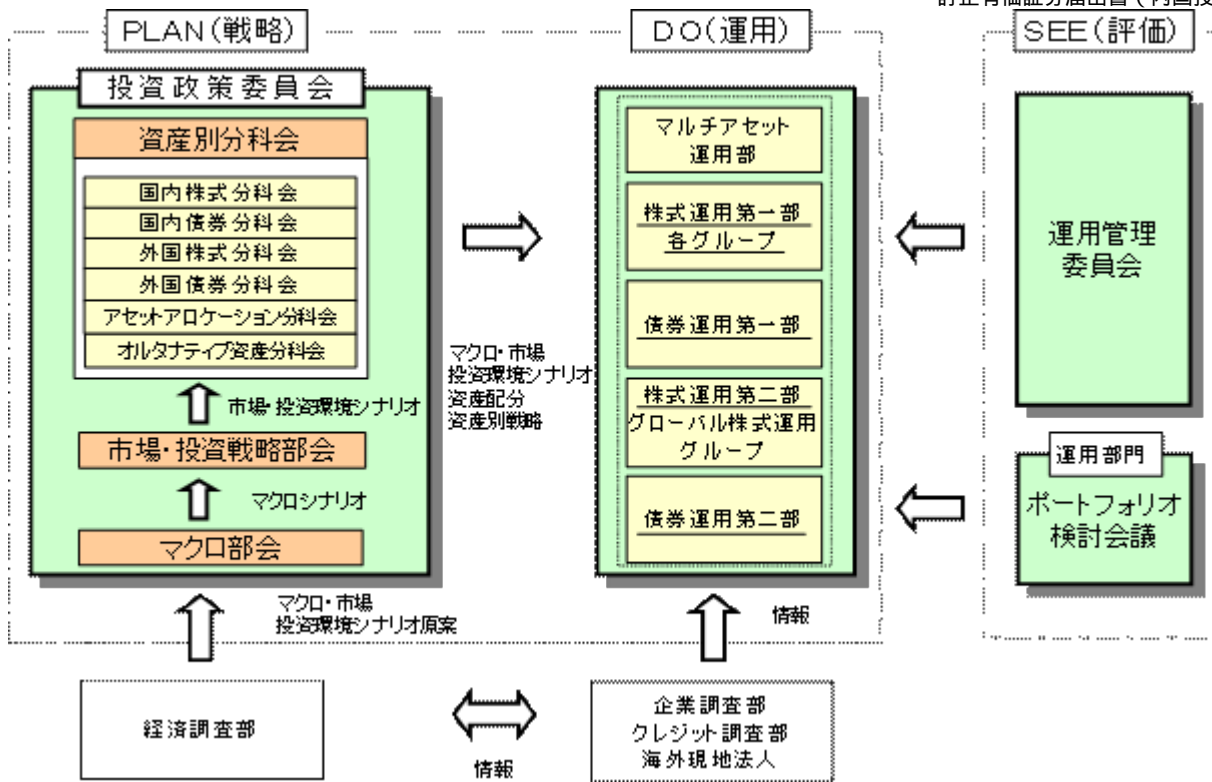
※上記のティー・ロウ・プライスにおける運用プロセスは、今後変更されることがあります。

<ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドの概要>

同社（所在地：英国ロンドン）は、米国ティー・ロウ・プライス・グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクの親会社であるティー・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P 500インデックスの採用銘柄です。ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドは、ティー・ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。

(以下略)

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成29年2月末現在で約100名です。
(以下略)

[次へ](#)

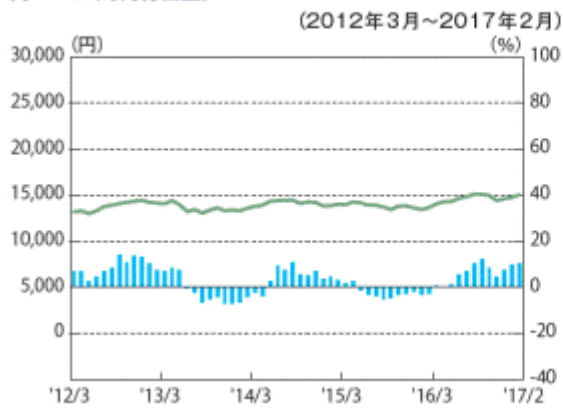
3 投資リスク

< 参考情報 >

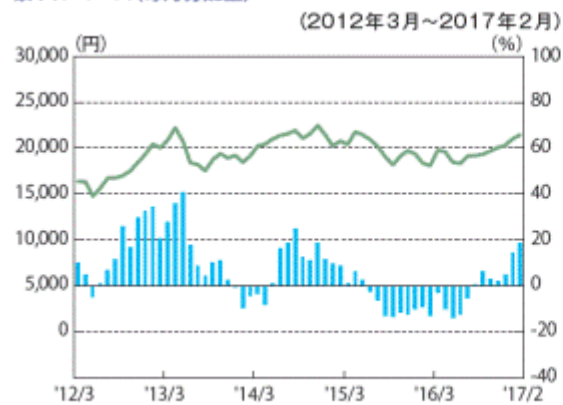
原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

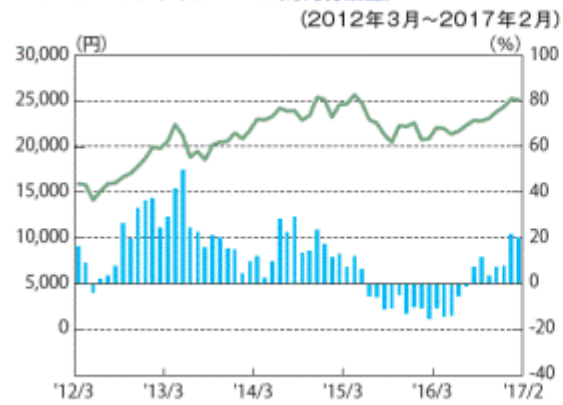
円コース(毎月分配型)



豪ドルコース(毎月分配型)

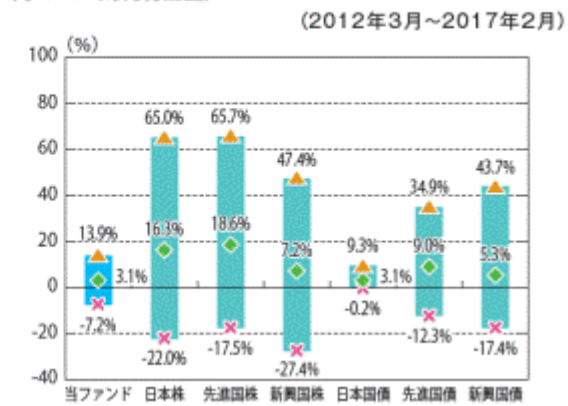


ニュージーランドドルコース(毎月分配型)

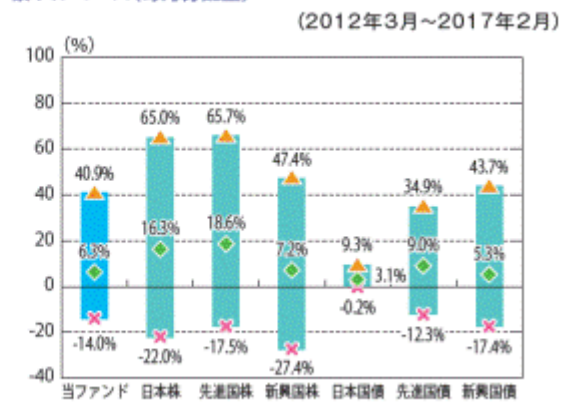


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

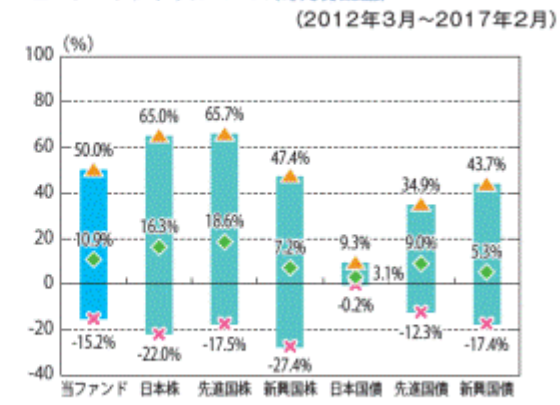
円コース(毎月分配型)



豪ドルコース(毎月分配型)



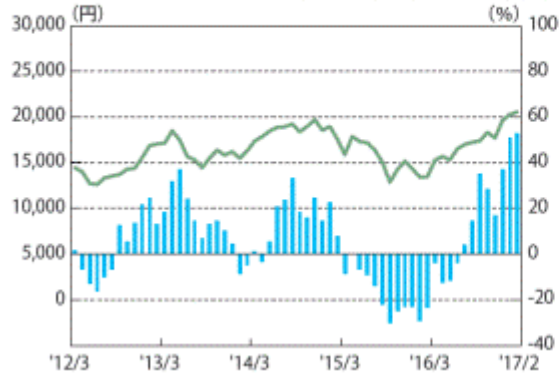
ニュージーランドドルコース(毎月分配型)



ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

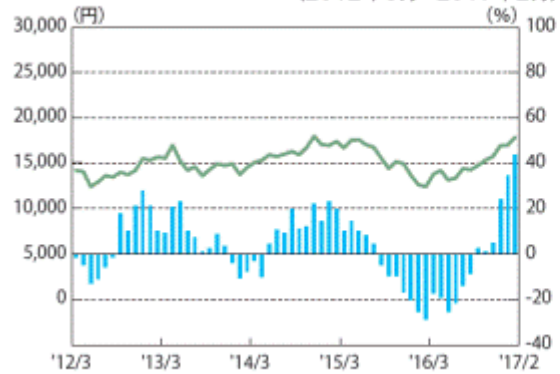
ブラジルリアルコース（毎月分配型）

(2012年3月～2017年2月)



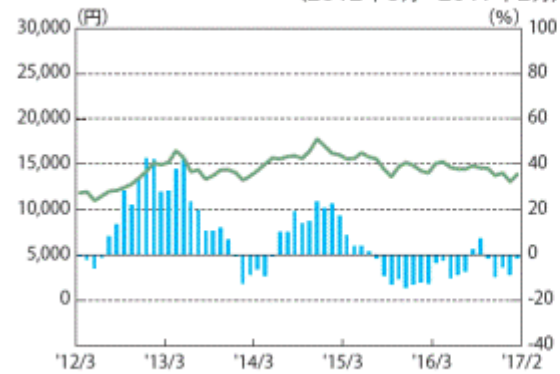
南アフリカランドコース（毎月分配型）

(2012年3月～2017年2月)



トルコリラコース（毎月分配型）

(2012年3月～2017年2月)

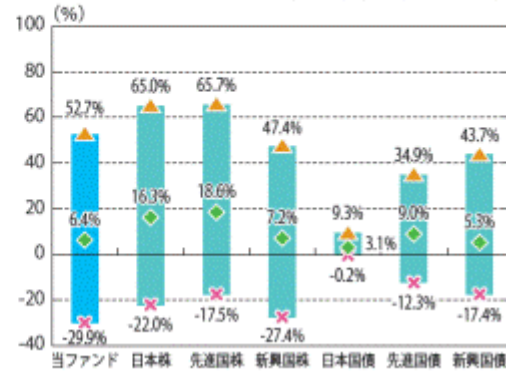


■ 年間騰落率(右目盛) — 分配金再投資基準価額(左目盛)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

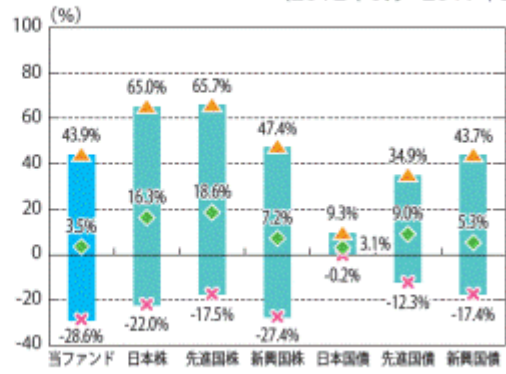
ブラジルリアルコース（毎月分配型）

(2012年3月～2017年2月)



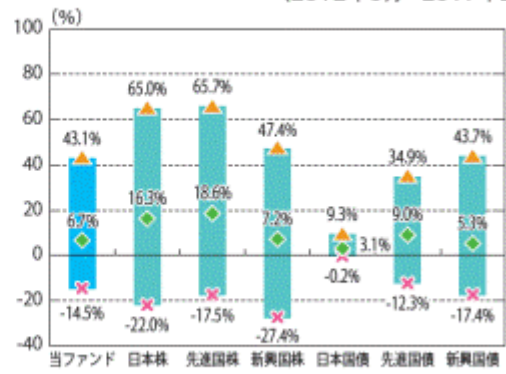
南アフリカランドコース（毎月分配型）

(2012年3月～2017年2月)



トルコリラコース（毎月分配型）

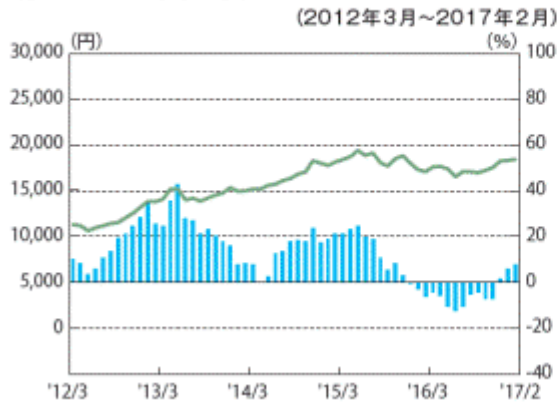
(2012年3月～2017年2月)



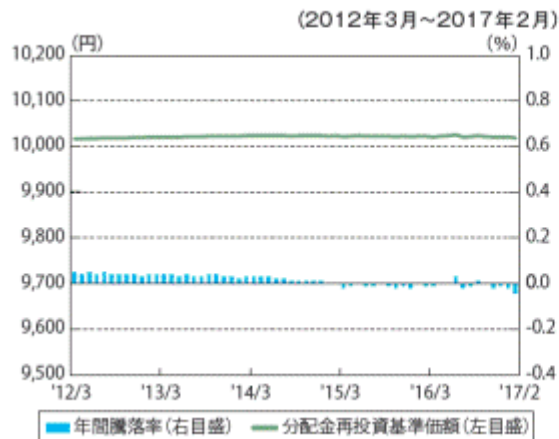
◆ 平均値 ▲ 最大値 × 最小値

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

中国元コース（毎月分配型）



マネーボールファンド



※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※年間騰落率および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

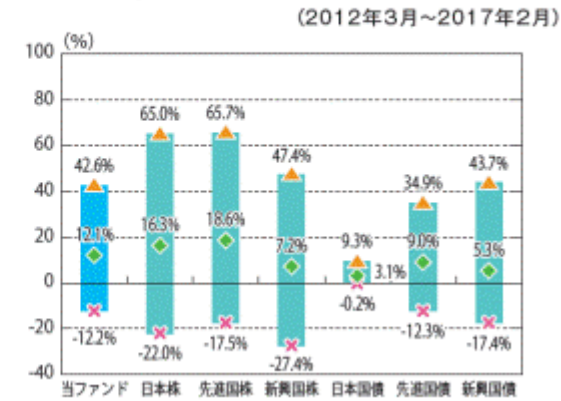
<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX(配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	Citigroup Index LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

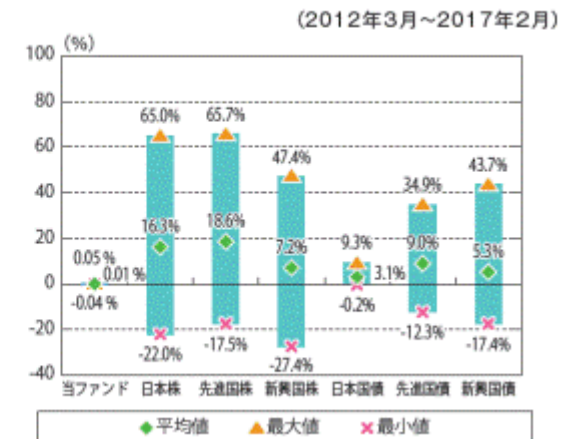
(注)上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

中国元コース（毎月分配型）



マネーボールファンド



※上記グラフは、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は平成28年8月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

< 訂正後 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は平成29年2月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[前へ](#) [次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）

(1) 投資状況

（平成29年2月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	125,962,527	0.96%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	12,946,766,333	98.23%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		107,016,750	0.81%
純資産総額		13,179,745,610	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成29年2月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund JPY Class ケイマン諸島	投資信託受益証券	18,752,558,420	0.6847	0.6904	-	98.23%
		-	-	12,839,958,062	12,946,766,333	-	
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益証券	123,747,448	1.0180	1.0179	-	0.96%
		-	-	125,974,903	125,962,527	-	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	98.23%
親投資信託受益証券	0.96%
合計	99.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成29年2月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成29年2月末現在）

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成21年7月17日）	826	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成22年1月18日）	3,297	3,400	1.0898	1.1258
第2特定期間末 （平成22年7月16日）	8,381	8,576	1.1000	1.1430
第3特定期間末 （平成23年1月17日）	21,569	22,247	1.1061	1.1511
第4特定期間末 （平成23年7月19日）	20,391	21,269	1.0932	1.1382
第5特定期間末 （平成24年1月16日）	57,054	58,875	1.0439	1.0914
第6特定期間末 （平成24年7月17日）	67,786	70,774	1.0723	1.1203
第7特定期間末 （平成25年1月16日）	80,701	84,006	1.0794	1.1274
第8特定期間末 （平成25年7月16日）	57,868	61,063	0.9554	1.0034
第9特定期間末 （平成26年1月16日）	42,666	45,182	0.9173	0.9653

第10特定期間末 (平成26年7月16日)	35,148	37,101	0.9306	0.9786
第11特定期間末 (平成27年1月16日)	26,881	28,521	0.8435	0.8915
第12特定期間末 (平成27年7月16日)	21,671	23,062	0.8049	0.8529
第13特定期間末 (平成28年1月18日)	16,571	17,751	0.7184	0.7664
平成28年2月末日	16,424	-	0.7307	-
平成28年3月末日	16,587	-	0.7459	-
平成28年4月末日	16,399	-	0.7486	-
平成28年5月末日	16,032	-	0.7422	-
平成28年6月末日	15,962	-	0.7528	-
第14特定期間末 (平成28年7月19日)	15,718	16,767	0.7552	0.8032
平成28年7月末日	15,724	-	0.7532	-
平成28年8月末日	15,641	-	0.7600	-
平成28年9月末日	15,025	-	0.7499	-
平成28年10月末日	14,498	-	0.7356	-
平成28年11月末日	13,391	-	0.7013	-
平成28年12月末日	13,202	-	0.7020	-
第15特定期間末 (平成29年1月16日)	13,258	14,201	0.7034	0.7514
平成29年1月末日	13,283	-	0.7014	-
平成29年2月末日	13,179	-	0.7064	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(平成21年7月17日～平成22年1月18日)	0.0360
第2特定期間(平成22年1月19日～平成22年7月16日)	0.0430
第3特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	0.0450
第4特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	0.0450
第5特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	0.0475
第6特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	0.0480
第7特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	0.0480
第8特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	0.0480
第9特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	0.0480
第10特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	0.0480
第11特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	0.0480
第12特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	0.0480
第13特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	0.0480
第14特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	0.0480
第15特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	0.0480

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成21年7月17日～平成22年1月18日)	12.6%
第2特定期間(平成22年1月19日～平成22年7月16日)	4.9%
第3特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	4.6%
第4特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	2.9%
第5特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	0.2%
第6特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	7.3%
第7特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	5.1%
第8特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	7.0%
第9特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	1.0%
第10特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	6.7%
第11特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	4.2%
第12特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	1.1%
第13特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	4.8%
第14特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	11.8%
第15特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	0.5%

(注) 収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配付基準価額) ÷ 前特定期末分配付基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1特定期間(平成21年7月17日～平成22年1月18日)	4,523,456,305	1,497,764,905
第2特定期間(平成22年1月19日～平成22年7月16日)	6,561,047,361	1,966,825,959
第3特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	15,181,125,347	3,299,863,786

第4特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	6,089,709,707	6,938,085,542
第5特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	46,558,461,946	10,558,161,914
第6特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	28,510,312,565	19,945,366,893
第7特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	32,965,692,636	21,416,371,194
第8特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	14,656,075,658	28,854,948,282
第9特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	2,877,531,522	16,934,705,189
第10特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	1,958,943,704	10,698,753,246
第11特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	1,144,650,777	7,045,207,443
第12特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	774,356,729	5,722,038,238
第13特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	703,142,919	4,557,488,535
第14特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	1,009,970,294	3,265,363,781
第15特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	1,391,295,879	3,355,656,443

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース(毎月分配型)

(1)投資状況

(平成29年2月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
親投資信託受益証券 (キャッシュ・マネジメント・マザーファンド)	日本	400,480,431	0.99%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	39,745,019,981	98.05%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		389,303,217	0.96%
純資産総額		40,534,803,629	100.00%

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成29年2月末現在)

イ.主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund AUD Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	60,651,640,442	0.6638 40,262,265,391	0.6553 39,745,019,981	- -	98.05%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	393,437,893	1.0179 400,519,649	1.0179 400,480,431	- -	0.99%

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	98.05%
親投資信託受益証券	0.99%
合計	99.04%

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ.投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

(3)運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (平成21年7月17日)	462	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成22年1月18日)	4,853	5,124	1.1600	1.2630
第2特定期間末 (平成22年7月16日)	7,992	8,347	1.0707	1.1387
第3特定期間末 (平成23年1月17日)	12,427	13,109	1.1454	1.2174

第4特定期間末 (平成23年7月19日)	17,953	18,960	1.1473	1.2283
第5特定期間末 (平成24年1月16日)	122,291	129,330	1.0017	1.1067
第6特定期間末 (平成24年7月17日)	163,786	179,591	1.0083	1.1163
第7特定期間末 (平成25年1月16日)	168,435	182,770	1.1501	1.2401
第8特定期間末 (平成25年7月16日)	123,532	135,244	0.9674	1.0574
第9特定期間末 (平成26年1月16日)	129,830	142,351	0.9210	1.0110
第10特定期間末 (平成26年7月16日)	106,737	118,139	0.9231	1.0131
第11特定期間末 (平成27年1月16日)	89,815	99,915	0.8171	0.9071
第12特定期間末 (平成27年7月16日)	73,451	83,089	0.7097	0.7997
第13特定期間末 (平成28年1月18日)	47,886	55,634	0.5277	0.6077
平成28年2月末日	48,109	-	0.5400	-
平成28年3月末日	51,003	-	0.5803	-
平成28年4月末日	49,159	-	0.5647	-
平成28年5月末日	45,153	-	0.5221	-
平成28年6月末日	42,968	-	0.5086	-
第14特定期間末 (平成28年7月19日)	44,593	49,802	0.5326	0.5926
平成28年7月末日	43,519	-	0.5217	-
平成28年8月末日	42,322	-	0.5124	-
平成28年9月末日	41,038	-	0.5062	-
平成28年10月末日	40,424	-	0.5055	-
平成28年11月末日	40,082	-	0.5047	-
平成28年12月末日	39,280	-	0.5014	-
第15特定期間末 (平成29年1月16日)	39,986	44,801	0.5110	0.5710
平成29年1月末日	40,013	-	0.5088	-
平成29年2月末日	40,534	-	0.5094	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(平成21年7月17日～平成22年1月18日)	0.1030
第2特定期間(平成22年1月19日～平成22年7月16日)	0.0680
第3特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	0.0720
第4特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	0.0810
第5特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	0.1050
第6特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	0.1080
第7特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	0.0900
第8特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	0.0900
第9特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	0.0900
第10特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	0.0900
第11特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	0.0900
第12特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	0.0900
第13特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	0.0800
第14特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	0.0600
第15特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	0.0600

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成21年7月17日～平成22年1月18日)	26.3%
第2特定期間(平成22年1月19日～平成22年7月16日)	1.8%
第3特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	13.7%
第4特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	7.2%
第5特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	3.5%
第6特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	11.4%
第7特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	23.0%
第8特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	8.1%
第9特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	4.5%
第10特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	10.0%
第11特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	1.7%
第12特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	2.1%

第13特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	14.4%
第14特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	12.3%
第15特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	7.2%

(注) 収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配付基準価額) ÷ 前特定期末分配付基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1特定期間(平成21年7月17日～平成22年1月18日)	5,012,113,493	827,501,661
第2特定期間(平成22年1月19日～平成22年7月16日)	5,466,040,017	2,186,485,899
第3特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	5,806,280,532	2,420,522,845
第4特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	8,959,869,024	4,160,924,975
第5特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	114,065,772,244	7,626,603,988
第6特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	89,663,753,666	49,315,158,518
第7特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	50,006,541,022	65,992,519,377
第8特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	36,447,324,564	55,196,338,717
第9特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	38,260,767,070	24,997,108,621
第10特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	19,535,312,226	44,867,960,678
第11特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	14,163,321,749	19,879,046,928
第12特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	10,114,462,815	16,538,284,629
第13特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	5,812,475,597	18,561,775,017
第14特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	4,257,277,958	11,277,400,271
第15特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	5,090,442,665	10,561,645,342

(注) 本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース(毎月分配型)

(1) 投資状況

(平成29年2月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
親投資信託受益証券 (キャッシュ・マネジメント・マザーファンド)	日本	13,203,706	0.77%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	1,641,209,076	95.76%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		59,472,298	3.47%
純資産総額		1,713,885,080	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成29年2月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund NZD Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	2,174,362,847	0.7607 1,654,159,302	0.7548 1,641,209,076	- -	95.76%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	12,971,516	1.0179 13,204,956	1.0179 13,203,706	- -	0.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	95.76%
親投資信託受益証券	0.77%
合計	96.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成21年7月17日）	21	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成22年1月18日）	421	441	1.1632	1.2762
第2特定期間末 （平成22年7月16日）	989	1,027	1.0986	1.1646
第3特定期間末 （平成23年1月17日）	840	890	1.1118	1.1778
第4特定期間末 （平成23年7月19日）	687	732	1.1438	1.2098
第5特定期間末 （平成24年1月16日）	849	903	0.9983	1.0643
第6特定期間末 （平成24年7月17日）	1,269	1,339	1.0554	1.1214
第7特定期間末 （平成25年1月16日）	1,219	1,290	1.2556	1.3216
第8特定期間末 （平成25年7月16日）	2,159	2,263	1.1678	1.2338
第9特定期間末 （平成26年1月16日）	2,457	2,591	1.2566	1.3226
第10特定期間末 （平成26年7月16日）	2,723	2,851	1.3198	1.3858
第11特定期間末 （平成27年1月16日）	2,437	2,571	1.2523	1.3183
第12特定期間末 （平成27年7月16日）	2,212	2,344	1.1053	1.1713
第13特定期間末 （平成28年1月18日）	1,597	1,719	0.9177	0.9837
平成28年2月末日	1,603	-	0.9423	-
平成28年3月末日	1,640	-	0.9862	-
平成28年4月末日	1,600	-	0.9691	-
平成28年5月末日	1,517	-	0.9314	-
平成28年6月末日	1,538	-	0.9364	-
第14特定期間末 （平成28年7月19日）	1,579	1,688	0.9684	1.0344
平成28年7月末日	1,545	-	0.9526	-
平成28年8月末日	1,605	-	0.9638	-
平成28年9月末日	1,632	-	0.9496	-
平成28年10月末日	1,355	-	0.9501	-
平成28年11月末日	1,373	-	0.9677	-
平成28年12月末日	1,567	-	0.9797	-
第15特定期間末 （平成29年1月16日）	1,635	1,741	0.9933	1.0593
平成29年1月末日	1,662	-	1.0040	-
平成29年2月末日	1,713	-	0.9890	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	0.1130
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	0.0660
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	0.0660
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	0.0660
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	0.0660
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	0.0660
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	0.0660
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	0.0660
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	0.0660
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	0.0660
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	0.0660
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	0.0660
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	0.0660
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	0.0660
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	0.0660

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	27.6%
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	0.1%

第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	7.2%
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	8.8%
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	7.0%
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	12.3%
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	25.2%
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	1.7%
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	13.3%
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	10.3%
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	0.1%
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	6.5%
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	11.0%
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	12.7%
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	9.4%

（注）収益率 = （当特定期末分配基準価額 - 前特定期末分配基準価額） ÷ 前特定期末分配基準価額 × 100

（4）設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	475,169,637	113,164,164
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	648,099,099	109,322,328
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	401,016,430	545,460,967
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	325,859,175	481,280,183
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	688,211,812	437,899,145
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	774,171,011	422,784,701
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	718,813,150	950,233,813
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	1,894,873,822	1,017,000,483
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	859,470,155	752,857,324
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	1,525,578,412	1,417,905,550
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	981,274,346	1,097,768,921
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	684,106,812	629,457,166
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	269,197,271	530,195,017
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	185,140,801	295,119,281
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	529,279,920	513,459,190

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）

（1）投資状況

（平成29年2月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	450,585,739	0.68%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	65,179,105,154	98.77%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		360,691,765	0.55%
純資産総額		65,990,382,658	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成29年2月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund BRL Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	186,332,490,437	0.3595 66,994,637,496	0.3498 65,179,105,154	- -	98.77%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	442,662,088	1.0179 450,629,960	1.0179 450,585,739	- -	0.68%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	98.77%
親投資信託受益証券	0.68%
合計	99.45%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成29年2月末現在）
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
（平成29年2月末現在）
該当事項はありません。

(3) 運用実績
純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成21年7月17日）	8,291	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成22年1月18日）	67,412	72,095	1.0895	1.2145
第2特定期間末 （平成22年7月16日）	169,288	179,375	1.0425	1.1345
第3特定期間末 （平成23年1月17日）	318,220	342,469	1.0260	1.1220
第4特定期間末 （平成23年7月19日）	389,383	423,443	1.0103	1.1063
第5特定期間末 （平成24年1月16日）	351,754	392,479	0.8031	0.8991
第6特定期間末 （平成24年7月17日）	341,443	385,208	0.7209	0.8169
第7特定期間末 （平成25年1月16日）	334,470	364,243	0.8037	0.8697
第8特定期間末 （平成25年7月16日）	246,807	271,003	0.7163	0.7823
第9特定期間末 （平成26年1月16日）	221,166	243,250	0.6811	0.7471
第10特定期間末 （平成26年7月16日）	173,384	191,723	0.7137	0.7797
第11特定期間末 （平成27年1月16日）	139,303	154,262	0.6351	0.7011
第12特定期間末 （平成27年7月16日）	108,663	122,513	0.5304	0.5964
第13特定期間末 （平成28年1月18日）	63,281	74,913	0.3441	0.4041
平成28年2月末日	61,944	-	0.3461	-
平成28年3月末日	67,880	-	0.3844	-
平成28年4月末日	67,305	-	0.3862	-
平成28年5月末日	63,641	-	0.3694	-
平成28年6月末日	66,270	-	0.3898	-
第14特定期間末 （平成28年7月19日）	66,774	75,127	0.3987	0.4467
平成28年7月末日	65,078	-	0.3932	-
平成28年8月末日	63,597	-	0.3907	-
平成28年9月末日	61,844	-	0.3859	-
平成28年10月末日	63,352	-	0.3983	-
平成28年11月末日	60,779	-	0.3767	-
平成28年12月末日	66,076	-	0.4090	-
第15特定期間末 （平成29年1月16日）	65,461	73,182	0.4070	0.4550
平成29年1月末日	66,510	-	0.4147	-
平成29年2月末日	65,990	-	0.4128	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	0.1250
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	0.0920
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	0.0960
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	0.0960
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	0.0960
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	0.0960
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	0.0660
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	0.0660
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	0.0660
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	0.0660
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	0.0660
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	0.0660

第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	0.0600
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	0.0480
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	0.0480

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	21.5%
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	4.1%
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	7.6%
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	7.8%
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	11.0%
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	1.7%
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	20.6%
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	2.7%
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	4.3%
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	14.5%
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	1.8%
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	6.1%
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	23.8%
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	29.8%
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	14.1%

（注）収益率 = （当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配付基準価額） ÷ 前特定期末分配付基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	70,043,874,886	8,167,080,335
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	114,781,362,126	14,274,136,214
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	164,781,289,376	17,012,282,553
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	139,802,305,748	64,537,190,265
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	149,707,173,597	97,119,652,542
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	120,939,570,757	85,310,198,271
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	74,357,521,307	131,843,345,851
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	57,596,184,197	129,206,089,908
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	41,997,319,256	61,798,223,624
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	15,142,179,864	96,946,785,043
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	13,834,270,900	37,409,573,204
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	17,736,532,358	32,239,354,435
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	10,819,996,822	31,744,935,430
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	7,385,620,159	23,840,091,905
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	16,275,765,945	22,894,028,514

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）

(1) 投資状況

（平成29年2月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	16,091,384	0.99%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	1,583,907,699	97.20%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		29,532,487	1.81%
純資産総額		1,629,531,570	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成29年2月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund ZAR Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	4,040,580,866	0.3930 1,588,257,605	0.3920 1,583,907,699	- -	97.20%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	15,808,414	1.0179 16,092,945	1.0179 16,091,384	- -	0.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	97.20%

親投資信託受益証券	0.99%
合計	98.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

投資不動産物件
（平成29年2月末現在）
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
（平成29年2月末現在）
該当事項はありません。

(3) 運用実績
純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成21年7月17日）	744	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成22年1月18日）	1,947	2,128	1.1097	1.2257
第2特定期間末 （平成22年7月16日）	1,652	1,769	1.0637	1.1377
第3特定期間末 （平成23年1月17日）	1,921	2,046	1.1011	1.1791
第4特定期間末 （平成23年7月19日）	4,094	4,310	1.0197	1.1037
第5特定期間末 （平成24年1月16日）	6,831	7,455	0.7928	0.8828
第6特定期間末 （平成24年7月17日）	8,488	9,370	0.8015	0.8915
第7特定期間末 （平成25年1月16日）	5,850	6,366	0.8468	0.9068
第8特定期間末 （平成25年7月16日）	5,213	5,628	0.7467	0.8067
第9特定期間末 （平成26年1月16日）	4,222	4,618	0.6776	0.7376
第10特定期間末 （平成26年7月16日）	3,003	3,325	0.6734	0.7334
第11特定期間末 （平成27年1月16日）	2,204	2,434	0.6539	0.7139
第12特定期間末 （平成27年7月16日）	1,954	2,152	0.6096	0.6696
第13特定期間末 （平成28年1月18日）	1,122	1,288	0.3799	0.4339
平成28年2月末日	1,129	-	0.3899	-
平成28年3月末日	1,227	-	0.4256	-
平成28年4月末日	1,261	-	0.4311	-
平成28年5月末日	1,131	-	0.3919	-
平成28年6月末日	1,137	-	0.3920	-
第14特定期間末 （平成28年7月19日）	1,221	1,343	0.4187	0.4607
平成28年7月末日	1,201	-	0.4159	-
平成28年8月末日	1,166	-	0.4040	-
平成28年9月末日	1,193	-	0.4111	-
平成28年10月末日	1,208	-	0.4199	-
平成28年11月末日	1,269	-	0.4231	-
平成28年12月末日	1,373	-	0.4485	-
第15特定期間末 （平成29年1月16日）	1,409	1,534	0.4488	0.4908
平成29年1月末日	1,474	-	0.4433	-
平成29年2月末日	1,629	-	0.4590	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	0.1160
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	0.0740
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	0.0780
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	0.0840

第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	0.0900
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	0.0900
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	0.0600
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	0.0600
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	0.0600
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	0.0600
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	0.0600
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	0.0600
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	0.0540
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	0.0420
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	0.0420

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	22.6%
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	2.5%
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	10.8%
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	0.2%
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	13.4%
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	12.4%
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	13.1%
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	4.7%
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	1.2%
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	8.2%
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	6.0%
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	2.4%
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	28.8%
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	21.3%
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	17.2%

（注）収益率 = （当特定期末分配基準価額 - 前特定期末分配基準価額） ÷ 前特定期末分配基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	2,755,323,743	1,000,295,190
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	750,882,623	952,397,302
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	681,030,043	489,532,782
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	2,673,735,412	403,210,041
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	5,829,713,133	1,227,917,718
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	7,052,429,493	5,078,409,981
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	2,323,551,335	6,005,920,242
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	4,686,748,693	4,613,949,193
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	849,273,890	1,599,677,230
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	715,929,523	2,487,155,872
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	269,224,439	1,358,470,626
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	324,492,262	489,262,065
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	197,324,279	449,215,254
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	379,531,378	416,373,348
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	705,333,826	481,739,347

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）

(1) 投資状況

（平成29年2月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	82,251,439	1.01%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	7,948,422,467	97.44%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		126,350,868	1.55%
純資産総額		8,157,024,774	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成29年2月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund TRY Class	投資信託受益証券	20,742,229,820	0.3788	0.3832	-	97.44%

	ケイマン諸島	-		7,858,563,801	7,948,422,467	-	
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券	80,805,029	1.0179	1.0179	-	1.01%
		-		82,259,303	82,251,439	-	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	97.44%
親投資信託受益証券	1.01%
合計	98.45%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成29年2月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成29年2月末現在）

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成21年7月17日）	1,094	-	1.0000	-
第1特定期間末 （平成22年1月18日）	4,400	4,726	1.1057	1.1767
第2特定期間末 （平成22年7月16日）	2,244	2,452	1.0201	1.0941
第3特定期間末 （平成23年1月17日）	2,898	3,098	0.9577	1.0357
第4特定期間末 （平成23年7月19日）	20,467	21,169	0.8347	0.9127
第5特定期間末 （平成24年1月16日）	29,686	32,785	0.6786	0.7566
第6特定期間末 （平成24年7月17日）	58,462	63,656	0.7181	0.7961
第7特定期間末 （平成25年1月16日）	49,508	53,919	0.8257	0.8857
第8特定期間末 （平成25年7月16日）	50,445	54,352	0.7465	0.8065
第9特定期間末 （平成26年1月16日）	37,873	41,569	0.6621	0.7221
第10特定期間末 （平成26年7月16日）	28,922	31,854	0.6818	0.7418
第11特定期間末 （平成27年1月16日）	23,718	26,041	0.6624	0.7224
第12特定期間末 （平成27年7月16日）	20,051	22,112	0.5857	0.6457
第13特定期間末 （平成28年1月18日）	12,523	14,282	0.4337	0.4897
平成28年2月末日	12,338	-	0.4421	-
平成28年3月末日	12,791	-	0.4668	-
平成28年4月末日	12,514	-	0.4641	-
平成28年5月末日	11,493	-	0.4364	-
平成28年6月末日	10,742	-	0.4234	-
第14特定期間末 （平成28年7月19日）	10,534	11,815	0.4255	0.4735
平成28年7月末日	10,043	-	0.4154	-
平成28年8月末日	9,909	-	0.4185	-
平成28年9月末日	9,274	-	0.4032	-
平成28年10月末日	8,790	-	0.3939	-
平成28年11月末日	7,957	-	0.3645	-
平成28年12月末日	7,780	-	0.3645	-
第15特定期間末 （平成29年1月16日）	7,154	8,229	0.3359	0.3839

平成29年1月末日	7,305	-	0.3315	-
平成29年2月末日	8,157	-	0.3438	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	0.0710
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	0.0740
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	0.0780
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	0.0780
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	0.0780
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	0.0780
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	0.0600
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	0.0600
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	0.0600
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	0.0600
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	0.0600
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	0.0600
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	0.0560
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	0.0480
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	0.0480

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	17.7%
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	1.0%
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	1.5%
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	4.7%
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	9.4%
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	17.3%
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	23.3%
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	2.3%
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	3.3%
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	12.0%
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	6.0%
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	2.5%
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	16.4%
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	9.2%
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	9.8%

（注）収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配付基準価額) ÷ 前特定期末分配付基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	5,776,669,415	1,796,996,731
第2特定期間（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	1,101,479,432	2,881,280,575
第3特定期間（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	1,445,393,533	618,378,711
第4特定期間（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	22,232,380,472	738,354,865
第5特定期間（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	24,295,764,649	5,070,766,664
第6特定期間（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	61,008,589,651	23,344,115,786
第7特定期間（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	31,330,656,272	52,783,068,892
第8特定期間（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	42,242,893,328	34,625,045,087
第9特定期間（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	4,955,262,858	15,328,426,951
第10特定期間（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	5,997,807,626	20,779,252,185
第11特定期間（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	3,639,327,935	10,255,929,049
第12特定期間（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	4,003,631,840	5,574,630,801
第13特定期間（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	993,804,167	6,353,002,733
第14特定期間（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	878,452,278	4,991,815,878
第15特定期間（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	1,677,056,706	5,135,960,976

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）

(1) 投資状況

（平成29年2月末日現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （キャッシュ・マネジメント・マザーファンド）	日本	2,073,279	0.69%
投資信託受益証券	ケイマン諸島	293,857,090	98.09%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,638,798	1.21%
純資産総額		299,569,167	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成29年2月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	TRP Global Emerging Markets Bond Fund CNY Class ケイマン諸島	投資信託受益証券 -	304,325,902	0.9784 297,782,895	0.9656 293,857,090	- -	98.09%
2	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	2,036,820	1.0179 2,073,482	1.0179 2,073,279	- -	0.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
投資信託受益証券	98.09%
親投資信託受益証券	0.69%
合計	98.79%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (平成22年2月1日)	3,333	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成22年7月16日)	5,136	5,235	0.9900	1.0100
第2特定期間末 (平成23年1月17日)	2,937	3,027	0.9818	1.0058
第3特定期間末 (平成23年7月19日)	1,895	1,954	0.9483	0.9723
第4特定期間末 (平成24年1月16日)	1,282	1,320	0.9240	0.9480
第5特定期間末 (平成24年7月17日)	1,050	1,079	0.9939	1.0179
第6特定期間末 (平成25年1月16日)	734	753	1.1879	1.2119
第7特定期間末 (平成25年7月16日)	649	663	1.2253	1.2493
第8特定期間末 (平成26年1月16日)	680	691	1.2913	1.3153
第9特定期間末 (平成26年7月16日)	480	490	1.2980	1.3220
第10特定期間末 (平成27年1月16日)	521	529	1.4178	1.4418
第11特定期間末 (平成27年7月16日)	621	630	1.5157	1.5397
第12特定期間末 (平成28年1月18日)	400	407	1.3092	1.3332
平成28年2月末日	364	-	1.3287	-
平成28年3月末日	373	-	1.3645	-
平成28年4月末日	366	-	1.3649	-
平成28年5月末日	345	-	1.3388	-
平成28年6月末日	325	-	1.2700	-
第13特定期間末 (平成28年7月19日)	325	332	1.3161	1.3401
平成28年7月末日	325	-	1.3106	-
平成28年8月末日	314	-	1.3046	-
平成28年9月末日	307	-	1.2903	-

平成28年10月末日	307	-	1.3068	-
平成28年11月末日	296	-	1.3268	-
平成28年12月末日	312	-	1.3771	-
第14特定期間末 (平成29年1月16日)	311	316	1.3866	1.4106
平成29年1月末日	300	-	1.3755	-
平成29年2月末日	299	-	1.3809	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

分配の推移

期間	1口当りの分配金(円)
第1特定期間(平成22年2月1日～平成22年7月16日)	0.0200
第2特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	0.0240
第3特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	0.0240
第4特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	0.0240
第5特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	0.0240
第6特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	0.0240
第7特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	0.0240
第8特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	0.0240
第9特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	0.0240
第10特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	0.0240
第11特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	0.0240
第12特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	0.0240
第13特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	0.0240
第14特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	0.0240

収益率の推移

期間	収益率
第1特定期間(平成22年2月1日～平成22年7月16日)	1.0%
第2特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	1.6%
第3特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	1.0%
第4特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	0.0%
第5特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	10.2%
第6特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	21.9%
第7特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	5.2%
第8特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	7.3%
第9特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	2.4%
第10特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	11.1%
第11特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	8.6%
第12特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	12.0%
第13特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	2.4%
第14特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	7.2%

(注) 収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配落基準価額) ÷ 前特定期末分配落基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1特定期間(平成22年2月1日～平成22年7月16日)	6,239,224,986	1,051,260,697
第2特定期間(平成22年7月17日～平成23年1月17日)	207,105,234	2,402,802,483
第3特定期間(平成23年1月18日～平成23年7月19日)	242,343,336	1,235,646,674
第4特定期間(平成23年7月20日～平成24年1月16日)	47,685,811	659,065,309
第5特定期間(平成24年1月17日～平成24年7月17日)	352,308,864	682,683,075
第6特定期間(平成24年7月18日～平成25年1月16日)	117,520,592	556,112,323
第7特定期間(平成25年1月17日～平成25年7月16日)	511,289,882	599,992,923
第8特定期間(平成25年7月17日～平成26年1月16日)	163,900,603	166,966,515
第9特定期間(平成26年1月17日～平成26年7月16日)	32,931,146	189,936,578
第10特定期間(平成26年7月17日～平成27年1月16日)	154,112,456	156,416,208
第11特定期間(平成27年1月17日～平成27年7月16日)	136,098,992	93,780,053
第12特定期間(平成27年7月17日～平成28年1月18日)	37,040,995	141,357,719
第13特定期間(平成28年1月19日～平成28年7月19日)	7,230,230	65,142,373
第14特定期間(平成28年7月20日～平成29年1月16日)	7,855,144	30,940,077

(注) 本邦外における設定及び解約の実績はありません。

エマーシング・ボンド・ファンド(マネー・プールファンド)

(1) 投資状況

(平成29年2月末日現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
親投資信託受益証券 (キャッシュ・マネジメント・マザーファンド)	日本	775,914,771	100.13%

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,006,140	0.13%
純資産総額	774,908,631	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成29年2月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	762,270,136	1.0180 776,064,588	1.0179 775,914,771	- -	100.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.13%
合計	100.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (平成21年7月17日)	1	-	1.0000	-
第1計算期間末 (平成22年1月18日)	34	-	1.0003	-
第2計算期間末 (平成22年7月16日)	66	-	1.0007	-
第3計算期間末 (平成23年1月17日)	380	-	1.0009	-
第4計算期間末 (平成23年7月19日)	393	-	1.0015	-
第5計算期間末 (平成24年1月16日)	1,153	-	1.0016	-
第6計算期間末 (平成24年7月17日)	1,469	-	1.0018	-
第7計算期間末 (平成25年1月16日)	910	-	1.0020	-
第8計算期間末 (平成25年7月16日)	2,425	-	1.0022	-
第9計算期間末 (平成26年1月16日)	1,549	-	1.0024	-
第10計算期間末 (平成26年7月16日)	1,349	-	1.0024	-
第11計算期間末 (平成27年1月16日)	1,000	-	1.0023	-
第12計算期間末 (平成27年7月16日)	1,037	-	1.0023	-
第13計算期間末 (平成28年1月18日)	1,115	-	1.0022	-
平成28年2月末日	983	-	1.0023	-
平成28年3月末日	939	-	1.0021	-
平成28年4月末日	943	-	1.0023	-
平成28年5月末日	902	-	1.0024	-
平成28年6月末日	1,070	-	1.0026	-
第14計算期間末 (平成28年7月19日)	1,049	-	1.0026	-

平成28年7月末日	1,107	-	1.0021	-
平成28年8月末日	1,080	-	1.0022	-
平成28年9月末日	1,002	-	1.0024	-
平成28年10月末日	995	-	1.0022	-
平成28年11月末日	844	-	1.0021	-
平成28年12月末日	886	-	1.0021	-
第15計算期間末 （平成29年1月16日）	816	-	1.0021	-
平成29年1月末日	840	-	1.0021	-
平成29年2月末日	774	-	1.0019	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

期間	収益率
第1期（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	0.0%
第2期（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	0.0%
第3期（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	0.0%
第4期（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	0.1%
第5期（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	0.0%
第6期（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	0.0%
第7期（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	0.0%
第8期（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	0.0%
第9期（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	0.0%
第10期（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	0.0%
第11期（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	0.0%
第12期（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	0.0%
第13期（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	0.0%
第14期（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	0.0%
第15期（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	0.0%

（注）収益率 = (当計算期末分配付基準価額 - 前計算期末分配付基準価額) ÷ 前計算期末分配付基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1期（平成21年7月17日～平成22年1月18日）	48,931,273	14,002,982
第2期（平成22年1月19日～平成22年7月16日）	133,766,074	102,324,386
第3期（平成22年7月17日～平成23年1月17日）	478,318,289	164,434,910
第4期（平成23年1月18日～平成23年7月19日）	1,502,577,720	1,490,224,626
第5期（平成23年7月20日～平成24年1月16日）	5,105,935,530	4,346,677,515
第6期（平成24年1月17日～平成24年7月17日）	6,558,252,160	6,243,614,877
第7期（平成24年7月18日～平成25年1月16日）	3,406,055,597	3,963,358,349
第8期（平成25年1月17日～平成25年7月16日）	7,232,843,198	5,722,428,723
第9期（平成25年7月17日～平成26年1月16日）	4,524,841,110	5,398,446,830
第10期（平成26年1月17日～平成26年7月16日）	1,764,961,896	1,964,871,588
第11期（平成26年7月17日～平成27年1月16日）	1,007,799,497	1,355,792,467
第12期（平成27年1月17日～平成27年7月16日）	843,742,386	806,694,692
第13期（平成27年7月17日～平成28年1月18日）	977,777,122	900,080,126
第14期（平成28年1月19日～平成28年7月19日）	477,507,834	543,848,190
第15期（平成28年7月20日～平成29年1月16日）	254,893,689	486,246,335

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

(参考) マザーファンドの運用状況

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

(1) 投資状況

（平成29年2月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
特殊債券	日本	1,785,633,435	43.24%
社債券	日本	1,200,065,158	29.06%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,144,134,570	27.70%
純資産総額		4,129,833,163	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成29年2月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	873 政保公営企業 日本	特殊債券 -	500,000,000	101.19 505,971,000	100.08 500,424,500	1.7000 2017/03/17	12.12%
2	30 政保道路機構 日本	特殊債券 -	490,000,000	100.87 494,275,600	100.13 490,661,500	1.7000 2017/03/28	11.88%
3	49 政保道路機構 日本	特殊債券 -	365,000,000	101.46 370,361,850	101.40 370,138,835	1.5000 2018/01/31	8.96%
4	37 政保道路機構 日本	特殊債券 -	290,000,000	100.98 292,853,600	100.80 292,332,760	1.9000 2017/07/31	7.08%
5	21 政保政策投資B 日本	特殊債券 -	130,000,000	101.65 132,145,000	101.59 132,075,840	1.6000 2018/02/19	3.20%
6	16 沖縄電力 日本	社債券 -	100,000,000	101.68 101,683,900	100.54 100,545,100	1.8300 2017/06/20	2.43%
7	30 東海旅客鉄道 日本	社債券 -	100,000,000	101.47 101,474,800	100.38 100,385,200	1.7800 2017/05/19	2.43%
8	33 クレディセゾン 日本	社債券 -	100,000,000	100.54 100,546,000	100.31 100,314,500	2.0700 2017/04/27	2.43%
9	32 野村ホールディング 日本	社債券 -	100,000,000	100.42 100,425,000	100.28 100,287,500	1.0000 2017/06/22	2.43%
10	62 住友金属工業 日本	社債券 -	100,000,000	100.69 100,691,000	100.26 100,268,300	0.7300 2017/07/21	2.43%
11	33 日本郵船 日本	社債券 -	100,000,000	100.33 100,338,000	100.08 100,089,300	0.4720 2017/06/16	2.42%
12	1 コカ・コーライースト 日本	社債券 -	100,000,000	100.12 100,126,000	100.05 100,050,200	0.1560 2017/09/22	2.42%
13	65 小田急電鉄 日本	社債券 -	100,000,000	100.13 100,135,000	100.04 100,049,900	0.1700 2017/07/25	2.42%
14	27 日産フィナンシャル 日本	社債券 -	100,000,000	100.12 100,126,000	100.01 100,019,900	0.1460 2017/06/20	2.42%
15	18 ホンダファイナンス 日本	社債券 -	100,000,000	100.28 100,286,500	100.01 100,018,900	0.4790 2017/03/17	2.42%
16	22 日新製鋼 日本	社債券 -	100,000,000	100.18 100,188,300	100.00 100,000,000	0.3300 2017/03/10	2.42%
17	157 オリックス 日本	社債券 -	98,000,000	100.69 98,676,200	100.03 98,036,358	1.1100 2017/03/13	2.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
特殊債券	43.24%
社債券	29.06%
合計	72.30%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

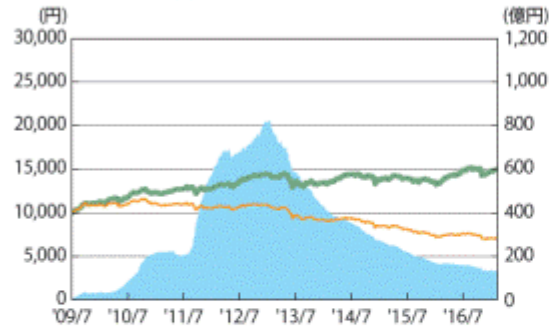
(平成29年2月末現在)

該当事項はありません。

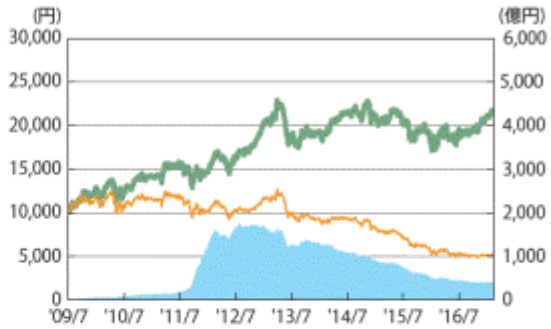
(参考情報)

基準価額・純資産の推移 (設定日～2017年2月28日)

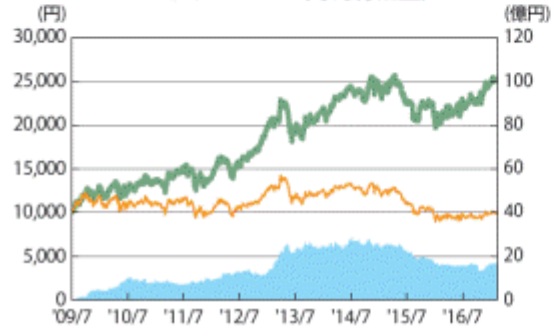
円コース(毎月分配型)



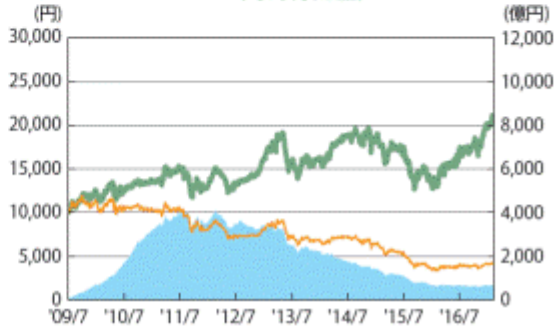
豪ドルコース(毎月分配型)



ニュージーランドドルコース(毎月分配型)



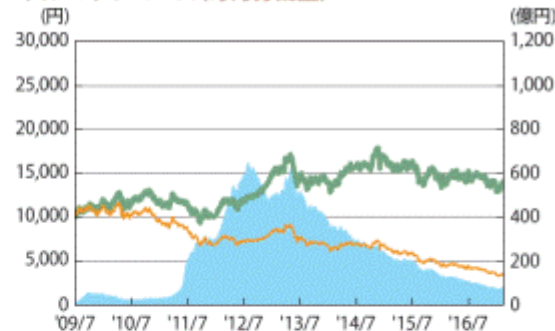
ブラジルリアルコース(毎月分配型)



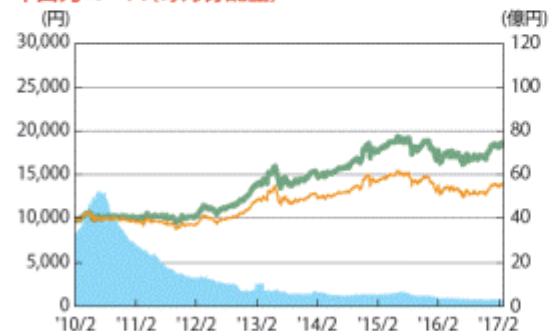
南アフリカランドコース(毎月分配型)



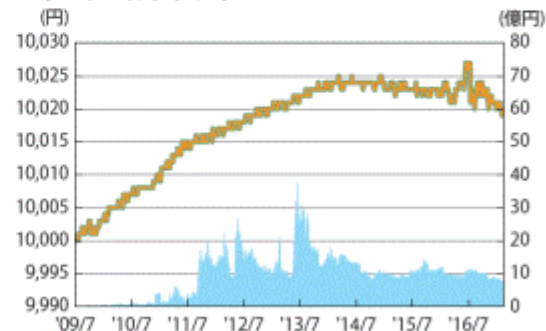
トルコリラコース(毎月分配型)



中国元コース(毎月分配型)



マネーブルファンド



■ 純資産総額:右目盛 ■ 基準価額:左目盛 ■ 分配金再投資基準価額:左目盛

*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したもとして計算しております。

分配の推移

	円 コース (毎月分配型)	豪ドル コース (毎月分配型)	ニュージーランド ドル コース (毎月分配型)	ブラジルレアル コース (毎月分配型)	南アフリカランド コース (毎月分配型)	トルコリラ コース (毎月分配型)	中国元 コース (毎月分配型)		マネー プール ファンド
2017年2月	80円	100円	110円	80円	70円	80円	40円	2017年1月	0円
2017年1月	80円	100円	110円	80円	70円	80円	40円	2016年7月	0円
2016年12月	80円	100円	110円	80円	70円	80円	40円	2016年1月	0円
2016年11月	80円	100円	110円	80円	70円	80円	40円	2015年7月	0円
2016年10月	80円	100円	110円	80円	70円	80円	40円	2015年1月	0円
直近1年間累計	960円	1,200円	1,320円	960円	840円	960円	480円	設定来累計	0円
設定来累計	7,045円	12,870円	10,480円	11,610円	10,370円	9,770円	3,360円		

*分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

円コース(毎月分配型)

投資銘柄	投資比率
TRP Global Emerging Markets Bond Fund JPY Class	98.2%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	1.0%

ニュージーランドドルコース(毎月分配型)

投資銘柄	投資比率
TRP Global Emerging Markets Bond Fund NZD Class	95.8%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.8%

南アフリカランドコース(毎月分配型)

投資銘柄	投資比率
TRP Global Emerging Markets Bond Fund ZAR Class	97.2%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	1.0%

中国元コース(毎月分配型)

投資銘柄	投資比率
TRP Global Emerging Markets Bond Fund CNY Class	98.1%
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	0.7%

*投資比率は全て純資産総額対比

■参考情報(上位10銘柄)

グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド

	投資銘柄	国名	種別	クーポン	償還日	投資比率
1	SERBIA	セルビア	国債証券	7.250%	2021/9/28	4.8%
2	KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB	カザフスタン	社債券	7.000%	2020/5/5	4.5%
3	DOMINICAN REPUBLIC	ドミニカ共和国	国債証券	7.500%	2021/5/6	2.8%
4	TURKEY	トルコ	国債証券	6.250%	2022/9/26	2.4%
5	BRAZIL	ブラジル	国債証券	4.250%	2025/1/7	2.2%
6	KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB	カザフスタン	社債券	9.125%	2018/7/2	1.9%
7	SRI LANKA	スリランカ	国債証券	6.250%	2021/7/27	1.9%
8	UKRAINE	ウクライナ	国債証券	7.750%	2021/9/1	1.8%
9	PETROLEOS MEXICANOS	メキシコ	社債券	6.500%	2041/6/2	1.7%
10	US TREASURY N/B	米国	国債証券	0.875%	2017/11/15	1.7%

*投資比率はグローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンドの純資産総額対比

*上位10銘柄は、2017年2月末現在(現地)

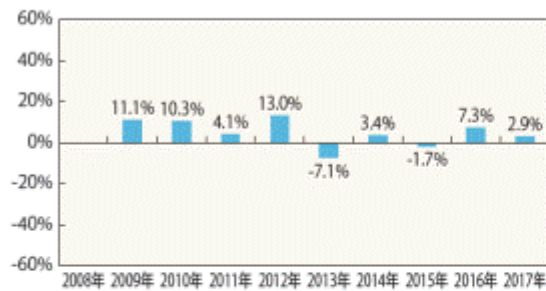
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

	投資銘柄	種別	投資比率
1	873 政保公営企業	特殊債券	12.1%
2	30 政保道路機構	特殊債券	11.9%
3	49 政保道路機構	特殊債券	9.0%
4	37 政保道路機構	特殊債券	7.1%
5	21 政保政策投資B	特殊債券	3.2%
6	16 沖縄電力	社債券	2.4%
7	30 東海旅客鉄道	社債券	2.4%
8	33 クレディセゾン	社債券	2.4%
9	32 野村ホールディング	社債券	2.4%
10	62 住友金属工業	社債券	2.4%

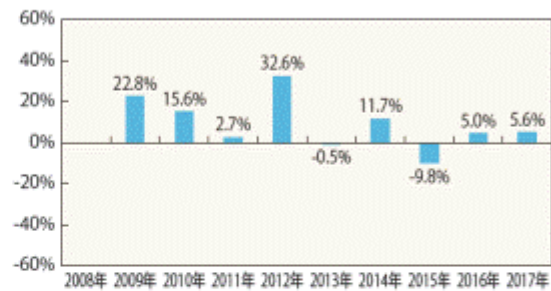
*投資比率はキャッシュ・マネジメント・マザーファンドの純資産総額対比

年間収益率の推移

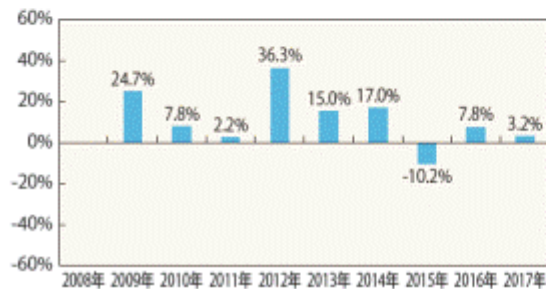
円コース(毎月分配型)



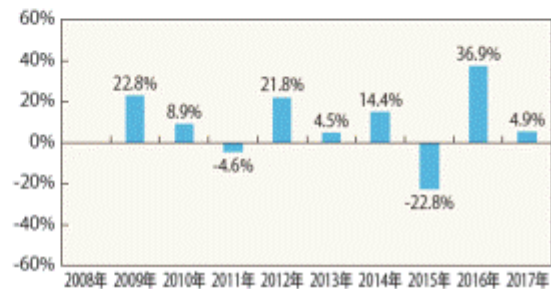
豪ドルコース(毎月分配型)



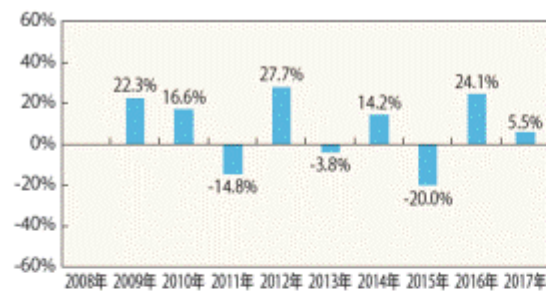
ニュージーランドドルコース(毎月分配型)



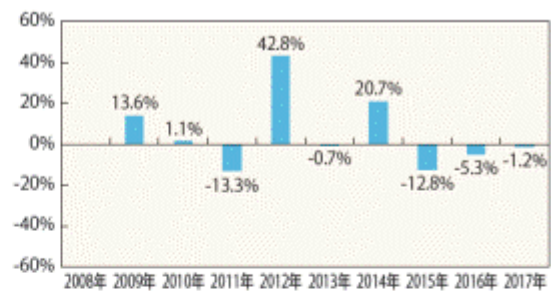
ブラジルリアルコース(毎月分配型)



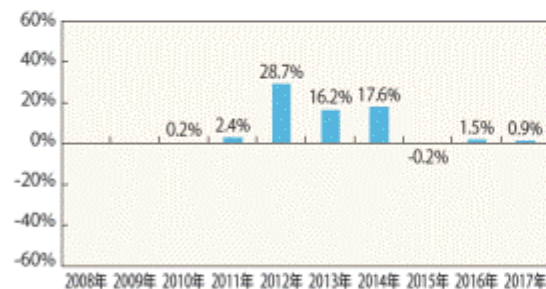
南アフリカランドコース(毎月分配型)



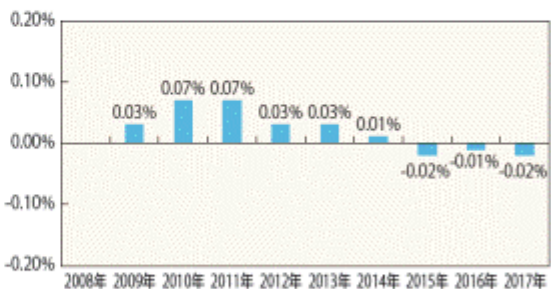
トルコリラコース(毎月分配型)



中国元コース(毎月分配型)



マネープールファンド



*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、各ファンド(中国元コース(毎月分配型)を除く)の2009年は当初設定日(2009年7月17日)から年末までの収益率、中国元コース(毎月分配型)の2010年は当初設定日(2010年2月1日)から年末までの収益率です。また、各ファンドの2017年は2月末までの収益率です。

*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして計算しております。

*ファンドには、ベンチマークはありません。

・ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ・ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

[前へ](#)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）
エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）

- 1．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
- 2．当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成28年7月20日から平成29年1月16日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

エマージング・ボンド・ファンド（マネープールファンド）

- 1．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
- 2．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（平成28年7月20日から平成29年1月16日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

1 財務諸表

エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	397,910,708	370,335,095
投資信託受益証券	15,395,467,895	12,988,892,122
親投資信託受益証券	153,816,788	128,780,902
未収入金	12,460,140	6,498,925
流動資産合計	15,959,655,531	13,494,507,044
資産合計	15,959,655,531	13,494,507,044
負債の部		
流動負債		
未払金	-	52,086,401
未払収益分配金	166,508,260	150,793,375
未払解約金	51,369,777	14,833,115
未払受託者報酬	465,780	364,810
未払委託者報酬	22,513,029	17,633,054
その他未払費用	427,477	394,491
流動負債合計	241,284,323	236,105,246
負債合計	241,284,323	236,105,246
純資産の部		
元本等		
元本	20,813,532,563	18,849,171,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,095,161,355	5,590,770,201
（分配準備積立金）	550,835,966	689,968,169
元本等合計	15,718,371,208	13,258,401,798
純資産合計	15,718,371,208	13,258,401,798
負債純資産合計	15,959,655,531	13,494,507,044

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	1,411,059,853	1,288,287,001
受取利息	9,583	955
有価証券売買等損益	588,571,848	1,248,539,060
営業収益合計	1,999,641,284	39,748,896
営業費用		

支払利息	39,353	67,061
受託者報酬	2,652,549	2,339,079
委託者報酬	128,208,739	113,057,891
その他費用	427,643	394,534
営業費用合計	131,328,284	115,858,565
営業利益又は営業損失()	1,868,313,000	76,109,669
経常利益又は経常損失()	1,868,313,000	76,109,669
当期純利益又は当期純損失()	1,868,313,000	76,109,669
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	22,610,781	1,468,851
期首剰余金又は期首欠損金()	6,497,330,221	5,095,161,355
剰余金増加額又は欠損金減少額	867,208,337	887,841,166
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	867,208,337	887,841,166
剰余金減少額又は欠損金増加額	261,271,684	365,259,539
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	261,271,684	365,259,539
分配金	1,049,470,006	943,549,655
期末剰余金又は期末欠損金()	5,095,161,355	5,590,770,201

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	23,068,926,050円	20,813,532,563円
期中追加設定元本額	1,009,970,294円	1,391,295,879円
期中一部解約元本額	3,265,363,781円	3,355,656,443円
2. 受益権の総数	20,813,532,563口	18,849,171,999口
3. 元本の欠損	5,095,161,355円	5,590,770,201円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																
<p>分配金の計算過程</p> <p>第77期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,850,961,934円（1万口当たり819.10円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1180,780,682円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>219,729,423円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>1,289,598,797円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>341,633,714円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>1,850,961,934円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（819.10円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>180,780,682円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（80円）</td> </tr> </table> <p>第78期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,890,802,969円（1万口当たり842.21円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1179,603,364円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>231,345,915円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>1,284,156,871円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>375,300,183円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	219,729,423円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,289,598,797円	分配準備積立金	341,633,714円	分配可能額	1,850,961,934円	（1万口当たり分配可能額）	（819.10円）	収益分配金	180,780,682円	（1万口当たり収益分配金）	（80円）	配当等収益 （費用控除後）	231,345,915円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	1,284,156,871円	分配準備積立金	375,300,183円	<p>分配金の計算過程</p> <p>第83期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,961,961,880円（1万口当たり946.35円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1165,854,396円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>210,483,020円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>1,213,574,289円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>537,904,571円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>1,961,961,880円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（946.35円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>165,854,396円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（80円）</td> </tr> </table> <p>第84期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,949,791,332円（1万口当たり964.95円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1161,649,143円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>198,325,081円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>1,188,503,712円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>562,962,539円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	210,483,020円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	1,213,574,289円	分配準備積立金	537,904,571円	分配可能額	1,961,961,880円	（1万口当たり分配可能額）	（946.35円）	収益分配金	165,854,396円	（1万口当たり収益分配金）	（80円）	配当等収益 （費用控除後）	198,325,081円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,188,503,712円	分配準備積立金	562,962,539円
配当等収益 （費用控除後）	219,729,423円																																																
有価証券売買等損益	0円																																																
収益調整金	1,289,598,797円																																																
分配準備積立金	341,633,714円																																																
分配可能額	1,850,961,934円																																																
（1万口当たり分配可能額）	（819.10円）																																																
収益分配金	180,780,682円																																																
（1万口当たり収益分配金）	（80円）																																																
配当等収益 （費用控除後）	231,345,915円																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																
収益調整金	1,284,156,871円																																																
分配準備積立金	375,300,183円																																																
配当等収益 （費用控除後）	210,483,020円																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																
収益調整金	1,213,574,289円																																																
分配準備積立金	537,904,571円																																																
分配可能額	1,961,961,880円																																																
（1万口当たり分配可能額）	（946.35円）																																																
収益分配金	165,854,396円																																																
（1万口当たり収益分配金）	（80円）																																																
配当等収益 （費用控除後）	198,325,081円																																																
有価証券売買等損益	0円																																																
収益調整金	1,188,503,712円																																																
分配準備積立金	562,962,539円																																																

分配可能額	1,890,802,969円
（1万口当たり分配可能額）	(842.21円)
収益分配金	179,603,364円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第79期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した1,905,736,800円（1万口当たり864.57円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い176,340,220円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	225,191,708円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,262,809,456円
分配準備積立金	417,735,636円
分配可能額	1,905,736,800円
（1万口当たり分配可能額）	(864.57円)
収益分配金	176,340,220円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第80期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,933,219,203円（1万口当たり882.97円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い175,156,317円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	214,874,091円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,258,434,230円
分配準備積立金	459,910,882円
分配可能額	1,933,219,203円
（1万口当たり分配可能額）	(882.97円)
収益分配金	175,156,317円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第81期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,926,796,550円（1万口当たり901.00円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い171,081,163円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	208,778,349円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,234,682,732円
分配準備積立金	483,335,469円
分配可能額	1,926,796,550円
（1万口当たり分配可能額）	(901.00円)
収益分配金	171,081,163円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第82期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,924,402,522円（1万口当たり924.59円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い166,508,260円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	214,968,478円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,207,058,296円
分配準備積立金	502,375,748円
分配可能額	1,924,402,522円
（1万口当たり分配可能額）	(924.59円)
収益分配金	166,508,260円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

分配可能額	1,949,791,332円
（1万口当たり分配可能額）	(964.95円)
収益分配金	161,649,143円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第85期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した1,952,416,073円（1万口当たり983.80円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い158,765,198円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	195,606,750円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,172,142,473円
分配準備積立金	584,666,850円
分配可能額	1,952,416,073円
（1万口当たり分配可能額）	(983.80円)
収益分配金	158,765,198円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第86期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,938,273,329円（1万口当たり1,003.29円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い154,553,126円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	191,668,627円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,147,424,603円
分配準備積立金	599,180,099円
分配可能額	1,938,273,329円
（1万口当たり分配可能額）	(1,003.29円)
収益分配金	154,553,126円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第87期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,944,318,042円（1万口当たり1,023.77円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い151,934,417円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	190,248,909円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	1,134,944,699円
分配準備積立金	619,124,434円
分配可能額	1,944,318,042円
（1万口当たり分配可能額）	(1,023.77円)
収益分配金	151,934,417円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

第88期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,974,522,305円（1万口当たり1,047.54円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い150,793,375円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	194,988,896円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,133,760,761円
分配準備積立金	645,772,648円
分配可能額	1,974,522,305円
（1万口当たり分配可能額）	(1,047.54円)
収益分配金	150,793,375円
（1万口当たり収益分配金）	(80円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成28年 7月20日 至 平成29年 1月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成29年 1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成28年 7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	30,197
投資信託受益証券	291,763,111
合計	291,793,308

当期（平成29年 1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	21
投資信託受益証券	122,306,754
合計	122,306,775

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年 7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年 1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自 平成28年 7月20日 至 平成29年 1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成28年 7月19日現在	当期 平成29年 1月16日現在
1口当たり純資産額 0.7552円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,552円）」	1口当たり純資産額 0.7034円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,034円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund JPY Class	18,849,067,077	12,988,892,122	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	126,491,408	128,780,902	
合計		2銘柄	18,975,558,485	13,117,673,024	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成28年7月19日現在 金額（円）	平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	732,964,579	1,664,839,890
地方債証券	300,001,668	188,365,119
特殊債券	2,406,181,300	1,603,041,000
社債券	1,306,787,900	1,401,188,174
未収利息	12,126,630	12,102,882
前払費用	3,708,905	102,212
流動資産合計	4,761,770,982	4,869,639,277
資産合計	4,761,770,982	4,869,639,277
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,425,000
未払解約金	15,819,108	22,282,289
流動負債合計	15,819,108	122,707,289
負債合計	15,819,108	122,707,289
純資産の部		
元本等		
元本	4,659,260,245	4,662,482,041
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	86,691,629	84,449,947
元本等合計	4,745,951,874	4,746,931,988
純資産合計	4,745,951,874	4,746,931,988
負債純資産合計	4,761,770,982	4,869,639,277

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成28年 7月20日 至 平成29年 1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年 7月19日現在	平成29年 1月16日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	4,900,743,869円	4,659,260,245円
期中追加設定元本額	1,646,806,186円	3,134,069,539円
期中一部解約元本額	1,888,289,810円	3,130,847,743円
元本の内訳		
S M B C ファンドラップ・ヘッジファンド	117,976,896円	152,081,338円
S M B C ファンドラップ・欧州株	72,310,490円	78,044,081円
S M B C ファンドラップ・新興国株	42,541,917円	46,622,559円
S M B C ファンドラップ・コモディティ	14,731,860円	15,756,425円
S M B C ファンドラップ・米国債	71,735,078円	79,939,217円
S M B C ファンドラップ・欧州債	59,201,968円	65,243,027円
S M B C ファンドラップ・新興国債	29,643,703円	31,368,290円
S M B C ファンドラップ・日本グロース株	97,699,244円	105,027,628円
S M B C ファンドラップ・日本中小型株	31,780,064円	35,383,568円
S M B C ファンドラップ・日本債	410,918,591円	506,892,459円
D C 日本国債プラス	668,054,652円	501,032,788円
エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）	151,008,039円	126,491,408円
エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）	471,869,212円	393,594,452円
エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）	13,240,537円	12,301,140円
エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）	566,620,118円	457,242,305円
エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）	14,700,624円	14,166,116円
エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）	99,385,338円	74,317,538円
エマージング・ボンド・ファンド（マネープールファンド）	1,030,179,745円	803,769,283円
大和住銀 中国株式ファンド（マネー・ポートフォリオ）	460,629,853円	932,238,991円
エマージング好配当株オープン マネー・ポートフォリオ	1,681,159円	2,064,944円
エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）	2,540,680円	2,160,101円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（円コース）	1,252,431円	1,803,049円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（中国・インド・インドネシア通貨コース）	3,298,867円	1,508,367円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（BRICs通貨コース）	2,897,369円	1,772,576円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（世界6地域通貨コース）	9,415,452円	12,164,702円
米国短期社債戦略ファンド2015-12（為替ヘッジあり）	245,556円	245,556円
米国短期社債戦略ファンド2015-12（為替ヘッジなし）	245,556円	245,556円
グローバル・ハイイールド債券ファンド（マネープールファンド）	38,165,887円	38,164,808円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・アジア3通貨コース	30,477,968円	28,874,243円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・円コース	2,792,507円	2,615,203円
アジア・ハイ・インカム・ファンド（マネープールファンド）	2,895,264円	2,885,439円
日本株厳選ファンド・円コース	270,889円	270,889円
日本株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	18,658,181円	18,658,181円
日本株厳選ファンド・豪ドルコース	679,887円	679,887円
日本株厳選ファンド・アジア3通貨コース	9,783円	9,783円
株式&通貨 資源ダブルフォーカス（毎月分配型）	9,512,243円	9,512,243円
日本株 2 2 5 ・米ドルコース	49,237円	49,237円
日本株 2 2 5 ・ブラジルリアルコース	393,895円	393,895円

日本株225・豪ドルコース	147,711円	147,711円
日本株225・資源3通貨コース	49,237円	49,237円
グローバルCBオープン・高金利通貨コース	598,533円	598,533円
グローバルCBオープン・円コース	827,757円	827,757円
グローバルCBオープン（マネーボールファンド）	19,811,227円	15,459,424円
オーストラリア高配当株プレミアム（毎月分配型）	1,057,457円	1,057,457円
スマート・ストラテジー・ファンド（毎月決算型）	12,541,581円	12,541,581円
スマート・ストラテジー・ファンド（年2回決算型）	4,566,053円	4,566,053円
ボンド・アンド・カレンシー トータルリターン・ファンド（毎月決算型）	14,309円	14,309円
ボンド・アンド・カレンシー トータルリターン・ファンド（年2回決算型）	12,837円	12,837円
カナダ高配当株ツイン（毎月分配型）	66,417,109円	66,417,109円
日本株厳選ファンド・米ドルコース	196,696円	196,696円
日本株厳選ファンド・メキシコペソコース	196,696円	196,696円
日本株厳選ファンド・トルコリラコース	196,696円	196,696円
エマージング・ボンド・ファンド・カナダドルコース（毎月分配型）	585,298円	1,862,530円
エマージング・ボンド・ファンド・メキシコペソコース（毎月分配型）	1,571,810円	1,987,645円
カナダ高配当株ファンド	984円	984円
短期米ドル社債オープン＜為替ヘッジなし＞（毎月分配型）	98,290円	98,290円
短期米ドル社債ファンド2015-06（為替ヘッジあり）	98,242円	98,242円
短期米ドル社債ファンド2015-06（為替ヘッジなし）	98,242円	98,242円
短期米ドル社債オープン＜為替ヘッジあり＞（毎月分配型）	98,242円	98,242円
米国短期社債戦略ファンド2015-10（為替ヘッジあり）	149,304円	149,304円
米国短期社債戦略ファンド2015-10（為替ヘッジなし）	215,194円	215,194円
合計	4,659,260,245円	4,662,482,041円
2. 受益権の総数	4,659,260,245口	4,662,482,041口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成28年7月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
地方債証券	3,080,152

特殊債券	6,676,700
社債券	2,506,100
合計	12,262,952

「計算期間」とは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年7月28日から平成28年7月19日まで）を指しております。

（平成29年1月16日現在）

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
地方債証券	1,761,031
特殊債券	12,001,000
社債券	4,681,626
合計	18,443,657

「計算期間」とは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年7月26日から平成29年1月16日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1口当たり純資産額 1.0186円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,186円）」	1口当たり純資産額 1.0181円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,181円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
円	地方債証券	18-2 広島県公債	3,000,000	3,001,974	
	地方債証券	18-7 埼玉県公債	100,000,000	100,205,300	
	地方債証券	47 共同発行地方	85,000,000	85,157,845	
	特殊債券	16 政保政策投資B	200,000,000	200,411,200	
	特殊債券	25 政保道路機構	200,000,000	200,133,200	
	特殊債券	30 政保道路機構	300,000,000	301,035,900	
	特殊債券	156 政保道路機構	400,000,000	400,033,200	
	特殊債券	873 政保公営企業	500,000,000	501,427,500	
	社債券	1 コカ・コーライースト	100,000,000	100,118,000	
	社債券	62 住友金属工業	100,000,000	100,383,700	
	社債券	22 日新製鋼	100,000,000	100,037,800	
	社債券	39 日本精工	100,000,000	100,203,900	
	社債券	27 日産フィナンシャル	100,000,000	100,049,200	
	社債券	18 ホンダファイナンス	100,000,000	100,076,200	
	社債券	157 オリックス	98,000,000	98,158,074	
	社債券	4 三井住友F&L	100,000,000	100,046,400	
	社債券	32 野村ホールディング	100,000,000	100,422,300	
	社債券	65 小田急電鉄	100,000,000	100,098,300	
	社債券	30 東海旅客鉄道	100,000,000	100,614,700	
	社債券	33 日本郵船	100,000,000	100,157,100	
社債券	425 九州電力	100,000,000	100,018,500		
社債券	16 沖縄電力	100,000,000	100,804,000		
	合計	22銘柄	3,186,000,000	3,192,594,293	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund JPY Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

この投資信託は、2016年3月31日に計算期間が終了し、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地において独立監査人による財務諸表の監査を受けております。

以下の「貸借対照表」、「損益計算書」、「純資産変動計算書」及び「有価証券明細表」等は、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund」の2016年3月31日現在の財務諸表の原文を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

貸借対照表

2016年3月31日現在

(単位：円)

資産の部

有価証券（公正価値）（取得原価 131,142,565,215円）	141,203,830,601
外貨建現金（公正価値）（取得原価 1,223,722円）	1,223,708
外国為替予約取引に係る評価益	14,317,560,153
スワップ契約に係る評価益	5,721,524
スワップ契約に係る前受プレミアム	730,083,174
未収金：	
有価証券売却分	1,322,069,033
受益証券発行分	10,953,597
未収利息	2,112,876,893
その他資産	1,539,920
資産 合計	159,705,858,603

負債の部

外国為替予約取引に係る評価損	1,482,368,872
スワップ契約に係る評価損	590,346,317
スワップ契約に係る前払プレミアム	33,771,760
分配金	179
未払金：	
有価証券購入分	5,314,337,815
受益証券買戻分	289,633,400
管理会社報酬	25,763,746
カストディーフィー	12,833,330
専門家報酬	8,707,967
名義書換代理人報酬	5,168,403
負債 合計	7,762,931,789

純資産

151,942,926,814

Class A-JPY Class	16,291,607,655
Class B-AUD Class	50,002,083,402
Class C-NZD Class	1,612,495,817
Class D-BRL Class	67,730,503,442
Class E-ZAR Class	1,214,883,710
Class F-TRY Class	12,636,612,337
Class G-USD Class	1,854,052,894
Class H-CNY Class	366,927,177
Class I-CAD Class	50,662,887
Class J-MXN Class	183,097,493
	151,942,926,814

発行済み受益証券

Class A-JPY Class	21,634,422,078
Class B-AUD Class	78,585,001,258
Class C-NZD Class	2,294,190,438
Class D-BRL Class	162,667,368,599
Class E-ZAR Class	2,616,634,868
Class F-TRY Class	26,453,351,340
Class G-USD Class	252,274
Class H-CNY Class	371,493,558
Class I-CAD Class	71,153,660
Class J-MXN Class	267,495,831

受益証券一口当たりの純資産

Class A-JPY Class	0.7530
Class B-AUD Class	0.6363
Class C-NZD Class	0.7029
Class D-BRL Class	0.4164
Class E-ZAR Class	0.4643
Class F-TRY Class	0.4777
Class G-USD Class	7,349.3554
Class H-CNY Class	0.9877
Class I-CAD Class	0.7120
Class J-MXN Class	0.6845

損益計算書 (2016年3月31日に終了した年度)**収 益**

受取利息(源泉税 31,060円控除後)	12,437,351,789
収益 合計	12,437,351,789

費 用

管理会社報酬	126,303,159
カストディーフィー	72,221,871
名義書換代理人報酬	25,279,315
専門家報酬	9,034,142
受託会社報酬	1,313,256
ファンド設立費用	1,107,639
費用合計	235,259,382

純利益	12,202,092,407
------------	-----------------------

実現及び未実現(損)益:**実現(損)益:**

有価証券	19,828,514,890
スワップ契約	438,981,439
外国為替取引及び外国為替予約取引	(35,354,648,677)
実現(損)益 合計	(15,087,152,348)

未実現(損)益の変動:

有価証券	(37,578,267,101)
スワップ契約	207,518,685
外国為替取引及び外国為替予約取引	34,226,795,492
未実現(損)益の変動 合計	(3,143,952,924)

実現及び未実現(損)益 合計	(18,231,105,272)
-----------------------	-------------------------

運用による純資産の増加(減少)額 合計	(6,029,012,865)
----------------------------	------------------------

純資産変動計算書(2016年3月31日に終了した年度)**運用による純資産の増減額:**

純利益	12,202,092,407
実現(損)益	(15,087,152,348)
未実現(損)益の変動	(3,143,952,924)
運用による純資産の増加(減少)額 合計	(6,029,012,865)

受益者への分配金	(44,755,794,515)
ファンドの受益証券の取引による純資産の増加(減少)額	(41,316,465,140)
純資産の増加(減少)額	(92,101,272,520)

純資産

期首	244,044,199,334
期末	151,942,926,814

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表（2016年3月31日現在）

	額面	銘柄	公正価値
			(単位：円)
		確定利付証券 (87.1%)	
		アンゴラ (0.4%)	
		国債 (0.4%)	
		Angolan Government International Bond	
USD	6,155,000	9.50% due 11/12/25	632,124,221
		国債 計	632,124,221
		アンゴラ 計 (取得原価632,813,660円)	632,124,221
		アルゼンチン (7.5%)	
		社債券 (0.2%)	
		Banco Hipotecario S.A.	
USD	3,300,000	9.75% due 11/30/20	395,939,479
		社債券 計	395,939,479
		国債 (7.3%)	
		Argentina Bonar Bond	
USD	67,080,000	7.00% due 04/17/17	7,867,422,822
USD	9,500,000	8.75% due 05/07/24	1,157,977,566
		Argentine Republic Government International Bond	
USD	6,000,000	2.50% due 12/31/38	452,165,077
USD	7,753,270	8.28% due 12/31/33	1,045,714,538
USD	4,000,000	8.75% due 06/02/17	533,876,240
		国債 計	11,057,156,243

		アルゼンチン 計 (取得原価10,523,555,974円)	11,453,095,722
			<hr/>
		バハマ (0.7%)	
		国債 (0.7%)	
		Bahamas Government International Bond	
USD	8,700,000	7.13% due 04/02/38	1,069,508,653
		国債 計	1,069,508,653
			<hr/>
		バハマ 計 (取得原価720,753,779円)	1,069,508,653
			<hr/>
		バミューダ (0.5%)	
		国債 (0.5%)	
		Bermuda Government International Bond	
USD	6,950,000	4.85% due 02/06/24	823,170,850
		国債 計	823,170,850
			<hr/>
		バミューダ 計 (取得原価674,769,215円)	823,170,850
			<hr/>
		ブラジル (5.0%)	
		社債券 (1.1%)	
		BR Properties S.A.	
USD	4,728,000	9.00% ^{(a)(b)}	442,924,859
		Marfrig Overseas, Ltd.	
USD	1,850,000	9.50% due 05/04/20 ^(a)	211,049,707
		Minerva Luxembourg S.A.	
USD	1,300,000	7.75% due 01/31/23 ^(a)	148,122,558
		Votorantim Cimentos S.A.	
USD	8,950,000	7.25% due 04/05/41	824,866,890

	社債券 計		1,626,964,014
--	--------------	--	----------------------

国債 (3.9%)

Brazilian Government International Bond

USD	34,630,000	4.25% due 01/07/25	3,575,994,380
USD	16,850,000	5.00% due 01/27/45	1,524,553,852
USD	7,500,000	6.00% due 04/07/26	857,714,328

	国債 計		5,958,262,560
--	-------------	--	----------------------

	ブラジル 計 (取得原価7,771,184,207円)		7,585,226,574
--	------------------------------------	--	----------------------

チリ (1.3%)**社債券 (1.3%)**

Corp. Nacional del Cobre de Chile

USD	12,000,000	4.50% due 09/16/25	1,378,315,146
-----	------------	--------------------	---------------

<u>額面</u>	<u>銘柄</u>		<u>公正価値</u>
-----------	-----------	--	-------------

		確定利付証券 (87.1%) (続き)	(単位：円)
--	--	----------------------------	--------

		チリ (1.3%) (続き)	
--	--	-----------------------	--

		社債券 (1.3%) (続き)	
--	--	------------------------	--

Corp. Nacional del Cobre de Chile

USD	4,800,000	6.15% due 10/24/36	595,611,666
-----	-----------	--------------------	-------------

	社債券 計		1,973,926,812
--	--------------	--	----------------------

	チリ 計 (取得原価1,938,224,267円)		1,973,926,812
--	----------------------------------	--	----------------------

中国 (1.1%)**社債券 (1.1%)**

		Agile Property Holdings, Ltd.	
USD	2,000,000	9.88% due 03/20/17	234,907,794
		CIFI Holdings Group Co., Ltd.	
USD	4,300,000	8.88% due 01/27/19 (a)	524,296,219
		KWG Property Holding, Ltd.	
USD	1,900,000	13.25% due 03/22/17	231,702,288
		Longfor Properties Co., Ltd.	
USD	2,950,000	6.75% due 01/29/23 (a)	351,456,506
		West China Cement, Ltd.	
USD	2,900,000	6.50% due 09/11/19 (a)	343,169,106
		社債券 計	1,685,531,913
			<hr/>
		中国 計 (取得原価1,558,451,036円)	1,685,531,913
			<hr/>
		コロンビア (1.6%)	
		国債 (1.6%)	
		Colombia Government International Bond	
USD	1,705,000	5.00% due 06/15/45 (a)	179,177,296
USD	4,050,000	5.63% due 02/26/44 (a)	455,199,742
USD	14,550,000	6.13% due 01/18/41	1,725,291,318
		国債 計	2,359,668,356
			<hr/>
		コロンビア 計 (取得原価2,219,624,963円)	2,359,668,356
			<hr/>
		クロアチア (2.5%)	
		国債 (2.5%)	
		Croatia Government International Bond	
USD	3,350,000	5.50% due 04/04/23	398,215,500

USD	13,890,000	6.00% due 01/26/24	1,703,911,783
USD	2,060,000	6.38% due 03/24/21	253,427,985
USD	9,320,000	6.63% due 07/14/20	1,152,834,991
USD	2,270,000	6.75% due 11/05/19	280,444,925
国債 計			3,788,835,184
クロアチア 計 (取得原価3,997,546,510円)			3,788,835,184
ドミニカ共和国 (3.3%)			
国債 (3.3%)			
Dominican Republic International Bond			
USD	13,805,000	6.85% due 01/27/45	1,543,854,883
USD	26,900,000	7.50% due 05/06/21	3,303,092,300
USD	1,130,138	9.04% due 01/23/18	134,960,738
国債 計			4,981,907,921
ドミニカ共和国 計 (取得原価4,013,690,806円)			4,981,907,921
エルサルバドル (1.2%)			
国債 (1.2%)			
El Salvador Government International Bond			
USD	11,305,000	6.38% due 01/18/27 (c)	1,105,444,144
USD	6,625,000	7.65% due 06/15/35	655,262,838
国債 計			1,760,706,982
エルサルバドル 計 (取得原価2,118,769,737円)			1,760,706,982

	額面	銘柄	公正価値
		確定利付証券 (87.1%) (続き)	(単位: 円)
		ガボン (0.5%)	
		国債 (0.5%)	
		Gabonese Republic	
USD	7,700,000	6.38% due 12/12/24	722,643,640
		国債 計	722,643,640
		ガボン 計 (取得原価837,533,590円)	722,643,640
		グレナダ (0.2%)	
		国債 (0.2%)	
		Grenada Government International Bond	
USD	4,197,400	5.31% due 05/12/30	261,830,554
		国債 計	261,830,554
		グレナダ 計 (取得原価272,281,566円)	261,830,554
		香港 (0.4%)	
		社債券 (0.4%)	
		PCCW-HKT Capital No 5, Ltd.	
USD	2,250,000	3.75% due 03/08/23	262,967,879
		Shimao Property Holdings, Ltd.	
USD	2,600,000	8.13% due 01/22/21 (a)	319,296,566
USD	200,000	8.38% due 02/10/22	24,641,367
		社債券 計	606,905,812

香港 計（取得原価502,374,783円）

606,905,812

ハンガリー（2.3%）

国債（2.3%）

Hungary Government International Bond

USD	19,500,000	6.38% due 03/29/21	2,493,521,807
-----	------------	--------------------	---------------

USD	6,062,000	7.63% due 03/29/41	967,432,505
-----	-----------	--------------------	-------------

国債 計

3,460,954,312

ハンガリー 計（取得原価3,184,616,251円）

3,460,954,312

インド（1.0%）

社債券（1.0%）

Export-Import Bank of India

USD	2,294,000	4.00% due 01/14/23	268,956,832
-----	-----------	--------------------	-------------

GCX, Ltd.

USD	2,235,000	7.00% due 08/01/19 ^(a)	236,205,259
-----	-----------	-----------------------------------	-------------

NTPC, Ltd.

USD	8,090,000	4.38% due 11/26/24	954,279,217
-----	-----------	--------------------	-------------

社債券 計

1,459,441,308

インド 計（取得原価1,420,605,840円）

1,459,441,308

インドネシア（4.1%）

社債券（1.7%）

Majapahit Holding BV

USD	7,500,000	7.88% due 06/29/37	995,252,088
-----	-----------	--------------------	-------------

Pertamina Persero PT

USD	3,300,000	5.63% due 05/20/43	328,522,948
-----	-----------	--------------------	-------------

USD	12,322,000	6.00% due 05/03/42	1,271,107,828
社債券 計			2,594,882,864
国債 (2.4%)			
Indonesia Government International Bond			
USD	11,700,000	3.75% due 04/25/22	1,330,559,770
USD	2,900,000	4.63% due 04/15/43	308,221,556
USD	17,350,000	5.25% due 01/17/42	1,966,889,975
国債 計			3,605,671,301
インドネシア 計 (取得原価4,926,183,033円)			6,200,554,165

<u>額面</u>	<u>銘柄</u>	<u>公正価値</u>
-----------	-----------	-------------

確定利付証券 (87.1%) (続き)

(単位：円)

アイルランド (0.5%)

社債券 (0.5%)

Vnesheconombank Via VEB Finance PLC

USD	1,800,000	6.80% due 11/22/25	203,879,109
USD	5,250,000	6.90% due 07/09/20	610,720,420

社債券 計	814,599,529
--------------	--------------------

アイルランド 計 (取得原価846,341,954円)	814,599,529
------------------------------------	--------------------

イスラエル (1.7%)

社債券 (1.7%)

Israel Electric Corp., Ltd.

USD	8,915,000	6.88% due 06/21/23	1,185,273,477
USD	5,000,000	7.25% due 01/15/19	623,918,121
USD	5,750,000	7.75% due 12/15/27	772,294,130
社債券 計			2,581,485,728
イスラエル 計（取得原価1,848,046,513円）			2,581,485,728
アイボリーコースト（2.0%）			
国債（2.0%）			
Ivory Coast Government International Bond			
USD	24,490,000	5.38% due 07/23/24	2,539,230,605
USD	4,399,000	6.38% due 03/03/28	469,704,316
国債 計			3,008,934,921
アイボリーコースト 計（取得原価3,353,837,394円）			3,008,934,921
ジャマイカ（4.1%）			
社債券（0.1%）			
Digicel, Ltd.			
USD	1,400,000	6.00% due 04/15/21 ^(a)	141,617,697
社債券 計			141,617,697
国債（4.0%）			
Jamaica Government International Bond			
USD	9,233,000	6.75% due 04/28/28	1,066,280,949
USD	9,995,000	7.63% due 07/09/25	1,249,769,156
USD	3,590,000	7.88% due 07/28/45	410,559,259

USD	26,175,000	8.00% due 06/24/19	3,192,003,894
USD	2,051,000	8.00% due 03/15/39	248,387,607
国債 計			6,167,000,865
ジャマイカ 計 (取得原価5,370,479,834円)			6,308,618,562
カザフスタン (7.1%)			
社債券 (7.1%)			
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV			
USD	14,200,000	6.38% due 10/06/20	1,577,622,948
USD	17,968,000	7.00% due 05/11/16	2,029,893,623
KazMunayGas National Co. JSC			
USD	31,400,000	7.00% due 05/05/20	3,719,779,896
USD	28,138,000	9.13% due 07/02/18	3,460,595,280
社債券 計			10,787,891,747
カザフスタン 計 (取得原価8,328,435,133円)			10,787,891,747
ケニア (0.7%)			
国債 (0.7%)			
Kenya Government International Bond			
USD	9,400,000	6.88% due 06/24/24	1,001,046,050
国債 計			1,001,046,050
ケニア 計 (取得原価1,186,363,642円)			1,001,046,050
ルクセンブルグ (0.6%)			
社債券 (0.6%)			
Cosan Luxembourg S.A.			

USD	1,400,000	5.00% due 03/14/23 (a)	138,454,902
-----	-----------	------------------------	-------------

<u>額面</u>	<u>銘柄</u>	—	<u>公正価値</u>
-----------	-----------	---	-------------

確定利付証券 (87.1%) (続き)	(単位：円)
----------------------------	--------

ルクセンブルグ (0.6%) (続き)

社債券 (0.6%) (続き)

Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.

USD	1,950,000	4.95% due 07/19/22	214,406,800
-----	-----------	--------------------	-------------

USD	4,315,000	7.29% due 08/16/37	529,845,475
-----	-----------	--------------------	-------------

社債券 計	882,707,177
--------------	--------------------

ルクセンブルグ 計 (取得原価898,635,596円)	882,707,177
-------------------------------------	--------------------

メキシコ (5.3%)

社債券 (3.8%)

Alfa SAB de CV

USD	1,465,000	6.88% due 03/25/44 (a)	165,481,965
-----	-----------	------------------------	-------------

Cemex SAB de CV

USD	2,000,000	7.25% due 01/15/21 (a)	234,343,571
-----	-----------	------------------------	-------------

USD	1,300,000	7.75% due 04/16/26 (a)	150,117,007
-----	-----------	------------------------	-------------

Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV

USD	3,500,000	8.13% due 02/08/20 (a)(c)	409,117,793
-----	-----------	---------------------------	-------------

Grupo Televisa SAB

USD	1,380,000	6.13% due 01/31/46 (a)	165,186,929
-----	-----------	------------------------	-------------

Petroleos Mexicanos

USD	7,895,000	5.50% due 06/27/44	741,742,978
USD	3,475,000	5.63% due 01/23/46	329,701,876
USD	600,000	6.38% due 01/23/45	62,851,283
USD	19,490,000	6.50% due 06/02/41	2,073,382,561
USD	13,000,000	6.63% due 06/15/38	1,391,731,063
社債券 計			5,723,657,026
国債 (1.5%)			
Mexico Government International Bond			
USD	19,974,000	5.75% due 10/12/10	2,284,264,799
国債 計			2,284,264,799
メキシコ 計 (取得原価6,775,786,378円)			8,007,921,825
モンゴル (0.2%)			
国債 (0.2%)			
Mongolia Government International Bond			
USD	3,537,000	5.13% due 12/05/22	310,772,196
国債 計			310,772,196
モンゴル 計 (取得原価320,291,166円)			310,772,196
モロッコ (0.8%)			
国債 (0.8%)			
Morocco Government International Bond			
USD	9,960,000	4.25% due 12/11/22	1,146,461,012
国債 計			1,146,461,012
モロッコ 計 (取得原価1,033,621,071円)			1,146,461,012

オランダ (2.9%)**社債券 (2.9%)**

		ICTSI Treasury BV	
USD	510,000	5.88% due 09/17/25	61,592,356
		Lukoil International Finance BV	
USD	3,500,000	4.56% due 04/24/23	377,114,160
		Petrobras Global Finance BV	
USD	3,000,000	2.76% due 01/15/19 (d)	274,839,489
USD	7,800,000	3.00% due 01/15/19	755,632,381
USD	9,720,000	4.88% due 03/17/20	911,892,539
USD	3,070,000	5.63% due 05/20/43	226,009,482
USD	735,000	6.75% due 01/27/41	59,809,874
USD	1,915,000	6.85% due 06/05/15	151,203,586
USD	10,400,000	6.88% due 01/20/40	847,458,285
USD	5,325,000	7.88% due 03/15/19	575,460,985

額面**銘柄****公正価値****確定利付証券 (87.1%) (続き)**

(単位:円)

オランダ (2.9%) (続き)**社債券 (2.9%) (続き)**

		Royal Capital BV	
USD	1,000,000	5.50% (a)(b)(d)	111,873,485

USD	280,000	6.25%	(a)(b)(d)	32,193,448
社債券 計				4,385,080,070
オランダ 計 (取得原価4,784,912,450円)				4,385,080,070
パキスタン (1.5%)				
国債 (1.5%)				
Pakistan Government International Bond				
USD	10,875,000	6.75%	due 12/03/19	1,281,139,358
USD	8,900,000	8.25%	due 04/15/24	1,067,444,654
国債 計				2,348,584,012
パキスタン 計 (取得原価2,437,666,964円)				2,348,584,012
フィリピン (1.0%)				
社債券 (0.5%)				
Alliance Global Group, Inc.				
USD	5,000,000	6.50%	due 08/18/17	592,883,614
SM Investments Corp.				
USD	1,700,000	4.25%	due 10/17/19	198,861,482
社債券 計				791,745,096
国債 (0.5%)				
Philippine Government International Bond				
USD	3,349,000	3.70%	due 03/01/41	398,680,444
USD	2,369,000	6.38%	due 10/23/34	376,431,976
国債 計				775,112,420
フィリピン 計 (取得原価1,231,604,131円)				1,566,857,516

ポーランド (0.6%)**国債 (0.6%)**

Poland Government International Bond

USD	8,825,000	3.25% due 04/06/26	984,436,795
-----	-----------	--------------------	-------------

国債 計**984,436,795****ポーランド 計 (取得原価984,962,318円)****984,436,795****ルーマニア (0.9%)****国債 (0.9%)**

Romanian Government International Bond

USD	10,912,000	4.38% due 08/22/23 ^(c)	1,306,486,488
-----	------------	-----------------------------------	---------------

国債 計**1,306,486,488****ルーマニア 計 (取得原価1,072,816,196円)****1,306,486,488****ロシア (1.3%)****社債券 (0.1%)**

VimpelCom Holdings BV

USD	1,770,000	7.50% due 03/01/22	210,129,473
-----	-----------	--------------------	-------------

社債券 計**210,129,473****国債 (1.2%)**

Russian Foreign Bond - Eurobond

USD	8,600,000	4.50% due 04/04/22	992,904,853
-----	-----------	--------------------	-------------

USD	4,000,000	4.88% due 09/16/23	470,623,483
-----	-----------	--------------------	-------------

USD	2,800,000	5.63% due 04/04/42	319,178,281
-----	-----------	--------------------	-------------

		国債 計	1,782,706,617
		ロシア 計 (取得原価2,066,427,391円)	1,992,836,090
		セルビア (3.7%)	
		国債 (3.7%)	
		Republic of Serbia	
USD	12,332,612	6.75% due 11/01/24 ^(a)	1,436,890,640
		額面	銘柄
			公正価値
		確定利付証券 (87.1%) (続き)	(単位：円)
		セルビア (3.7%) (続き)	
		国債 (3.7%) (続き)	
		Republic of Serbia	
USD	33,830,000	7.25% due 09/28/21	4,258,601,516
		国債 計	5,695,492,156
		セルビア 計 (取得原価4,875,443,995円)	5,695,492,156
		シンガポール (0.5%)	
		社債券 (0.5%)	
		Pratama Agung Pte, Ltd.	
USD	2,100,000	6.25% due 02/24/20 ^(a)	235,820,846
		TBG Global Pte, Ltd.	
USD	4,200,000	5.25% due 02/10/22 ^(a)	458,122,394
		社債券 計	693,943,240
		シンガポール 計 (取得原価749,581,075円)	693,943,240

スロベニア (0.2%)**国債 (0.2%)**

Slovenia Government International Bond

USD	3,000,000	5.25% due 02/18/24	378,473,297
-----	-----------	--------------------	-------------

国債 計

378,473,297**スロベニア 計 (取得原価378,692,205円)**

378,473,297**南アフリカ (3.6%)****社債券 (3.2%)**

Eskom Holdings SOC, Ltd.

USD	30,590,000	5.75% due 01/26/21	3,179,214,305
-----	------------	--------------------	---------------

USD	8,000,000	6.75% due 08/06/23	833,970,885
-----	-----------	--------------------	-------------

USD	7,700,000	7.13% due 02/11/25	803,436,929
-----	-----------	--------------------	-------------

社債券 計

4,816,622,119**国債 (0.4%)**

South Africa Government International Bond

USD	4,910,000	5.88% due 09/16/25	598,933,050
-----	-----------	--------------------	-------------

国債 計

598,933,050**南アフリカ 計 (取得原価4,956,349,610円)**

5,415,555,169**スリランカ (1.0%)****国債 (1.0%)**

Sri Lanka Government International Bond

USD	14,235,000	6.25% due 07/27/21	1,568,555,119
-----	------------	--------------------	---------------

国債 計

1,568,555,119

		スリランカ 計 (取得原価1,394,278,260円)	1,568,555,119
			<hr/>
		トリニダッド (0.3%)	
		社債券 (0.3%)	
		Petroleum Co. of Trinidad & Tobago, Ltd.	
USD	4,500,000	9.75% due 08/14/19 ^(c)	523,226,814
		社債券 計	523,226,814
			<hr/>
		トリニダッド 計 (取得原価566,403,849円)	523,226,814
			<hr/>
		トルコ (3.6%)	
		社債券 (0.5%)	
		Akbank TAS	
USD	1,050,000	5.13% due 03/31/25	114,658,644
		Arcelik AS	
USD	1,600,000	5.00% due 04/03/23	171,050,800
		Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	
USD	3,700,000	4.49% due 11/25/24	410,133,416
		社債券 計	695,842,860
			<hr/>
		国債 (3.1%)	
		Turkey Government International Bond	
USD	17,650,000	5.63% due 03/30/21	2,145,161,463

額面**銘柄****公正価値**

確定利付証券 (87.1%) (続き)

(単位:円)

トルコ (3.6%) (続き)

国債 (3.1%) (続き)

		Turkey Government International Bond	
USD	15,725,000	6.25% due 09/26/22	1,969,384,042
USD	4,550,000	6.75% due 05/30/40	601,236,951

国債 計**4,715,782,456****トルコ 計 (取得原価4,026,434,230円)****5,411,625,316****ウクライナ (1.7%)****国債 (1.7%)**

		Ukraine Government International Bond	
USD	1,540,000	0.00% due 05/31/40 (c)(d)	57,266,263
USD	896,000	7.75% due 09/01/20 (c)	94,688,740
USD	11,214,000	7.75% due 09/01/21 (c)	1,172,850,297
USD	814,000	7.75% due 09/01/22 (c)	84,170,366
USD	814,000	7.75% due 09/01/23 (c)	83,218,875
USD	699,000	7.75% due 09/01/24 (c)	70,609,488
USD	4,799,000	7.75% due 09/01/25 (c)	480,833,506
USD	2,838,000	7.75% due 09/01/26 (c)	283,053,814
USD	2,699,000	7.75% due 09/01/27 (c)	268,377,371

国債 計**2,595,068,720****ウクライナ 計 (取得原価2,935,175,895円)****2,595,068,720**

アラブ首長国連邦 (0.8%)**社債券 (0.8%)**

DP World, Ltd.

USD	6,480,000	6.85% due 07/02/37	746,134,284
-----	-----------	--------------------	-------------

Ruwais Power Co. PJSC

USD	3,385,000	6.00% due 08/31/36	407,564,634
-----	-----------	--------------------	-------------

社債券 計**1,153,698,918****アラブ首長国連邦 計 (取得原価1,176,648,217円)****1,153,698,918****イギリス (0.3%)****社債券 (0.3%)**

Petra Diamonds US Treasury PLC

USD	2,790,000	8.25% due 05/31/20 (a)	268,112,648
-----	-----------	------------------------	-------------

Vedanta Resources PLC

USD	3,225,000	6.00% due 01/31/19	248,747,692
-----	-----------	--------------------	-------------

社債券 計**516,860,340****イギリス 計 (取得原価645,577,375円)****516,860,340****アメリカ (5.6%)****社債券 (0.2%)**

Cemex Finance LLC

USD	2,100,000	9.38% due 10/12/22 (a)(c)	260,812,593
-----	-----------	---------------------------	-------------

社債券 計**260,812,593****国債 (5.4%)**

U.S. Treasury Notes

USD	11,790,000	1.00% due 08/31/16	1,328,480,347
USD	9,000,000	1.00% due 09/30/16	1,014,498,607
USD	12,334,000	1.00% due 12/15/17	1,392,696,995
USD	10,000,000	1.50% due 06/30/16	1,127,307,219
USD	10,000,000	2.00% due 04/30/16	1,125,541,493
USD	550,000	3.00% due 08/31/16	62,479,744
USD	10,000,000	3.25% due 05/31/16	1,129,437,104
USD	9,900,000	4.88% due 08/15/16	1,131,431,834
		国債 計	8,311,873,343
		アメリカ 計 (取得原価9,132,290,533円)	8,572,685,936

<u>額面</u>	<u>銘柄</u>	<u>純資産比率(%)</u>	<u>公正価値</u>
			(単位:円)
		確定利付証券 (87.1%) (続き)	
		ベトナム (0.8%)	
		国債 (0.8%)	
		Vietnam Government International Bond	
USD	11,351,000	4.80% due 11/19/24	1,282,098,053
		国債 計	1,282,098,053
		ベトナム 計 (取得原価1,306,201,298円)	1,282,098,053
		ザンビア (0.2%)	
		国債 (0.2%)	
		Zambia Government International Bond	

USD	4,140,000	5.38% due 09/20/22		355,966,198
国債 計				355,966,198
ザンビア 計 (取得原価366,324,639円)				355,966,198
確定利付証券 計 (取得原価122,362,608,529円)				132,424,001,973
短期投資 (5.8%)				
ケイマン諸島 (5.8%)				
定期預金 (5.8%)				
Bank of Tokyo Mitsubishi				
USD	78,115,831	0.14% due 04/01/16		8,779,828,627
Brown Brothers Harriman & Co.				
JPY	1	(0.31)% due 04/01/16		1
定期預金 計				8,779,828,628
ケイマン諸島 計 (取得原価8,779,956,686円)				8,779,828,628
短期投資 計 (取得原価8,779,956,686円)				8,779,828,628
有価証券 計 (取得原価131,142,565,215円)				141,203,830,601
				92.9%
				7.1
現金その他資産 (負債控除後)				10,739,096,213
純資産				151,942,926,814
				100.0%

(a) コーラブル証券

(b) 永久債

(c) 規則144A証券 - 1933年証券法規則144Aに基づく登録を免除された有価証券。これらの証券は、登録を免除され一般的には、適格機関投資家への転売が可能である。別段の指定がない限り、これらの証券は流動性が低いとはみなされない。

(d) 変動利付証券 (2016年3月31日現在)

Class A - JPY Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計
	BNP Paribas							
JPY	S.A.	15,834,365,465	04/04/2016	USD	140,100,968	/	87,375,743 /	- / 87,375,743

	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
JPY	Co.	36,422,265	04/04/2016	USD	321,000	342,688	-	342,688
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
JPY	Co.	162,846,670	04/04/2016	USD	1,435,000	1,556,347	-	1,556,347
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
JPY	Co.	81,014,920	04/04/2016	USD	712,000	987,945	-	987,945
JPY	Citibank NA	5,898,305,454	05/06/2016	USD	52,560,198	-	(3,356,157)	(3,356,157)
	Deutsche							
JPY	Bank AG	10,192,076,440	05/06/2016	USD	91,000,000	-	(25,754,236)	(25,754,236)
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
USD	Co.	136,000	04/04/2016	JPY	15,444,976	-	(158,925)	(158,925)
USD	Citibank NA	52,513,403	04/04/2016	JPY	5,898,305,454	4,066,498	-	4,066,498
	Deutsche							
USD	Bank AG	91,000,000	04/04/2016	JPY	10,200,898,890	27,267,908	-	27,267,908
						/	121,597,129	/
							(29,269,318)	/
								92,327,811

Class B - AUD Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計
	Bank of							
AUD	America NA	136,515,500	04/04/2016	USD	98,270,000	757,876,914	-	757,876,914
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
AUD	Co.	2,855,370	04/04/2016	USD	2,071,000	14,101,112	-	14,101,112
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
AUD	Co.	1,915,568	04/04/2016	USD	1,462,000	2,807,751	(1,512,170)	1,295,581
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
AUD	Co.	649,033	04/04/2016	USD	465,000	3,850,827	-	3,850,827

	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
AUD	Co.	2,894,199	04/04/2016	USD	2,159,000	7,567,278	-	7,567,278
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
AUD	Co.	2,889,187	04/04/2016	USD	2,200,000	4,637,666	(2,112,049)	2,525,617
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
AUD	Co.	2,893,269	04/04/2016	USD	2,064,000	18,164,608	-	18,164,608
AUD	Citibank NA	154,920,037	04/04/2016	USD	110,478,002	976,990,839	-	976,990,839
	Goldman							
AUD	Sachs & Co.	136,552,529	04/04/2016	USD	98,270,000	761,078,443	-	761,078,443
	Goldman							
AUD	Sachs & Co.	2,891,569	04/04/2016	USD	2,203,000	4,641,491	(2,247,042)	2,394,449
	Goldman							
AUD	Sachs & Co.	137,479,919	04/04/2016	USD	98,270,000	841,260,904	-	841,260,904
	Credit							
	Suisse First							
AUD	Boston	130,000,000	05/03/2016	USD	99,661,250	58,560,123	(35,535,182)	23,024,941
	Goldman							
AUD	Sachs & Co.	130,831,599	05/03/2016	USD	98,283,000	249,536,606	-	249,536,606
	Morgan							
AUD	Stanley	117,647,524	05/03/2016	USD	90,165,062	55,968,362	(32,158,664)	23,809,698
	Royal Bank							
AUD	of Canada	192,328,516	05/03/2016	USD	147,425,000	86,730,477	(50,549,641)	36,180,836
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
USD	Co.	9,111,000	04/04/2016	AUD	12,078,909	-	(20,293,190)	(20,293,190)
	Credit							
	Suisse First							
USD	Boston	99,788,000	04/04/2016	AUD	130,000,000	-	(23,925,436)	(23,925,436)
	Goldman							
USD	Sachs & Co.	98,283,000	04/04/2016	AUD	130,653,815	-	(249,612,669)	(249,612,669)
	Morgan							
USD	Stanley	90,282,710	04/04/2016	AUD	117,647,524	-	(24,296,720)	(24,296,720)
	Royal Bank							
USD	of Canada	147,425,000	04/04/2016	AUD	192,075,931	111,049,003	(147,802,280)	(36,753,277)
						<u>/ 3,954,822,404 /</u>	<u>(590,045,043) /</u>	<u>3,364,777,361</u>

Class C - NZD Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
NZD	Co.	205,082	04/04/2016	USD	138,000	497,785	(5,316)	492,469
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
NZD	Co.	90,763	04/04/2016	USD	62,000	178,482	(64,587)	113,895
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
NZD	Co.	104,800	04/04/2016	USD	69,000	422,455	-	422,455
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
NZD	Co.	103,265	04/04/2016	USD	68,000	415,109	-	415,109
	Goldman							
NZD	Sachs & Co.	20,238,069	04/04/2016	USD	13,286,721	85,855,028	-	85,855,028
	Royal Bank							
NZD	of Canada	20,475,934	05/03/2016	USD	14,159,293	6,944,115	(3,028,521)	3,915,594
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
USD	Co.	179,000	04/04/2016	NZD	266,044	-	(641,250)	(641,250)
	Royal Bank							
USD	of Canada	14,180,608	04/04/2016	NZD	20,475,934	-	(3,945,901)	(3,945,901)
						/	94,312,974	/
							(7,685,575)	/
								86,627,399

Class D - BRL Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計
	Barclays							
BRL	Bank PLC	362,509,339	04/04/2016	USD	91,742,000	1,441,113,483	(256,125,240)	1,184,988,243
	Barclays							
BRL	Bank PLC	145,004,526	04/04/2016	USD	36,697,000	576,448,535	(102,450,655)	473,997,880
	BNP Paribas							
BRL	S.A.	9,771,959	04/04/2016	USD	2,423,000	37,567,104	-	37,567,104

	Credit							
	Suisse First							
BRL	Boston	299,592,998	04/04/2016	USD	71,884,492	1,421,604,069	-	1,421,604,069
	Deutsche							
BRL	Bank AG	167,544,728	04/04/2016	USD	47,077,672	22,131,194	(58,487)	22,072,707
	Deutsche							
BRL	Bank AG	169,192,960	04/04/2016	USD	47,540,802	22,348,911	(59,062)	22,289,849
	JPMorgan							
BRL	Chase & Co.	12,168,828	04/04/2016	USD	3,010,000	47,603,668	-	47,603,668
	Morgan							
BRL	Stanley	53,776,002	04/04/2016	USD	15,110,287	7,103,339	(18,772)	7,084,567
	Morgan							
BRL	Stanley	167,499,150	04/04/2016	USD	47,064,866	22,125,174	(58,472)	22,066,702
	Morgan							
BRL	Stanley	271,034,809	04/04/2016	USD	76,156,905	35,801,328	(94,614)	35,706,714
	Goldman							
BRL	Sachs & Co.	361,048,000	05/03/2016	USD	86,696,602	1,612,992,647	-	1,612,992,647
	JPMorgan							
BRL	Chase & Co.	10,970,044	05/03/2016	USD	2,654,000	46,783,306	-	46,783,306
	Morgan							
BRL	Stanley	9,527,960	05/03/2016	USD	2,600,000	7,518,730	-	7,518,730
	Morgan							
BRL	Stanley	10,581,984	05/03/2016	USD	2,534,000	48,061,120	-	48,061,120
	Morgan							
BRL	Stanley	21,081,425	05/03/2016	USD	5,574,000	39,588,926	(2,883,234)	36,705,692
	Royal Bank							
	of Scotland							
BRL	PLC	381,726,400	05/03/2016	USD	92,000,000	1,667,417,835	-	1,667,417,835
BRL	Citibank NA	166,842,930	06/02/2016	USD	40,463,447	655,162,079	-	655,162,079
	Deutsche							
BRL	Bank AG	171,781,904	06/02/2016	USD	45,580,000	234,842,379	-	234,842,379
	Deutsche							
BRL	Bank AG	170,001,382	06/02/2016	USD	45,578,000	179,621,281	-	179,621,281
	Morgan							
BRL	Stanley	11,046,000	06/02/2016	USD	3,000,000	7,348,070	-	7,348,070
	Morgan							
BRL	Stanley	187,555,800	06/02/2016	USD	46,000,000	678,914,612	-	678,914,612
	Royal Bank							
BRL	of Canada	187,293,600	06/02/2016	USD	46,000,000	670,749,694	-	670,749,694
	Morgan							
BRL	Stanley	171,405,185	07/05/2016	USD	45,578,000	216,402,881	(43,007,950)	173,394,931

	Morgan							
BRL	Stanley	271,034,809	07/05/2016	USD	72,727,831	311,380,407	(110,887,852)	200,492,555
	Barclays							
USD	Bank PLC	40,744,198	04/04/2016	BRL	145,004,526	99,389	(19,202,600)	(19,103,211)
	Barclays							
USD	Bank PLC	101,859,940	04/04/2016	BRL	362,509,339	248,471	(48,006,239)	(47,757,768)
	BNP Paribas							
USD	S.A.	2,745,781	04/04/2016	BRL	9,771,959	6,697	(1,294,076)	(1,287,379)
	Credit							
	Suisse First							
USD	Boston	84,181,347	04/04/2016	BRL	299,592,998	205,346	(39,674,379)	(39,469,033)
	Deutsche							
USD	Bank AG	45,578,000	04/04/2016	BRL	167,544,728	-	(190,632,032)	(190,632,032)
	Deutsche							
USD	Bank AG	45,580,000	04/04/2016	BRL	169,192,960	-	(242,678,961)	(242,678,961)
	JPMorgan							
USD	Chase & Co.	3,419,267	04/04/2016	BRL	12,168,828	8,341	(1,611,488)	(1,603,147)
	Morgan							
USD	Stanley	45,578,000	04/04/2016	BRL	167,499,150	-	(189,186,579)	(189,186,579)
	Morgan							
USD	Stanley	74,439,662	04/04/2016	BRL	271,034,809	-	(228,720,431)	(228,720,431)
	Morgan							
USD	Stanley	14,785,000	04/04/2016	BRL	53,776,002	-	(43,646,043)	(43,646,043)
						/ 10,011,199,016 / (1,520,297,166) / 8,490,901,850		

Class E - ZAR Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計
	BNP Paribas							
USD	S.A.	10,577,956	04/04/2016	ZAR	156,827,722	-	(9,503,780)	(9,503,780)
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
USD	Co.	216,000	04/04/2016	ZAR	3,303,785	-	(968,867)	(968,867)
	Barclays							
ZAR	Bank PLC	154,117,022	04/04/2016	USD	9,619,598	96,506,294	-	96,506,294
	Brown							
	Brothers							
	Harriman &							
ZAR	Co.	795,947	04/04/2016	USD	51,000	350,161	-	350,161

	Brown Brothers Harriman & Co.	821,875	04/04/2016	USD	54,000	256,632	(45,530)	211,102
ZAR								
	Brown Brothers Harriman & Co.	799,828	04/04/2016	USD	52,000	276,371	(8,946)	267,425
ZAR								
	Brown Brothers Harriman & Co.	1,584,235	04/04/2016	USD	102,000	641,794	-	641,794
ZAR								
	Brown Brothers Harriman & Co.	441,720	04/04/2016	USD	29,000	123,903	(7,914)	115,989
ZAR								
	Brown Brothers Harriman & Co.	787,270	04/04/2016	USD	50,000	396,252	-	396,252
ZAR								
	Brown Brothers Harriman & Co.	783,610	04/04/2016	USD	50,000	368,283	-	368,283
ZAR								
	BNP Paribas S.A.	156,827,722	05/04/2016	USD	10,516,175	9,420,080	-	9,420,080
ZAR								
						/	108,339,770	/
							(10,535,037)	/
								97,804,733

Class F - TRY Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計
	Brown Brothers Harriman & Co.	1,261,370	04/04/2016	USD	441,000	1,034,302	(251,490)	782,812
TRY								
	Brown Brothers Harriman & Co.	3,197,766	04/04/2016	USD	1,091,000	5,019,523	-	5,019,523
TRY								
	Citibank NA Goldman Sachs & Co.	148,410,000	04/04/2016	USD	50,000,000	304,206,051	-	304,206,051
TRY								
	Sachs & Co.	1,594,318	04/04/2016	USD	553,000	1,578,584	(94,027)	1,484,557
TRY								

	Goldman										
TRY	Sachs & Co.	165,997,253	04/04/2016	USD	55,511,906	386,711,820	-	386,711,820			
	Goldman										
TRY	Sachs & Co.	171,465,084	05/03/2016	USD	60,199,096	48,507,452	(28,160,852)	20,346,600			
	Royal Bank of Scotland										
TRY	PLC	143,090,000	05/03/2016	USD	50,000,000	55,374,685	(11,782,759)	43,591,926			
	Brown Brothers Harriman & Co.										
USD		2,438,000	04/04/2016	TRY	7,050,623	-	(7,414,568)	(7,414,568)			
	Goldman										
USD	Sachs & Co.	60,684,864	04/04/2016	TRY	171,465,084	-	(23,543,848)	(23,543,848)			
	Royal Bank of Scotland										
USD	PLC	50,000,000	04/04/2016	TRY	141,945,000	3,985,135	(50,127,957)	(46,142,822)			
						/	806,417,552	/	(121,375,501)	/	685,042,051

Class H - CNY Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損) 益計
	JPMorgan							
CNY	Chase & Co.	105,040	04/05/2016	USD	16,000	32,423	(5,321)	27,102
	JPMorgan							
CNY	Chase & Co.	103,856	04/05/2016	USD	16,000	16,034	(9,506)	6,528
	JPMorgan							
CNY	Chase & Co.	102,945	04/05/2016	USD	15,700	24,412	-	24,412
	JPMorgan							
CNY	Chase & Co.	103,712	04/05/2016	USD	16,000	17,275	(13,249)	4,026
	JPMorgan							
CNY	Chase & Co.	105,093	04/05/2016	USD	16,000	29,345	(1,326)	28,019
	Morgan							
CNY	Stanley	208,754	04/05/2016	USD	32,000	31,161	-	31,161
	Standard Chartered							
CNY	Bank	20,043,237	04/05/2016	USD	3,052,161	5,270,754	-	5,270,754
	Standard Chartered							
CNY	Bank	20,772,636	04/05/2016	USD	3,214,981	325,430	(678,548)	(353,118)
	Standard Chartered							
CNY	Bank	20,772,636	05/04/2016	USD	3,201,701	2,263,225	(1,558,004)	705,221

	JPMorgan								
USD	Chase & Co.	16,052	04/05/2016	CNY	103,712	2,890	(1,127)	1,763	
	JPMorgan								
USD	Chase & Co.	16,074	04/05/2016	CNY	103,856	2,893	(1,128)	1,765	
	JPMorgan								
USD	Chase & Co.	16,265	04/05/2016	CNY	105,093	2,928	(1,142)	1,786	
	JPMorgan								
USD	Chase & Co.	16,257	04/05/2016	CNY	105,040	2,926	(1,141)	1,785	
	JPMorgan								
USD	Chase & Co.	15,933	04/05/2016	CNY	102,945	2,868	(1,119)	1,749	
	Morgan								
USD	Stanley	32,309	04/05/2016	CNY	208,754	5,817	(2,268)	3,549	
	Standard								
	Chartered								
USD	Bank	3,206,643	04/05/2016	CNY	20,772,636	2,671,441	(3,255,355)	(583,914)	
	Standard								
	Chartered								
USD	Bank	3,102,092	04/05/2016	CNY	20,043,237	558,463	(217,744)	340,719	
						/	11,260,285 /	(5,746,978) /	5,513,307

Class I - CAD Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損)益計	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	1,558	04/04/2016	USD	1,200	1,813	(1,325)	488	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	2,596	04/04/2016	USD	2,000	2,818	(2,039)	779	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	2,606	04/04/2016	USD	2,000	2,828	(1,180)	1,648	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	76,954	04/04/2016	USD	58,000	167,948	-	167,948	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	2,526	04/04/2016	USD	1,900	5,939	-	5,939	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	2,419	04/04/2016	USD	1,800	7,927	-	7,927	
	Brown Brothers								
CAD	Harriman & Co.	4,950	04/04/2016	USD	3,700	14,243	-	14,243	
CAD	Morgan Stanley	480,535	04/04/2016	USD	355,021	1,853,132	-	1,853,132	
	Goldman Sachs								
CAD	& Co.	574,144	05/03/2016	USD	443,461	96,814	(48,408)	48,406	
	Goldman Sachs								
USD	& Co.	443,442	04/04/2016	CAD	574,144	-	(49,098)	(49,098)	
						/	2,153,462 /	(102,050) /	2,051,412

Class J - MXN Class 外国為替予約取引 2016年3月31日現在

買	取引相手方	契約額	決済日	売	契約額	評価益	評価(損)	評価(損) 益計
	Bank of							
MXN	America NA	26,810,911	04/04/2016	USD	1,475,332	10,011,097	-	10,011,097
	Brown Brothers							
MXN	Harriman & Co.	139,240	04/04/2016	USD	8,000	16,535	(2,532)	14,003
	Brown Brothers							
MXN	Harriman & Co.	138,711	04/04/2016	USD	8,000	19,673	(9,139)	10,534
	Brown Brothers							
MXN	Harriman & Co.	135,967	04/04/2016	USD	7,600	37,494	-	37,494
	Brown Brothers							
MXN	Harriman & Co.	273,826	04/04/2016	USD	15,300	76,156	-	76,156
MXN	HSBC Bank Plc	27,498,655	05/03/2016	USD	1,591,409	1,298,612	(316,027)	982,585
USD	HSBC Bank Plc	1,595,753	04/04/2016	MXN	27,498,655	-	(986,512)	(986,512)
						/ 11,459,567	/ (1,314,210)	/ 10,145,357

クレジット・デフォルト・スワップ 2016年3月31日現在

		クレジット・		受取り プレツ		プレミアム				
通貨	取引相手方	想定元本	プロテクション	参照対象	(支払い)ド	終了日	支払い(受取り)	評価(損)益	公正価値	
				CDS Brazilian						
				Government			/			
USD	Citibank NA	2,500,000	Sell	International	1.000%	3.17%	12/20/2020	(33,771,760)	/ 5,721,524	/(28,050,236)
	JPMorgan			The Markit						
USD	Chase & Co.	22,750,000	Sell	CDX.EM.16	5.000%	5.27%	12/20/2016	207,258,158	(175,858,453)	31,399,705
	JPMorgan			The Markit						
USD	Chase & Co.	27,300,000	Sell	CDX.EM.16	5.000%	5.27%	12/20/2016	218,570,632	(180,890,986)	37,679,646
	JPMorgan			The Markit						
USD	Chase & Co.	27,300,000	Sell	CDX.EM.16	5.000%	5.27%	12/20/2016	188,574,736	(150,895,090)	37,679,646
	JPMorgan			The Markit						
USD	Chase & Co.	13,650,000	Sell	CDX.EM.17	5.000%	4.22%	6/20/2017	115,679,648	(82,701,788)	32,977,860
							/			
						/696,311,414	(584,624,793)	/111,686,621		

通貨

AUD	-	オーストラリア・ドル
BRL	-	ブラジル・レアル
CAD	-	カナダ・ドル
CNY	-	中国・人民元
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコ・ペソ
NZD	-	ニュージーランド・ドル
USD	-	米ドル
ZAR	-	南アフリカ・ランド

デリバティブ取引の価値

以下の表は本ファンドのデリバティブ取引の要約である。

取引相手方	デリバティブ 資産の価値	デリバティブ 負債の価値	担保 受取	担保 差入	純額*
店頭デリバティブ					
Bank of America NA	/ 767,888,011	/ -	/ 675,803,609	/ -	/ 92,084,402
Barclays Bank PLC	1,755,492,417	(66,860,979)	1,326,168,310	-	362,463,128
BNP Paribas S.A.	134,362,927	(10,791,159)	-	-	123,571,768
Brown Brothers Hariman & Co.	60,326,431	(29,476,800)	30,346,649	-	502,982
Citibank NA	1,946,146,991	(3,356,157)	1,283,302,774	-	659,488,060
Credit Suisse First Boston	1,444,629,010	(63,394,469)	1,159,916,379	-	221,318,162
Deutsche Bank AG	486,094,124	(459,065,229)	-	-	27,028,895
Goldman Sachs Group, Inc.	3,961,709,460	(273,205,615)	3,117,025,565	-	571,478,280
HSBC Bank PLC	982,585	(986,512)	-	-	(3,927)
JPMorgan Chase & Co.	94,485,909	(591,949,464)	-	-	(497,463,555)
Morgan Stanley	1,242,991,233	(485,849,773)	523,760,691	-	233,380,769
Royal Bank of Canada	710,846,124	(40,699,178)	466,418,845	-	203,728,101
Royal Bank of Scotland PLC					341,934,453
	1,711,009,761	(46,142,822)	1,322,932,486	-	
Standard Chartered Bank	6,316,694	(937,032)	-	-	5,379,662
合計	/ 14,323,281,677	/ (2,072,715,189)	/ 9,905,675,308	/ -	/ 2,344,891,180

*純額は、デフォルトが発生した場合に取引相手方から（または取引相手方に）生じる受取り（または支払い）の額をあらわしている。

純額は、同一の法人格に対する同一の契約に基づく取引に関して損益を通算することが認められている。

添付の注記は、本財務諸表の不可欠の部分である

[前へ](#) [次へ](#)

財務諸表に関する注記（抜粋）

2016年3月31日現在

重要な会計方針

以下は、本ファンドが米国で一般に公正妥当と認められた会計原則（「米国GAAP」）に準拠して、その財務諸表を作成するにあたって継続して適用している重要な会計方針の要約である。米国GAAPに準拠した財務諸表を作成するにあたって、経営陣は、財務諸表の報告額及び開示事項に影響する予想及び仮定を設定する必要がある。このような予想と実績は異なる可能性がある。

(A) 受益証券の純資産額の決定

本ファンドの純資産額（「純資産額」）は、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行が営業している日（それぞれを「営業日」）及び受託会社が決定できるその他の日（それぞれを「計算日」）に算出される。純資産額は、管理会社報酬、弁護士報酬、監査報酬並びにその他の専門家報酬及び費用等を含み、本ファンドの資産及び負債の全額を考慮して算出される。本ファンドの各クラスについて、純資産額は日本円で算出される。日本円で表示される一口当たりの純資産額は、通常各営業日に算出され、一口当たりの純資産は小数点第4位まで表示される。

(B) 有価証券の評価

純資産額を算出する目的上、市場の公表価格が容易に入手できる有価証券及びその他の資産は、公正価値で計上されている。公正価値は通常、直前に報告された売却価格、または売却価格が報告されない場合には、相場報告システムもしくは主要なマーケット・メーカーまたは第三者の価格提供サービスから取得する価格を基に決定される。

国内外の債券及び非上場デリバティブは、通常、主要なマーケット・メーカーまたは価格提供サービスから得られる公表価格に基づいて評価される。独立した価格提供サービスから得られる価格は、マーケット・メーカーが提供する情報、または類似した性質を持つ投資もしくは有価証券に関する利回りのデータから取得した市場価格の概算を利用している。

先渡契約で購入した債券は、先渡決済日に決済されるまで毎日値洗いされる。最新の公表価格が存在しない破産や倒産した企業の証券は、最近の利用可能な市場価格や公表価格で評価される。残存60日以内の短期有価証券は、公正価値に近似する償却原価で評価される。

市場の公表価格が容易に入手できない有価証券及びその他の資産は、ブラウン・ブラザーズ・ハリマン社（アドミニストレーター）が誠実に決定した公正価値で評価する。

最新の市場データまたは信頼性の高い市場データ（売買情報、ビッドアスク情報、ブローカー価格など）がない状況では、市場の公表価格は容易に入手できないとみなされる。こうした状況には、関連市場の終了後に本ファンドの有価証券やその他の資産の価値に重大な影響を及ぼすような事象が発生する場合も含まれる。さらに、非常の事態により証券取引所もしくは証券市場が終日開かれず、他の市場価格も入手できないような場合も、市場の公表価格は容易に入手できないとみなされる。

アドミニストレーターは、本ファンドの有価証券やその他の資産の価値に重大な影響を及ぼす可能性がある重要事象の監視、及びそうした重要事象が有価証券やその他の資産の価値に影響するかどうかの判断の責任を負う。

本ファンドが公正価値を用いて純資産額を決定する際、有価証券がその主要な取引市場の公表価格で評価されるのではなく、運用会社またはその指示により行動する者が公正価値を正確に反映していると考える方法により算出される価額で評価される場合がある。公正価値の評価には、有価証券の価値に関する主観的な判断を要することがある。

本ファンドの方針は、算出した本ファンドの純資産額が価格決定時点の有価証券の価値を適切に反映することを目指している。しかし、運用会社またはその指示により行動する者が決定した公正価値が、価格決定時点で当該有価証券を売却した場合に本ファンドが得る価格を正確に反映することは保証できない（例えば、強制処分または清算処分の場合など）。本ファンドが用いる価格は有価証券を売却した場合に実現されるであろう価値とは異なる場合があり、そうした相違は財務諸表に重大な影響を及ぼし得る。

< 公正価値測定 >

米国GAAPに基づく公正価値測定及び開示事項に関する当局の指針に従い、本ファンドは、階層での投資商品の公正価値を開示している。階層では、公正価値の測定に用いられる評価技法に関するインプットに優先順位を付けている。階層において、優先順位が最も高いのは、活発な市場で同一資産または負債における未調整の公表価格に基づく評価（レベル1）で、優先順位が最も低いのは、その評価にとって重大な、観察不可能なインプットに基づく評価（レベル3）である。当該指針は、公正価値の階層として次の3レベルを設定している。

- ・ レベル1： 公正価値の測定は、同一資産または負債の活発な市場での(調整なしの)公表価格から導出される。
- ・ レベル2： 公正価値の測定は、資産または負債に対して直接的（例えば、価格）にも、間接的（例えば、価格から派生したもの）にも観察可能なインプットのうち、レベル1に含まれる公表価格以外のインプットから導出される。
- ・ レベル3： 公正価値の測定は、観察可能な市場データに基づかない（観察不可能なインプット）資産または負債にかかるインプットを含む評価技法から導出される。

インプットは、様々な評価技法を適用する際に用いられ、また、リスクに対する仮定を含む、市場参加者が評価を決定するにあたって用いる様々な仮定を幅広く参照している。インプットには、価格情報、特定の広範な信用データ、流動性に関する統計値、及びその他の要素などが含まれる場合がある。

公正価値の階層での金融商品のレベルは、公正価値測定にとって十分なインプットの最低水準に基づいている。しかし、何が「観察可能」を構成するのかを決定するには、運用会社による重要な判断が必要となる。運用会社は、容易に入手でき、定期的に配布または更新され、信頼性が高く検証可能で、独占的なものではなく、関連する市場に積極的に関与している独立した情報源によって提供されている市場データを観察可能なデータとみなしている。ある金融商品の階層における分類は、その価格決定の透明性に基づくもので、当該商品に対する運用会社の認識したリスクとは必ずしも一致しない。

投資

公正価値が活発な市場の公表価格に基づいているためレベル1に分類される有価証券には、優先株式、普通株式及び定期預金が含まれている。本ファンドがその商品を大量に保有し、売却すると取引価格に影響を与え得ると合理的に判断できる状況においても、当該商品の公表価格は調整されない。

活発でない市場で取引されているものの、市場の公表価格、ディーラーの呼び値、または観察可能なインプットに基づくその他の価格情報源に基づいて評価されている投資はレベル2に分類される。これらには、社債、投資適格社債、ソブリン債、先物取引及び為替予約取引が含まれている。レベル2の有価証券は、活発な市場で取引されていない、または譲渡制限の対象となっているポジションを含むため、その評価は一般的に入手可能な市場情報に基づいた非流動性または非譲渡性を反映するように調整される。

デリバティブ商品

本ファンドは、ヘッジ目的でデリバティブを利用する場合がある。ヘッジ取引は、本ファンドが、デリバティブを用いて、他の保有有価証券に関連するリスクを相殺する一つの戦略である。ヘッジ取引は損失を減少させるが、一方で市場が本ファンドの想定と異なる動きをする、あるいはデリバティブのコストがヘッジ取引の利益を上回ると、利益を減少させる、または損失を生じさせる場合がある。

またヘッジ取引は、デリバティブの価値の変動が、想定するほどヘッジ対象保有有価証券の価値の変動に連動しないリスクがある。その場合、ヘッジ対象保有有価証券の損失は、減少せず増加するかもしれない。

本ファンドのヘッジ戦略がリスクを減少させる、もしくはヘッジ取引が有効である、あるいはコストに見合う効果が得られる保証はない。本ファンドにはヘッジ取引を用いる義務はなく、ヘッジ取引を用いない選択もある。本ファンドがデリバティブ商品に投資すると、投資元本を超える損失を被る場合がある。また、適切なデリバティブ取引があらゆる環境で利用できるとは限らず、本ファンドが他のリスクへのエクスポージャーを減らすために効果があると思われる場合でも、デリバティブ取引を利用できる保証はない。

デリバティブ商品は、取引所または店頭の相対にて取引されることもある。先物や上場オプションなどの上場デリバティブは、活発に取引されているとみなされるか否かで、通常では公正価値の階層のレベル1またはレベル2に分類される。

外国為替予約取引及びスワップを含む店頭デリバティブについては、取引相手方、ディーラーまたはブローカーから受領する価格等、観察可能なインプットを入手でき、それらが信頼できるとみなされた場合には、常にそれらを用いて評価する。モデルが使用されている場合、店頭デリバティブの価値は、商品の契約条件や固有のリスク、さらには観察可能なインプットの入手可能性や信頼性に依存する。そのようなインプットとしては、参照する有価証券の市場価格、イールドカーブ、クレジットカーブ、ボラティリティ指標、期限前償還率及びそれぞれのインプットの相関関係などが挙げられる。

通常の外国為替予約取引及びスワップのような一部の店頭デリバティブは、一般に市場データで確認できるインプットを有していて、ゆえにレベル2に分類される。

流動性が低いか、インプットが観察不可能な店頭デリバティブは、レベル3に分類される。こうした流動性の低い店頭デリバティブの評価は、レベル1またはレベル2のインプットを利用できるが、公正価値の決定には重要であるとみなされる観察不可能なその他のインプットも含んでいる。

各測定日において、観察可能なインプットを反映するためにレベル1及びレベル2のインプットを更新するが、その結果としての損益は、観察不可能なインプットが重要であることを理由としてレベル3に反映される。

次表は、2016年3月31日現在の貸借対照表に計上された金融商品を、公正価値の階層のレベル別に表示している。*

(未調整)				
活発な市場における同				
一の投資にかかる公表	重要なその他の	重要な観察		
価格を反映したイン	観察可能な	不可能な		
プット	インプット	インプット		2016年3月31日時点
資産	(Level 1)	(Level 2)	(Level 3)	での公正価値
確定利付証券				
Angola	\ -	\ 632,124,221	\ -	\ 632,124,221
Argentina	-	11,453,095,722	-	11,453,095,722
Bahamas	-	1,069,508,653	-	1,069,508,653

Bermuda	-	823,170,850	-	823,170,850
Brazil	-	7,585,226,574	-	7,585,226,574
Chile	-	1,973,926,812	-	1,973,926,812
China	-	1,685,531,913	-	1,685,531,913
Colombia	-	2,359,668,356	-	2,359,668,356
Croatia	-	3,788,835,184	-	3,788,835,184
Dominican Republic	-	4,981,907,921	-	4,981,907,921
El Salvador	-	1,760,706,982	-	1,760,706,982
Gabon	-	722,643,640	-	722,643,640
Grenada	-	261,830,554	-	261,830,554
Hong Kong	-	606,905,812	-	606,905,812
Hungary	-	3,460,954,312	-	3,460,954,312
India	-	1,459,441,308	-	1,459,441,308
Indonesia	-	6,200,554,165	-	6,200,554,165
Ireland	-	814,599,529	-	814,599,529
Israel	-	2,581,485,728	-	2,581,485,728
Ivory Coast	-	3,008,934,921	-	3,008,934,921
Jamaica	-	6,308,618,562	-	6,308,618,562
Kazakhstan	-	10,787,891,747	-	10,787,891,747
Kenya	-	1,001,046,050	-	1,001,046,050
Luxembourg	-	882,707,177	-	882,707,177
Mexico	-	8,007,921,825	-	8,007,921,825
Mongolia	-	310,772,196	-	310,772,196
Morocco	-	1,146,461,012	-	1,146,461,012
Netherlands	-	4,385,080,070	-	4,385,080,070
Pakistan	-	2,348,584,012	-	2,348,584,012
Philippines	-	1,566,857,516	-	1,566,857,516
Poland	-	984,436,795	-	984,436,795
Romania	-	1,306,486,488	-	1,306,486,488
Russia	-	1,992,836,090	-	1,992,836,090
Serbia	-	5,695,492,156	-	5,695,492,156
Singapore	-	693,943,240	-	693,943,240
Slovenia	-	378,473,297	-	378,473,297
South Africa	-	5,415,555,169	-	5,415,555,169
Sri Lanka	-	1,568,555,119	-	1,568,555,119
Trinidad	-	523,226,814	-	523,226,814
Turkey	-	5,411,625,316	-	5,411,625,316
Ukraine	-	2,595,068,720	-	2,595,068,720
United Arab Emirates	-	1,153,698,918	-	1,153,698,918
United Kingdom	-	516,860,340	-	516,860,340
United States	-	8,572,685,936	-	8,572,685,936
Vietnam	-	1,282,098,053	-	1,282,098,053

Zambia	-	355,966,198	-	355,966,198
短期投資				
定期預金	8,779,828,628	-	-	8,779,828,628
有価証券 計	\ 8,779,828,628	\ 132,424,001,973	\ -	\ 141,203,830,601

金融デリバティブ****資産**

外国為替予約取引	-	14,317,560,153	-	14,317,560,153
スワップ	-	5,721,524	-	5,721,524

負債

外国為替予約取引	-	(1,482,368,872)	-	(1,482,368,872)
スワップ	-	(590,346,317)	-	(590,346,317)

* 分類についての詳細は、有価証券明細表を参照。

**金融デリバティブ商品は、外国為替予約取引の評価損益及びクレジット・デフォルト・スワップ契約の時価を含む。

2016年3月31日に終了した年度において、レベル1、レベル2及びレベル3間の異動はなかった。本ファンドの投資勘定は、年度末にそれぞれのレベルへ振り替えている。

2016年3月31日現在、レベル3で評価された有価証券はない。

(C) 有価証券の取引及び収益

有価証券取引は、財務報告の目的上、約定日基準で計上される。有価証券の売却にかかる実現損益は、個別原価法で算出されている。有価証券にかかるプレミアム及びディスカウントは、実効金利法に基づいて償却または上乘せされる。受取利息は、発生主義によって計上される。回収が見込めない証券のクーポン収入は計上されない。

(D) 経費

本ファンドは、管理会社報酬、保管手数料、名義書換代理人報酬、監査報酬及び本ファンドの運営に関連するその他の費用等を含む（ただし、これらに限定されない。）自らの費用を負担する。費用項目は発生主義で計上される。

(E) 分配方針

受託会社は毎月分配を行う意向である。受託会社は前月の最終営業日または受託会社が単独の裁量によって決められるその他の日（「基準日」）に、当月の分配金を公表し、通常は毎月10日（この日が営業日ではない場合は翌営業日）または受託会社が単独の裁量によって決められるその他の日（「分配日」）に分配を行うことを目指す。

分配を行う場合、通常は本ファンドのネット実現益（ヘッジポジションを含む）、未実現益及びネットのインカム収入から、あるいは各クラスの純資産総額にポートフォリオ利回りを乗ずるものから支払われる。

既存の受益者は分配再投資を選択した。ゆえに、受益証券は各分配日に発行されている。

2016年3月31日に終了した年度に公表、再投資された分配金は次の通りである。

受益者への分配金

金額

Class A-JPY Class	/	3,234,496,250
Class B-AUD Class		5,150,305,452
Class C-NZD Class		267,713,329
Class D-BRL Class		32,198,516,613
Class E-ZAR Class		503,255,321
Class F-TRY Class		2,840,811,995
Class G-USD Class		485,346,400
Class H-CNY Class		45,347,343
Class I-CAD Class		8,368,775
Class J-MXN Class		21,633,037
分配金合計	/	44,755,794,515

(F) 新興市場有価証券

本ファンドはその大半の資産を新興諸国の有価証券（または有価証券への投資商品）に投資する。新興諸国の通貨及び有価証券の価値は、発行国の政治的動向に大きな影響を受ける場合がある。さらに、関連する現政権が、国有化、収用、没収課税の徴収または支払利息への源泉徴収の制度導入や強制など、本ファンドに悪影響を与える措置を講じる可能性もある。

本ファンドが投資をしている諸国の多くがそのような政治的、経済的、社会的不安定状況を経験してきた。通貨価値の大きな変動も経験している。そのような不安定状況や価値変動が将来起きない保証はなく、それが起きた場合、本ファンドのパフォーマンスに著しい悪影響を及ぼさない保証もない。

(G) ソブリン債

本ファンドは、主として新興国が発行または保証するソブリン債に投資する。同債券への投資には、高いリスクを伴う。同債券の元利払いを管理する政府機関は、期日に元本と利息、もしくはそのいずれかを当該債券の発行条件通りに支払えないか、または支払おうとしない場合がある。政府機関が期日の到来した元利を遅滞なく支払う能力、または支払おうとする意志は、キャッシュフローの状況、外貨準備の規模、十分な外貨の入手可能性、債務支払負担額の経済全体に占める割合、当該政府機関の国際通貨基金に対する方針および政府機関が受ける可能性のある政治的制約などの要因に影響されることがある。

政府機関は、元利支払い削減を目的として、米国以外の政府、多国籍機関およびその他の国際機関が拠出する資金に依存することもある。これら政府および機関などの拠出の承諾は、経済改革の実施と経済成長及び債務者び遅滞ない債務履行が条件となる場合がある。経済改革の実施できない場合、一定水準の経済成果の達成できない場合、または期日に元利支払いを実施できない場合には、当該政府機関に対する第三者からの資金供与の承諾が取り消されて、債務者が遅滞なく元利を支払う能力、または支払おうとする意思が一段と損なわれる可能性がある。それゆえ、政府機関が債務不履行を起こす可能性がある。

ソブリン債の保有者は、当該債務の返済猶予交渉に参加し当該政府機関への追加融資を求められる可能性がある。政府機関の債務不履行が発生した場合、かかる債務を回収する実効的な法的救済策はほとんど、あるいは全くないかもしれない。

(H) 現金及び外国通貨

本ファンドの機能通貨及び報告通貨は日本円である。外国の有価証券、通貨並びにその他の資産及び負債の公正価値は、毎営業日の為替レートに基づいて本ファンドの機能通貨に換算される。

為替レートの変動の結果としての保有通貨並びにその他の資産及び負債の公正価値の変動は、外国通貨の未実現損益として計上されている。有価証券の実現損益、未実現損益、並びに利益及び費用は、各取引日及び報告日の為替レートでそれぞれ換算されている。

有価証券及びデリバティブへの投資に関する外国通貨の為替レートの変動による影響は、損益計算書上で当該有価証券の市場価格及び評価の変動の影響と区分されず、実現及び未実現損益に含めて計上している。

(I) 定期預金

本ファンドは余剰資金を、運用会社の判断により、カストディアンを通じ、一つ以上の適格預金取扱機関の翌日物定期預金として運用する。これらは本ファンドの有価証券明細表に短期金融資産として分類されている。当該通貨への需要が低下した際に、本ファンドは預金に対して手数料を支払う可能性があり、その場合金融費用として計上される。

(J) 外国為替予約取引

本ファンドは、予定される有価証券の購入または売却の決済に伴い、本ファンドが保有する有価証券の一部または全部に伴う通貨エクスポージャーをヘッジするため、もしくは投資戦略の一環として、外国為替予約取引を締結することがある。

外国為替予約取引は、二当事者間で将来の特定日に設定された価格で通貨の売買を行う契約である。外国為替予約取引の公正価値は、外国為替レートの変動により上下する。外国為替予約取引は毎日値洗いされ、価格の変動は未実現損益として計上される。

評価損益の生じている外国為替予約取引は、グロス金額で、貸借対照表に資産または負債として計上される。実現損益は取引開始時における価値と取引終了時における価値との差額に相当し、通貨の引き渡しまたは受領により計上される。これらの契約には、貸借対照表に計上された未実現損益を超える市場リスクが含まれることがある。また、本ファンドは、取引相手方が契約の条件を履行できなくなる場合や、為替の変動がベース通貨に不利となる場合にリスクにさらされる可能性がある。

本ファンドはまた、投資家向けに為替リスクをヘッジする目的で、外国為替予約取引を締結できる権限を付与されている。クラスごとに保有する外国為替予約取引から生じた損益は、同クラスに配賦される。クラスG - 米ドル・クラスはクラスレベルの外国為替予約取引を行わない。2016年3月31日現在で未決済の外国為替予約取引は有価証券明細表に記載されている。

(K) スワップ契約

本ファンドは、スワップに投資する。クレジット・デフォルト・スワップを含むが、これに限定されるものではない。スワップは、ファンドと取引相手方との間でキャッシュフロー、資産、外国為替または市場にリンクしたリターンを特定の将来の期間で交換する契約である。本ファンドは、クレジットリスクに対するエクスポージャーを管理するために、クレジット・デフォルト契約を締結している。これらの契約に関連して、有価証券は個々のスワップ契約の条文により、担保として特定される場合がある。

スワップを利用することで本ファンドは、取引相手方のデフォルト・リスクにさらされている。スワップ取引に対して取引相手方の債務不履行が発生した場合、本ファンドは、当該取引に関する契約上の救済策をとるが、取引相手方が契約を履行できない場合、プロテクションまたは資産のエクスポージャーを失う。

本ファンドは、他商品の代替として金利スワップ、クレジット・デフォルト・スワップまたはその他のスワップを締結することができる。そうした取引の価値は、原資産の値動きとともに取引相手方にかかるリスクに依存する。運用会社がスワップをどのように利用するかによって、スワップはポートフォリオ全体の変動率を増減させることになる。

取引相手方の債務不履行、参照価値の変動や変動率、またはスワップ契約に関連して本ファンドが受け払う金額を決定する他の要因など、スワップに関連する将来のどのようなリスクも、本ファンドのパフォーマンスにとって重大な悪影響を及ぼさないとは限らない。

スワップ契約によってファンドからの支払いが要求された場合、ファンドは支払いに応じなければならない。2016年3月31日に未決済のスワップ契約は有価証券明細表に記載されている。

社債またはソブリン債のクレジット・デフォルト・スワップでは、一方の当事者は、(発行体の)債務不履行が生じた場合に一定のリターンを受け取る権利と引き換えに、他方の当事者に対して一連の支払いを行う。

本ファンドは、発行体の債務不履行に対応するプロテクション(つまり、本ファンドが参照債権を保有する場合のリスク軽減)の手段を提供する、または特定の発行体の債務不履行の可能性に関してアクティブにロング/ショート・ポジションを構築する、社債/ソブリン債のクレジット・デフォルト・スワップを使用できる。

本ファンドはプロテクションの売り手である場合、クレジット・イベントがなければ、プロテクションの買い手からスワップ契約期間を通して前払金、かつ/または固定金利の収入を得る。本ファンドがプロテクションの売り手で、クレジット・イベントが発生した場合、スワップ契約の条件に基づき、プロテクションの買い手に最大でスワップ想定元本を支払い、場合によっては当該有価証券の現引きをする。本ファンドが売り手である場合、本ファンドの純資産総額に加え、スワップ想定元本のエクスポージャーを有することになるため、ポートフォリオのレバレッジが高まる。本ファンドが買い手である場合、クレジット・イベントが発生した場合、プロテクションの売り手から最大でスワップ想定元本を受領する。

クレジット指数のクレジット・デフォルト・スワップでは、一方の当事者は、クレジット指数を構成する全部または一部の、減額、元本毀損、利息の不足または債務不履行が生じた場合に一定のリターンを受け取る権利と引き換えに、他方の当事者に対して一連の支払いを行う。

クレジット指数とは、信用市場のある部分において代表されるように構成されたクレジット商品/エクスポージャーの一覧である。同指数は、セクターごとにCDS市場で最も流動性のあるとディーラーから選ばれた銘柄から構成される。

指数は、投資適格債、高利回り債、資産担保証券、新興国債券、かつ/または多様な信用格付けを有する現物債から構成される。クレジット指数は、固定スプレッド、標準化された満期など標準化された条件を有するクレジット・デフォルト・スワップを用いて取引される。

インデックス・クレジット・デフォルト・スワップは、すべての構成銘柄を参照して、構成銘柄の債務不履行が生じた場合、クレジット・イベントは、当該銘柄の指数ウェイトに基づいて清算される。指数の見直しは定期的(通常6カ月ごと)に実施され、ほとんどの指数において各構成銘柄を均等ウェイトとしている。

(L) デリバティブ取引

ASC 815-10-50は、デリバティブ商品及びヘッジ取引の開示を義務づけている。具体的には、a)デリバティブ商品をどのように、また何故利用しているか、b)デリバティブ商品とヘッジ取引をどのように計上しているか、c)デリバティブ商品とヘッジ取引が金融ポジション、パフォーマンス及びキャッシュフローにどのような影響を及ぼすか、を開示することが要求されている。

本ファンドは、いかなるデリバティブ商品もASC 第 815号に基づくヘッジ取引として指定していない。

本ファンドは、クレジット・デフォルト・スワップ及び外国為替予約取引を含む様々なデリバティブ取引をヘッジ目的で行っており、主として金利リスク、信用リスク及び外国為替リスクを負っている。これらデリバティブ商品の公正価値は、貸借対照表に記載されるとともに、公正価値の変動は、損益計算書内の外国為替予約取引に関する実現損益または未実現損益の純変動額として計上される。本年度中の本ファンドのデリバティブ商品の取引は、外国為替予約取引及びクレジット・デフォルト・スワップであった。

2016年3月31日時点の貸借対照表におけるデリバティブ商品の公正価値
ASC第815号に基づくヘッジ取引として指定されていないデリバティブ商品

該当箇所	信用リスク*	外国為替リスク*
デリバティブ資産		
外国為替予約取引にかかる評価益	/	14,317,560,153
スワップ契約にかかる評価益	/	5,721,524
デリバティブ負債		
外国為替予約取引にかかる評価損	/	(1,482,368,872)
スワップ契約にかかる評価損	/	(590,346,317)

*総額は貸借対照表の外国為替予約取引とスワップ契約にかかる未実現評価損益に記載される。

2016年3月31日に終了した年度の損益計算書におけるデリバティブ商品の影響
ASC第815号に基づくヘッジ取引として指定されていないデリバティブ商品

該当箇所	信用リスク	外国為替リスク
運用の成果として認識されたデリバティブにかか る実現（損）益		
外国為替予約取引にかかる実現（損）益	/	(34,636,524,162)
スワップ契約にかかる実現（損）益	/	438,981,439
運用の成果として認識されたデリバティブにかか る未実現（損）益の変動		
外国為替予約取引にかかる未実現（損）益の変動	/	34,334,021,066
スワップ契約にかかる未実現（損）益の変動	/	207,518,685

2016年3月31日に終了した年度における外国為替予約取引の未決済の平均想定元本はおよそ次の通り：

ファンドレベル*	/	13,776,435,203
Class A-JPY Class	/	49,180,457,782
Class B-AUD Class	/	164,641,260,000
Class C-NZD Class	/	4,088,996,328
Class D-BRL Class	/	170,645,822,105
Class E-ZAR Class	/	3,681,670,277
Class F-TRY Class	/	43,200,271,320
Class H-CNY Class	/	1,677,672,970
Class I-CAD Class	/	171,737,234
Class J-MXN Class	/	339,116,564

*外国為替予約取引は、全クラスで保有している。ファンドレベルでは、年度において7ヶ月程度保有している。

2016年3月31日に終了した年度におけるスワップ契約の未決済の平均想定元本は7,998,586,275円だった。

本ファンドは、特定の取引相手方と、随時締結される店頭デリバティブ取引および外国為替取引を規定する国際スワップ・デリバティブ協会（ISDA）マスター契約（以下「マスター契約」という。）の当事者である。当該マスター契約に

は、特に当事者の一般的義務、表明、合意、担保要求、債務不履行事由および期限前終了に関する条項が含まれる場合がある。

担保要求は本ファンドにおける各取引相手方のネット・ポジションに基づいて決定される。担保となりうるのは、現金、米国債や本ファンドと当該取引相手方が同意するその他の有価証券である。特定の取引相手方に関して、マスター契約の条件に従ってサブファンドに差し入れられた担保は、ファンドの受託会社が分別保管し、売却または再担保が可能な額に関しては本ファンドの有価証券明細表に表示される。サブファンドが差し入れた担保は本ファンドの受託会社が分別保管し、本ファンドの有価証券明細表において識別される。

本ファンドに対して適用される取引終了事由は、一定期間に亘り本ファンドの純資産が規定された閾値を下回る場合に発生しうる。取引相手方に対して適用される取引終了事由は、取引相手方の信用格付が規定された水準を下回る場合に発生しうる。いずれの場合も、発生時に、他方の当事者は期限前終了を選択することが可能であり、当事者による合理的決定に基づいて、未決済のデリバティブおよび外国為替取引のすべての決済（期限前終了によって生じた損失および費用の支払いを含む）が行われる。単一または複数の本ファンドの取引相手方による期限前終了の決定が、本ファンドの将来のデリバティブ取引に影響を与える可能性がある。

2016年3月31日現在、ファンドは想定元本合計で93.5百万米ドルの売り手（プロテクションを提供すること）である。スワップの想定元本は、財務諸表に記載されない。しかし、想定元本は、ファンドが売り手としてクレジットイベントが生じた場合に要求される将来における最大限の潜在的な支払額に近似している。

貸借対照表日にファンドがプロテクションを提供しているクレジット・デフォルト・スワップは、有価証券明細表に要約されている。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,551,913,802	1,522,823,682
投資信託受益証券	43,508,215,262	39,022,384,601
親投資信託受益証券	480,645,979	400,718,511
未収入金	57,642,350	5,793,394
流動資産合計	45,598,417,393	40,951,720,188
資産合計	45,598,417,393	40,951,720,188
負債の部		
流動負債		
未払金	-	52,799,439
未払収益分配金	837,236,798	782,524,771
未払解約金	103,907,461	75,072,227
未払受託者報酬	1,278,765	1,098,419
未払委託者報酬	61,807,492	53,090,370
その他未払費用	681,204	646,916
流動負債合計	1,004,911,720	965,232,142
負債合計	1,004,911,720	965,232,142
純資産の部		
元本等		
元本	83,723,679,853	78,252,477,176
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,130,174,180	38,265,989,130
（分配準備積立金）	2,801,737	34,177,157
元本等合計	44,593,505,673	39,986,488,046
純資産合計	44,593,505,673	39,986,488,046
負債純資産合計	45,598,417,393	40,951,720,188

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	1,818,733,931	1,423,615,231
受取利息	32,669	2,826
有価証券売買等損益	4,255,677,986	1,887,433,558
営業収益合計	6,074,444,586	3,311,051,615
営業費用		

支払利息	127,608	225,087
受託者報酬	7,694,981	6,603,433
委託者報酬	371,926,045	319,167,671
その他費用	681,875	647,071
営業費用合計	380,430,509	326,643,262
営業利益又は営業損失（ ）	5,694,014,077	2,984,408,353
経常利益又は経常損失（ ）	5,694,014,077	2,984,408,353
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,694,014,077	2,984,408,353
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	99,068,679	5,139,920
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	42,857,249,049	39,130,174,180
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,293,914,500	5,201,203,202
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,293,914,500	5,201,203,202
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,952,669,744	2,501,112,420
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,952,669,744	2,501,112,420
分配金	5,209,115,285	4,815,174,165
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,130,174,180	38,265,989,130

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	90,743,802,166円	83,723,679,853円
期中追加設定元本額	4,257,277,958円	5,090,442,665円
期中一部解約元本額	11,277,400,271円	10,561,645,342円
2. 受益権の総数	83,723,679,853口	78,252,477,176口
3. 元本の欠損	39,130,174,180円	38,265,989,130円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																								
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																								
<p>分配金の計算過程</p> <p>第77期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した23,301,605,343円（1万口当たり2,613.84円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1891,471,048円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>286,040,699円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>23,010,485,774円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>5,078,870円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>23,301,605,343円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(2,613.84円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>891,471,048円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第78期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した22,497,222,998円（1万口当たり2,546.99円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1883,285,970円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>292,678,433円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>22,198,798,812円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>5,745,753円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>22,497,222,998円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(2,546.99円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	286,040,699円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	23,010,485,774円	分配準備積立金	5,078,870円	分配可能額	23,301,605,343円	（1万口当たり分配可能額）	(2,613.84円)	収益分配金	891,471,048円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	配当等収益（費用控除後）	292,678,433円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	22,198,798,812円	分配準備積立金	5,745,753円	分配可能額	22,497,222,998円	（1万口当たり分配可能額）	(2,546.99円)	<p>分配金の計算過程</p> <p>第83期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した18,137,134,280円（1万口当たり2,191.94円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1827,447,085円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>208,880,339円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>17,925,125,016円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>3,128,925円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>18,137,134,280円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(2,191.94円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>827,447,085円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>(100円)</td></tr> </table> <p>第84期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した17,264,611,310円（1万口当たり2,115.18円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1816,222,713円（1万口当たり100円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>189,146,694円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>17,070,061,313円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>5,403,303円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>17,264,611,310円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>(2,115.18円)</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	208,880,339円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	17,925,125,016円	分配準備積立金	3,128,925円	分配可能額	18,137,134,280円	（1万口当たり分配可能額）	(2,191.94円)	収益分配金	827,447,085円	（1万口当たり収益分配金）	(100円)	配当等収益（費用控除後）	189,146,694円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	17,070,061,313円	分配準備積立金	5,403,303円	分配可能額	17,264,611,310円	（1万口当たり分配可能額）	(2,115.18円)
配当等収益（費用控除後）	286,040,699円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	23,010,485,774円																																																								
分配準備積立金	5,078,870円																																																								
分配可能額	23,301,605,343円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(2,613.84円)																																																								
収益分配金	891,471,048円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																								
配当等収益（費用控除後）	292,678,433円																																																								
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																								
収益調整金	22,198,798,812円																																																								
分配準備積立金	5,745,753円																																																								
分配可能額	22,497,222,998円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(2,546.99円)																																																								
配当等収益（費用控除後）	208,880,339円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	17,925,125,016円																																																								
分配準備積立金	3,128,925円																																																								
分配可能額	18,137,134,280円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(2,191.94円)																																																								
収益分配金	827,447,085円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	(100円)																																																								
配当等収益（費用控除後）	189,146,694円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	17,070,061,313円																																																								
分配準備積立金	5,403,303円																																																								
分配可能額	17,264,611,310円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	(2,115.18円)																																																								

収益分配金	883,285,970円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第79期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した21,677,470,092円（1万口当たり2,483.62円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1872,816,663円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	319,428,703円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	21,351,184,598円
分配準備積立金	6,856,791円
分配可能額	21,677,470,092円
（1万口当たり分配可能額）	(2,483.62円)
収益分配金	872,816,663円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第80期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した20,947,881,062円（1万口当たり2,411.37円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1868,713,342円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	240,759,463円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	20,703,721,998円
分配準備積立金	3,399,601円
分配可能額	20,947,881,062円
（1万口当たり分配可能額）	(2,411.37円)
収益分配金	868,713,342円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第81期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した19,996,634,369円（1万口当たり2,337.17円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1855,591,464円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	220,376,116円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	19,775,024,298円
分配準備積立金	1,233,955円
分配可能額	19,996,634,369円
（1万口当たり分配可能額）	(2,337.17円)
収益分配金	855,591,464円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第82期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した18,977,145,979円（1万口当たり2,266.64円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1837,236,798円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	245,854,158円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	18,723,173,202円
分配準備積立金	8,118,619円
分配可能額	18,977,145,979円
（1万口当たり分配可能額）	(2,266.64円)
収益分配金	837,236,798円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

収益分配金	816,222,713円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第85期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した16,459,692,993円（1万口当たり2,042.48円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1805,869,180円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	219,682,203円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	16,233,128,348円
分配準備積立金	6,882,442円
分配可能額	16,459,692,993円
（1万口当たり分配可能額）	(2,042.48円)
収益分配金	805,869,180円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第86期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した15,625,792,316円（1万口当たり1,965.42円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1795,037,227円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	181,796,464円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	15,434,777,587円
分配準備積立金	9,218,265円
分配可能額	15,625,792,316円
（1万口当たり分配可能額）	(1,965.42円)
収益分配金	795,037,227円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第87期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した14,923,435,918円（1万口当たり1,893.66円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1788,073,189円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	221,974,400円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	14,701,142,152円
分配準備積立金	319,366円
分配可能額	14,923,435,918円
（1万口当たり分配可能額）	(1,893.66円)
収益分配金	788,073,189円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

第88期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した14,241,132,216円（1万口当たり1,819.90円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1782,524,771円（1万口当たり100円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	204,417,242円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	14,034,799,609円
分配準備積立金	1,915,365円
分配可能額	14,241,132,216円
（1万口当たり分配可能額）	(1,819.90円)
収益分配金	782,524,771円
（1万口当たり収益分配金）	(100円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成29年1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成28年7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	94,308
投資信託受益証券	2,219,837,181
合計	2,219,931,489

当期（平成29年1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	9
投資信託受益証券	371,350,356
合計	371,350,347

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成28年7月19日現在	当期 平成29年1月16日現在
1口当たり純資産額 0.5326円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,326円）」	1口当たり純資産額 0.5110円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,110円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
----	----	----	----	-----	----

円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund AUD Class	60,312,804,639	39,022,384,601	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	393,594,452	400,718,511	
合計		2銘柄	60,706,399,091	39,423,103,112	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund AUD Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース(毎月分配型)」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,789,016	43,492,972
投資信託受益証券	1,551,415,278	1,603,550,956
親投資信託受益証券	13,486,810	12,523,790
未収入金	-	3,910,415
流動資産合計	1,618,691,104	1,663,478,133
資産合計	1,618,691,104	1,663,478,133
負債の部		
流動負債		
未払金	10,581,566	-
未払収益分配金	17,935,861	18,109,889
未払解約金	8,840,549	7,915,229
未払受託者報酬	45,483	43,519
未払委託者報酬	2,198,763	2,103,788
その他未払費用	51,270	49,023
流動負債合計	39,653,492	28,221,448
負債合計	39,653,492	28,221,448
純資産の部		
元本等		
元本	1,630,532,890	1,646,353,620
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	51,495,278	11,096,935
（分配準備積立金）	45,487,598	1,016,845
元本等合計	1,579,037,612	1,635,256,685
純資産合計	1,579,037,612	1,635,256,685
負債純資産合計	1,618,691,104	1,663,478,133

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	65,580,227	55,783,209
受取利息	1,204	197
有価証券売買等損益	143,049,778	90,123,590
営業収益合計	208,631,209	145,906,996
営業費用		

支払利息	4,811	12,052
受託者報酬	256,728	245,515
委託者報酬	12,409,909	11,868,570
その他費用	51,288	49,028
営業費用合計	12,722,736	12,175,165
営業利益又は営業損失()	195,908,473	133,731,831
経常利益又は経常損失()	195,908,473	133,731,831
当期純利益又は当期純損失()	195,908,473	133,731,831
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	7,257,846	4,252,491
期首剰余金又は期首欠損金()	143,254,787	51,495,278
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,509,026	27,769,770
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,509,026	27,769,770
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,050,328	10,674,174
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,050,328	10,674,174
分配金	109,349,816	106,176,593
期末剰余金又は期末欠損金()	51,495,278	11,096,935

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	1,740,511,370円	1,630,532,890円
期中追加設定元本額	185,140,801円	529,279,920円
期中一部解約元本額	295,119,281円	513,459,190円
2. 受益権の総数	1,630,532,890口	1,646,353,620口
3. 元本の欠損	51,495,278円	11,096,935円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																								
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																								
<p>分配金の計算過程</p> <p>第77期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,191,245,875円（1万口当たり7,014.41円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い118,681,109円（1万口当たり110円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>11,910,916円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>1,073,781,162円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>105,553,797円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>1,191,245,875円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（7,014.41円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>118,681,109円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（110円）</td></tr> </table> <p>第78期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,170,841,986円（1万口当たり6,963.81円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い118,494,570円（1万口当たり110円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>9,953,383円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>1,064,691,098円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>96,197,505円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>1,170,841,986円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,963.81円）</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	11,910,916円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,073,781,162円	分配準備積立金	105,553,797円	分配可能額	1,191,245,875円	（1万口当たり分配可能額）	（7,014.41円）	収益分配金	118,681,109円	（1万口当たり収益分配金）	（110円）	配当等収益（費用控除後）	9,953,383円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	1,064,691,098円	分配準備積立金	96,197,505円	分配可能額	1,170,841,986円	（1万口当たり分配可能額）	（6,963.81円）	<p>分配金の計算過程</p> <p>第83期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,094,227,775円（1万口当たり6,692.65円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い117,984,666円（1万口当たり110円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>8,126,584円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>1,041,695,930円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>44,405,261円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>1,094,227,775円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,692.65円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>117,984,666円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（110円）</td></tr> </table> <p>第84期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,139,280,283円（1万口当たり6,635.32円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い118,886,921円（1万口当たり110円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>9,033,321円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>1,095,819,182円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>34,427,780円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>1,139,280,283円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,635.32円）</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	8,126,584円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	1,041,695,930円	分配準備積立金	44,405,261円	分配可能額	1,094,227,775円	（1万口当たり分配可能額）	（6,692.65円）	収益分配金	117,984,666円	（1万口当たり収益分配金）	（110円）	配当等収益（費用控除後）	9,033,321円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	1,095,819,182円	分配準備積立金	34,427,780円	分配可能額	1,139,280,283円	（1万口当たり分配可能額）	（6,635.32円）
配当等収益（費用控除後）	11,910,916円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	1,073,781,162円																																																								
分配準備積立金	105,553,797円																																																								
分配可能額	1,191,245,875円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（7,014.41円）																																																								
収益分配金	118,681,109円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	（110円）																																																								
配当等収益（費用控除後）	9,953,383円																																																								
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																								
収益調整金	1,064,691,098円																																																								
分配準備積立金	96,197,505円																																																								
分配可能額	1,170,841,986円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（6,963.81円）																																																								
配当等収益（費用控除後）	8,126,584円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	1,041,695,930円																																																								
分配準備積立金	44,405,261円																																																								
分配可能額	1,094,227,775円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（6,692.65円）																																																								
収益分配金	117,984,666円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	（110円）																																																								
配当等収益（費用控除後）	9,033,321円																																																								
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																								
収益調整金	1,095,819,182円																																																								
分配準備積立金	34,427,780円																																																								
分配可能額	1,139,280,283円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（6,635.32円）																																																								

収益分配金	18,494,570円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第79期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した1,138,931,011円（1万口当たり6,918.99円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,107,027円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	10,674,165円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,043,644,631円
分配準備積立金	84,612,215円
分配可能額	1,138,931,011円
（1万口当たり分配可能額）	(6,918.99円)
収益分配金	18,107,027円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第80期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,129,668,883円（1万口当たり6,859.66円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,115,112円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	8,315,023円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,045,535,925円
分配準備積立金	75,817,935円
分配可能額	1,129,668,883円
（1万口当たり分配可能額）	(6,859.66円)
収益分配金	18,115,112円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第81期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,114,509,007円（1万口当たり6,804.79円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,016,137円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	8,967,948円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,040,765,311円
分配準備積立金	64,775,748円
分配可能額	1,114,509,007円
（1万口当たり分配可能額）	(6,804.79円)
収益分配金	18,016,137円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第82期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した1,101,049,824円（1万口当たり6,752.70円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,935,861円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	9,349,125円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,037,626,365円
分配準備積立金	54,074,334円
分配可能額	1,101,049,824円
（1万口当たり分配可能額）	(6,752.70円)
収益分配金	17,935,861円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

収益分配金	18,886,921円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第85期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した1,112,568,879円（1万口当たり6,569.96円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,627,592円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	7,527,561円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,080,939,618円
分配準備積立金	24,101,700円
分配可能額	1,112,568,879円
（1万口当たり分配可能額）	(6,569.96円)
収益分配金	18,627,592円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第86期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した912,738,525円（1万口当たり6,510.71円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い15,420,941円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	7,000,227円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	895,034,124円
分配準備積立金	10,704,174円
分配可能額	912,738,525円
（1万口当たり分配可能額）	(6,510.71円)
収益分配金	15,420,941円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第87期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,006,318,358円（1万口当たり6,455.81円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い17,146,584円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	7,971,840円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	996,134,111円
分配準備積立金	2,212,407円
分配可能額	1,006,318,358円
（1万口当たり分配可能額）	(6,455.81円)
収益分配金	17,146,584円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

第88期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した1,052,817,130円（1万口当たり6,394.84円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い18,109,889円（1万口当たり110円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	8,004,283円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	1,044,720,965円
分配準備積立金	91,882円
分配可能額	1,052,817,130円
（1万口当たり分配可能額）	(6,394.84円)
収益分配金	18,109,889円
（1万口当たり収益分配金）	(110円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成28年 7月20日 至 平成29年 1月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成29年 1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成28年 7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,594
投資信託受益証券	59,967,687
合計	59,970,281

当期（平成29年 1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5
投資信託受益証券	6,857,970
合計	6,857,965

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年 7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年 1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自 平成28年 7月20日 至 平成29年 1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成28年 7月19日現在	当期 平成29年 1月16日現在
1口当たり純資産額 0.9684円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,684円）」	1口当たり純資産額 0.9933円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,933円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund NZD Class	2,129,832,589	1,603,550,956	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	12,301,140	12,523,790	
合計		2銘柄	2,142,133,729	1,616,074,746	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund NZD Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,175,574,331	2,353,211,453
投資信託受益証券	65,656,662,562	64,324,985,287
親投資信託受益証券	577,159,252	465,518,390
未収入金	88,034,177	146,351,737
流動資産合計	68,497,430,322	67,290,066,867
資産合計	68,497,430,322	67,290,066,867
負債の部		
流動負債		
未払金	-	51,580,970
未払収益分配金	1,339,810,094	1,286,863,993
未払解約金	288,610,066	399,923,790
未払受託者報酬	1,899,304	1,810,324
未払委託者報酬	91,800,081	87,499,150
その他未払費用	757,217	741,700
流動負債合計	1,722,876,762	1,828,419,927
負債合計	1,722,876,762	1,828,419,927
純資産の部		
元本等		
元本	167,476,261,773	160,857,999,204
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,701,708,213	95,396,352,264
（分配準備積立金）	10,503,468,453	16,807,799,864
元本等合計	66,774,553,560	65,461,646,940
純資産合計	66,774,553,560	65,461,646,940
負債純資産合計	68,497,430,322	67,290,066,867

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	15,583,059,192	16,229,021,424
受取利息	36,891	3,389
有価証券売買等損益	2,847,349,387	6,646,194,576
営業収益合計	18,430,445,470	9,582,830,237
営業費用		

支払利息	146,976	280,997
受託者報酬	10,545,813	10,143,574
委託者報酬	509,716,377	490,274,630
その他費用	758,173	741,877
営業費用合計	521,167,339	501,441,078
営業利益又は営業損失（ ）	17,909,278,131	9,081,389,159
経常利益又は経常損失（ ）	17,909,278,131	9,081,389,159
当期純利益又は当期純損失（ ）	17,909,278,131	9,081,389,159
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	210,754,472	118,332,415
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	120,649,209,422	100,701,708,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,261,781,859	14,023,207,197
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,261,781,859	14,023,207,197
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,659,763,477	9,960,469,573
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,659,763,477	9,960,469,573
分配金	8,353,040,832	7,720,438,419
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,701,708,213	95,396,352,264

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	183,930,733,519円	167,476,261,773円
期中追加設定元本額	7,385,620,159円	16,275,765,945円
期中一部解約元本額	23,840,091,905円	22,894,028,514円
2. 受益権の総数	167,476,261,773口	160,857,999,204口
3. 元本の欠損	100,701,708,213円	95,396,352,264円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																								
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																								
<p>分配金の計算過程</p> <p>第77期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した19,126,617,098円（1万口当たり1,060.85円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,442,367,706円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,485,605,210円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>12,087,604,181円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>4,553,407,707円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>19,126,617,098円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（1,060.85円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>1,442,367,706円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（80円）</td></tr> </table> <p>第78期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した19,927,415,623円（1万口当たり1,124.22円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,418,046,684円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,540,019,169円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>11,909,465,162円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>5,477,931,292円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>19,927,415,623円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（1,124.22円）</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	2,485,605,210円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	12,087,604,181円	分配準備積立金	4,553,407,707円	分配可能額	19,126,617,098円	（1万口当たり分配可能額）	（1,060.85円）	収益分配金	1,442,367,706円	（1万口当たり収益分配金）	（80円）	配当等収益（費用控除後）	2,540,019,169円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	11,909,465,162円	分配準備積立金	5,477,931,292円	分配可能額	19,927,415,623円	（1万口当たり分配可能額）	（1,124.22円）	<p>分配金の計算過程</p> <p>第83期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した24,087,769,445円（1万口当たり1,469.89円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,311,001,309円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,528,459,222円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>11,397,040,399円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>10,162,269,824円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>24,087,769,445円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（1,469.89円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>1,311,001,309円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（80円）</td></tr> </table> <p>第84期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した24,843,703,454円（1万口当たり1,547.33円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,284,465,194円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,524,762,488円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>11,279,252,096円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>11,039,688,870円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>24,843,703,454円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（1,547.33円）</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	2,528,459,222円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	11,397,040,399円	分配準備積立金	10,162,269,824円	分配可能額	24,087,769,445円	（1万口当たり分配可能額）	（1,469.89円）	収益分配金	1,311,001,309円	（1万口当たり収益分配金）	（80円）	配当等収益（費用控除後）	2,524,762,488円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	11,279,252,096円	分配準備積立金	11,039,688,870円	分配可能額	24,843,703,454円	（1万口当たり分配可能額）	（1,547.33円）
配当等収益（費用控除後）	2,485,605,210円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	12,087,604,181円																																																								
分配準備積立金	4,553,407,707円																																																								
分配可能額	19,126,617,098円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（1,060.85円）																																																								
収益分配金	1,442,367,706円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	（80円）																																																								
配当等収益（費用控除後）	2,540,019,169円																																																								
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																								
収益調整金	11,909,465,162円																																																								
分配準備積立金	5,477,931,292円																																																								
分配可能額	19,927,415,623円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（1,124.22円）																																																								
配当等収益（費用控除後）	2,528,459,222円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	11,397,040,399円																																																								
分配準備積立金	10,162,269,824円																																																								
分配可能額	24,087,769,445円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（1,469.89円）																																																								
収益分配金	1,311,001,309円																																																								
（1万口当たり収益分配金）	（80円）																																																								
配当等収益（費用控除後）	2,524,762,488円																																																								
有価証券売買等損益	0円																																																								
収益調整金	11,279,252,096円																																																								
分配準備積立金	11,039,688,870円																																																								
分配可能額	24,843,703,454円																																																								
（1万口当たり分配可能額）	（1,547.33円）																																																								

収益分配金	1,418,046,684円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第79期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した20,766,975,895円（1万口当たり1,187.78円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,398,713,654円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,505,659,351円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	11,795,628,718円
分配準備積立金	6,465,687,826円
分配可能額	20,766,975,895円
（1万口当たり分配可能額）	（1,187.78円）
収益分配金	1,398,713,654円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第80期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した21,727,353,018円（1万口当たり1,253.53円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,386,632,371円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,522,899,489円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	11,736,239,571円
分配準備積立金	7,468,213,958円
分配可能額	21,727,353,018円
（1万口当たり分配可能額）	（1,253.53円）
収益分配金	1,386,632,371円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第81期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した22,587,673,261円（1万口当たり1,321.43円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,367,470,323円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,524,173,819円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	11,684,398,087円
分配準備積立金	8,379,101,355円
分配可能額	22,587,673,261円
（1万口当たり分配可能額）	（1,321.43円）
収益分配金	1,367,470,323円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第82期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した23,368,972,378円（1万口当たり1,395.36円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,339,810,094円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,575,466,713円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	11,525,693,831円
分配準備積立金	9,267,811,834円
分配可能額	23,368,972,378円
（1万口当たり分配可能額）	（1,395.36円）
収益分配金	1,339,810,094円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

収益分配金	1,284,465,194円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第85期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した26,013,333,469円（1万口当たり1,630.17円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,276,598,606円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,593,621,622円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	11,344,068,024円
分配準備積立金	12,075,643,823円
分配可能額	26,013,333,469円
（1万口当たり分配可能額）	（1,630.17円）
収益分配金	1,276,598,606円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第86期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した27,231,385,752円（1万口当たり1,714.26円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,270,816,580円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,601,745,970円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	11,497,219,494円
分配準備積立金	13,132,420,288円
分配可能額	27,231,385,752円
（1万口当たり分配可能額）	（1,714.26円）
収益分配金	1,270,816,580円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第87期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した29,134,343,767円（1万口当たり1,805.81円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,290,692,737円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,754,047,199円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	12,162,226,427円
分配準備積立金	14,218,070,141円
分配可能額	29,134,343,767円
（1万口当たり分配可能額）	（1,805.81円）
収益分配金	1,290,692,737円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第88期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した30,556,132,531円（1万口当たり1,899.57円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,286,863,993円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,780,744,242円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	12,461,468,674円
分配準備積立金	15,313,919,615円
分配可能額	30,556,132,531円
（1万口当たり分配可能額）	（1,899.57円）
収益分配金	1,286,863,993円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成29年1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成28年7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	113,310
投資信託受益証券	4,108,919,180
合計	4,109,032,490

当期（平成29年1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	12
投資信託受益証券	755,360,729
合計	755,360,717

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成28年7月19日現在	当期 平成29年1月16日現在
1口当たり純資産額 0.3987円 「1口 = 1円（10,000口 = 3,987円）」	1口当たり純資産額 0.4070円 「1口 = 1円（10,000口 = 4,070円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
----	----	----	----	-----	----

円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund BRL Class	182,172,147,514	64,324,985,287	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	457,242,305	465,518,390	
合計 2銘柄			182,629,389,819	64,790,503,677	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund BRL Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース(毎月分配型)」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,916,885	48,959,757
投資信託受益証券	1,203,312,046	1,376,332,479
親投資信託受益証券	14,974,055	14,422,522
流動資産合計	1,252,202,986	1,439,714,758
資産合計	1,252,202,986	1,439,714,758
負債の部		
流動負債		
未払金	-	5,467,660
未払収益分配金	20,421,823	21,986,985
未払解約金	8,575,445	736,928
未払受託者報酬	34,087	37,776
未払委託者報酬	1,647,715	1,826,158
その他未払費用	38,076	39,809
流動負債合計	30,717,146	30,095,316
負債合計	30,717,146	30,095,316
純資産の部		
元本等		
元本	2,917,403,402	3,140,997,881
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,695,917,562	1,731,378,439
（分配準備積立金）	199,308,760	321,015,225
元本等合計	1,221,485,840	1,409,619,442
純資産合計	1,221,485,840	1,409,619,442
負債純資産合計	1,252,202,986	1,439,714,758

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	255,841,352	295,802,718
受取利息	603	84
有価証券売買等損益	10,651,401	69,437,498
営業収益合計	245,190,554	226,365,304
営業費用		
支払利息	3,410	6,926

受託者報酬	190,826	199,450
委託者報酬	9,225,221	9,642,468
その他費用	38,092	39,812
営業費用合計	9,457,549	9,888,656
営業利益又は営業損失()	235,733,005	216,476,648
経常利益又は経常損失()	235,733,005	216,476,648
当期純利益又は当期純損失()	235,733,005	216,476,648
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	2,861,144	5,091,938
期首剰余金又は期首欠損金()	1,831,844,780	1,695,917,562
剰余金増加額又は欠損金減少額	253,370,305	282,765,108
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	253,370,305	282,765,108
剰余金減少額又は欠損金増加額	228,634,038	404,956,381
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	228,634,038	404,956,381
分配金	121,680,910	124,654,314
期末剰余金又は期末欠損金()	1,695,917,562	1,731,378,439

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	2,954,245,372円	2,917,403,402円
期中追加設定元本額	379,531,378円	705,333,826円
期中一部解約元本額	416,373,348円	481,739,347円
2. 受益権の総数	2,917,403,402口	3,140,997,881口
3. 元本の欠損		
	1,695,917,562円	1,731,378,439円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																				
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																				
<p>分配金の計算過程</p> <p>第77期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した321,010,797円（1万口当たり1,104.39円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,346,756円（1万口当たり70円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>39,276,223円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>189,465,748円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>92,268,826円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>321,010,797円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（1,104.39円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>20,346,756円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（70円）</td> </tr> </table> <p>第78期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した338,742,490円（1万口当たり1,172.28円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,227,269円（1万口当たり70円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>39,825,746円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>189,415,800円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>109,500,944円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>338,742,490円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	39,276,223円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	189,465,748円	分配準備積立金	92,268,826円	分配可能額	321,010,797円	（1万口当たり分配可能額）	（1,104.39円）	収益分配金	20,346,756円	（1万口当たり収益分配金）	（70円）	配当等収益 （費用控除後）	39,825,746円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	189,415,800円	分配準備積立金	109,500,944円	分配可能額	338,742,490円	<p>分配金の計算過程</p> <p>第83期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した453,319,846円（1万口当たり1,558.05円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,366,753円（1万口当たり70円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>44,356,419円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>214,097,283円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>194,866,144円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>453,319,846円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（1,558.05円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>20,366,753円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（70円）</td> </tr> </table> <p>第84期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した478,522,137円（1万口当たり1,642.79円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,389,998円（1万口当たり70円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>44,318,717円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>222,316,632円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>211,886,788円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>478,522,137円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	44,356,419円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	214,097,283円	分配準備積立金	194,866,144円	分配可能額	453,319,846円	（1万口当たり分配可能額）	（1,558.05円）	収益分配金	20,366,753円	（1万口当たり収益分配金）	（70円）	配当等収益 （費用控除後）	44,318,717円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	222,316,632円	分配準備積立金	211,886,788円	分配可能額	478,522,137円
配当等収益 （費用控除後）	39,276,223円																																																				
有価証券売買等損益	0円																																																				
収益調整金	189,465,748円																																																				
分配準備積立金	92,268,826円																																																				
分配可能額	321,010,797円																																																				
（1万口当たり分配可能額）	（1,104.39円）																																																				
収益分配金	20,346,756円																																																				
（1万口当たり収益分配金）	（70円）																																																				
配当等収益 （費用控除後）	39,825,746円																																																				
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																				
収益調整金	189,415,800円																																																				
分配準備積立金	109,500,944円																																																				
分配可能額	338,742,490円																																																				
配当等収益 （費用控除後）	44,356,419円																																																				
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																				
収益調整金	214,097,283円																																																				
分配準備積立金	194,866,144円																																																				
分配可能額	453,319,846円																																																				
（1万口当たり分配可能額）	（1,558.05円）																																																				
収益分配金	20,366,753円																																																				
（1万口当たり収益分配金）	（70円）																																																				
配当等収益 （費用控除後）	44,318,717円																																																				
有価証券売買等損益	0円																																																				
収益調整金	222,316,632円																																																				
分配準備積立金	211,886,788円																																																				
分配可能額	478,522,137円																																																				

（1万口当たり分配可能額）	(1,172.28円)
収益分配金	20,227,269円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第79期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した359,856,048円（1万口当たり1,244.95円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,233,677円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	41,010,957円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	191,415,021円
分配準備積立金	127,430,070円
分配可能額	359,856,048円
（1万口当たり分配可能額）	(1,244.95円)
収益分配金	20,233,677円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第80期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した378,175,757円（1万口当たり1,318.49円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,077,746円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	41,130,397円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	192,318,915円
分配準備積立金	144,726,445円
分配可能額	378,175,757円
（1万口当たり分配可能額）	(1,318.49円)
収益分配金	20,077,746円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第81期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した405,561,775円（1万口当たり1,393.43円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,373,639円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	42,154,804円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	200,087,955円
分配準備積立金	163,319,016円
分配可能額	405,561,775円
（1万口当たり分配可能額）	(1,393.43円)
収益分配金	20,373,639円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第82期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した430,328,405円（1万口当たり1,475.04円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,421,823円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	44,136,413円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	210,597,822円
分配準備積立金	175,594,170円
分配可能額	430,328,405円
（1万口当たり分配可能額）	(1,475.04円)
収益分配金	20,421,823円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

（1万口当たり分配可能額）	(1,642.79円)
収益分配金	20,389,998円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第85期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した500,183,909円（1万口当たり1,731.02円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,226,744円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	45,614,653円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	224,643,085円
分配準備積立金	229,926,171円
分配可能額	500,183,909円
（1万口当たり分配可能額）	(1,731.02円)
収益分配金	20,226,744円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第86期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した532,706,491円（1万口当たり1,822.80円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い120,457,277円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	47,226,261円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	236,379,836円
分配準備積立金	249,100,394円
分配可能額	532,706,491円
（1万口当たり分配可能額）	(1,822.80円)
収益分配金	20,457,277円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第87期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した583,326,868円（1万口当たり1,923.67円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い121,226,557円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	51,341,283円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	268,200,218円
分配準備積立金	263,785,367円
分配可能額	583,326,868円
（1万口当たり分配可能額）	(1,923.67円)
収益分配金	21,226,557円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

第88期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した635,696,320円（1万口当たり2,023.87円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い121,986,985円（1万口当たり70円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	52,929,824円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	292,694,110円
分配準備積立金	290,072,386円
分配可能額	635,696,320円
（1万口当たり分配可能額）	(2,023.87円)
収益分配金	21,986,985円
（1万口当たり収益分配金）	(70円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
----	------------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成29年1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期（平成28年7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,884
投資信託受益証券	73,629,170
合計	73,632,054

当期（平成29年1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	-
投資信託受益証券	1,864,167
合計	1,864,167

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期（自平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 平成28年7月19日現在	当期 平成29年1月16日現在
1口当たり純資産額 0.4187円 「1口 = 1円（10,000口 = 4,187円）」	1口当たり純資産額 0.4488円 「1口 = 1円（10,000口 = 4,488円）」

(4) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
----	----	----	----	-----	----

円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund ZAR Class	3,506,579,566	1,376,332,479	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	14,166,116	14,422,522	
合計		2銘柄	3,520,745,682	1,390,755,001	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund ZAR Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	378,342,482	317,606,230
投資信託受益証券	10,324,011,349	6,958,829,402
親投資信託受益証券	101,233,905	75,662,685
未収入金	39,775,117	32,682,680
流動資産合計	10,843,362,853	7,384,780,997
資産合計	10,843,362,853	7,384,780,997
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	198,088,388	170,417,154
未払解約金	94,408,188	48,835,345
未払受託者報酬	315,212	211,299
未払委託者報酬	15,235,443	10,213,257
その他未払費用	357,052	284,773
流動負債合計	308,404,283	229,961,828
負債合計	308,404,283	229,961,828
純資産の部		
元本等		
元本	24,761,048,548	21,302,144,278
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,226,089,978	14,147,325,109
（分配準備積立金）	179,119	626,642
元本等合計	10,534,958,570	7,154,819,169
純資産合計	10,534,958,570	7,154,819,169
負債純資産合計	10,843,362,853	7,384,780,997

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	985,753,647	632,069,078
受取利息	7,840	652
有価証券売買等損益	213,865,624	1,495,786,314
営業収益合計	1,199,627,111	863,716,584
営業費用		
支払利息	30,646	51,771

受託者報酬	1,948,335	1,425,427
委託者報酬	94,171,997	68,898,042
その他費用	357,215	284,806
営業費用合計	96,508,193	70,660,046
営業利益又は営業損失（ ）	1,103,118,918	934,376,630
経常利益又は経常損失（ ）	1,103,118,918	934,376,630
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,103,118,918	934,376,630
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	30,422,398	23,181,775
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	16,351,053,398	14,226,089,978
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,825,106,461	3,104,919,855
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,825,106,461	3,104,919,855
剰余金減少額又は欠損金増加額	491,843,376	1,039,927,028
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	491,843,376	1,039,927,028
分配金	1,280,996,185	1,075,033,103
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,226,089,978	14,147,325,109

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	28,874,412,148円	24,761,048,548円
期中追加設定元本額	878,452,278円	1,677,056,706円
期中一部解約元本額	4,991,815,878円	5,135,960,976円
2. 受益権の総数	24,761,048,548口	21,302,144,278口
3. 元本の欠損	14,226,089,978円	14,147,325,109円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																
<p>分配金の計算過程</p> <p>第77期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した4,915,953,323円（1万口当たり1,739.62円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い226,070,160円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>182,283,707円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>4,416,390,236円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>317,279,380円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>4,915,953,323円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（1,739.62円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>226,070,160円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（80円）</td> </tr> </table> <p>第78期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した4,751,004,625円（1万口当たり1,718.97円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い221,109,133円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>163,866,526円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>4,320,510,900円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>266,627,199円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	182,283,707円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	4,416,390,236円	分配準備積立金	317,279,380円	分配可能額	4,915,953,323円	（1万口当たり分配可能額）	（1,739.62円）	収益分配金	226,070,160円	（1万口当たり収益分配金）	（80円）	配当等収益 （費用控除後）	163,866,526円	有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	4,320,510,900円	分配準備積立金	266,627,199円	<p>分配金の計算過程</p> <p>第83期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した3,770,214,217円（1万口当たり1,582.81円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い190,558,528円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>110,343,372円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>3,659,633,412円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>237,433円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>3,770,214,217円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（1,582.81円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>190,558,528円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（80円）</td> </tr> </table> <p>第84期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した3,611,373,435円（1万口当たり1,547.22円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い186,728,563円（1万口当たり80円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>103,527,762円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>3,506,744,099円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>1,101,574円</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	110,343,372円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	3,659,633,412円	分配準備積立金	237,433円	分配可能額	3,770,214,217円	（1万口当たり分配可能額）	（1,582.81円）	収益分配金	190,558,528円	（1万口当たり収益分配金）	（80円）	配当等収益 （費用控除後）	103,527,762円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	3,506,744,099円	分配準備積立金	1,101,574円
配当等収益 （費用控除後）	182,283,707円																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																
収益調整金	4,416,390,236円																																																
分配準備積立金	317,279,380円																																																
分配可能額	4,915,953,323円																																																
（1万口当たり分配可能額）	（1,739.62円）																																																
収益分配金	226,070,160円																																																
（1万口当たり収益分配金）	（80円）																																																
配当等収益 （費用控除後）	163,866,526円																																																
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																
収益調整金	4,320,510,900円																																																
分配準備積立金	266,627,199円																																																
配当等収益 （費用控除後）	110,343,372円																																																
有価証券売買等損益	0円																																																
収益調整金	3,659,633,412円																																																
分配準備積立金	237,433円																																																
分配可能額	3,770,214,217円																																																
（1万口当たり分配可能額）	（1,582.81円）																																																
収益分配金	190,558,528円																																																
（1万口当たり収益分配金）	（80円）																																																
配当等収益 （費用控除後）	103,527,762円																																																
有価証券売買等損益	0円																																																
収益調整金	3,506,744,099円																																																
分配準備積立金	1,101,574円																																																

分配可能額	4,751,004,625円
（1万口当たり分配可能額）	（1,718.97円）
収益分配金	221,109,133円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第79期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した4,593,821,558円（1万口当たり1,700.93円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い216,061,309円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	167,131,865円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	4,223,134,290円
分配準備積立金	203,555,403円
分配可能額	4,593,821,558円
（1万口当たり分配可能額）	（1,700.93円）
収益分配金	216,061,309円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第80期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した4,472,305,265円（1万口当たり1,674.96円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い213,607,498円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	144,119,410円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	4,176,042,875円
分配準備積立金	152,142,980円
分配可能額	4,472,305,265円
（1万口当たり分配可能額）	（1,674.96円）
収益分配金	213,607,498円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第81期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した4,242,051,189円（1万口当たり1,646.92円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い206,059,697円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	133,377,362円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	4,029,385,381円
分配準備積立金	79,288,446円
分配可能額	4,242,051,189円
（1万口当たり分配可能額）	（1,646.92円）
収益分配金	206,059,697円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第82期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した4,002,479,229円（1万口当たり1,616.44円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い198,088,388円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	122,412,502円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	3,873,542,657円
分配準備積立金	6,524,070円
分配可能額	4,002,479,229円
（1万口当たり分配可能額）	（1,616.44円）
収益分配金	198,088,388円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

分配可能額	3,611,373,435円
（1万口当たり分配可能額）	（1,547.22円）
収益分配金	186,728,563円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第85期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した3,398,092,779円（1万口当たり1,507.46円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い180,334,193円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	90,502,101円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	3,305,519,139円
分配準備積立金	2,071,539円
分配可能額	3,398,092,779円
（1万口当たり分配可能額）	（1,507.46円）
収益分配金	180,334,193円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第86期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した3,216,886,348円（1万口当たり1,469.13円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い175,172,772円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	91,095,149円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	3,125,520,755円
分配準備積立金	270,444円
分配可能額	3,216,886,348円
（1万口当たり分配可能額）	（1,469.13円）
収益分配金	175,172,772円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第87期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した3,071,447,242円（1万口当たり1,430.06円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い171,821,893円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	87,511,562円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	2,982,260,889円
分配準備積立金	1,674,791円
分配可能額	3,071,447,242円
（1万口当たり分配可能額）	（1,430.06円）
収益分配金	171,821,893円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

第88期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した2,958,803,565円（1万口当たり1,388.97円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い170,417,154円（1万口当たり80円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	82,556,687円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	2,872,968,346円
分配準備積立金	3,278,532円
分配可能額	2,958,803,565円
（1万口当たり分配可能額）	（1,388.97円）
収益分配金	170,417,154円
（1万口当たり収益分配金）	（80円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期
	自 平成28年 7月20日 至 平成29年 1月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成29年 1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期（平成28年7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	19,875
投資信託受益証券	163,190,466
合計	163,210,341

当期（平成29年1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3
投資信託受益証券	521,956,491
合計	521,956,494

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期（自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 平成28年 7月19日現在	当期 平成29年 1月16日現在
1口当たり純資産額 0.4255円 「1口 = 1円 (10,000口 = 4,255円)」	1口当たり純資産額 0.3359円 「1口 = 1円 (10,000口 = 3,359円)」

(4) 附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund TRY Class	18,833,097,165	6,958,829,402	
	親投資信託受益証券	キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	74,317,538	75,662,685	
合計 2銘柄			18,907,414,703	7,034,492,087	

< 参考 >

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund TRY Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）

(1) 貸借対照表

区分	前期 平成28年7月19日現在 金額（円）	当期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,360,788	4,833,848
投資信託受益証券	320,738,067	306,047,865
親投資信託受益証券	2,587,936	2,199,198
未収入金	9,133,777	-
流動資産合計	337,820,568	313,080,911
資産合計	337,820,568	313,080,911
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	990,520	898,181
未払解約金	10,435,763	386,920
未払受託者報酬	9,573	8,597
未払委託者報酬	462,972	416,061
その他未払費用	11,502	9,832
流動負債合計	11,910,330	1,719,591
負債合計	11,910,330	1,719,591
純資産の部		
元本等		
元本	247,630,197	224,545,264
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	78,280,041	86,816,056
（分配準備積立金）	54,071,158	52,401,995
元本等合計	325,910,238	311,361,320
純資産合計	325,910,238	311,361,320
負債純資産合計	337,820,568	313,080,911

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	当期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	15,483,746	12,614,743
受取利息	210	20
有価証券売買等損益	2,692,469	10,670,658
営業収益合計	12,791,487	23,285,421
営業費用		
支払利息	830	1,306

受託者報酬	57,929	49,598
委託者報酬	2,802,112	2,399,021
その他費用	11,504	9,833
営業費用合計	2,872,375	2,459,758
営業利益又は営業損失（ ）	9,919,112	20,825,663
経常利益又は経常損失（ ）	9,919,112	20,825,663
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,919,112	20,825,663
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,726,150	115,566
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	94,486,480	78,280,041
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,432,554	2,696,663
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,432,554	2,696,663
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,494,099	9,536,560
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,494,099	9,536,560
分配金	6,337,856	5,565,317
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	78,280,041	86,816,056

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において確定分配金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	305,542,340円	247,630,197円
期中追加設定元本額	7,230,230円	7,855,144円
期中一部解約元本額	65,142,373円	30,940,077円
2. 受益権の総数	247,630,197口	224,545,264口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																																																
自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日	自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日																																																																
<p>分配金の計算過程</p> <p>第70期計算期間末（平成28年2月16日）に、投資信託約款に基づき計算した186,596,462円（1万口当たり6,809.65円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,096,071円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,710,179円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>129,957,044円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>53,929,239円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>186,596,462円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,809.65円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>1,096,071円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（40円）</td></tr> </table> <p>第71期計算期間末（平成28年3月16日）に、投資信託約款に基づき計算した187,231,153円（1万口当たり6,857.47円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い11,092,129円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>2,396,206円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>129,600,068円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>55,234,879円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>187,231,153円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（6,857.47円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>1,092,129円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（40円）</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	2,710,179円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	129,957,044円	分配準備積立金	53,929,239円	分配可能額	186,596,462円	（1万口当たり分配可能額）	（6,809.65円）	収益分配金	1,096,071円	（1万口当たり収益分配金）	（40円）	配当等収益（費用控除後）	2,396,206円	有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円	収益調整金	129,600,068円	分配準備積立金	55,234,879円	分配可能額	187,231,153円	（1万口当たり分配可能額）	（6,857.47円）	収益分配金	1,092,129円	（1万口当たり収益分配金）	（40円）	<p>分配金の計算過程</p> <p>第76期計算期間末（平成28年8月16日）に、投資信託約款に基づき計算した170,131,590円（1万口当たり7,052.14円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1964,993円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>1,803,141円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>115,747,686円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>52,580,763円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>170,131,590円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（7,052.14円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>964,993円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（40円）</td></tr> </table> <p>第77期計算期間末（平成28年9月16日）に、投資信託約款に基づき計算した168,627,156円（1万口当たり7,083.65円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1952,204円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益（費用控除後）</td><td>1,697,715円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td>0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td>114,336,951円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>52,592,490円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td>168,627,156円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td>（7,083.65円）</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>952,204円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td>（40円）</td></tr> </table>	配当等収益（費用控除後）	1,803,141円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	115,747,686円	分配準備積立金	52,580,763円	分配可能額	170,131,590円	（1万口当たり分配可能額）	（7,052.14円）	収益分配金	964,993円	（1万口当たり収益分配金）	（40円）	配当等収益（費用控除後）	1,697,715円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	114,336,951円	分配準備積立金	52,592,490円	分配可能額	168,627,156円	（1万口当たり分配可能額）	（7,083.65円）	収益分配金	952,204円	（1万口当たり収益分配金）	（40円）
配当等収益（費用控除後）	2,710,179円																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																
収益調整金	129,957,044円																																																																
分配準備積立金	53,929,239円																																																																
分配可能額	186,596,462円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	（6,809.65円）																																																																
収益分配金	1,096,071円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	（40円）																																																																
配当等収益（費用控除後）	2,396,206円																																																																
有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円																																																																
収益調整金	129,600,068円																																																																
分配準備積立金	55,234,879円																																																																
分配可能額	187,231,153円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	（6,857.47円）																																																																
収益分配金	1,092,129円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	（40円）																																																																
配当等収益（費用控除後）	1,803,141円																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																
収益調整金	115,747,686円																																																																
分配準備積立金	52,580,763円																																																																
分配可能額	170,131,590円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	（7,052.14円）																																																																
収益分配金	964,993円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	（40円）																																																																
配当等収益（費用控除後）	1,697,715円																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																
収益調整金	114,336,951円																																																																
分配準備積立金	52,592,490円																																																																
分配可能額	168,627,156円																																																																
（1万口当たり分配可能額）	（7,083.65円）																																																																
収益分配金	952,204円																																																																
（1万口当たり収益分配金）	（40円）																																																																

第72期計算期間末（平成28年4月18日）に、投資信託約款に基づき計算した186,424,623円（1万口当たり6,897.14円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,081,171円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,148,747円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	128,418,713円
分配準備積立金	55,857,163円
分配可能額	186,424,623円
（1万口当たり分配可能額）	(6,897.14円)
収益分配金	1,081,171円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第73期計算期間末（平成28年5月16日）に、投資信託約款に基づき計算した181,805,278円（1万口当たり6,938.18円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,048,143円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	2,112,451円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	124,592,168円
分配準備積立金	55,100,659円
分配可能額	181,805,278円
（1万口当たり分配可能額）	(6,938.18円)
収益分配金	1,048,143円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第74期計算期間末（平成28年6月16日）に、投資信託約款に基づき計算した179,596,821円（1万口当たり6,975.83円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1,029,822円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,987,758円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	123,312,405円
分配準備積立金	54,296,658円
分配可能額	179,596,821円
（1万口当たり分配可能額）	(6,975.83円)
収益分配金	1,029,822円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第75期計算期間末（平成28年7月19日）に、投資信託約款に基づき計算した173,762,830円（1万口当たり7,017.03円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い990,520円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,997,887円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	118,701,152円
分配準備積立金	53,063,791円
分配可能額	173,762,830円
（1万口当たり分配可能額）	(7,017.03円)
収益分配金	990,520円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第78期計算期間末（平成28年10月17日）に、投資信託約款に基づき計算した169,141,523円（1万口当たり7,121.51円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い950,031円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,846,953円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	114,349,528円
分配準備積立金	52,945,042円
分配可能額	169,141,523円
（1万口当たり分配可能額）	(7,121.51円)
収益分配金	950,031円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第79期計算期間末（平成28年11月16日）に、投資信託約款に基づき計算した162,071,531円（1万口当たり7,155.94円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い905,941円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,670,507円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	109,242,016円
分配準備積立金	51,159,008円
分配可能額	162,071,531円
（1万口当たり分配可能額）	(7,155.94円)
収益分配金	905,941円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第80期計算期間末（平成28年12月16日）に、投資信託約款に基づき計算した161,014,682円（1万口当たり7,204.50円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い893,967円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,974,378円
有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）	0円
収益調整金	107,962,405円
分配準備積立金	51,077,899円
分配可能額	161,014,682円
（1万口当たり分配可能額）	(7,204.50円)
収益分配金	893,967円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

第81期計算期間末（平成29年1月16日）に、投資信託約款に基づき計算した162,677,151円（1万口当たり7,244.74円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い898,181円（1万口当たり40円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	1,797,477円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	109,376,975円
分配準備積立金	51,502,699円
分配可能額	162,677,151円
（1万口当たり分配可能額）	(7,244.74円)
収益分配金	898,181円
（1万口当たり収益分配金）	(40円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自平成28年7月20日 至平成29年1月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、投資信託受益証券においては、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成29年1月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成28年7月19日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	506
投資信託受益証券	4,990,851
合計	4,991,357

当期（平成29年1月16日現在）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	-
投資信託受益証券	1,100,458
合計	1,100,458

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

当期（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成28年7月19日現在	当期 平成29年1月16日現在
1口当たり純資産額 1.3161円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,161円）」	1口当たり純資産額 1.3866円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,866円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	投資信託受益証券	TRP Global Emerging Markets Bond Fund CNY Class	314,734,539	306,047,865	

	親投資信託 受益証券	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド	2,160,101	2,199,198	
	合計 2銘柄		316,894,640	308,247,063	

<参考>

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

当ファンドは、「TRP Global Emerging Markets Bond Fund CNY Class」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、この投資信託の受益証券であり、ケイマン籍の円建て外国投資信託です。

これらのファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド（マネープールファンド）

(1) 貸借対照表

区分	第14期 平成28年7月19日現在 金額（円）	第15期 平成29年1月16日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,049,341,088	818,317,507
未収入金	10,692,117	14,220,458
流動資産合計	1,060,033,205	832,537,965
資産合計	1,060,033,205	832,537,965
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,693,116	15,639,701
未払受託者報酬	5,724	-
未払委託者報酬	52,036	-
その他未払費用	31,825	31,282
流動負債合計	10,782,701	15,670,983
負債合計	10,782,701	15,670,983
純資産の部		
元本等		
元本	1,046,509,425	815,156,779
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,741,079	1,710,203
（分配準備積立金）	5,616,916	6,716,494
元本等合計	1,049,250,504	816,866,982
純資産合計	1,049,250,504	816,866,982
負債純資産合計	1,060,033,205	832,537,965

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	第14期 自 平成28年1月19日 至 平成28年7月19日 金額（円）	第15期 自 平成28年7月20日 至 平成29年1月16日 金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	494,802	508,872
営業収益合計	494,802	508,872
営業費用		
受託者報酬	5,724	-
委託者報酬	52,036	-
その他費用	31,825	31,282
営業費用合計	89,585	31,282
営業利益又は営業損失（ ）	405,217	540,154
経常利益又は経常損失（ ）	405,217	540,154

当期純利益又は当期純損失()	405,217	540,154
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	57,202	185,951
期首剰余金又は期首欠損金()	2,474,195	2,741,079
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,133,173	581,995
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,133,173	581,995
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,214,304	1,258,668
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,214,304	1,258,668
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	2,741,079	1,710,203

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第15期	
	自 平成28年7月20日	至 平成29年1月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、前計算期末が休日のため、平成28年7月20日から平成29年1月16日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期
	平成28年7月19日現在	平成29年1月16日現在
1. 元本状況		
期首元本額	1,112,849,781円	1,046,509,425円
期中追加設定元本額	477,507,834円	254,893,689円
期中一部解約元本額	543,848,190円	486,246,335円
2. 受益権の総数	1,046,509,425口	815,156,779口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期	第15期
自 平成28年1月19日	自 平成28年7月20日
至 平成28年7月19日	至 平成29年1月16日
分配金の計算過程 該当事項はありません。	分配金の計算過程 該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第15期	
	自 平成28年7月20日	至 平成29年1月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期	
	平成29年1月16日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第14期（平成28年7月19日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	407,034
合計	407,034

第15期（平成29年1月16日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	336,555
合計	336,555

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第14期（平成28年7月19日現在）

該当事項はありません。

第15期（平成29年1月16日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期（自平成28年7月20日 至 平成29年1月16日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第14期 平成28年7月19日現在	第15期 平成29年1月16日現在
1口当たり純資産額 1.0026円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,026円）」	1口当たり純資産額 1.0021円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,021円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	キャッシュ・マネジメント・マ ザーファンド	803,769,283	818,317,507	
合計 1銘柄			803,769,283	818,317,507	

< 参考 >

当ファンドは、「キャッシュ・マネジメント・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの状況は、前記「エマージング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成29年2月末現在)

エマージング・ボンド・ファンド・円コース(毎月分配型)

資産総額	13,203,490,794 円
負債総額	23,745,184 円
純資産総額(-)	13,179,745,610 円
発行済数量	18,656,841,430 口
1単位当り純資産額(/)	0.7064 円

エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース(毎月分配型)

資産総額	40,672,293,347 円
負債総額	137,489,718 円
純資産総額(-)	40,534,803,629 円
発行済数量	79,576,806,972 口
1単位当り純資産額(/)	0.5094 円

エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース(毎月分配型)

資産総額	1,720,192,616 円
負債総額	6,307,536 円
純資産総額(-)	1,713,885,080 円
発行済数量	1,732,949,554 口
1単位当り純資産額(/)	0.9890 円

エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース(毎月分配型)

資産総額	66,278,511,864 円
負債総額	288,129,206 円
純資産総額(-)	65,990,382,658 円
発行済数量	159,853,062,303 口
1単位当り純資産額(/)	0.4128 円

エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース(毎月分配型)

資産総額	1,631,850,319 円
負債総額	2,318,749 円
純資産総額(-)	1,629,531,570 円
発行済数量	3,550,228,096 口
1単位当り純資産額(/)	0.4590 円

エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース(毎月分配型)

資産総額	8,319,205,000 円
負債総額	162,180,226 円
純資産総額(-)	8,157,024,774 円
発行済数量	23,728,555,371 口
1単位当り純資産額(/)	0.3438 円

エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース(毎月分配型)

資産総額	299,739,420 円
負債総額	170,253 円
純資産総額(-)	299,569,167 円
発行済数量	216,932,693 口
1単位当り純資産額(/)	1.3809 円

エマージング・ボンド・ファンド(マネーボールファンド)

資産総額	776,514,770 円
負債総額	1,606,139 円
純資産総額(-)	774,908,631 円
発行済数量	773,444,505 口
1単位当り純資産額(/)	1.0019 円

(参考) キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

資産総額	4,636,566,609 円
負債総額	506,733,446 円
純資産総額(-)	4,129,833,163 円
発行済数量	4,057,103,837 口
1単位当り純資産額(/)	1.0179 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1 委託会社等の概況

(1) 資本金の額

資本金の額：20億円（平成29年2月末現在）

会社が発行する株式総数：12,800,000株

発行済株式総数：3,850,000株

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社は、10名以内で構成される取締役により運営されます。取締役は、株主総会の決議によって選任されます。取締役の選任は、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上を有する株主が出席し、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上をもってこれを行います。

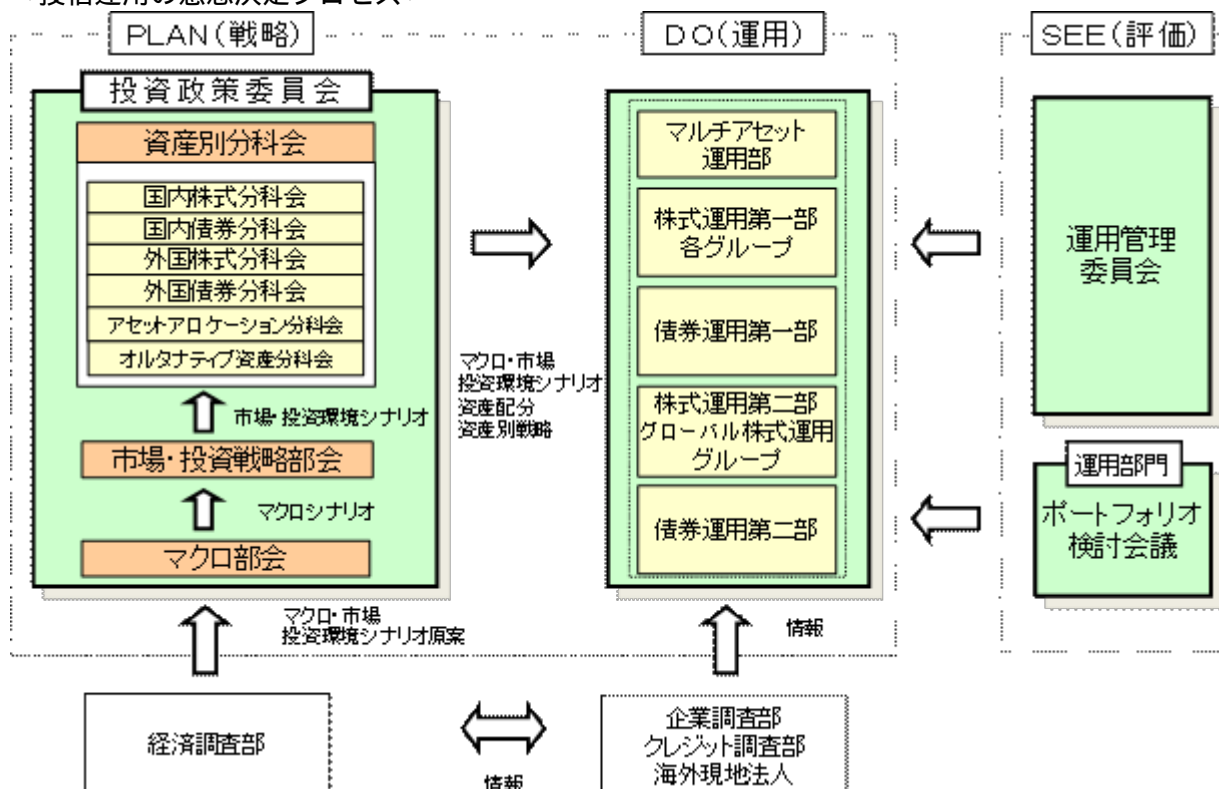
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、取締役会の決議によって取締役の中から取締役社長、取締役副社長各1名、専務取締役および常務取締役若干名を選定することができます。また代表取締役は2名とし、取締役社長および取締役副社長がこれに就任します。ただし、取締役副社長を置かない場合、専務取締役から代表取締役1名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、代表取締役が招集し、招集通知は3日前までにこれを発します。ただし、緊急の必要があるときは、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に定める事項の他、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の3分の2以上が出席し、その8分の5以上をもって行います。

< 投信運用の意思決定プロセス >



2 事業の内容及び営業の概況

委託会社は、株式会社住友銀行（現株式会社三井住友フィナンシャルグループ）および大和証券株式会社（現株式会社大和証券グループ本社）の戦略的提携により平成11年4月1日付で、大和投資顧問株式会

社と住銀投資顧問株式会社およびエス・ビー・アイ・エム投信株式会社の三社が合併して設立された会社です。

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成29年2月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、397本であり、その純資産総額は、約3,386,856百万円です（なお、親投資信託134本は、ファンド数及び純資産総額からは除いております。）。

種類	ファンド数	純資産総額
単位型株式投資信託	32	101,328百万円
追加型株式投資信託	293	2,931,032百万円
単位型公社債投資信託	72	354,495百万円
合計	397	3,386,856百万円

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

- 1 . 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）により作成しております。
また、委託会社の間接財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号。）により作成しております。
- 2 . 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 3 . 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第44期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表及び、第45期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	19,107,074	22,725,768
前払費用	198,366	195,917
未収委託者報酬	3,278,499	3,678,543
未収運用受託報酬	1,001,357	957,351
未収収益	15,862	12,713
繰延税金資産	559,646	644,694
その他	7,378	824
流動資産計	24,168,184	28,215,813
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 135,473	110,648
器具備品	1 48,230	80,498
土地	710	710
リース資産	1 6,166	10,102
有形固定資産計	190,580	201,959
無形固定資産		
ソフトウェア	105,376	95,535
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	118,082	108,242
投資その他の資産		
投資有価証券	5,298,347	5,480,557
関係会社株式	1,169,774	956,115
従業員長期貸付金	3,738	2,428
長期差入保証金	510,636	511,355
出資金	82,660	82,660
繰延税金資産	561,097	556,611
その他	2,190	1,567
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産計	7,607,693	7,570,543
固定資産計	7,916,356	7,880,745
資産合計	32,084,541	36,096,558

(単位：千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,042	3,565
未払金	53,907	85,383
未払手数料	1,519,563	1,620,526
未払費用	1,178,272	1,178,517
未払法人税等	1,515,891	1,923,850
未払消費税等	620,431	323,266
賞与引当金	1,220,900	1,498,000
役員賞与引当金	87,600	101,000
業務委託関連引当金	-	25,700
その他	29,244	20,860
流動負債計	6,228,853	6,780,670
固定負債		
リース債務	3,527	7,280
退職給付引当金	1,459,244	1,546,322
役員退職慰労引当金	148,160	100,350
固定負債計	1,610,931	1,653,953
負債合計	7,839,785	8,434,623

(単位：千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		

別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	20,569,363	24,034,752
利益剰余金合計	22,013,094	25,478,483
株主資本合計	24,169,363	27,634,752
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	75,392	27,182
評価・換算差額等合計	75,392	27,182
純資産合計	24,244,756	27,661,934
負債純資産合計	32,084,541	36,096,558

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	3,613,731	4,608,029
委託者報酬	30,077,141	33,183,045
その他営業収益	54,133	45,653
営業収益計	33,745,007	37,836,728
営業費用		
支払手数料	14,599,540	15,893,270
広告宣伝費	172,450	168,848
公告費	-	1,028
調査費		
調査費	1,225,517	1,315,033
委託調査費	3,858,570	3,914,869
委託計算費	166,866	193,638
営業雑経費		
通信費	35,132	31,664
印刷費	465,810	523,643
協会費	23,810	23,203
諸会費	2,207	2,545
その他	48,630	63,792
営業費用計	20,598,538	22,131,536
一般管理費		
給料		
役員報酬	201,630	191,952
給料・手当	2,893,443	2,916,345

賞与	99,464	108,042
退職金	4,787	7,113
福利厚生費	644,228	683,822
交際費	17,830	19,339
旅費交通費	149,324	165,319
租税公課	91,224	136,339
不動産賃借料	627,983	635,313
退職給付費用	225,474	226,884
固定資産減価償却費	58,879	55,907
賞与引当金繰入額	1,174,402	1,498,000
役員退職慰労引当金繰入額	38,530	37,270
役員賞与引当金繰入額	86,300	101,100
諸経費	250,480	279,901
一般管理費計	6,563,983	7,062,654
営業利益	6,582,484	8,642,537
営業外収益		
受取配当金	18,215	17,230
受取利息	3,072	4,001
投資有価証券売却益	71,459	62,103
為替差益	397	106
その他	12,418	13,069
営業外収益計	105,563	96,510
営業外費用		
投資有価証券売却損	764	5,968
営業外費用計	764	5,968
経常利益	6,687,284	8,733,078
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	400	-
特別利益計	400	-
特別損失		
関係会社株式評価損	-	213,659
業務委託関連引当金繰入	-	25,700
固定資産除却損	95	4,215
割増退職金	7,785	-
特別損失計	7,881	243,574
税引前当期純利益	6,679,803	8,489,504
法人税、住民税及び事業税	2,602,339	3,016,713
法人税等調整額	53,385	56,198

法人税等合計	2,548,953	2,960,515
当期純利益	4,130,849	5,528,988

(3) 株主資本等変動計算書

第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,953,563
当期変動額						
剰余金の配当						3,515,050
当期純利益						4,130,849
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	615,799
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	20,569,363

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	21,397,294	23,553,563	3,001	3,001	23,556,565
当期変動額					
剰余金の配当	3,515,050	3,515,050			3,515,050
当期純利益	4,130,849	4,130,849			4,130,849
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			72,391	72,391	72,391
当期変動額合計	615,799	615,799	72,391	72,391	688,190
当期末残高	22,013,094	24,169,363	75,392	75,392	24,244,756

第44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	20,569,363
当期変動額						
剰余金の配当						2,063,600
当期純利益						5,528,988
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						

当期変動額合計	-	-	-	-	-	3,465,388
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	24,034,752

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	22,013,094	24,169,363	75,392	75,392	24,244,756
当期変動額					
剰余金の配当	2,063,600	2,063,600			2,063,600
当期純利益	5,528,988	5,528,988			5,528,988
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)			48,210	48,210	48,210
当期変動額合計	3,465,388	3,465,388	48,210	48,210	3,417,178
当期末残高	25,478,483	27,634,752	27,182	27,182	27,661,934

[前へ](#) [次へ](#)

注記事項

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。）を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 15～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p> <p>(6) 業務委託関連引当金 一部業務を外部委託するに当たり、当社が負担する従業員費用等の支出に備えるため合理的に発生すると見込まれる費用を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

(貸借対照表関係)

第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
----------------------	----------------------

1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	416,284千円	建物	438,341千円
器具備品	241,990千円	器具備品	272,516千円
リース資産	10,452千円	リース資産	13,775千円
2.保証債務		2.保証債務	
被保証者	従業員	被保証者	従業員
被保証債務の内容	住宅ローン	被保証債務の内容	住宅ローン
金額	7,139千円	金額	2,945千円

(株主資本等変動計算書関係)

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

(単位：千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月24日 定時株主総会	普通株式	3,515,050	913	平成26年3月31日	平成26年6月25日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月24日 定時株主総会	普通 株式	2,063,600	利益 剰余金	536	平成27年3月31日	平成27年6月25日

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

(単位：千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月24日 定時株主総会	普通株式	2,063,600	536	平成27年3月31日	平成27年6月25日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,764,300	利益 剰余金	718	平成28年3月31日	平成28年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

また、デリバティブ取引についても行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（注2）を参照ください）。

第43期（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	19,107,074	19,107,074	-
(2) 未収委託者報酬	3,278,499	3,278,499	-
(3) 未収運用受託報酬	1,001,357	1,001,357	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,247,212	5,247,212	-
資産計	28,634,143	28,634,143	-
(1) 未払手数料	1,519,563	1,519,563	-
(2) 未払費用（*1）	926,569	926,569	-

負債計	2,446,132	2,446,132	-
-----	-----------	-----------	---

(*1) 金融商品に該当するものを表示しております。

第44期(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,725,768	22,725,768	-
(2) 未収委託者報酬	3,678,543	3,678,543	-
(3) 未収運用受託報酬	957,351	957,351	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,429,421	5,429,421	-
資産計	32,791,085	32,791,085	-
(1) 未払手数料	1,620,526	1,620,526	-
(2) 未払費用(*1)	917,268	917,268	-
負債計	2,537,794	2,537,794	-

(*1) 金融商品に該当するものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(4) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	第43期(平成27年3月31日)	第44期(平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	1,169,774	956,115
(3) 長期差入保証金	510,636	511,355

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) その他有価証券の非上場株式については

2. (4) 投資有価証券には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第43期(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	19,107,074	-	-	-
未収委託者報酬	3,278,499	-	-	-
未収運用受託報酬	1,001,357	-	-	-
投資有価証券				

その他有価証券のうち満期があるもの	428,800	2,113,200	149,744	-
合計	23,815,730	2,113,200	149,744	-

第44期（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	22,725,768	-	-	-
未収委託者報酬	3,678,543	-	-	-
未収運用受託報酬	957,351	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期のあるもの	-	2,106,635	236,275	-
合計	27,361,663	2,106,635	236,275	-

（有価証券関係）

1. 子会社株式

第43期（平成27年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 1,169,774千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第44期（平成28年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第43期（平成27年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,086,552	2,925,460	161,092
小計	3,086,552	2,925,460	161,092
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	2,160,660	2,210,000	49,340
小計	2,160,660	2,210,000	49,340
合計	5,247,212	5,135,460	111,752

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第44期（平成28年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	2,768,399	2,640,700	127,699
小計	2,768,399	2,640,700	127,699

貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	2,661,022	2,749,542	88,520
小計	2,661,022	2,749,542	88,520
合計	5,429,421	5,390,242	39,178

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	2,494,198	71,459	764

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	728,134	62,103	5,968

4. 減損処理を行った有価証券

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当事業年度において、関係会社株式について213,659千円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	第43期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第44期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	1,391,001	1,459,244
退職給付費用	162,604	162,311
退職給付の支払額	122,316	75,233
その他	27,955	-
退職給付引当金の期末残高	1,459,244	1,546,322

（注）その他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

（2）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	第43期 （平成27年3月31日）	第44期 （平成28年3月31日）
積立型制度の退職給付債務	-	-

年金資産	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,459,244	1,546,322
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,459,244	1,546,322
退職給付引当金	1,459,244	1,546,322
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,459,244	1,546,322

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第43期 162,604千円 第44期 162,311千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第43期は62,870千円、第44期は64,573千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	107,110	119,355
賞与引当金	404,117	462,282
社会保険料	33,528	31,640
未払事業所税	4,550	4,486
その他	19,871	26,929
繰延税金資産合計	569,179	644,694
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	9,532	-
繰延税金負債合計	9,532	-
繰延税金資産の純額	559,646	644,694
(2) 固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	471,999	473,920
投資有価証券	2,243	67,546
ゴルフ会員権	11,618	11,000
役員退職慰労引当金	48,561	30,899
その他	67,362	63,787
繰延税金資産小計	601,785	647,154
評価性引当額	13,861	78,546
繰延税金資産合計	587,924	568,607
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	26,826	11,996
繰延税金負債合計	26,826	11,996
繰延税金資産の純額	561,097	556,611

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	第43期 (平成27年3月31日)	第44期 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.60%	33.10%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.56%	0.47%
住民税均等割等	0.06%	0.04%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.22%	0.95%
特定外国子会社等留保課税	0.46%	0.31%
税額控除	-	0.46%
その他	0.26%	0.46%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.16%	34.87%

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。

これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の33.10%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額が81,319千円減少し、法人税等調整額が80,645千円、その他有価証券評価差額金が673千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	30,077,141	3,613,731	54,133	33,745,007

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	33,183,045	4,608,029	45,653	37,836,728

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

第43期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事 者 との関係	取引の内 容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証 券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	5,383,745	未払 手数料	555,261
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	2,695,822	未払 手数料	344,291

取引条件及び取引条件の決定方針等

1 投資信託に係る事務代 hands 手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第44期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 割合	関連当事 者との関係	取引の内 容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の 関係 会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	5,745,272	未払手数料	451,175
その他の 関係 会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	2,730,584	未払手数料	436,102

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

（1株当たり情報）

	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	6,297円34銭	7,184円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,072円95銭	1,436円10銭

(注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第43期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第44期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(千円)	4,130,849	5,528,988
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,130,849	5,528,988
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,403,442
前払費用		174,052
未収委託者報酬		3,194,847
未収運用受託報酬		1,169,249
未収収益		11,212
繰延税金資産		319,200
流動資産計		23,272,005
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	101,567
器具備品	1	71,189
土地		710
リース資産	1	12,687
有形固定資産計		186,153
無形固定資産		
投資その他の資産		
投資有価証券		7,578,136
関係会社株式		956,115
従業員長期貸付金		301
長期差入保証金		511,994
出資金		82,660
繰延税金資産		529,235
その他		356
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産計		9,638,048
固定資産計		9,918,550
資産合計		33,190,556

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
--	--	-------------------------

負債の部

流動負債

リース債務	4,092
未払金	170,532
未払手数料	1,384,083
未払費用	1,130,930
未払法人税等	779,479
未払消費税等	129,602
前受収益	50,427
賞与引当金	706,000
役員賞与引当金	44,600
その他	25,087
流動負債計	4,424,835
固定負債	
リース債務	9,556
退職給付引当金	1,472,159
役員退職慰労引当金	74,475
固定負債計	1,556,191
負債合計	5,981,027

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

純資産の部

株主資本

資本金	2,000,000
-----	-----------

資本剰余金

資本準備金	156,268
-------	---------

資本剰余金合計	156,268
---------	---------

利益剰余金

利益準備金	343,731
-------	---------

その他利益剰余金

別途積立金	1,100,000
-------	-----------

繰越利益剰余金	23,624,772
---------	------------

利益剰余金合計	25,068,503
---------	------------

株主資本合計

株主資本合計	27,224,772
--------	------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	15,242
--------------	--------

評価・換算差額等合計	15,242
------------	--------

純資産合計	27,209,529
負債純資産合計	33,190,556

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

当中間会計期間	
(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	14,366,017
運用受託報酬	2,079,955
その他営業収益	18,316
営業収益計	16,464,289
営業費用	9,571,524
一般管理費	1 3,477,200
営業利益	3,415,565
営業外収益	
受取配当金	1,724
受取利息	600
投資有価証券売却益	6,000
雑収入	4,168
営業外収益計	12,493
営業外費用	
投資有価証券売却損	106
為替差損	491
営業外費用計	598
経常利益	3,427,460
税引前中間純利益	3,427,460
法人税、住民税及び事業税	701,547
法人税等調整額	371,592
法人税等合計	1,073,140
中間純利益	2,354,320

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金

当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	24,034,752
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,764,300
中間純利益						2,354,320
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	409,979
当中間期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	23,624,772

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,478,483	27,634,752	27,182	27,182	27,661,934
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,764,300	2,764,300			2,764,300
中間純利益	2,354,320	2,354,320			2,354,320
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			42,425	42,425	42,425
当中間期変動額 合計	409,979	409,979	42,425	42,425	452,405
当中間期末残高	25,068,503	27,224,772	15,242	15,242	27,209,529

注記事項

（重要な会計方針）

1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>(1) 子会社株式 …総平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>時価のあるもの…中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は総平均法により算定）</p> <p>時価のないもの…総平均法による原価法</p>
------------------	---

<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物15年～30年、器具備品4年～15年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当中間会計期間末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末の要支給額を計上しております。</p>
<p>4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得する建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。

（追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

（中間貸借対照表関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	731,458千円
2. 保証債務	
被保証者	従業員
被保証債務の内容	住宅ローン
金額	1,946千円

（中間損益計算書関係）

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）		
1. 減価償却実施額	有形固定資産	25,160千円
	無形固定資産	20,743千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）					
1. 発行済株式に関する事項					
株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
普通株式（千株）	3,850	-	-	3,850	
2. 配当に関する事項					
配当金支払額					
決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,764,300	718	平成28年3月31日	平成28年6月24日

（金融商品関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。

（（注2）をご参照ください。）

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	18,403,442	18,403,442	-
(2) 未収委託者報酬	3,194,847	3,194,847	-
(3) 未収運用受託報酬	1,169,249	1,169,249	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	7,527,000	7,527,000	-
資産計	30,294,540	30,294,540	-
(1) 未払手数料	1,384,083	1,384,083	-
(2) 未払費用 1	832,303	832,303	-
負債計	2,216,386	2,216,386	-

（ 1 ） 金融商品に該当するものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

（1）現金・預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

これらはすべて短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（4）投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1) 未払手数料及び(2) 未払費用

これらはすべて短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115
(3) 長期差入保証金	511,994

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区 分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託の受益証券	2,943,194	2,816,700	126,494
小計	2,943,194	2,816,700	126,494
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託の受益証券	4,583,805	4,732,270	148,464
小計	4,583,805	4,732,270	148,464
合計	7,527,000	7,548,970	21,970

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間（平成28年9月30日）

デリバティブ取引を利用しておりませんので、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1. サービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	14,366,017	2,079,955	18,316	16,464,289

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成28年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	7,067円41銭
純資産の部の合計額(千円)	27,209,529
純資産の部の合計額から控除する金額(千円)	-
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	27,209,529
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末の普通株式の数(千株)	3,850

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	611円51銭

中間純利益金額(千円)	2,354,320
普通株式に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	2,354,320
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載してありません。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

4 利害関係人との取引制限

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)および(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)および(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 その他

- (1) 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えると予想される訴訟事件等は発生していません。
委託会社の営業年度は、毎年4月1日より翌年3月31日までとし、営業年度末に決算を行います。

[前へ](#)

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 受託会社

名称	資本金の額（百万円） 平成28年9月末現在	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要>

- ・ 資本金：51,000百万円（平成28年9月末現在）
- ・ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ・ 再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成28年9月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	
株式会社イオン銀行	51,250	
株式会社百十四銀行	37,322	
株式会社新生銀行	512,204	
株式会社あおぞら銀行（注1）	100,000	
オーストラリア・アンド・ニュー ジーランド・バンキング・グルー プ・リミテッド（銀行）	2,220,600	
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
池田泉州TT証券株式会社（注2）	1,250	
宇都宮証券株式会社（注3）	301	
エース証券株式会社	8,831	
株式会社SBI証券	47,937	

香川証券株式会社	555
日本アジア証券株式会社	4,400
極東証券株式会社	5,251
寿証券株式会社	305
めぶき証券株式会社（注4）	3,000
高木証券株式会社	11,069
大和証券株式会社	100,000
むさし証券株式会社	5,000
楽天証券株式会社（注5）	7,495
東海東京証券株式会社	6,000
内藤証券株式会社	3,002
西日本シティＴＴ証券株式会社（注6）	3,000
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000
マネックス証券株式会社	12,200
日産証券株式会社	1,500
浜銀ＴＴ証券株式会社	3,307
フィデリティ証券株式会社	7,657
ほくほくＴＴ証券株式会社（注7）	1,250
ふくおか証券株式会社	3,000
丸八証券株式会社	3,751
リテラ・クリア証券株式会社	3,794
水戸証券株式会社	12,272
ＳＭＢＣフレンド証券株式会社	27,270
ワイエム証券株式会社	1,270

(注1) 株式会社あおぞら銀行の資本金の額は、平成28年12月末現在です。

(注2) 池田泉州ＴＴ証券株式会社の資本金の額は、平成28年10月3日現在です。

(注3)宇都宮証券株式会社の資本金の額は、平成28年11月11日現在です。

(注4)めぶき証券株式会社の資本金の額は、平成28年10月1日現在です。

(注5)楽天証券株式会社の資本金の額は、平成28年11月29日現在です。

(注6)西日本シティTT証券株式会社の資本金の額は、平成28年10月3日現在です。

(注7)ほくほくTT証券株式会社の資本金の額は、平成29年1月4日現在です。

3 資本関係

(2)販売会社

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

大和証券株式会社およびテラ・クリア証券株式会社の親会社である株式会社大和証券グループ本社は、ファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の44.0%の株式を保有しています。

株式会社三井住友銀行、SMB C日興証券株式会社およびSMB Cフレンド証券株式会社の親会社である株式会社三井住友フィナンシャルグループは、ファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の44.0%の株式を保有しています。

以上

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・円コース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・豪ドルコース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・トルコリラコース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド・中国元コース（毎月分配型）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているエマーシング・ボンド・ファンド（マネープールファンド）の平成28年7月20日から平成29年1月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、エマーシング・ボンド・ファンド（マネープールファンド）の平成29年1月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和住銀投信投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年 6月10日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩 司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第44期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月9日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅津 広 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第45期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[前へ](#)