

【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12月15日

【発行者名】 T & Dアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 藤瀬 宏

【本店の所在の場所】 東京都港区芝五丁目36番7号

【事務連絡者氏名】 富岡 秀夫

【電話番号】 03-6722-4813

【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】 T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）円  
ヘッジ・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ド  
ルブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ド  
ルペア・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユー  
ロブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユー  
ロペア・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ド  
ルブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ド  
ルペア・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）レア  
ルブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）イン  
ドネシアルピアブル・コース

【届出の対象とした募集内国投資信託  
受益証券の金額】 継続募集額  
各ファンドにつき2,000億円を上限とし、合計で2,000億円を上  
限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成29年6月15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。）の関係情報を新たな情報に訂正し、加えて、原届出書の記載事項に訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部は、訂正部分を示します。また<更新後>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示し、<追加>の記載事項は現届出書の追加の内容を示します。

## 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

##### (3) ファンドの仕組み

委託会社の概況

<訂正前>

a. 資本金

平成29年3月末日現在 11億円

b. (略)

c. 大株主の状況

平成29年3月末日現在

(略)

<訂正後>

a. 資本金

平成29年9月末日現在 11億円

b. (略)

c. 大株主の状況

平成29年9月末日現在

(略)

#### 2 投資方針

##### (2) 投資対象

(参考)

<更新後>

投資する投資信託証券の概要																			
ファンド名	<p>エマージングマーケットハイイールドボンドファンド Emerging Market High Yield Bond Fund            なお、「T&amp;D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)」が各々投資対象とする外国投資信託は以下の通りです。</p> <table border="1"> <tr> <td>円ヘッジコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class A-JPY Hedged Class</td> </tr> <tr> <td>米ドルブルコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class B-USD Bull Class</td> </tr> <tr> <td>米ドルベアコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class C-USD Bear Class</td> </tr> <tr> <td>ユーロブルコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class D-EUR Bull Class</td> </tr> <tr> <td>ユーロベアコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class E-EUR Bear Class</td> </tr> <tr> <td>豪ドルブルコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class G-AUD Bull Class</td> </tr> <tr> <td>豪ドルベアコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class H-AUD Bear Class</td> </tr> <tr> <td>レアルブルコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class F-BRL Bull Class</td> </tr> <tr> <td>インドネシアレアルブルコース</td> <td>Emerging Market High Yield Bond Fund Class I-IDR Bull Class</td> </tr> </table>	円ヘッジコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class A-JPY Hedged Class	米ドルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class B-USD Bull Class	米ドルベアコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class C-USD Bear Class	ユーロブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class D-EUR Bull Class	ユーロベアコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class E-EUR Bear Class	豪ドルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class G-AUD Bull Class	豪ドルベアコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class H-AUD Bear Class	レアルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class F-BRL Bull Class	インドネシアレアルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class I-IDR Bull Class
円ヘッジコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class A-JPY Hedged Class																		
米ドルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class B-USD Bull Class																		
米ドルベアコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class C-USD Bear Class																		
ユーロブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class D-EUR Bull Class																		
ユーロベアコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class E-EUR Bear Class																		
豪ドルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class G-AUD Bull Class																		
豪ドルベアコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class H-AUD Bear Class																		
レアルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class F-BRL Bull Class																		
インドネシアレアルブルコース	Emerging Market High Yield Bond Fund Class I-IDR Bull Class																		
分類	ケイマン籍/外国投資信託/円建て																		
設定日	2011年11月22日 なお、Class H- AUD BearおよびClass I- IDR Bullは2012年6月15日																		
運用基本方針	<p>主として新興国の米ドル建てハイイールド社債に投資を行い、安定的なインカム収益の獲得と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。各クラスにおいては、外国為替予約取引、為替先物取引等*を活用します。            ※NDF取引を行う場合があります。</p>																		
投資態度	<p>①米ドル建ての新興国ハイイールド社債を主要投資対象とします。            ・S&amp;P、ムーディーズおよびフィッチによる信用格付(各社の信用格付が異なる場合は、最も低い信用格付)がBB格相当以下の社債および社債に準ずる債券への投資は、純資産総額の70%以上とします。            ・CCC格相当以下の信用格付の債券への投資は純資産総額の15%以下とします。            ・無格付の債券への投資は純資産総額の15%以下とします。            ・原則として、デフォルトした債券への投資は行いません。ただし、保有している債券がデフォルトした場合は、継続して保有することができるものとします。            ・同一発行体の発行する債券への投資は、純資産総額の5%以下とします。            ②各クラスで、原則として以下の為替ヘッジおよび為替取引を行います。</p> <table border="1"> <tr> <td>Class A- JPY Hedged</td> <td>組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。</td> </tr> <tr> <td>Class B- USD Bull</td> <td>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジおよび為替取引を行いません。</td> </tr> <tr> <td>Class C- USD Bear</td> <td>組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として、円買い/米ドル売りポジションを構築します。</td> </tr> <tr> <td>Class D- EUR Bull</td> <td>組入外貨建資産については、原則としてユーロ買い/米ドル売りの為替取引を行います。</td> </tr> <tr> <td>Class E- EUR Bear</td> <td>組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として、円買い/ユーロ売りポジションを構築します。</td> </tr> <tr> <td>Class G- AUD Bull</td> <td>組入外貨建資産については、原則として豪ドル買い/米ドル売りの為替取引を行います。</td> </tr> <tr> <td>Class H- AUD Bear</td> <td>組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として円買い/豪ドル売りポジションを構築します。</td> </tr> <tr> <td>Class F- BRL Bull</td> <td>組入外貨建資産については、原則としてブラジルレアル買い/米ドル売りの為替取引を行います。</td> </tr> <tr> <td>Class I- IDR Bull</td> <td>組入外貨建資産については、原則としてインドネシアレアル買い/米ドル売りの為替取引を行います。</td> </tr> </table> <p>・米ドル建て以外の債券にも投資することがありますが、この場合には原則として当該現地通貨売り/米ドル買いのヘッジ(米ドルからみたヘッジ)を行います。            ③運用の効率化を図るため、デリバティブ取引を利用することがあります。            ④資金動向や市場動向等によっては、上記のような運用が行われない場合があります。</p>	Class A- JPY Hedged	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。	Class B- USD Bull	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジおよび為替取引を行いません。	Class C- USD Bear	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として、円買い/米ドル売りポジションを構築します。	Class D- EUR Bull	組入外貨建資産については、原則としてユーロ買い/米ドル売りの為替取引を行います。	Class E- EUR Bear	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として、円買い/ユーロ売りポジションを構築します。	Class G- AUD Bull	組入外貨建資産については、原則として豪ドル買い/米ドル売りの為替取引を行います。	Class H- AUD Bear	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として円買い/豪ドル売りポジションを構築します。	Class F- BRL Bull	組入外貨建資産については、原則としてブラジルレアル買い/米ドル売りの為替取引を行います。	Class I- IDR Bull	組入外貨建資産については、原則としてインドネシアレアル買い/米ドル売りの為替取引を行います。
Class A- JPY Hedged	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。																		
Class B- USD Bull	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジおよび為替取引を行いません。																		
Class C- USD Bear	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として、円買い/米ドル売りポジションを構築します。																		
Class D- EUR Bull	組入外貨建資産については、原則としてユーロ買い/米ドル売りの為替取引を行います。																		
Class E- EUR Bear	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として、円買い/ユーロ売りポジションを構築します。																		
Class G- AUD Bull	組入外貨建資産については、原則として豪ドル買い/米ドル売りの為替取引を行います。																		
Class H- AUD Bear	組入外貨建資産については、原則として円買い/米ドル売りの為替ヘッジを行います。それに加えて、為替取引として円買い/豪ドル売りポジションを構築します。																		
Class F- BRL Bull	組入外貨建資産については、原則としてブラジルレアル買い/米ドル売りの為替取引を行います。																		
Class I- IDR Bull	組入外貨建資産については、原則としてインドネシアレアル買い/米ドル売りの為替取引を行います。																		
分配方針	原則として、毎月分配を行います。																		
決算日	9月30日																		
信託報酬等	<p>純資産総額の年0.63%程度。内訳は以下の通りです。            運用報酬:0.54%            管理事務代行報酬・保管受託報酬:0.08%            受託報酬:年10,000米ドル            名義書換事務代行報酬:0.01%</p>																		
その他の費用	<p>売買時の売買委託手数料、監査費用、外国為替予約取引、為替先物取引等(NDF取引を行う場合があります。)にかかる費用等がかかります。その他費用の一部については運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>																		
投資顧問会社	JPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド																		
ファンド名	マネーアカウントマザーファンド																		
分類	親投資信託																		
設定日	2010年2月26日																		
運用基本方針	安定した収益の確保を目標として運用を行います。																		
主な投資対象	わが国の国債、公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。																		
主な投資制限	<p>①株式への投資は行いません。            ②外貨建資産への投資は行いません。</p>																		
分配方針	分配は行いません。																		
決算日	6月、12月の各10日(休業日の場合は翌営業日)																		
信託報酬等	信託報酬、申込手数料、信託財産留保額はありません。																		
委託会社	T&Dアセットマネジメント株式会社																		

各概要は、2017年9月末日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

### (3) 運用体制

<訂正前>

(略)

委託会社の運用体制等は平成29年3月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

委託会社の運用体制等は平成29年9月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3 投資リスク

#### (3) リスクの管理体制

<訂正前>

（略）

リスクの管理体制は平成29年3月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

（略）

リスクの管理体制は平成29年9月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

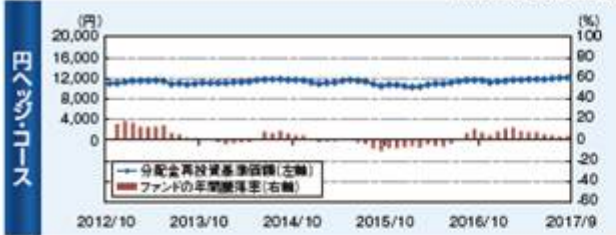
## &lt; 参考情報 &gt;

&lt; 更新後 &gt;

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較

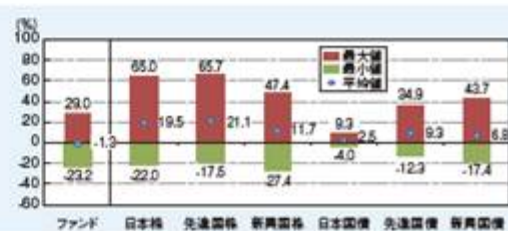
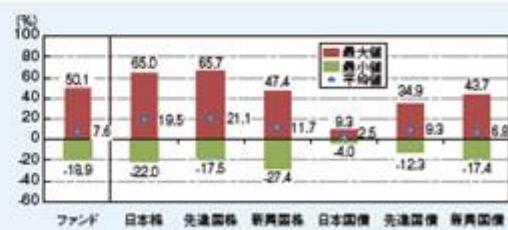
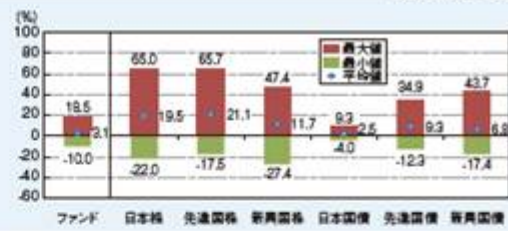
## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

(2012年10月～2017年9月)



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2012年10月～2017年9月)





(注)ファンドの年間騰落率及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みなして計算した基準価額が記載されており、実際の基準価額及び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。

- \*右のグラフは、2012年10月から2017年9月の5年間の各月末における直近1年間騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。
- \*右のグラフは、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たものであり、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- \*上記の騰落率は2017年9月末から遡って算出した結果であり、ファンドの決算日に対応した数値とは異なります。

## ○各資産クラスの指数

- 日本株 …… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株 …… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 …… MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 …… NOMURA-BPI国債
- 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)
- 新興国債 …… JPMオルガンGBI-EMグローバルレディバースィファイド(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しております。

\*詳細は「指数に関して」をご参照ください。

## ●指数に関して

○「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

## 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)とは、東証第一部上場全銘柄の時価総額を基準時の時価総額で除して算出したわが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する一切の知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。

## MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックスはMSCIが開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国の株式市場の動きを捉える指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。

## MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した新興国の株式市場の動きを捉える株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。

## NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本で発行されている公募利付国債の市場全体を表す投資収益指数です。その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスを用いて行われるT&Dアセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、シティグループ・インデックスLLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

## JPMオルガンGBI-EMグローバルレディバースィファイド(円ベース)

JPMオルガンGBI-EMグローバルレディバースィファイドは、JPMオルガン社が算出し公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成されている指数です。同指数の著作権はJPMオルガン社に帰属します。

## 4 手数料等及び税金

## (5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(略)

税金の取扱いについては、平成29年3月末日現在のものであり、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

税金の取扱いについては、平成29年9月末日現在のものであり、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 運用状況

&lt;更新後&gt;

T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）円ヘッジ・コース

## (1) 投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

(平成29年9月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(百万円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ケイマン諸島	2,062	95.28
親投資信託受益証券	日本	66	3.06
現金・預金・その他の資産(負債差引後)	日本	36	1.66
合計(純資産総額)	-	2,164	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。)

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄(全銘柄)

(平成29年9月29日現在)

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	時価単価(円) 時価金額(円)	投資比率(%)
1	ケイマン諸島	投資信託受益証券	エマージングマーケット・ハイイールドボンドファンド Class A- JPY Hedged Class	22,629,064.266	91.140 2,062,412,917	91.101 2,061,530,383	95.28
2	日本	親投資信託受益証券	マネーアカウントマザーファンド	66,127,026	1.0028 66,312,181	1.0027 66,305,568	3.06

(注) 1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ. 投資有価証券の種類別比率

(平成29年9月29日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	95.28
親投資信託受益証券	3.06
合計	98.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。



	純資産総額 （分配落） （単位:百万円）	純資産総額 （分配付） （単位:百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位:円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位:円）
第1期 特定期間 （平成24年3月15日現在）	15,906	16,056	1.0660	1.0760
第2期 特定期間 （平成24年9月18日現在）	8,338	8,618	1.0856	1.1156
第3期 特定期間 （平成25年3月15日現在）	8,301	8,586	1.1244	1.1634
第4期 特定期間 （平成25年9月17日現在）	6,557	6,863	1.0047	1.0487
第5期 特定期間 （平成26年3月17日現在）	5,157	5,292	1.0160	1.0400
第6期 特定期間 （平成26年9月16日現在）	4,540	4,652	1.0478	1.0718
第7期 特定期間 （平成27年3月16日現在）	3,816	3,915	0.9674	0.9914
第8期 特定期間 （平成27年9月15日現在）	3,368	3,460	0.9098	0.9338
第9期 特定期間 （平成28年3月15日現在）	2,832	2,914	0.8742	0.8982
第10期 特定期間 （平成28年9月15日現在）	2,598	2,669	0.9247	0.9487
第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	2,286	2,347	0.9005	0.9245
第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）	2,176	2,235	0.9232	0.9472
平成28年9月末日	2,574	-	0.9326	-
平成28年10月末日	2,474	-	0.9263	-
平成28年11月末日	2,317	-	0.8937	-
平成28年12月末日	2,255	-	0.8995	-
平成29年1月末日	2,247	-	0.9069	-
平成29年2月末日	2,230	-	0.9140	-
平成29年3月末日	2,288	-	0.9115	-
平成29年4月末日	2,277	-	0.9180	-
平成29年5月末日	2,269	-	0.9150	-
平成29年6月末日	2,265	-	0.9100	-
平成29年7月末日	2,242	-	0.9156	-
平成29年8月末日	2,219	-	0.9211	-
平成29年9月末日	2,164	-	0.9224	-

（注）分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金（円）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	0.0100
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	0.0300
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	0.0390
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	0.0440

第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	0.0240
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	0.0240
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	0.0240
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	0.0240
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	0.0240
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	0.0240
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	0.0240
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	0.0240

## 収益率の推移

	収益率（％）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	7.60
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	4.65
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	7.17
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	6.73
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	3.51
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	5.49
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	5.38
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	3.47
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	1.28
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	8.52
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	0.02
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	5.19

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （4）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	18,736,641,093	3,815,815,795
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	1,643,946,638	8,884,450,199
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	3,002,606,554	3,300,229,568
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	782,944,485	1,639,223,884
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	169,577,727	1,620,289,682
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	138,731,626	881,383,071
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	163,270,777	552,003,610
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	174,410,789	416,599,490
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	20,045,345	482,934,631
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	53,965,430	483,339,857
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	156,624,507	427,792,361
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	100,493,861	282,258,081

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。

2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルブル・コース

## （１）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（百万円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	403	94.96
親投資信託受益証券	日本	12	2.92
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	9	2.12
合計（純資産総額）	-	424	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	時価単価（円） 時価金額（円）	投資比率 （％）
1	ケイマン諸島	投資信託受益証券	エマージングマーケット・ハイイールドボンドファンド Class B- USD Bull Class	2,890,665.495	137.010 396,067,423	139.444 403,085,959	94.96
2	日本	親投資信託受益証券	マネーアカウント マザーファンド	12,370,307	1.0028 12,404,943	1.0027 12,403,706	2.92

（注）1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ．投資有価証券の種類別比率

（平成29年9月29日現在）

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	94.96
親投資信託受益証券	2.92
合計	97.88

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （３）運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （単位:百万円）	純資産総額 （分配付） （単位:百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位:円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位:円）
第1期 特定期間 （平成24年3月15日現在）	900	908	1.1548	1.1648
第2期 特定期間 （平成24年9月18日現在）	643	667	1.1104	1.1404
第3期 特定期間 （平成25年3月15日現在）	1,114	1,142	1.3967	1.4397
第4期 特定期間 （平成25年9月17日現在）	872	922	1.2823	1.3423
第5期 特定期間 （平成26年3月17日現在）	725	763	1.2970	1.3570
第6期 特定期間 （平成26年9月16日現在）	689	720	1.3850	1.4450
第7期 特定期間 （平成27年3月16日現在）	805	838	1.4152	1.4752
第8期 特定期間 （平成27年9月15日現在）	613	643	1.2952	1.3552
第9期 特定期間 （平成28年3月15日現在）	522	550	1.1653	1.2253
第10期 特定期間 （平成28年9月15日現在）	471	497	1.0887	1.1487
第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	411	428	1.1795	1.2245
第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）	418	429	1.1792	1.2092
平成28年9月末日	480	-	1.0847	-
平成28年10月末日	472	-	1.1115	-
平成28年11月末日	421	-	1.1457	-
平成28年12月末日	416	-	1.1911	-
平成29年1月末日	430	-	1.1761	-
平成29年2月末日	416	-	1.1767	-
平成29年3月末日	429	-	1.1662	-
平成29年4月末日	428	-	1.1723	-
平成29年5月末日	418	-	1.1655	-
平成29年6月末日	430	-	1.1737	-
平成29年7月末日	423	-	1.1675	-
平成29年8月末日	414	-	1.1737	-
平成29年9月末日	424	-	1.1984	-

（注）分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金（円）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	0.0100
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	0.0300
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	0.0430
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	0.0600

第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	0.0600
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	0.0600
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	0.0600
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	0.0600
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	0.0600
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	0.0600
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	0.0450
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	0.0300

## 収益率の推移

	収益率（％）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	16.48
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	1.25
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	29.66
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	3.89
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	5.83
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	11.41
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	6.51
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	4.24
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	5.40
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	1.42
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	12.47
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	2.52

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	1,217,702,891	438,083,651
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	774,041,640	974,244,800
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	758,634,258	540,554,200
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	666,891,664	784,143,164
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	155,444,929	276,666,295
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	175,718,390	237,231,879
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	226,101,003	154,520,869
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	83,392,585	179,277,558
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	26,028,680	51,471,766
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	38,069,374	53,648,811
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	80,975,421	164,465,624
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	41,748,472	35,667,905

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。

2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルペア・コース

## (1) 投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

(平成29年9月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(百万円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ケイマン諸島	36	94.86
親投資信託受益証券	日本	1	2.15
現金・預金・その他の資産(負債差引後)	日本	1	2.99
合計(純資産総額)	-	38	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。)

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄(全銘柄)

(平成29年9月29日現在)

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	時価単価(円) 時価金額(円)	投資比率 (%)
1	ケイマン諸島	投資信託受益証券	エマージングマーケット・ハイールドボンドファンド Class C- USD Bear Class	644,462,222	56.800 36,609,965	55.747 35,926,835	94.86
2	日本	親投資信託受益証券	マネーアカウントマザーファンド	810,623	1.0028 812,892	1.0027 812,811	2.15

(注) 1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ. 投資有価証券の種類別比率

(平成29年9月29日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	94.86
親投資信託受益証券	2.15
合計	97.01

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (単位:百万円)	純資産総額 (分配付) (単位:百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (単位:円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (単位:円)

第1期 特定期間 (平成24年3月15日現在)	1,107	1,119	0.9818	0.9918
第2期 特定期間 (平成24年9月18日現在)	698	725	1.0582	1.0882
第3期 特定期間 (平成25年3月15日現在)	164	174	0.8941	0.9251
第4期 特定期間 (平成25年9月17日現在)	108	112	0.7744	0.7984
第5期 特定期間 (平成26年3月17日現在)	99	101	0.7627	0.7867
第6期 特定期間 (平成26年9月16日現在)	63	65	0.7362	0.7602
第7期 特定期間 (平成27年3月16日現在)	50	52	0.5913	0.6153
第8期 特定期間 (平成27年9月15日現在)	44	46	0.5493	0.5733
第9期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	44	46	0.5417	0.5657
第10期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	41	42	0.6139	0.6379
第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	55	57	0.5222	0.5432
第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	39	40	0.5413	0.5593
平成28年9月末日	41	-	0.6265	-
平成28年10月末日	39	-	0.5995	-
平成28年11月末日	53	-	0.5369	-
平成28年12月末日	53	-	0.5175	-
平成29年1月末日	56	-	0.5329	-
平成29年2月末日	57	-	0.5403	-
平成29年3月末日	58	-	0.5411	-
平成29年4月末日	41	-	0.5423	-
平成29年5月末日	43	-	0.5412	-
平成29年6月末日	42	-	0.5308	-
平成29年7月末日	43	-	0.5393	-
平成29年8月末日	40	-	0.5420	-
平成29年9月末日	38	-	0.5314	-

(注) 分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成23年11月22日 ~ 平成24年3月15日)	0.0100
第2期 特定期間(平成24年3月16日 ~ 平成24年9月18日)	0.0300
第3期 特定期間(平成24年9月19日 ~ 平成25年3月15日)	0.0310
第4期 特定期間(平成25年3月16日 ~ 平成25年9月17日)	0.0240
第5期 特定期間(平成25年9月18日 ~ 平成26年3月17日)	0.0240
第6期 特定期間(平成26年3月18日 ~ 平成26年9月16日)	0.0240
第7期 特定期間(平成26年9月17日 ~ 平成27年3月16日)	0.0240

第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	0.0240
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	0.0240
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	0.0240
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	0.0210
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	0.0180

## 収益率の推移

	収益率（％）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	0.82
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	10.84
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	12.58
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	10.70
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	1.59
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	0.33
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	16.42
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	3.04
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	2.99
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	17.76
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	11.52
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	7.10

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	1,554,306,146	427,015,194
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	172,202,309	640,247,932
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	28,598,210	504,387,476
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	52,364,662	95,760,005
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	37,638,976	48,404,169
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	52,333,219	96,322,296
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	7,540,173	8,297,916
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	17,920,063	22,264,837
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	15,545,508	13,709,146
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	43,293,542	59,332,958
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	54,479,192	15,021,869
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	12,958,546	47,207,767

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。

2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロブル・コース

## （１）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況



（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（百万円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	5	93.43
親投資信託受益証券	日本	0	1.70
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	1	4.87
合計（純資産総額）	-	6	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	時価単価（円） 時価金額（円）	投資比率（％）
1	ケイマン諸島	投資信託受益証券	エマージングマーケット・ハイイールドボンドファンド Class D- EUR Bull Class	45,540.660	113.930 5,188,696	114.559 5,217,092	93.43
2	日本	親投資信託受益証券	マネーアカウントマザーファンド	94,485	1.0028 94,749	1.0027 94,740	1.70

（注）1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ．投資有価証券の種類別比率

（平成29年9月29日現在）

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	93.43
親投資信託受益証券	1.70
合計	95.13

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （３）運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （単位：百万円）	純資産総額 （分配付） （単位：百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位：円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位：円）
第1期 特定期間 （平成24年3月15日現在）	78	79	1.1131	1.1231

第2期 特定期間 (平成24年9月18日現在)	84	87	1.0702	1.1002
第3期 特定期間 (平成25年3月15日現在)	159	164	1.3311	1.3701
第4期 特定期間 (平成25年9月17日現在)	78	81	1.2545	1.3025
第5期 特定期間 (平成26年3月17日現在)	59	62	1.3375	1.3855
第6期 特定期間 (平成26年9月16日現在)	110	114	1.3418	1.3898
第7期 特定期間 (平成27年3月16日現在)	64	67	1.1192	1.1672
第8期 特定期間 (平成27年9月15日現在)	32	34	1.0943	1.1423
第9期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	28	30	0.9612	1.0092
第10期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	26	27	0.9053	0.9533
第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	26	27	0.9168	0.9528
第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	5	5	1.0238	1.0478
平成28年9月末日	26	-	0.8989	-
平成28年10月末日	26	-	0.9012	-
平成28年11月末日	26	-	0.8998	-
平成28年12月末日	26	-	0.9186	-
平成29年1月末日	26	-	0.9228	-
平成29年2月末日	26	-	0.9139	-
平成29年3月末日	26	-	0.9119	-
平成29年4月末日	27	-	0.9324	-
平成29年5月末日	36	-	0.9516	-
平成29年6月末日	37	-	0.9771	-
平成29年7月末日	14	-	0.9937	-
平成29年8月末日	33	-	1.0103	-
平成29年9月末日	6	-	1.0295	-

(注) 分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成23年11月22日～平成24年3月15日)	0.0100
第2期 特定期間(平成24年3月16日～平成24年9月18日)	0.0300
第3期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	0.0390
第4期 特定期間(平成25年3月16日～平成25年9月17日)	0.0480
第5期 特定期間(平成25年9月18日～平成26年3月17日)	0.0480
第6期 特定期間(平成26年3月18日～平成26年9月16日)	0.0480
第7期 特定期間(平成26年9月17日～平成27年3月16日)	0.0480
第8期 特定期間(平成27年3月17日～平成27年9月15日)	0.0480
第9期 特定期間(平成27年9月16日～平成28年3月15日)	0.0480

第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	0.0480
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	0.0360
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	0.0240

## 収益率の推移

	収益率（％）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	12.31
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	1.16
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	28.02
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	2.15
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	10.44
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	3.91
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	13.01
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	2.06
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	7.78
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	0.82
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	5.25
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	14.29

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （4）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	337,485,176	267,770,786
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	412,928,597	403,709,858
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	159,276,905	118,545,697
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	31,888,400	89,385,721
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	9,486,715	27,168,862
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	48,136,239	10,322,088
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	1,453,854	26,505,253
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	9,765,701	37,447,362
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	160,136	382,467
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	3,369,251	3,938,365
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	149,888	587,441
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	38,385,515	62,079,049

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。

2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロペア・コース

## （1）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（百万円）	投資比率（％）
-------	------	-----------	---------

投資信託受益証券	ケイマン諸島	86	94.99
親投資信託受益証券	日本	2	2.18
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	3	2.83
合計（純資産総額）	-	91	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	時価単価（円） 時価金額（円）	投資比率 （％）
1	ケイマン諸島	投資信託受益証券	エマージングマーケット・ハイイールドボンドファンド Class E- EUR Bear Class	1,297,536,180	67.100 87,067,272	66.624 86,447,050	94.99
2	日本	親投資信託受益証券	マネーアカウント マザーファンド	1,982,031	1.0028 1,987,580	1.0027 1,987,382	2.18

（注）1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ．投資有価証券の種類別比率

（平成29年9月29日現在）

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	94.99
親投資信託受益証券	2.18
合計	97.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （３）運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （単位：百万円）	純資産総額 （分配付） （単位：百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位：円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位：円）
第1期 特定期間 （平成24年3月15日現在）	2,656	2,683	1.0087	1.0187
第2期 特定期間 （平成24年9月18日現在）	800	839	1.0787	1.1087

第3期 特定期間 (平成25年3月15日現在)	711	735	0.9261	0.9571
第4期 特定期間 (平成25年9月17日現在)	307	318	0.7903	0.8143
第5期 特定期間 (平成26年3月17日現在)	274	282	0.7457	0.7697
第6期 特定期間 (平成26年9月16日現在)	186	195	0.7714	0.7954
第7期 特定期間 (平成27年3月16日現在)	173	178	0.7588	0.7828
第8期 特定期間 (平成27年9月15日現在)	214	221	0.6590	0.6830
第9期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	195	203	0.6728	0.6968
第10期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	162	168	0.7636	0.7876
第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	138	142	0.7042	0.7252
第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	92	94	0.6642	0.6822
平成28年9月末日	164	-	0.7820	-
平成28年10月末日	143	-	0.7657	-
平成28年11月末日	148	-	0.7106	-
平成28年12月末日	144	-	0.7000	-
平成29年1月末日	140	-	0.7096	-
平成29年2月末日	143	-	0.7279	-
平成29年3月末日	137	-	0.7262	-
平成29年4月末日	113	-	0.7182	-
平成29年5月末日	107	-	0.6983	-
平成29年6月末日	96	-	0.6720	-
平成29年7月末日	95	-	0.6662	-
平成29年8月末日	94	-	0.6649	-
平成29年9月末日	91	-	0.6594	-

(注) 分配の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成23年11月22日～平成24年3月15日)	0.0100
第2期 特定期間(平成24年3月16日～平成24年9月18日)	0.0300
第3期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	0.0310
第4期 特定期間(平成25年3月16日～平成25年9月17日)	0.0240
第5期 特定期間(平成25年9月18日～平成26年3月17日)	0.0240
第6期 特定期間(平成26年3月18日～平成26年9月16日)	0.0240
第7期 特定期間(平成26年9月17日～平成27年3月16日)	0.0240
第8期 特定期間(平成27年3月17日～平成27年9月15日)	0.0240
第9期 特定期間(平成27年9月16日～平成28年3月15日)	0.0240
第10期 特定期間(平成28年3月16日～平成28年9月15日)	0.0240

第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	0.0210
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	0.0180

## 収益率の推移

	収益率（％）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	1.87
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	9.91
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	11.27
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	12.07
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	2.61
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	6.66
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	1.48
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	9.99
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	5.74
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	17.06
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	5.03
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	3.12

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万円当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	3,973,942,079	1,340,524,257
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	649,848,483	2,541,706,872
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	721,794,290	695,168,218
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	106,471,575	485,669,714
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	92,927,559	115,052,849
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	144,698,274	270,822,474
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	106,001,910	119,119,789
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	154,556,768	57,179,623
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	3,266,618	37,770,238
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	34,397,910	112,896,952
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	25,685,575	41,491,023
第12期 特定期間（平成28年3月16日～平成29年9月15日）	2,771,110	60,933,942

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。

2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルブル・コース

## （１）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（百万円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	1,861	95.35

親投資信託受益証券	日本	63	3.25
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	28	1.40
合計（純資産総額）	-	1,952	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/ 地域	種 類	銘 柄 名	券面総額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	時価単価（円） 時価金額（円）	投資 比率 （%）
1	ケイ マン 諸島	投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファン ド Class G- AUD Bull Class	15,024,854.901	123.790 1,859,926,788	123.862 1,861,008,577	95.35
2	日本	親投資信託 受益証券	マネーアカウント マザーファンド	63,256,518	1.0028 63,433,636	1.0027 63,427,310	3.25

（注）1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ．投資有価証券の種類別比率

（平成29年9月29日現在）

種類	投資 比 率（%）
投資信託受益証券	95.35
親投資信託受益証券	3.25
合計	98.60

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （3）運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （単位：百万円）	純資産総額 （分配付） （単位：百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位：円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位：円）
第1期 特定期間 （平成24年3月15日現在）	2,536	2,562	1.2369	1.2469
第2期 特定期間 （平成24年9月18日現在）	1,500	1,560	1.2167	1.2467
第3期 特定期間 （平成25年3月15日現在）	1,155	1,210	1.5006	1.5736

第4期 特定期間 (平成25年9月17日現在)	1,691	1,880	1.1629	1.3129
第5期 特定期間 (平成26年3月17日現在)	3,290	3,638	1.0649	1.2149
第6期 特定期間 (平成26年9月16日現在)	14,283	15,547	1.0494	1.1994
第7期 特定期間 (平成27年3月16日現在)	7,653	8,571	0.8891	0.9641
第8期 特定期間 (平成27年9月15日現在)	4,956	5,404	0.7475	0.8075
第9期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	3,907	4,266	0.6856	0.7456
第10期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	3,170	3,492	0.6183	0.6783
第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	2,572	2,753	0.6653	0.7043
第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	1,975	2,034	0.7011	0.7191
平成28年9月末日	3,144	-	0.6294	-
平成28年10月末日	3,075	-	0.6378	-
平成28年11月末日	3,037	-	0.6432	-
平成28年12月末日	3,059	-	0.6421	-
平成29年1月末日	2,910	-	0.6624	-
平成29年2月末日	2,763	-	0.6734	-
平成29年3月末日	2,526	-	0.6654	-
平成29年4月末日	2,390	-	0.6524	-
平成29年5月末日	2,265	-	0.6483	-
平成29年6月末日	2,196	-	0.6714	-
平成29年7月末日	2,217	-	0.6938	-
平成29年8月末日	2,010	-	0.6904	-
平成29年9月末日	1,952	-	0.7011	-

(注) 分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成23年11月22日～平成24年3月15日)	0.0100
第2期 特定期間(平成24年3月16日～平成24年9月18日)	0.0300
第3期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	0.0730
第4期 特定期間(平成25年3月16日～平成25年9月17日)	0.1500
第5期 特定期間(平成25年9月18日～平成26年3月17日)	0.1500
第6期 特定期間(平成26年3月18日～平成26年9月16日)	0.1500
第7期 特定期間(平成26年9月17日～平成27年3月16日)	0.0750
第8期 特定期間(平成27年3月17日～平成27年9月15日)	0.0600
第9期 特定期間(平成27年9月16日～平成28年3月15日)	0.0600
第10期 特定期間(平成28年3月16日～平成28年9月15日)	0.0600
第11期 特定期間(平成28年9月16日～平成29年3月15日)	0.0390
第12期 特定期間(平成29年3月16日～平成29年9月15日)	0.0180



## 収益率の推移

	収益率（％）
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	24.69
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	0.79
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	29.33
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	12.51
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	4.47
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	12.63
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	8.13
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	9.18
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	0.25
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	1.06
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	13.91
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	8.09

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	4,765,908,828	2,715,517,135
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	2,047,254,118	2,864,564,463
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	419,101,784	882,392,851
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	948,246,406	264,312,167
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	1,834,922,624	199,076,821
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	11,168,832,495	647,952,483
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	2,133,590,908	7,137,370,251
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	231,245,828	2,207,144,086
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	132,796,402	1,065,973,600
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	110,517,251	681,391,100
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	213,274,055	1,474,799,722
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	37,343,288	1,085,709,505

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。

2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルペア・コース

## （１）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（百万円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	22	94.29
親投資信託受益証券	日本	0	1.87
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	1	3.84

合計（純資産総額）	-	23	100.00
-----------	---	----	--------

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

## （2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	時価単価（円） 時価金額（円）	投資比率（%）
1	ケイマン諸島	投資信託受益証券	エマージングマーケット・ハイールドボンドファンド Class H- AUD Bear Class	334,024.094	65.250 21,795,072	65.148 21,761,001	94.29
2	日本	親投資信託受益証券	マネーアカウントマザーファンド	430,154	1.0028 431,358	1.0027 431,315	1.87

（注）1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

ロ．投資有価証券の種類別比率

（平成29年9月29日現在）

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	94.29
親投資信託受益証券	1.87
合計	96.16

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （3）運用実績

純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （単位：百万円）	純資産総額 （分配付） （単位：百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位：円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位：円）
第1期 特定期間 （平成24年9月18日現在）	76	76	1.0113	1.0163
第2期 特定期間 （平成25年3月15日現在）	34	36	0.8662	0.8912
第3期 特定期間 （平成25年9月17日現在）	22	23	0.8311	0.8371
第4期 特定期間 （平成26年3月17日現在）	16	17	0.8489	0.8549

第5期 特定期間 (平成26年9月16日現在)	15	15	0.8304	0.8364
第6期 特定期間 (平成27年3月16日現在)	14	14	0.8019	0.8079
第7期 特定期間 (平成27年9月15日現在)	14	14	0.8101	0.8161
第8期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	11	12	0.7828	0.7888
第9期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	4	4	0.9125	0.9185
第10期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	22	23	0.7853	0.8003
第11期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	23	24	0.7745	0.7985
平成28年9月末日	3	-	0.9107	-
平成28年10月末日	3	-	0.8790	-
平成28年11月末日	4	-	0.8068	-
平成28年12月末日	3	-	0.8114	-
平成29年1月末日	3	-	0.8002	-
平成29年2月末日	21	-	0.8003	-
平成29年3月末日	23	-	0.8050	-
平成29年4月末日	24	-	0.8294	-
平成29年5月末日	24	-	0.8284	-
平成29年6月末日	23	-	0.7902	-
平成29年7月末日	22	-	0.7718	-
平成29年8月末日	23	-	0.7835	-
平成29年9月末日	23	-	0.7730	-

(注) 分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成24年6月15日～平成24年9月18日)	0.0050
第2期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	0.0250
第3期 特定期間(平成25年3月16日～平成25年9月17日)	0.0060
第4期 特定期間(平成25年9月18日～平成26年3月17日)	0.0060
第5期 特定期間(平成26年3月18日～平成26年9月16日)	0.0060
第6期 特定期間(平成26年9月17日～平成27年3月16日)	0.0060
第7期 特定期間(平成27年3月17日～平成27年9月15日)	0.0060
第8期 特定期間(平成27年9月16日～平成28年3月15日)	0.0060
第9期 特定期間(平成28年3月16日～平成28年9月15日)	0.0060
第10期 特定期間(平成28年9月16日～平成29年3月15日)	0.0150
第11期 特定期間(平成29年3月16日～平成29年9月15日)	0.0240

#### 収益率の推移

	収益率(%)
第1期 特定期間(平成24年6月15日～平成24年9月18日)	1.63
第2期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	11.88

第3期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	3.36
第4期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	2.86
第5期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	1.47
第6期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	2.71
第7期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	1.77
第8期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	2.63
第9期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	17.34
第10期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	12.30
第11期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	1.68

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配額の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

#### （４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成24年6月15日～平成24年9月18日）	105,780,045	30,603,272
第2期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	173,877,332	209,965,992
第3期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	47,412,622	59,750,727
第4期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	48,434,474	55,852,202
第5期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	86,527,051	88,344,004
第6期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	10,384,414	9,966,642
第7期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	5,964,958	6,590,958
第8期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	781,436	3,502,259
第9期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	1,663,012	11,525,852
第10期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	26,538,440	2,748,352
第11期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	1,366,049	157,664

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。  
2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）リアルブル・コース

##### （１）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（百万円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	795	95.35
親投資信託受益証券	日本	24	2.90
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	15	1.75
合計（純資産総額）	-	834	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。  
（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

##### （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価（円） 簿価金額（円）	時価単価（円） 時価金額（円）	投資比率 （%）
1	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファン ド Class F- BRL Bull Class	6,188,113.503	128.900 797,673,006	128.536 795,395,357	95.35
2	日本	親投資信託 受益証券	マネーアカウント マザーファンド	24,163,192	1.0028 24,230,848	1.0027 24,228,432	2.90

（注）1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### ロ．投資有価証券の種類別比率

（平成29年9月29日現在）

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	95.35
親投資信託受益証券	2.90
合計	98.25

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### （3）運用実績

#### 純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （単位：百万円）	純資産総額 （分配付） （単位：百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落） （単位：円）	1口当たりの 純資産額 （分配付） （単位：円）
第1期 特定期間 （平成24年3月15日現在）	3,520	3,557	1.1858	1.1958
第2期 特定期間 （平成24年9月18日現在）	2,523	2,593	1.0615	1.0915
第3期 特定期間 （平成25年3月15日現在）	2,533	2,632	1.3715	1.4225
第4期 特定期間 （平成25年9月17日現在）	1,599	1,732	1.0955	1.1795
第5期 特定期間 （平成26年3月17日現在）	1,597	1,722	1.0873	1.1713
第6期 特定期間 （平成26年9月16日現在）	1,576	1,689	1.1923	1.2763
第7期 特定期間 （平成27年3月16日現在）	1,334	1,451	0.9032	0.9872
第8期 特定期間 （平成27年9月15日現在）	933	1,049	0.7078	0.7918

第9期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	835	945	0.6481	0.7321
第10期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	828	937	0.6411	0.7251
第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	986	1,054	0.7348	0.7858
第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	849	871	0.7758	0.7938
平成28年9月末日	844	-	0.6577	-
平成28年10月末日	934	-	0.6821	-
平成28年11月末日	883	-	0.6593	-
平成28年12月末日	973	-	0.7118	-
平成29年1月末日	985	-	0.7355	-
平成29年2月末日	978	-	0.7443	-
平成29年3月末日	968	-	0.7361	-
平成29年4月末日	955	-	0.7341	-
平成29年5月末日	919	-	0.7180	-
平成29年6月末日	820	-	0.7178	-
平成29年7月末日	855	-	0.7562	-
平成29年8月末日	831	-	0.7591	-
平成29年9月末日	834	-	0.7732	-

(注) 分配の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成23年11月22日 ~ 平成24年3月15日)	0.0100
第2期 特定期間(平成24年3月16日 ~ 平成24年9月18日)	0.0300
第3期 特定期間(平成24年9月19日 ~ 平成25年3月15日)	0.0510
第4期 特定期間(平成25年3月16日 ~ 平成25年9月17日)	0.0840
第5期 特定期間(平成25年9月18日 ~ 平成26年3月17日)	0.0840
第6期 特定期間(平成26年3月18日 ~ 平成26年9月16日)	0.0840
第7期 特定期間(平成26年9月17日 ~ 平成27年3月16日)	0.0840
第8期 特定期間(平成27年3月17日 ~ 平成27年9月15日)	0.0840
第9期 特定期間(平成27年9月16日 ~ 平成28年3月15日)	0.0840
第10期 特定期間(平成28年3月16日 ~ 平成28年9月15日)	0.0840
第11期 特定期間(平成28年9月16日 ~ 平成29年3月15日)	0.0510
第12期 特定期間(平成29年3月16日 ~ 平成29年9月15日)	0.0180

#### 収益率の推移

	収益率(%)
第1期 特定期間(平成23年11月22日 ~ 平成24年3月15日)	19.58
第2期 特定期間(平成24年3月16日 ~ 平成24年9月18日)	7.95
第3期 特定期間(平成24年9月19日 ~ 平成25年3月15日)	34.01
第4期 特定期間(平成25年3月16日 ~ 平成25年9月17日)	14.00
第5期 特定期間(平成25年9月18日 ~ 平成26年3月17日)	6.92
第6期 特定期間(平成26年3月18日 ~ 平成26年9月16日)	17.38

第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	17.20
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	12.33
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	3.43
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	11.88
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	22.57
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	8.03

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

#### （4）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成23年11月22日～平成24年3月15日）	6,410,049,084	3,442,047,441
第2期 特定期間（平成24年3月16日～平成24年9月18日）	626,670,619	1,217,936,791
第3期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	1,256,731,556	1,786,497,422
第4期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	379,579,451	766,997,575
第5期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	227,938,766	218,985,653
第6期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	250,164,628	397,251,228
第7期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	268,862,776	113,423,862
第8期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	225,635,870	384,072,502
第9期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	168,473,486	198,476,228
第10期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	107,607,841	104,623,545
第11期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	263,181,108	212,819,112
第12期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	98,012,972	344,972,007

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。  
2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）インドネシアルピアブル・コース

##### （1）投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（百万円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	31	94.91
親投資信託受益証券	日本	1	1.93
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	1	3.16
合計（純資産総額）	-	33	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。  
（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

##### （2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．評価額上位銘柄（全銘柄）

（平成29年9月29日現在）

	国/地域	種類	銘柄名	券面総額	簿価単価(円) 簿価金額(円)	時価単価(円) 時価金額(円)	投資 比率 (%)
1	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファン ド Class I- IDR Bull Class	256,629.103	122.110 31,339,289	122.082 31,329,794	94.91
2	日本	親投資信託 受益証券	マネーアカウント マザーファンド	636,065	1.0028 637,845	1.0027 637,782	1.93

(注) 1 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の評価額比率です。

2 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### ロ．投資有価証券の種類別比率

(平成29年9月29日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	94.91
親投資信託受益証券	1.93
合計	96.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### (3) 運用実績

#### 純資産の推移

平成29年9月末日及び同日前1年以内における各月末及び各特定期間末日の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (単位:百万円)	純資産総額 (分配付) (単位:百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (単位:円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (単位:円)
第1期 特定期間 (平成24年9月18日現在)	150	151	1.0595	1.0645
第2期 特定期間 (平成25年3月15日現在)	164	169	1.2618	1.3028
第3期 特定期間 (平成25年9月17日現在)	274	287	1.0574	1.1114
第4期 特定期間 (平成26年3月17日現在)	265	279	1.1131	1.1671
第5期 特定期間 (平成26年9月16日現在)	168	180	1.1597	1.2137
第6期 特定期間 (平成27年3月16日現在)	60	65	1.0800	1.1340
第7期 特定期間 (平成27年9月15日現在)	53	56	0.9413	0.9953
第8期 特定期間 (平成28年3月15日現在)	47	50	0.9532	1.0072



第9期 特定期間 (平成28年9月15日現在)	45	48	0.8969	0.9509
第10期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	32	34	0.9792	1.0182
第11期 特定期間 (平成29年9月15日現在)	33	34	1.0035	1.0275
平成28年9月末日	46	-	0.9082	-
平成28年10月末日	37	-	0.9283	-
平成28年11月末日	37	-	0.9278	-
平成28年12月末日	37	-	0.9751	-
平成29年1月末日	37	-	0.9750	-
平成29年2月末日	33	-	0.9770	-
平成29年3月末日	32	-	0.9726	-
平成29年4月末日	32	-	0.9810	-
平成29年5月末日	32	-	0.9770	-
平成29年6月末日	32	-	0.9859	-
平成29年7月末日	32	-	0.9833	-
平成29年8月末日	33	-	0.9904	-
平成29年9月末日	33	-	1.0026	-

(注) 分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 特定期間(平成24年6月15日～平成24年9月18日)	0.0050
第2期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	0.0410
第3期 特定期間(平成25年3月16日～平成25年9月17日)	0.0540
第4期 特定期間(平成25年9月18日～平成26年3月17日)	0.0540
第5期 特定期間(平成26年3月18日～平成26年9月16日)	0.0540
第6期 特定期間(平成26年9月17日～平成27年3月16日)	0.0540
第7期 特定期間(平成27年3月17日～平成27年9月15日)	0.0540
第8期 特定期間(平成27年9月16日～平成28年3月15日)	0.0540
第9期 特定期間(平成28年3月16日～平成28年9月15日)	0.0540
第10期 特定期間(平成28年9月16日～平成29年3月15日)	0.0390
第11期 特定期間(平成29年3月16日～平成29年9月15日)	0.0240

#### 収益率の推移

	収益率(%)
第1期 特定期間(平成24年6月15日～平成24年9月18日)	6.45
第2期 特定期間(平成24年9月19日～平成25年3月15日)	22.96
第3期 特定期間(平成25年3月16日～平成25年9月17日)	11.92
第4期 特定期間(平成25年9月18日～平成26年3月17日)	10.37
第5期 特定期間(平成26年3月18日～平成26年9月16日)	9.04
第6期 特定期間(平成26年9月17日～平成27年3月16日)	2.22
第7期 特定期間(平成27年3月17日～平成27年9月15日)	7.84
第8期 特定期間(平成27年9月16日～平成28年3月15日)	7.00
第9期 特定期間(平成28年3月16日～平成28年9月15日)	0.24

第10期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	13.52
第11期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	4.93

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数字です。なお、第1期特定期間においては、前期末基準価額（1万口当たり）を1万円として計算しています。（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

#### （４）設定及び解約の実績

	設定口数	解約口数
第1期 特定期間（平成24年6月15日～平成24年9月18日）	175,885,291	34,089,969
第2期 特定期間（平成24年9月19日～平成25年3月15日）	606,862,356	619,074,199
第3期 特定期間（平成25年3月16日～平成25年9月17日）	194,977,335	65,242,000
第4期 特定期間（平成25年9月18日～平成26年3月17日）	30,625,203	51,546,605
第5期 特定期間（平成26年3月18日～平成26年9月16日）	55,286,861	148,419,716
第6期 特定期間（平成26年9月17日～平成27年3月16日）	28,312,588	117,957,164
第7期 特定期間（平成27年3月17日～平成27年9月15日）	2,224,898	1,936,885
第8期 特定期間（平成27年9月16日～平成28年3月15日）	47,398,557	54,376,729
第9期 特定期間（平成28年3月16日～平成28年9月15日）	1,650,226	525,705
第10期 特定期間（平成28年9月16日～平成29年3月15日）	2,559,541	19,898,134
第11期 特定期間（平成29年3月16日～平成29年9月15日）	216,358	29,576

（注）1 第1期特定期間の設定口数には、当初申込期間がある場合の当該設定口数を含みます。  
2 設定口数および解約口数は、全て本邦内におけるものです。

#### （参考）マネーアカウントマザーファンドの状況

##### （１）投資状況

親投資信託資産の種類別、地域別の投資状況

（平成29年9月29日現在）

資産の種類	国名	時価合計（百万円）	投資比率（％）
現金・預金・その他の資産（負債差引後）	日本	965	100.00
合計（純資産総額）	-	965	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。  
（小数点以下第3位を四捨五入して算出しております。）

##### （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄  
該当事項はありません。

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
該当事項はありません。

#### （参考）運用実績

（2017年9月29日現在）

## 基準価額・純資産の推移



— 分配金再投資基準価額（左軸）  
— 基準価額（左軸）  
■ 純資産総額（右軸）

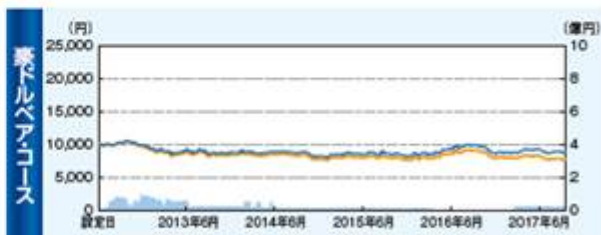
※分配金再投資基準価額は収益分配金（税引前）を再投資したものとみなして計算したものです。

※基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。

【各ファンド（豪ドルペアコース、インドネシアリアルペアコースを除く）】  
※設定日（2011年11月22日）～2017年9月29日

【豪ドルペアコース、インドネシアリアルペアコース】

※設定日（2012年6月15日）～2017年9月29日



## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

	円ヘッジ・コース	米ドルブル・コース	米ドルベア・コース	ユーロブル・コース	ユーロベア・コース
2017年9月	40円	50円	30円	40円	30円
2017年8月	40円	50円	30円	40円	30円
2017年7月	40円	50円	30円	40円	30円
2017年6月	40円	50円	30円	40円	30円
2017年5月	40円	50円	30円	40円	30円
直近1年間累計	480円	750円	390円	600円	390円
設定来累計	3,150円	5,780円	2,780円	4,750円	2,780円

	豪ドルブル・コース	豪ドルベア・コース	リアルブル・コース	インドネシアリアルブル・コース
2017年9月	30円	40円	30円	40円
2017年8月	30円	40円	30円	40円
2017年7月	30円	40円	30円	40円
2017年6月	30円	40円	30円	40円
2017年5月	30円	40円	30円	40円
直近1年間累計	570円	390円	690円	630円
設定来累計	8,750円	1,110円	7,480円	4,870円

## 主要な資産の状況

## ●投資比率

円ヘッジ・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass A-JPY Hedged Class	95.3%
マネーアカウントマザーファンド	3.1%
現金・預金等	1.7%
合 計	100.0%

米ドルブル・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass B-USD Bull Class	95.0%
マネーアカウントマザーファンド	2.9%
現金・預金等	2.1%
合 計	100.0%

米ドルベア・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass C-USD Bear Class	94.9%
マネーアカウントマザーファンド	2.1%
現金・預金等	3.0%
合 計	100.0%

ユーロブル・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass D-EUR Bull Class	93.4%
マネーアカウントマザーファンド	1.7%
現金・預金等	4.9%
合 計	100.0%

ユーロベア・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass E-EUR Bear Class	95.0%
マネーアカウントマザーファンド	2.2%
現金・預金等	2.8%
合 計	100.0%

豪ドルブル・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass G-AUD Bull Class	95.3%
マネーアカウントマザーファンド	3.2%
現金・預金等	1.4%
合 計	100.0%

豪ドルベア・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass H-AUD Bear Class	94.3%
マネーアカウントマザーファンド	1.9%
現金・預金等	3.8%
合 計	100.0%

リアルブル・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass F-BRL Bull Class	95.4%
マネーアカウントマザーファンド	2.9%
現金・預金等	1.7%
合 計	100.0%

インドネシアリアルブル・コース	
イマージンマーケットハイールドボンドファンドClass I-IDR Bull Class	94.9%
マネーアカウントマザーファンド	1.9%
現金・預金等	3.2%
合 計	100.0%

※比率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、合計の数値が必ずしも100とはなりません。

## ●エマージングマーケット・ハイールドボンドファンドの運用状況 2017年9月末日現在(現地)

## &lt;組入上位銘柄&gt;

銘柄名(銘柄数96)	国	通貨	業種	比率
REPUBLIC OF ARG 7.5% 04/22/26	アルゼンチン	米ドル	国債	3.3%
VOTORANTIM CIME 7.25% 04/05/41	ブラジル	米ドル	資本財	3.1%
YPF SOCIEDAD AN 8.75% 04/04/24	アルゼンチン	米ドル	石油・ガス	2.7%
NOSTRUM OIL & GAS 8% 07/25/22	オランダ	米ドル	石油・ガス	2.7%
DIGICEL GROUP L 8.25% 09/30/20	バミューダ諸島	米ドル	通信・メディア・テクノロジー	2.7%
ALTICE FINANCING 7.5% 05/15/26	ルクセンブルク	米ドル	通信・メディア・テクノロジー	2.2%
MILLICOM INTL CELL 6% 03/15/25	ルクセンブルク	米ドル	通信・メディア・テクノロジー	2.1%
IHS NETHERLANDS 9.5% 10/27/21	オランダ	米ドル	通信・メディア・テクノロジー	2.0%
YASAR HOLDING 8.875% 05/06/20	トルコ	米ドル	消費財	1.9%
BANCO DO BRASIL (CA V/R /PERP/	ブラジル	米ドル	金融	1.8%

## &lt;組入上位業種&gt;

業種	比率
通信・メディア・テクノロジー	19.8%
金融	11.9%
石油・ガス	11.8%
不動産	9.7%
国債	9.6%
公益	8.7%
資本財	7.4%

※「エマージングマーケット・ハイールドボンドファンド」の運用会社であるJPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッドおよび保管銀行であるBBH(ブラウン・ブラザーズ・ハリマン)より入手したデータをもとに作成しております。

※各項目の比率は、「エマージングマーケット・ハイールドボンドファンド」の純資産総額に対する評価額の比率です。

※変動利付債のクーポンは、現地基準日の経過利息における利率です。

※業種はJPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッドによる分類、国はBloombergから取得したものです。

## ●マネーアカウントマザーファンドの運用状況

## &lt;組入上位銘柄&gt;

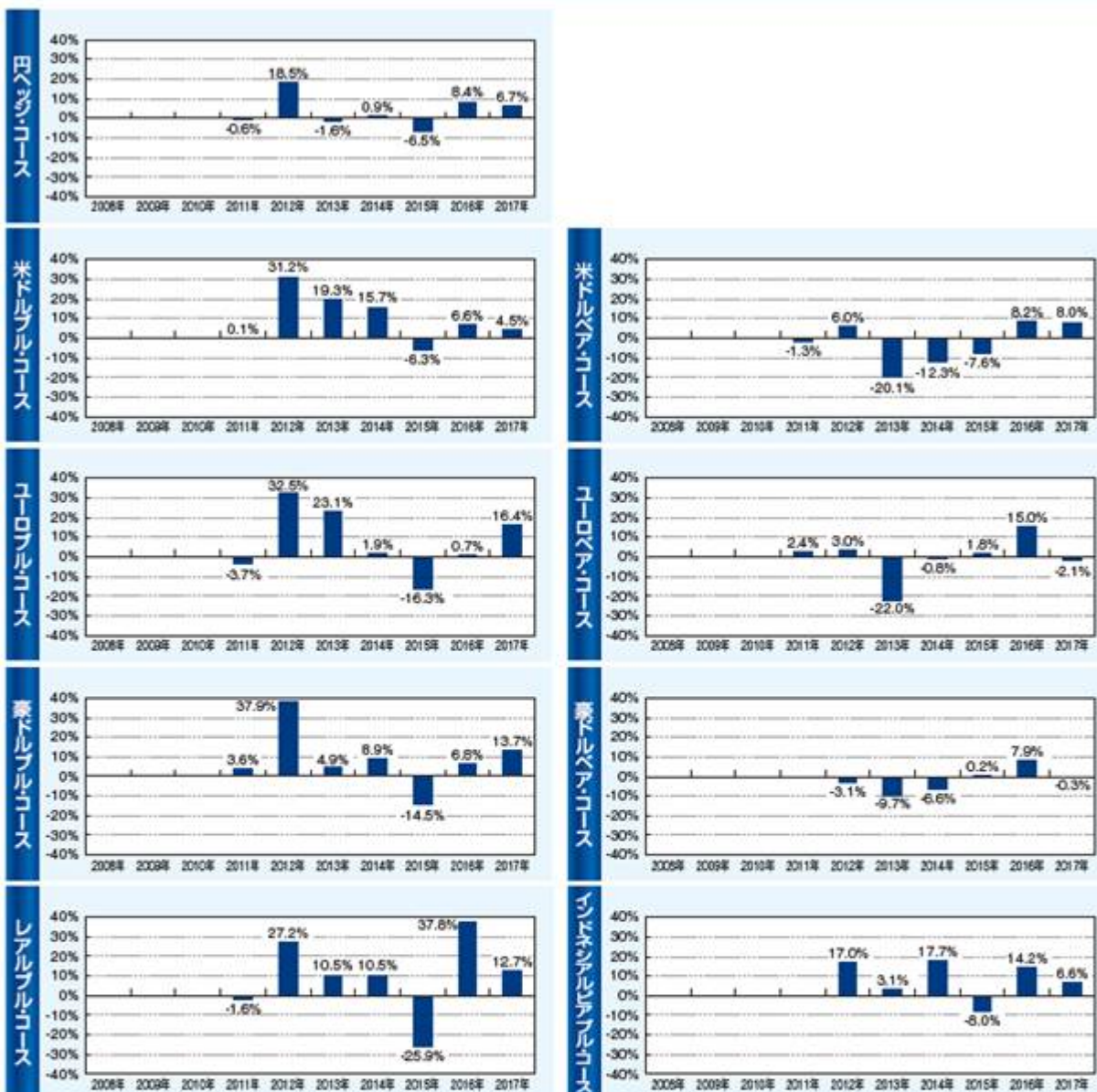
銘柄名(銘柄数-)	種類	償還日	比率
-	-	-	-

※比率および投資比率は、マネーアカウントマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率です。

## &lt;投資比率&gt;

公社債	-
現金・預金等	100.0%
合計	100.0%

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの収益率は分配金再投資基準額をもとに計算したものです。

※ファンドにはベンチマークはありません。

※各ファンド(豪ドルレバコース、インドネシアレアルコースを除く)

※2011年は設定日(11月22日)から年末まで、2017年は年初から9月末までの収益率を表示しています。

〔豪ドルレバコース、インドネシアレアルコース〕

※2012年は設定日(6月15日)から年末まで、2017年は年初から9月末までの収益率を表示しています。

- ◆運用実績は過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。
- ◆最新の運用状況は委託会社のホームページでご覧いただけます。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### <更新後>

T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）円ヘッジ・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルベア・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロベア・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）リアルブル・コース  
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルブル・コース

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）（以下「財務諸表等規則」という。）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）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しており、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、財務諸表は原則として6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、第12期特定期間（平成29年3月16日から平成29年9月15日まで）の財務諸表について、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1 財務諸表

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）円ヘッジ・コース

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	57,242,756	52,855,610
投資信託受益証券	2,168,447,117	2,076,512,917
親投資信託受益証券	72,954,000	66,312,181
流動資産合計	2,298,643,873	2,195,680,708
資産合計	2,298,643,873	2,195,680,708
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,154,811	9,427,754
未払解約金	-	7,628,931
未払受託者報酬	55,784	60,809
未払委託者報酬	2,324,318	2,533,721
未払利息	105	110
その他未払費用	29,742	28,366
流動負債合計	12,564,760	19,679,691
負債合計	12,564,760	19,679,691
純資産の部		
元本等		
元本	2,538,702,823	2,356,938,603
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	252,623,710	180,937,586
(分配準備積立金)	184,583,682	162,916,908
元本等合計	2,286,079,113	2,176,001,017
純資産合計	2,286,079,113	2,176,001,017
負債純資産合計	2,298,643,873	2,195,680,708

## (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第11期 特定期間 (自平成28年9月16日 至平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自平成29年3月16日 至平成29年9月15日)
営業収益		
受取配当金	73,852,510	66,367,411
受取利息	3	-
有価証券売買等損益	59,942,883	64,843,981
営業収益合計	13,909,630	131,211,392
営業費用		
支払利息	18,484	17,883
受託者報酬	377,869	368,537
委託者報酬	15,744,621	15,355,660
その他費用	149,346	186,201
営業費用合計	16,290,320	15,928,281
営業利益	2,380,690	115,283,111



経常利益	2,380,690	115,283,111
当期純利益	2,380,690	115,283,111
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	900,091	1,350,966
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	211,640,330	252,623,710
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,516,606	25,075,628
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,516,606	25,075,628
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,802,674	8,617,453
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,802,674	8,617,453
分配金	61,416,531	58,704,196
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	252,623,710	180,937,586

### （3）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 特定期間の末日における受益権の総数 2,538,702,823口	1 特定期間の末日における受益権の総数 2,356,938,603口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 252,623,710円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 180,937,586円
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9005円 （1万口当たり純資産額 9,005円）	3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9232円 （1万口当たり純資産額 9,232円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	期 別	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

<p>分配金の計算過程</p>	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額398,789,698円（1万口当たり1,481円）のうち、10,769,244円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額386,813,574円（1万口当たり1,480円）のうち、10,450,405円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額379,793,625円（1万口当たり1,483円）のうち、10,241,054円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額372,588,530円（1万口当たり1,491円）のうち、9,990,948円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額365,859,204円（1万口当たり1,491円）のうち、9,810,069円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額376,976,848円（1万口当たり1,484円）のうち、10,154,811円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額372,579,569円（1万口当たり1,488円）のうち、10,012,910円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額368,173,335円（1万口当たり1,486円）のうち、9,904,640円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額365,410,902円（1万口当たり1,482円）のうち、9,856,800円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額363,039,946円（1万口当たり1,478円）のうち、9,821,293円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額358,412,764円（1万口当たり1,480円）のうち、9,680,799円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額348,455,460円（1万口当たり1,478円）のうち、9,427,754円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>
-----------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
1 金融商品に対する取組方針	<p>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ます。</p> <p>有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定められた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。</p>	同左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。</p> <p>有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。</p>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の 1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。</p>	同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

項 目	期 別	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
期首元本額		2,809,870,677 円	2,538,702,823 円
期中追加設定元本額		156,624,507 円	100,493,861 円
期中一部解約元本額		427,792,361 円	282,258,081 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	19,943,266 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	19,943,266 円

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	25,745,662 円
親投資信託受益証券	1 円
合計	25,745,661 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

該当事項はありません。

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

該当事項はありません。

## （4）附属明細表

## 有価証券明細表

## a . 株式

該当事項はありません。

## b . 株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
----	----	------	--------	----

投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class A- JPY Hedged Class	22,783,771.310	2,076,512,917	
合計		22,783,771.310	2,076,512,917	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	66,127,026	66,312,181	
合計		66,127,026	66,312,181	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルブル・コース

### （1）貸借対照表

（単位：円）

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,052,627	12,152,621
投資信託受益証券	391,024,652	396,067,423
親投資信託受益証券	12,408,654	12,404,943
流動資産合計	413,485,933	420,624,987
資産合計	413,485,933	420,624,987
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,743,461	1,773,863
未払解約金	3,564	-
未払受託者報酬	10,490	11,351
未払委託者報酬	437,187	472,927
未払利息	18	25
その他未払費用	5,587	5,284
流動負債合計	2,200,307	2,263,450
負債合計	2,200,307	2,263,450
純資産の部		
元本等		
元本	348,692,218	354,772,785
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	62,593,408	63,588,752
（分配準備積立金）	6,099,040	5,353,540
元本等合計	411,285,626	418,361,537
純資産合計	411,285,626	418,361,537
負債純資産合計	413,485,933	420,624,987

### （2）損益及び剰余金計算書

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
営業収益		
受取配当金	13,578,706	12,425,298
受取利息	1	-
有価証券売買等損益	41,822,736	1,739,060
営業収益合計	55,401,443	14,164,358
営業費用		
支払利息	5,742	4,610
受託者報酬	69,825	68,817
委託者報酬	2,909,404	2,867,341
その他費用	27,625	34,690
営業費用合計	3,012,596	2,975,458
営業利益	52,388,847	11,188,900
経常利益	52,388,847	11,188,900
当期純利益	52,388,847	11,188,900
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,563,123	88,906
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	38,329,409	62,593,408
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,394,546	6,776,103
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,394,546	6,776,103
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,064,145	6,057,801
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,064,145	6,057,801
分配金	16,892,126	10,822,952
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	62,593,408	63,588,752

### （3）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 348,692,218口	1 特定期間の末日における受益権の総数 354,772,785口
2 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	2 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1795円 11,795円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1792円 11,792円)
---------------------------	---------------------	---------------------------	---------------------

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

期 別 項 目	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
分配金の計算過程	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額188,480,307円（1万口当たり4,487円）のうち、4,200,396円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額168,748,586円（1万口当たり4,436円）のうち、3,804,070円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額157,351,068円（1万口当たり4,395円）のうち、3,579,691円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額149,596,746円（1万口当たり4,352円）のうち、1,718,603円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額160,759,531円（1万口当たり4,354円）のうち、1,845,905円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額151,561,906円（1万口当たり4,346円）のうち、1,743,461円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額157,711,585円（1万口当たり4,341円）のうち、1,816,308円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額158,248,065円（1万口当たり4,342円）のうち、1,822,018円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額157,568,004円（1万口当たり4,339円）のうち、1,815,623円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額157,072,666円（1万口当たり4,346円）のうち、1,806,831円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額155,366,274円（1万口当たり4,343円）のうち、1,788,309円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額154,063,627円（1万口当たり4,342円）のうち、1,773,863円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>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ます。</p> <p>有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。</p>	同左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。</p> <p>有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。</p>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p>	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。</p>	同左



## （関連当事者との取引に関する注記）

第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

項 目	期 別	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
期首元本額		432,182,421 円	348,692,218 円
期中追加設定元本額		80,975,421 円	41,748,472 円
期中一部解約元本額		164,465,624 円	35,667,905 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,514,049 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	1,514,049 円

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	8,544,807 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	8,544,807 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

該当事項はありません。

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

該当事項はありません。

## （4）附属明細表

## 有価証券明細表

## a . 株式

該当事項はありません。

## b . 株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
----	----	------	--------	----

投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class B- USD Bull Class	2,890,665.495	396,067,423	
合計		2,890,665.495	396,067,423	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	12,370,307	12,404,943	
合計		12,370,307	12,404,943	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルペア・コース

### （1）貸借対照表

（単位：円）

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,508,004	1,392,422
投資信託受益証券	52,128,275	36,609,965
親投資信託受益証券	813,135	812,892
流動資産合計	55,449,414	38,815,279
資産合計	55,449,414	38,815,279
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	316,374	213,626
未払解約金	-	10,436
未払受託者報酬	1,398	1,092
未払委託者報酬	58,248	45,513
未払利息	4	2
その他未払費用	735	500
流動負債合計	376,759	271,169
負債合計	376,759	271,169
純資産の部		
元本等		
元本	105,458,202	71,208,981
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	50,385,547	32,664,871
元本等合計	55,072,655	38,544,110
純資産合計	55,072,655	38,544,110
負債純資産合計	55,449,414	38,815,279

### （2）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
営業収益		
受取配当金	1,562,779	1,303,153
有価証券売買等損益	6,642,422	2,981,447
営業収益合計	5,079,643	4,284,600
営業費用		
支払利息	898	893
受託者報酬	8,028	7,310
委託者報酬	334,275	304,683
その他費用	3,270	3,649
営業費用合計	346,471	316,535
営業利益	5,426,114	3,968,065
経常利益	5,426,114	3,968,065
当期純利益	5,426,114	3,968,065
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	27,085	216,278
期首剰余金又は期首欠損金( )	25,480,726	50,385,547
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,612,921	21,385,276
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,612,921	21,385,276
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,216,099	5,928,563
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,216,099	5,928,563
分配金	1,902,614	1,487,824
期末剰余金又は期末欠損金( )	50,385,547	32,664,871

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 105,458,202口	1 特定期間の末日における受益権の総数 71,208,981口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 50,385,547円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 32,664,871円

3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
0.5222円 5,222円)	0.5413円 5,413円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	期 別	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
分配金の計算過程		<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額2,717,120円(1万口当たり411円)のうち、264,220円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額2,808,609円(1万口当たり396円)のうち、283,332円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額3,809,623円(1万口当たり378円)のうち、402,895円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額3,922,258円(1万口当たり367円)のうち、320,394円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額3,793,089円(1万口当たり360円)のうち、315,399円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額3,697,174円(1万口当たり350円)のうち、316,374円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額3,951,529円(1万口当たり347円)のうち、340,934円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額2,602,621円(1万口当たり336円)のうち、232,059円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額2,638,396円(1万口当たり332円)のうち、237,773円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額2,565,076円(1万口当たり323円)のうち、237,659円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額2,412,605円(1万口当たり320円)のうち、225,773円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額2,207,712円(1万口当たり310円)のうち、213,626円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

1 金融商品に対する取組方針	<p>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ます。</p> <p>有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。</p>	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。</p> <p>有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。</p>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
--	-----------------------------	-----------------------------

1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。	同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

項 目	期 別	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
期首元本額		66,000,879 円	105,458,202 円
期中追加設定元本額		54,479,192 円	12,958,546 円
期中一部解約元本額		15,021,869 円	47,207,767 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	794,839 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	794,839 円

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	81,847 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	81,847 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

該当事項はありません。

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

該当事項はありません。

**（４）附属明細表**

有価証券明細表

a．株式

該当事項はありません。

b．株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class C- USD Bear Class	644,462.222	36,609,965	
合計		644,462.222	36,609,965	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	810,623	812,892	
合計		810,623	812,892	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロブル・コース****（１）貸借対照表**

（単位：円）

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,014,352	218,722
投資信託受益証券	24,592,881	4,488,696
親投資信託受益証券	514,881	94,749
流動資産合計	26,122,114	4,802,167
資産合計	26,122,114	4,802,167
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	113,347	18,573
未払解約金	1,765	-
未払受託者報酬	645	688
未払委託者報酬	26,912	28,652
未払利息	1	-
その他未払費用	338	305
流動負債合計	143,008	48,218
負債合計	143,008	48,218

純資産の部		
元本等		
元本	28,336,962	4,643,428
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,357,856	110,521
（分配準備積立金）	-	4,051
元本等合計	25,979,106	4,753,949
純資産合計	25,979,106	4,753,949
負債純資産合計	26,122,114	4,802,167

## （２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
営業収益		
受取配当金	819,036	902,644
有価証券売買等損益	719,662	2,945,683
営業収益合計	1,538,698	3,848,327
営業費用		
支払利息	260	672
受託者報酬	4,176	4,595
委託者報酬	173,987	191,274
その他費用	1,640	2,275
営業費用合計	180,063	198,816
営業利益	1,358,635	3,649,511
経常利益	1,358,635	3,649,511
当期純利益	1,358,635	3,649,511
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,541	1,707,341
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,724,182	2,357,856
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,357	1,773,519
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	47,357	1,773,519
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,734	582,220
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,734	582,220
分配金	1,027,473	665,092
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,357,856	110,521

## （３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--



2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
--------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 28,336,962口	1 特定期間の末日における受益権の総数 4,643,428口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 2,357,856円	-
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9168円 (1万口当たり純資産額 9,168円)	2 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0238円 (1万口当たり純資産額 10,238円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	期 別 第11期 特定期間 (自平成28年9月16日 至平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自平成29年3月16日 至平成29年9月15日)

<p>分配金の計算過程</p>	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額11,665,254円(1万口当たり4,075円)のうち、229,006円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額11,554,403円(1万口当たり4,033円)のうち、229,171円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額11,470,658円(1万口当たり3,999円)のうち、229,415円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額11,220,050円(1万口当たり3,963円)のうち、113,235円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額11,212,224円(1万口当たり3,958円)のうち、113,299円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額11,196,145円(1万口当たり3,951円)のうち、113,347円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額11,190,633円(1万口当たり3,946円)のうち、113,428円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額15,116,715円(1万口当たり3,947円)のうち、153,193円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額15,090,648円(1万口当たり3,945円)のうち、153,008円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額5,640,573円(1万口当たり3,963円)のうち、56,928円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額16,862,924円(1万口当たり3,968円)のうち、169,962円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額1,841,879円(1万口当たり3,966円)のうち、18,573円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
-----------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>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ます。</p> <p>有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。</p>	同左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。</p> <p>有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。</p>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の 1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。	同左
----------------------	--	----

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第11期 特定期間 ( 自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日 )	第12期 特定期間 ( 自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日 )
該当事項はありません。	同左

## ( その他の注記 )

## 1 元本の移動

項 目	期 別 第11期 特定期間 ( 自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日 )	第12期 特定期間 ( 自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日 )
期首元本額	28,774,515 円	28,336,962 円
期中追加設定元本額	149,888 円	38,385,515 円
期中一部解約元本額	587,441 円	62,079,049 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間 ( 自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日 )

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	56,586 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	56,586 円

第12期 特定期間 ( 自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日 )

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	157,397 円
親投資信託受益証券	1 円
合計	157,396 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間 ( 自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日 )

該当事項はありません。

第12期 特定期間 ( 自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日 )

該当事項はありません。

## ( 4 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## a. 株式

該当事項はありません。

## b. 株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class D- EUR Bull Class	39,435.068	4,488,696	
合計		39,435.068	4,488,696	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	94,485	94,749	
合計		94,485	94,749	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロペア・コース

## （1）貸借対照表

（単位：円）

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,351,930	3,147,996
投資信託受益証券	131,216,844	87,067,272
親投資信託受益証券	4,318,533	1,987,580
流動資産合計	138,887,307	92,202,848
資産合計	138,887,307	92,202,848
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	588,567	414,078
未払受託者報酬	3,513	2,603
未払委託者報酬	146,382	108,479
未払利息	6	6
その他未払費用	1,863	1,204
流動負債合計	740,331	526,370
負債合計	740,331	526,370
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	196,189,032	138,026,200
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,042,056	46,349,722

（分配準備積立金）	267,382	35,660
元本等合計	138,146,976	91,676,478
純資産合計	138,146,976	91,676,478
負債純資産合計	138,887,307	92,202,848

## （２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
営業収益		
受取配当金	4,740,833	3,089,242
有価証券売買等損益	11,472,628	4,350,525
営業収益合計	6,731,795	1,261,283
営業費用		
支払利息	1,701	1,652
受託者報酬	23,817	17,394
委託者報酬	992,424	724,792
その他費用	9,347	8,778
営業費用合計	1,027,289	752,616
営業利益	7,759,084	2,013,899
経常利益	7,759,084	2,013,899
当期純利益	7,759,084	2,013,899
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	170,826	871,652
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	50,106,121	58,042,056
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,404,889	18,032,705
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,404,889	18,032,705
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,128,938	802,790
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,128,938	802,790
分配金	4,281,976	2,652,030
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,042,056	46,349,722

## （３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 196,189,032口	1 特定期間の末日における受益権の総数 138,026,200口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 58,042,056円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 46,349,722円
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7042円 (1万口当たり純資産額 7,042円)	3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.6642円 (1万口当たり純資産額 6,642円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	期 別	第11期 特定期間 (自平成28年9月16日 至平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自平成29年3月16日 至平成29年9月15日)
分配金の計算過程		<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額21,149,975円(1万口当たり1,009円)のうち、837,830円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額20,918,968円(1万口当たり1,002円)のうち、834,319円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額20,376,451円(1万口当たり991円)のうち、821,637円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額20,148,338円(1万口当たり991円)のうち、609,563円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額19,551,044円(1万口当たり994円)のうち、590,060円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額19,439,062円(1万口当たり990円)のうち、588,567円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額15,553,650円(1万口当たり997円)のうち、468,010円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額15,230,611円(1万口当たり992円)のうち、460,520円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額15,049,177円(1万口当たり991円)のうち、455,434円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額14,056,938円(1万口当たり988円)のうち、426,702円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額14,078,973円(1万口当たり988円)のうち、427,286円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額13,527,956円(1万口当たり980円)のうち、414,078円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15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ます。 有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。 有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、コントリビューションリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	同左
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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)



1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)の1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。	同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
該当事項はありません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

項 目	期 別	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
期首元本額		211,994,480 円	196,189,032 円
期中追加設定元本額		25,685,575 円	2,771,110 円
期中一部解約元本額		41,491,023 円	60,933,942 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間(自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,265,138 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	2,265,138 円

第12期 特定期間(自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	477,494 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	477,494 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間(自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)

該当事項はありません。

第12期 特定期間(自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

該当事項はありません。

## (4) 附属明細表

## 有価証券明細表

## a. 株式

該当事項はありません。

## b. 株式以外の有価証券

(平成29年9月15日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class E- EUR Bear Class	1,297,536.180	87,067,272	
合計		1,297,536.180	87,067,272	

(注) 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(平成29年9月15日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	1,982,031	1,987,580	
合計		1,982,031	1,987,580	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型) 豪ドルブル・コース

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,138,384	43,934,733
投資信託受益証券	2,442,183,707	1,885,155,627
親投資信託受益証券	78,535,505	63,433,636
流動資産合計	2,586,857,596	1,992,523,996
資産合計	2,586,857,596	1,992,523,996
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,595,588	8,450,489
未払解約金	634,623	6,788,648
未払受託者報酬	67,725	55,124
未払委託者報酬	2,821,756	2,296,840
未払利息	121	92
その他未払費用	36,112	25,713
流動負債合計	15,155,925	17,616,906
負債合計	15,155,925	17,616,906
純資産の部		
元本等		

元本	3,865,196,020	2,816,829,803
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,293,494,349	841,922,713
（分配準備積立金）	-	228,013
元本等合計	2,571,701,671	1,974,907,090
純資産合計	2,571,701,671	1,974,907,090
負債純資産合計	2,586,857,596	1,992,523,996

## （２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
営業収益		
受取配当金	93,867,129	66,019,065
受取利息	6	-
有価証券売買等損益	336,689,687	115,550,051
営業収益合計	430,556,822	181,569,116
営業費用		
支払利息	29,846	22,292
受託者報酬	483,048	369,108
委託者報酬	20,126,615	15,379,333
その他費用	191,884	187,066
営業費用合計	20,831,393	15,957,799
営業利益	409,725,429	165,611,317
経常利益	409,725,429	165,611,317
当期純利益	409,725,429	165,611,317
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	5,425,213	4,739,615
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,957,023,262	1,293,494,349
剰余金増加額又は欠損金減少額	515,157,148	361,978,209
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	515,157,148	361,978,209
剰余金減少額又は欠損金増加額	74,279,759	12,150,934
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	74,279,759	12,150,934
分配金	181,648,692	59,127,341
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,293,494,349	841,922,713

## （３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 特定期間の末日における受益権の総数 3,865,196,020口	1 特定期間の末日における受益権の総数 2,816,829,803口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,293,494,349円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 841,922,713円
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.6653円 （1万口当たり純資産額 6,653円）	3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7011円 （1万口当たり純資産額 7,011円）

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

期 別	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
分配金の計算過程	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額676,645,251円（1万口当たり1,400円）のうち、48,320,617円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額633,753,814円（1万口当たり1,327円）のうち、47,738,363円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額596,414,863円（1万口当たり1,260円）のうち、47,304,643円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額562,440,898円（1万口当たり1,191円）のうち、14,159,251円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額498,460,295円（1万口当たり1,193円）のうち、12,530,230円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額458,944,992円（1万口当たり1,187円）のうち、11,595,588円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額435,449,304円（1万口当たり1,182円）のうち、11,045,537円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額422,501,094円（1万口当たり1,181円）のうち、10,730,419円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額407,134,295円（1万口当たり1,177円）のうち、10,376,661円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額380,232,691円（1万口当たり1,180円）のうち、9,662,237円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額348,141,178円（1万口当たり1,178円）のうち、8,861,998円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額331,791,011円（1万口当たり1,177円）のうち、8,450,489円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15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ます。 有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。 有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	同左
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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)

1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)の1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。	同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
該当事項はありません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

項 目	期 別	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
期首元本額		5,126,721,687 円	3,865,196,020 円
期中追加設定元本額		213,274,055 円	37,343,288 円
期中一部解約元本額		1,474,799,722 円	1,085,709,505 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間(自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	39,367,443 円
親投資信託受益証券	1 円
合計	39,367,444 円

第12期 特定期間(自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	71,967,152 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	71,967,152 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間(自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)

該当事項はありません。

第12期 特定期間(自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

該当事項はありません。

## (4) 附属明細表

## 有価証券明細表

## a. 株式

該当事項はありません。

## b. 株式以外の有価証券

(平成29年9月15日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class G- AUD Bull Class	15,227,920.345	1,885,155,627	
合計		15,227,920.345	1,885,155,627	

(注) 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(平成29年9月15日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	63,256,518	63,433,636	
合計		63,256,518	63,433,636	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型) レアルブル・コース

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,967,281	18,439,036
投資信託受益証券	936,482,923	810,913,246
親投資信託受益証券	29,609,169	24,230,848
流動資産合計	995,059,373	853,583,130
資産合計	995,059,373	853,583,130
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,025,291	3,284,414
未払解約金	4,108,097	12,373
未払受託者報酬	24,423	22,864
未払委託者報酬	1,017,567	952,585
未払利息	53	38
その他未払費用	13,014	10,656
流動負債合計	9,188,445	4,282,930
負債合計	9,188,445	4,282,930
純資産の部		

元本等		
元本	1,341,763,826	1,094,804,791
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	355,892,898	245,504,591
（分配準備積立金）	1,534,123	2,092,409
元本等合計	985,870,928	849,300,200
純資産合計	985,870,928	849,300,200
負債純資産合計	995,059,373	853,583,130

## （２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
営業収益		
受取配当金	29,447,733	26,120,047
受取利息	2	-
有価証券売買等損益	169,691,565	44,322,002
営業収益合計	199,139,300	70,442,049
営業費用		
支払利息	10,079	8,755
受託者報酬	149,716	145,876
委託者報酬	6,238,175	6,077,969
その他費用	60,870	73,849
営業費用合計	6,458,840	6,306,449
営業利益	192,680,460	64,135,600
経常利益	192,680,460	64,135,600
当期純利益	192,680,460	64,135,600
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,577,675	3,880,234
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	463,536,876	355,892,898
剰余金増加額又は欠損金減少額	65,697,350	89,812,125
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	65,697,350	89,812,125
剰余金減少額又は欠損金増加額	80,021,717	25,983,127
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	80,021,717	25,983,127
分配金	68,134,440	21,456,525
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	355,892,898	245,504,591

## （３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--



2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
--------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

第11期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第12期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 1,341,763,826口	1 特定期間の末日における受益権の総数 1,094,804,791口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 355,892,898円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 245,504,591円
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7348円 (1万口当たり純資産額 7,348円)	3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7758円 (1万口当たり純資産額 7,758円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	期 別 第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

<p>分配金の計算過程</p>	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額95,509,175円（1万口当たり715円）のうち、18,696,885円（1万口当たり140円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額80,467,550円（1万口当たり604円）のうち、18,624,541円（1万口当たり140円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額66,772,021円（1万口当たり499円）のうち、18,727,006円（1万口当たり140円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額54,559,882円（1万口当たり399円）のうち、4,094,791円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額53,595,819円（1万口当たり405円）のうち、3,965,926円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額53,958,422円（1万口当たり402円）のうち、4,025,291円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額52,102,508円（1万口当たり400円）のうち、3,905,113円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額52,344,107円（1万口当たり402円）のうち、3,897,134円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額48,954,135円（1万口当たり401円）のうち、3,661,267円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額46,354,126円（1万口当たり407円）のうち、3,411,141円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額44,894,800円（1万口当たり408円）のうち、3,297,456円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額45,005,147円（1万口当たり411円）のうち、3,284,414円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
-----------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第11期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第12期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>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ます。</p> <p>有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。</p>	同左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。</p> <p>有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。</p>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第12期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の 1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。	同左
----------------------	--	----

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
該当事項はありません。	同左

## ( その他の注記 )

## 1 元本の移動

項 目	期 別 第11期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第12期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
期首元本額	1,291,401,830 円	1,341,763,826 円
期中追加設定元本額	263,181,108 円	98,012,972 円
期中一部解約元本額	212,819,112 円	344,972,007 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	23,582,664 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	23,582,664 円

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	43,827,198 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	43,827,198 円

## 3 デリバティブ取引関係

第11期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

該当事項はありません。

第12期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

該当事項はありません。

## ( 4 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## a . 株式

該当事項はありません。

## b . 株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class F- BRL Bull Class	6,290,684.340	810,913,246	
合計		6,290,684.340	810,913,246	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	24,163,192	24,230,848	
合計		24,163,192	24,230,848	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルペア・コース

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）インドネシアルピアブル・コース

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）（以下「財務諸表等規則」という。）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）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しており、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、財務諸表は原則として6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、第11期特定期間（平成29年3月16日から平成29年9月15日まで）の財務諸表について、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## T &amp; D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルペア・コース

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	第10期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第11期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	836,553	941,342
投資信託受益証券	21,251,655	21,795,072
親投資信託受益証券	431,487	431,358
流動資産合計	22,519,695	23,167,772
資産合計	22,519,695	23,167,772
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	114,054	118,887
未払解約金	-	778
未払受託者報酬	323	640
未払委託者報酬	13,513	26,562
未払利息	1	1
その他未払費用	166	285
流動負債合計	128,057	147,153
負債合計	128,057	147,153
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	28,513,524	29,721,909
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,121,886	6,701,290
（分配準備積立金）	121,036	475,791
元本等合計	22,391,638	23,020,619
純資産合計	22,391,638	23,020,619
負債純資産合計	22,519,695	23,167,772

## (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第10期 特定期間 (自平成28年9月16日 至平成29年3月15日)	第11期 特定期間 (自平成29年3月16日 至平成29年9月15日)

営業収益		
受取配当金	183,236	684,934
有価証券売買等損益	872,768	156,712
営業収益合計	689,532	528,222
営業費用		
支払利息	75	312
受託者報酬	738	3,803
委託者報酬	30,965	158,358
その他費用	265	1,868
営業費用合計	32,043	164,341
営業利益	721,575	363,881
経常利益	721,575	363,881
当期純利益	721,575	363,881
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	28,581	4,989
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	413,181	6,121,886
剰余金増加額又は欠損金減少額	339,733	28,675
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	339,733	28,675
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,204,434	281,011
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,204,434	281,011
分配金	151,010	695,938
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,121,886	6,701,290

### (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

第10期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第11期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 28,513,524口	1 特定期間の末日における受益権の総数 29,721,909口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 6,121,886円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 6,701,290円
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7853円 (1万口当たり純資産額 7,853円)	3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7745円 (1万口当たり純資産額 7,745円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

期 別 項 目	第10期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第11期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
分配金の計算過程	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額630,013円（1万口当たり1,946円）のうち、3,237円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額858,883円（1万口当たり1,974円）のうち、4,349円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額649,831円（1万口当たり1,997円）のうち、3,253円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額661,107円（1万口当たり2,032円）のうち、13,013円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額662,227円（1万口当たり2,021円）のうち、13,104円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額5,742,186円（1万口当たり2,013円）のうち、114,054円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額6,258,599円（1万口当たり2,184円）のうち、114,612円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額6,255,589円（1万口当たり2,172円）のうち、115,162円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額6,253,756円（1万口当たり2,164円）のうち、115,550円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額6,229,723円（1万口当たり2,156円）のうち、115,561円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額6,256,389円（1万口当たり2,154円）のうち、116,166円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額6,359,129円（1万口当たり2,139円）のうち、118,887円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	第10期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第11期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>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ます。</p> <p>有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。</p>	同左



2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。</p> <p>有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。</p>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第10期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第11期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。</p>	同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

第10期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第11期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

期 別	第10期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第11期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
期首元本額	4,723,436 円	28,513,524 円
期中追加設定元本額	26,538,440 円	1,366,049 円
期中一部解約元本額	2,748,352 円	157,664 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第10期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	346,988 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	346,988 円

第11期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	311,222 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	311,222 円

## 3 デリバティブ取引関係

第10期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

該当事項はありません。

第11期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

該当事項はありません。

## （4）附属明細表

## 有価証券明細表

## a . 株式

該当事項はありません。

## b . 株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
----	----	------	--------	----

投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class H- AUD Bear Class	334,024.094	21,795,072	
合計		334,024.094	21,795,072	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	430,154	431,358	
合計		430,154	431,358	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）インドネシアルピアブル・コース

### （1）貸借対照表

（単位：円）

	第10期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第11期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,099,171	1,209,795
投資信託受益証券	30,474,277	31,339,289
親投資信託受益証券	638,036	637,845
流動資産合計	32,211,484	33,186,929
資産合計	32,211,484	33,186,929
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	130,863	131,610
未払解約金	10,827	-
未払受託者報酬	810	892
未払委託者報酬	33,667	37,074
未払利息	2	2
その他未払費用	423	406
流動負債合計	176,592	169,984
負債合計	176,592	169,984
純資産の部		
元本等		
元本	32,715,750	32,902,532
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	680,858	114,413
（分配準備積立金）	117,043	609,915
元本等合計	32,034,892	33,016,945
純資産合計	32,034,892	33,016,945
負債純資産合計	32,211,484	33,186,929

### （2）損益及び剰余金計算書

	第10期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第11期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
営業収益		
受取配当金	1,192,507	947,622
有価証券売買等損益	4,109,035	864,821
営業収益合計	5,301,542	1,812,443
営業費用		
支払利息	603	403
受託者報酬	6,112	5,261
委託者報酬	254,527	218,905
その他費用	2,335	2,597
営業費用合計	263,577	227,166
営業利益	5,037,965	1,585,277
経常利益	5,037,965	1,585,277
当期純利益	5,037,965	1,585,277
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	100,958	140
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,160,903	680,858
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,074,103	592
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,074,103	592
剰余金減少額又は欠損金増加額	141,581	3,380
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	10
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	141,581	3,370
分配金	1,591,400	787,078
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	680,858	114,413

### （3）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1)受取配当金 原則として、収益分配金落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

第10期 特定期間 (平成29年3月15日現在)	第11期 特定期間 (平成29年9月15日現在)
1 特定期間の末日における受益権の総数 32,715,750口	1 特定期間の末日における受益権の総数 32,902,532口

2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額			
元本の欠損	680,858円		-
3 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額		2 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9792円 9,792円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0035円 10,035円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

期 別	第10期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第11期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)
分配金の計算過程	<p>平成28年9月16日から平成28年10月17日までの計算期間末における分配対象金額5,115,449円(1万口当たり994円)のうち、462,818円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年10月18日から平成28年11月15日までの計算期間末における分配対象金額3,738,542円(1万口当たり943円)のうち、356,435円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年11月16日から平成28年12月15日までの計算期間末における分配対象金額3,863,146円(1万口当たり975円)のうち、356,576円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p> <p>平成28年12月16日から平成29年1月16日までの計算期間末における分配対象金額3,508,718円(1万口当たり931円)のうち、150,715円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年1月17日から平成29年2月15日までの計算期間末における分配対象金額3,134,175円(1万口当たり935円)のうち、133,993円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年2月16日から平成29年3月15日までの計算期間末における分配対象金額3,045,033円(1万口当たり930円)のうち、130,863円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>平成29年3月16日から平成29年4月17日までの計算期間末における分配対象金額3,037,813円(1万口当たり927円)のうち、130,941円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年4月18日から平成29年5月15日までの計算期間末における分配対象金額3,474,571円(1万口当たり1,060円)のうち、131,033円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年5月16日から平成29年6月15日までの計算期間末における分配対象金額3,473,641円(1万口当たり1,059円)のうち、131,106円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年6月16日から平成29年7月18日までの計算期間末における分配対象金額3,499,951円(1万口当たり1,067円)のうち、131,110円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年7月19日から平成29年8月15日までの計算期間末における分配対象金額3,504,284円(1万口当たり1,067円)のうち、131,278円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>平成29年8月16日から平成29年9月15日までの計算期間末における分配対象金額3,557,873円(1万口当たり1,081円)のうち、131,610円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第10期 特定期間 (自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)	第11期 特定期間 (自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15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ます。 有価証券等の金融商品に対して、信託約款及び委託会社で定めた投資ガイドラインや運用計画書等に従い、投資として運用することを目的としております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	金融商品の内容は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務となります。有価証券の詳細については、（その他の注記）2 有価証券関係に記載の通りです。 有価証券に係るリスクとしては、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスク、信用リスク、流動性リスクなどがあります。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、運用部門と独立した運用審査委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 価格変動リスク等の市場リスクに関しては、パフォーマンスの実績等の状況を常時分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	同左
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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第10期 特定期間 （平成29年3月15日現在）	第11期 特定期間 （平成29年9月15日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	証券投資信託では、金融商品は原則として時価評価されるため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券については、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）の 1 運用資産の評価基準及び評価方法に記載の通りです。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務については、時価が帳簿価額と近似しているため帳簿価額を時価としております。	同左
----------------------	--	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第10期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第11期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

項 目	期 別 第10期 特定期間 （自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）	第11期 特定期間 （自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）
期首元本額	50,054,343 円	32,715,750 円
期中追加設定元本額	2,559,541 円	216,358 円
期中一部解約元本額	19,898,134 円	29,576 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

第10期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	147,254 円
親投資信託受益証券	1 円
合計	147,255 円

第11期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	977,500 円
親投資信託受益証券	0 円
合計	977,500 円

## 3 デリバティブ取引関係

第10期 特定期間（自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日）

該当事項はありません。

第11期 特定期間（自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日）

該当事項はありません。

## （4）附属明細表

## 有価証券明細表

## a. 株式

該当事項はありません。

## b. 株式以外の有価証券

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託 受益証券	エマージングマーケット・ ハイイールドボンドファンド Class I- IDR Bull Class	256,629.103	31,339,289	
合計		256,629.103	31,339,289	

（注）投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（平成29年9月15日現在）

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	マネーアカウントマザーファンド	636,065	637,845	
合計		636,065	637,845	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）「エマージングマーケット・ハイイールドボンドファンド」の状況

Emerging Market High Yield Bond Fund Class A- JPY Hedged Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class B- USD Bull Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class C- USD Bear Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class D- EUR Bull Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class E- EUR Bear Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class G- AUD Bull Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class H- AUD Bear Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class F- BRL Bull Class  
Emerging Market High Yield Bond Fund Class I- IDR Bull Class

以下の組入資産の明細は、JPモルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッドより入手したものです。  
委託会社は、その内容の正確性・完全性を保証するものではありません。



Security	Country	Quantity	Market Value	%
<b>CASH &amp; CASH EQUIVALENTS</b>				
EURO	EURO	14.08	15.02	0
JAPAN	JAPAN	17	0.15	0
UNITED STATES	UNITED STATES	835,108.32	835,108.32	1.51
<b>TOTAL CASH &amp; CASH EQUIVQLENTS</b>			835,123.49	1.51
<b>FIXED INCOME</b>				
NETHERLANDS	NETHERLANDS	1,687,000.00	1,735,501.25	3.13
BRAZIL	BRAZIL	1,410,000.00	1,438,200.00	2.59
BRAZIL	BRAZIL	1,260,000.00	1,376,550.00	2.48
NETHERLANDS	NETHERLANDS	1,180,000.00	1,253,750.00	2.26
ARGENTINA	ARGENTINA	1,117,000.00	1,232,609.50	2.22
JAMAICA	JAMAICA	1,000,000.00	1,156,250.00	2.08
KAZAKHSTAN	KAZAKHSTAN	1,150,000.00	1,119,812.50	2.02
BERMUDA	BERMUDA	1,279,000.00	1,099,940.00	1.98
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	1,030,000.00	1,086,650.00	1.96
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	1,000,000.00	1,034,500.00	1.87
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	940,000.00	998,750.00	1.80
NETHERLANDS	NETHERLANDS	1,080,000.00	965,250.00	1.74
NETHERLANDS	NETHERLANDS	920,000.00	945,300.00	1.70
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	920,000.00	944,150.00	1.70
NETHERLANDS	NETHERLANDS	893,000.00	929,166.50	1.68
BARBADOS	BARBADOS	835,000.00	892,406.25	1.61
TURKEY	TURKEY	840,000.00	870,450.00	1.57
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	750,000.00	822,187.50	1.48
PANAMA	PANAMA	870,000.00	806,925.00	1.45
BRAZIL	BRAZIL	783,000.00	802,575.00	1.45
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	739,000.00	788,558.08	1.42
ARGENTINA	ARGENTINA	720,000.00	765,360.00	1.38
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	760,000.00	762,660.00	1.38
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	760,000.00	758,100.00	1.37
ARGENTINA	ARGENTINA	670,000.00	712,210.00	1.28
DOMINICAN REPUBLIC	DOMINICAN REPUBLIC	640,000.00	700,800.00	1.26
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	660,000.00	699,600.00	1.26
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	583,000.00	648,587.50	1.17
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	600,000.00	641,814.00	1.16
AUSTRIA	AUSTRIA	600,000.00	622,500.00	1.12
SINGAPORE	SINGAPORE	600,000.00	617,665.74	1.11
TURKEY	TURKEY	630,000.00	615,037.50	1.11
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	610,000.00	607,712.50	1.10
MEXICO	MEXICO	600,000.00	600,600.00	1.08
NETHERLANDS	NETHERLANDS	510,000.00	589,815.00	1.06
ARGENTINA	ARGENTINA	560,000.00	584,808.00	1.05
PERU	PERU	560,000.00	565,800.00	1.02
AUSTRIA	AUSTRIA	570,000.00	560,025.00	1.01
SINGAPORE	SINGAPORE	540,000.00	551,657.20	0.99
COLOMBIA	COLOMBIA	540,000.00	549,882.00	0.99
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	520,000.00	540,800.00	0.98
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	500,000.00	523,354.55	0.94
BERMUDA	BERMUDA	510,000.00	520,200.00	0.94
BERMUDA	BERMUDA	650,000.00	507,065.00	0.91
MEXICO	MEXICO	600,000.00	486,000.00	0.88
NETHERLANDS	NETHERLANDS	460,000.00	482,310.00	0.87
SOUTH KOREA	SOUTH KOREA	490,000.00	482,160.00	0.87
TURKEY	TURKEY	500,000.00	479,375.00	0.86
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	471,000.00	461,580.00	0.83
IRELAND	IRELAND	400,000.00	451,000.00	0.81
AUSTRIA	AUSTRIA	520,000.00	441,350.00	0.80
Jersey Channel Islands	Jersey Channel Islands	400,000.00	417,000.00	0.75

UNITED KINGDOM	UNITED KINGDOM	400,000.00	401,808.44	0.72
UNITED KINGDOM	UNITED KINGDOM	390,000.00	399,843.29	0.72
AZERBAIJAN	AZERBAIJAN	360,000.00	395,460.00	0.71
MEXICO	MEXICO	400,000.00	395,000.00	0.71
UNITED STATES	UNITED STATES	360,000.00	388,080.00	0.70
ARGENTINA	ARGENTINA	350,000.00	370,475.00	0.67
TURKEY	TURKEY	345,000.00	360,956.25	0.65
MAURITIUS	MAURITIUS	340,000.00	344,760.00	0.62
ARGENTINA	ARGENTINA	300,000.00	340,500.00	0.61
UNITED ARAB EMIRATES	UNITED ARAB EMIRATES	290,000.00	336,037.50	0.61
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	320,000.00	332,400.00	0.60
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	310,000.00	323,126.95	0.58
INDONESIA	INDONESIA	300,000.00	318,000.00	0.57
MAURITIUS	MAURITIUS	321,000.00	317,790.00	0.57
NETHERLANDS	NETHERLANDS	300,000.00	314,400.00	0.57
COLOMBIA	COLOMBIA	310,000.00	314,003.65	0.57
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	300,000.00	312,750.00	0.56
UNITED ARAB EMIRATES	UNITED ARAB EMIRATES	300,000.00	309,000.00	0.56
CHILE	CHILE	300,000.00	300,750.00	0.54
BERMUDA	BERMUDA	291,000.00	294,104.04	0.53
SINGAPORE	SINGAPORE	280,000.00	292,600.00	0.53
AZERBAIJAN	AZERBAIJAN	300,000.00	291,000.00	0.52
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	280,000.00	288,400.00	0.52
BRAZIL	BRAZIL	270,000.00	284,715.00	0.51
ARGENTINA	ARGENTINA	270,000.00	273,037.50	0.49
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	272,000.00	270,513.66	0.49
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	260,000.00	269,425.00	0.49
AUSTRIA	AUSTRIA	260,000.00	263,744.00	0.48
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	257,000.00	259,891.25	0.47
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	255,000.00	253,719.93	0.46
NETHERLANDS	NETHERLANDS	260,000.00	252,850.00	0.46
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	240,000.00	243,600.00	0.44
NETHERLANDS	NETHERLANDS	210,000.00	231,525.00	0.42
GHANA	GHANA	220,000.00	228,910.00	0.41
NETHERLANDS	NETHERLANDS	200,000.00	226,000.00	0.41
IRELAND	IRELAND	200,000.00	225,000.00	0.41
LUXEMBOURG	LUXEMBOURG	200,000.00	217,750.00	0.39
EGYPT	EGYPT	200,000.00	215,500.00	0.39
BRAZIL	BRAZIL	200,000.00	208,600.00	0.38
EGYPT	EGYPT	200,000.00	207,750.00	0.37
VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	VIRGIN ISLANDS (BRITISH)	200,000.00	207,000.00	0.37
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	200,000.00	206,061.78	0.37
MAURITIUS	MAURITIUS	200,000.00	204,500.00	0.37
MAURITIUS	MAURITIUS	200,000.00	202,500.00	0.37
CAYMAN ISLANDS	CAYMAN ISLANDS	200,000.00	200,882.48	0.36
CHINA	CHINA	200,000.00	200,486.80	0.36
MEXICO	MEXICO	200,000.00	199,280.00	0.36
ARGENTINA	ARGENTINA	160,000.00	164,160.00	0.30
ARGENTINA	ARGENTINA	129,000.00	140,706.75	0.25
ARGENTINA	ARGENTINA	3,000.00	3,310.50	0.01
UNITED KINGDOM	UNITED KINGDOM	1,408,131.33	1,760.16	0.00
Total Fixed Income			53,850,535.50	97.06
SHORT TERM				
UNITED KINGDOM	UNITED KINGDOM	1,555,237.87	171,076.17	0.31
Total Short Term			171,076.17	0.31
Total Securities			54,856,735.16	98.88

(注)%は、「エマージングマーケット・ハイイールドボンドファンド」の純資産総額に対する比率です。

## (参考) マネーアカウントマザーファンドの状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

当ファンドは「マネーアカウ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受益証券です。

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

対象年月日	(平成29年3月15日現在)	(平成29年9月15日現在)
-------	----------------	----------------

科 目	金額	金額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,269,851,247	1,024,765,322
流動資産合計	1,269,851,247	1,024,765,322
資産合計	1,269,851,247	1,024,765,322
負債の部		
流動負債		
未払利息	2,332	2,151
流動負債合計	2,332	2,151
負債合計	2,332	2,151
純資産の部		
元本等		
元本	1,265,970,373	1,021,937,624
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,878,542	2,825,547
元本等合計	1,269,848,915	1,024,763,171
純資産合計	1,269,848,915	1,024,763,171
負債純資産合計	1,269,851,247	1,024,765,322

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

(平成29年3月15日現在)		(平成29年9月15日現在)	
1 計算期間の末日における受益権の総数	1,265,970,373口	1 計算期間の末日における受益権の総数	1,021,937,624口
2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額		2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0031円	1口当たり純資産額	1.0028円
(1万口当たり純資産額)	10,031円)	(1万口当たり純資産額)	10,028円)

(その他の注記)

## 1 元本の移動

項 目	対象年月日	(平成29年3月15日現在)	(平成29年9月15日現在)
期首元本額		1,326,407,624 円	1,265,970,373 円
期中追加設定元本額		3,748,916,897 円	1,746,017,058 円
期中一部解約元本額		3,809,354,148 円	1,990,049,807 円
期末元本額		1,265,970,373 円	1,021,937,624 円
元本の内訳*			
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド (毎月分配型)円ヘッジ・コース		72,728,542 円	66,127,026 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド (毎月分配型)米ドルプル・コース		12,370,307 円	12,370,307 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド (毎月分配型)米ドルペア・コース		810,623 円	810,623 円

T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド （毎月分配型）ユーロブル・コース	513,290 円	94,485 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド （毎月分配型）ユーロベア・コース	4,305,187 円	1,982,031 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド （毎月分配型）リアルブル・コース	29,517,665 円	24,163,192 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド （毎月分配型）豪ドルブル・コース	78,292,798 円	63,256,518 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド （毎月分配型）豪ドルベア・コース	430,154 円	430,154 円
T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド （毎月分配型） インドネシアルピアブル・コース	636,065 円	636,065 円
T & D Jリートファンド限定追加型 1402	1,196,351 円	488,474 円
T & D ブル・ベア・ファンド （南アランド・ブル・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （南アランド・ベア・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （ブラジルリアル・ブル・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （ブラジルリアル・ベア・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （インド株・ブル・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （インド株・ベア・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （中国株・ブル・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （中国株・ベア・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （原油指数・ブル・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （原油指数・ベア・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （米国リート・ブル・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （米国リート・ベア・コース）	49,811 円	49,811 円
T & D ブル・ベア・ファンド （マネープール・コース）	896,593 円	1,694,200 円
リビング・アース戦略ファンド （年2回決算コース）	99,632 円	99,632 円
リビング・アース戦略ファンド （年4回決算コース）	99,632 円	99,632 円
T & D ダブルブル・ベア・シリーズ5 （インド・ダブルブル5）	19,931 円	19,931 円
T & D ダブルブル・ベア・シリーズ5 （インド・ダブルベア5）	19,931 円	19,931 円
T & D ダブルブル・ベア・シリーズ5 （中国・ダブルブル5）	19,931 円	19,931 円
T & D ダブルブル・ベア・シリーズ5 （中国・ダブルベア5）	19,931 円	19,931 円

T & Dダブルブル・ベア・シリーズ5 (リアル・ダブルブル5)	19,931 円	19,931 円
T & Dダブルブル・ベア・シリーズ5 (リアル・ダブルベア5)	19,931 円	19,931 円
T & Dダブルブル・ベア・シリーズ5 (金・ダブルブル5)	19,931 円	19,931 円
T & Dダブルブル・ベア・シリーズ5 (金・ダブルベア5)	19,931 円	19,931 円
T & Dダブルブル・ベア・シリーズ5 (マネーボールファンド5)	1,063,316,354 円	848,928,105 円
合計	1,265,970,373 円	1,021,937,624 円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 2 売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

(自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)

該当事項はありません。

(自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

該当事項はありません。

## 3 デリバティブ取引関係

(自 平成28年9月16日 至 平成29年3月15日)

該当事項はありません。

(自 平成29年3月16日 至 平成29年9月15日)

該当事項はありません。

### (3) 附属明細表

有価証券明細表

#### a. 株式

該当事項はありません。

#### b. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2 ファンドの現況

<更新後>

### 純資産額計算書

(平成29年9月29日現在)

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)円ヘッジ・コース

資産総額	2,171,385,663 円
負債総額	7,678,582 円
純資産総額( - )	2,163,707,081 円
発行済数量	2,345,846,237 口
1単位当たり純資産額( / )	0.9224 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)米ドルブル・コース

資産総額	424,861,520 円
負債総額	375,313 円
純資産総額 ( - )	424,486,207 円
発行済数量	354,216,719 口
1単位当たり純資産額 ( / )	1.1984 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)米ドルペア・コース

資産総額	37,893,451 円
負債総額	20,454 円
純資産総額 ( - )	37,872,997 円
発行済数量	71,269,320 口
1単位当たり純資産額 ( / )	0.5314 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)ユーロブル・コース

資産総額	6,301,230 円
負債総額	717,515 円
純資産総額 ( - )	5,583,715 円
発行済数量	5,423,859 口
1単位当たり純資産額 ( / )	1.0295 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)ユーロペア・コース

資産総額	91,051,273 円
負債総額	48,672 円
純資産総額 ( - )	91,002,601 円
発行済数量	138,018,580 口
1単位当たり純資産額 ( / )	0.6594 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)豪ドルブル・コース

資産総額	1,961,789,370 円
負債総額	9,950,576 円
純資産総額 ( - )	1,951,838,794 円
発行済数量	2,784,119,324 口
1単位当たり純資産額 ( / )	0.7011 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)豪ドルペア・コース

資産総額	23,090,344 円
負債総額	12,291 円
純資産総額 ( - )	23,078,053 円
発行済数量	29,856,005 口
1単位当たり純資産額 ( / )	0.7730 円

#### T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)リアルブル・コース

資産総額	840,731,921 円
負債総額	6,570,295 円
純資産総額( - )	834,161,626 円
発行済数量	1,078,796,934 口
1単位当たり純資産額( / )	0.7732 円

**T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)インドネシアルピアブル・コース**

資産総額	33,027,050 円
負債総額	17,820 円
純資産総額( - )	33,009,230 円
発行済数量	32,922,137 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0026 円

**(参考) マネーアカウントマザーファンド**

資産総額	1,074,735,129 円
負債総額	110,002,229 円
純資産総額( - )	964,732,900 円
発行済数量	962,096,205 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0027 円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

<訂正前>

##### (1) 資本金の額

平成29年3月末日現在の資本金の額 11億円

(略)

##### (2) 会社の機構

(略)

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終結の時までとし、補欠により選任された取締役の任期は、前任者の残任期間とします。

取締役会はその決議をもって、取締役中より取締役会長、取締役社長各1名、取締役副社長、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。また取締役中より代表取締役を選定します。

(略)

会社の機構は平成29年3月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

##### (1) 資本金の額

平成29年9月末日現在の資本金の額 11億円

(略)

##### (2) 会社の機構

(略)

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度に関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会はその決議をもって、取締役中より取締役会長、取締役社長各1名、取締役副社長若干名を選定することができます。また取締役中より代表取締役を選定します。

(略)

会社の機構は平成29年9月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### 2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

「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および第二種金融商品取引業を行っています。

委託会社の運用する証券投資信託は平成29年9月末日現在、237本であり、その純資産総額の合計は1,140,961百万円です（ただし、親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額
追加型株式投資信託	154本	486,124百万円
単位型株式投資信託	36本	109,639百万円
単位型公社債投資信託	47本	545,198百万円
合計	237本	1,140,961百万円

[次へ](#)



### 3 委託会社等の経理状況

<更新後>

1. 当社の財務諸表は、「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。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第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年内閣府令第52号）により作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## (1) 貸借対照表

区分	注記 番号	第36期 (平成28年3月31日現在)		第37期 (平成29年3月31日現在)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)					
流動資産					
1. 預金			6,399,568		6,642,674
2. 前払費用			42,361		39,531
3. 未収入金			125,183		48,324
4. 未収委託者報酬			541,361		854,047
5. 未収運用受託報酬			313,690		383,416
6. 未収法人税等			2,251		-
7. 未収消費税等			40,776		-
8. 繰延税金資産			54,160		52,937
9. その他			328		-
流動資産計			7,519,682		8,020,932
固定資産					
1. 有形固定資産			222,294		176,527
(1) 建物	1	129,493		114,696	
(2) 器具備品	1	92,128		61,326	
(3) その他	1	672		504	
2. 無形固定資産			45,558		48,795
(1) 電話加入権		2,862		2,862	
(2) ソフトウェア		41,328		42,345	
(3) ソフトウェア仮勘定		1,366		3,586	
3. 投資その他の資産			423,342		296,532
(1) 投資有価証券		63,050		38,529	
(2) 関係会社株式		5,386		5,386	
(3) 長期差入保証金		185,682		122,433	
(4) 繰延税金資産		132,823		103,847	
(5) その他		36,400		26,335	
固定資産計			691,195		521,854
資産合計			8,210,877		8,542,787

区分	注記 番号	第36期 (平成28年3月31日現在)		第37期 (平成29年3月31日現在)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
1. 預り金			136,502		14,970
2. 未払金			291,814		396,503
(1) 未払収益分配金		1,205		1,704	
(2) 未払償還金		5,660		5,660	
(3) 未払手数料		210,892		343,787	
(4) その他未払金		74,055		45,350	
3. 未払費用			268,567		583,303
4. 未払法人税等			-		11,174
5. 未払消費税等			-		38,997
6. 賞与引当金			115,430		91,112
7. 役員賞与引当金			6,175		6,458
流動負債計			818,489		1,142,521
固定負債					
1. 退職給付引当金			410,278		408,206
2. 役員退職慰労引当金			26,676		19,356
固定負債計			436,955		427,562
負債合計			1,255,444		1,570,083
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
1. 資本金			1,100,000		1,100,000
2. 資本剰余金			277,667		277,667
(1) 資本準備金		277,667		277,667	
3. 利益剰余金			5,580,304		5,594,927
(1) 利益準備金		175,000		175,000	
(2) その他利益剰余金					
別途積立金		3,137,790		3,137,790	
繰越利益剰余金		2,267,514		2,282,136	
株主資本計			6,957,972		6,972,595
評価・換算差額等					
1. その他有価証券評価差額金			2,539		108
評価・換算差額等計			2,539		108
純資産合計			6,955,433		6,972,703
負債純資産合計			8,210,877		8,542,787

## (2) 損益計算書

区分	注記 番号	第36期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第37期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業収益					
1. 委託者報酬			3,485,554		4,248,077
2. 運用受託報酬			1,528,989		1,289,990
営業収益計			5,014,544		5,538,067
営業費用					
1. 支払手数料			1,612,217		1,860,395
2. 広告宣伝費			3,125		2,604
3. 調査費			1,294,581		1,492,104
(1) 調査費		112,170		129,459	
(2) 委託調査費		800,411		988,082	
(3) 情報機器関連費		380,676		373,672	
(4) 図書費		1,323		888	
4. 委託計算費			164,312		181,296
5. 営業雑経費			144,458		104,940
(1) 通信費		8,940		7,672	
(2) 印刷費		92,160		87,593	
(3) 協会費		7,526		5,876	
(4) 諸会費		4,191		3,797	
(5) 紹介手数料		31,640		-	
営業費用計			3,218,696		3,641,341
一般管理費					
1. 給料			1,202,318		1,133,594
(1) 役員報酬		87,538		68,848	
(2) 給料・手当		1,066,119		1,010,113	
(3) 賞与		48,661		54,633	
2. 法定福利費			176,641		169,520
3. 退職金			4,021		6,136
4. 福利厚生費			3,654		3,723
5. 交際費			4,379		2,273
6. 旅費交通費			15,873		11,895
7. 事務委託費			96,492		94,455
8. 租税公課			20,908		68,018
9. 不動産賃借料			157,838		125,103
10. 退職給付費用			55,672		51,318
11. 役員退職慰労金			200		-
12. 役員退職慰労引当金繰入			6,278		4,451
13. 賞与引当金繰入			116,045		91,112
14. 役員賞与引当金繰入			6,175		6,458
15. 固定資産減価償却費			55,329		63,703
16. 諸経費			141,211		62,410
一般管理費計			2,063,042		1,894,176
営業利益または 営業損失( )			267,194		2,549

区分	注記 番号	第36期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)		第37期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業外収益					
1. 受取配当金			1,284		1,096
2. 有価証券利息			885		-
3. 受取利息			631		68
4. 雑収入			9		751
営業外収益計			2,810		1,916
営業外費用					
1. 為替差損			1,381		526
2. 雑損失			6,372		651
営業外費用計			7,754		1,177
経常利益または 経常損失( )			272,137		3,288
特別利益					
1. 投資有価証券売却益			52,535		725
特別利益計			52,535		725
特別損失					
1. 固定資産除却損	1		993		50
2. 投資有価証券売却損			2,642		6,007
3. 本社移転費用			257,044		-
特別損失計			260,680		6,057
税引前当期純利益または 税引前当期純損失( )			480,283		2,043
法人税、住民税及び事業税			100,821		45,696
法人税等調整額			43,150		29,030
当期純利益または 当期純損失( )			422,613		14,622

## ( 3 ) 株主資本等変動計算書

第36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							株主資本 合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金	利 益 剰 余 金		株主資本 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		利益 準備金	その他利益剰余金		
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計	
当期首残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,690,127	6,002,917	7,380,585
当期変動額								
剰余金の配当								
当期純利益または 当期純損失( )						422,613	422,613	422,613
株主資本以外の項 目の当期変動額 (純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	422,613	422,613	422,613
当期末残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,267,514	5,580,304	6,957,972

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有 価証券評 価差額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	1,080	1,080	7,379,505
当期変動額			
剰余金の配当			-
当期純利益または 当期純損失( )			422,613
株主資本以外の項 目の当期変動額 (純額)	1,458	1,458	1,458
当期変動額合計	1,458	1,458	424,072
当期末残高	2,539	2,539	6,955,433

第37期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							株主資本 合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金	利 益 剰 余 金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		利益 準備金	その他利益剰余金		
					別途 積立金			
当期首残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,267,514	5,580,304	6,957,972
当期変動額								
剰余金の配当								
当期純利益または 当期純損失( )						14,622	14,622	14,622
株主資本以外の項 目の当期変動額 (純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	14,622	14,622	14,622
当期末残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,282,136	5,594,927	6,972,595

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有 価証券評 価差額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	2,539	2,539	6,955,433
当期変動額			
剰余金の配当			-
当期純利益または 当期純損失( )			14,622
株主資本以外の項 目の当期変動額 (純額)	2,647	2,647	2,647
当期変動額合計	2,647	2,647	17,270
当期末残高	108	108	6,972,703

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

#### (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を採用しております。（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成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 3～50年

器具備品 2～15年

その他 8年

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

自社利用のソフトウェアについては、社内における見込利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員賞与の支出に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 役員賞与引当金

役員賞与の支出に備えるため、当事業年度における支給見込額に基づき計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、簡便法（期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）により、期末要支給額を計上しております。

#### (4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### (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。

#### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 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）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した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。

この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

## 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）を当事業年度から適用しております。



## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第36期 (平成28年3月31日現在)	第37期 (平成29年3月31日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物                  6,710千円 器具備品             83,324千円 その他                 224千円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物                  21,507千円 器具備品             92,906千円 その他                 392千円

## （損益計算書関係）

第36期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第37期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1 固定資産除却損の内訳は次のとおりであります。 器具備品                 315千円 ソフトウェア             677千円	1 固定資産除却損の内訳は次のとおりであります。 器具備品                  1千円 ソフトウェア             48千円

## （株主資本等変動計算書関係）

第36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

株式の種類	当事業年度期首 株式数（千株）	当事業年度増加 株式数（千株）	当事業年度減少 株式数（千株）	当事業年度末 株式数（千株）
普通株式	1,082	-	-	1,082
合計	1,082	-	-	1,082

## 2．配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

## (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

該当事項はありません。

第37期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31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 株式数（千株）	当事業年度増加 株式数（千株）	当事業年度減少 株式数（千株）	当事業年度末 株式数（千株）
普通株式	1,082	-	-	1,082
合計	1,082	-	-	1,082

## 2．配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

- (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  
該当事項はありません。

(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

当社では、資金運用については原則として預金等の資産を中心に投資する方針であり、有価証券の取得を行う場合には、投機的な取引は行いません。

また、資金調達については、主に金融機関からの借入による方針です。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は顧客の信用リスクに晒されておりますが、主に信託銀行により分別管理が行われている信託財産から支弁されており、当該リスクの影響は軽微であります。

投資有価証券及び関係会社株式は、主に非上場株式、子会社株式及び投資信託であります。非上場株式及び子会社株式は業務上の関係維持を目的として保有しており、定期的に発行体の財務状況等の把握を行っております。投資信託は当社が設定する投資信託を商品性の維持等を目的に取得しているものであり、市場価格等の変動リスクは軽微であります。長期差入保証金については、主に本社ビルの賃貸借契約に基づき差入れたものであり、信用リスクの影響は軽微であります。

未払金、未払費用は、ほとんどが1年以内の支払期日です。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は、「リスク管理基本方針」にて各種リスクの基本的考え方を定めており、「財務リスク管理規程」によって、財務リスク（資金繰りリスク、信用リスク）の管理方法を定めています。財務リスクの状況は、月次で開催されるリスク管理委員会にてモニタリングが行われます。

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、次表には含めておりません（（注2）参照のこと。）。

第36期（自 平成27年4月1日 至 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) 預金	6,399,568	6,399,568	-
(2) 未収入金	125,183	125,183	-
(3) 未収委託者報酬	541,361	541,361	-
(4) 未収運用受託報酬	313,690	313,690	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	32,850	32,850	-
資産計	7,412,654	7,412,654	-
(1) 未払金			
未払収益分配金	(1,205)	(1,205)	-
未払償還金	(5,660)	(5,660)	-
未払手数料	(210,892)	(210,892)	-
その他未払金	(74,055)	(74,055)	-
(2) 未払費用	(268,567)	(268,567)	-
負債計	(560,381)	(560,381)	-

(\*) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1) 預金

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、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収入金、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬

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、当該帳簿価額によっております。

## (3) 投資有価証券(投資信託)

投資信託は公表されている基準価額によっております。

## 負債

## (1) 未払金及び未払費用

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	貸借対照表計上額
非上場株式	30,200
子会社株式	5,386
長期差入保証金	185,682
合計	221,269

これらについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることができず、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はしておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超
預金	6,399,568	-	-
未収入金	125,183	-	-
未収委託者報酬	541,361	-	-
未収運用受託報酬	313,690	-	-
投資有価証券			
その他有価証券のうち 満期があるもの(その他)	23,921	1,400	7,528
合計	7,403,725	1,400	7,528

第37期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表 計上額(*)	時価(*)	差額
(1) 預金	6,642,674	6,642,674	-
(2) 未収入金	48,324	48,324	-
(3) 未収委託者報酬	854,047	854,047	-
(4) 未収運用受託報酬	383,416	383,416	-
(5) 投資有価証券			
その他有価証券	8,329	8,329	-
資産計	7,936,792	7,936,792	-
(1) 未払金			
未払収益分配金	(1,704)	(1,704)	-
未払償還金	(5,660)	(5,660)	-
未払手数料	(343,787)	(343,787)	-
その他未払金	(45,350)	(45,350)	-
(2) 未払費用	(583,303)	(583,303)	-
負債計	(979,807)	(979,807)	-

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資産

## (1) 預金

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、当該帳簿価額によっております。

## (2) 未収入金、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬

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、当該帳簿価額によっております。

## (3) 投資有価証券(投資信託)

投資信託は公表されている基準価額によっております。

## 負債

## (1) 未払金及び未払費用

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	貸借対照表計上額
非上場株式	30,200
子会社株式	5,386
長期差入保証金	122,433
合計	158,019

これらについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることができず、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はしておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超
預金	6,642,674	-	-
未収入金	48,324	-	-
未収委託者報酬	854,047	-	-
未収運用受託報酬	383,416	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち 満期があるもの(その他)	999	6,274	1,055
合計	7,929,462	6,274	1,055

## （有価証券関係）

第36期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

その他有価証券の当事業年度中の売却額は107,042千円であり、売却益の合計額は52,535千円、売却損の合計額は2,642千円であります。また、その他有価証券において、種類ごとの取得原価、貸借対照表計上額及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	種類(*)	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1) その他の証券	14,353	16,214	1,861
	小計	14,353	16,214	1,861
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1) その他の証券	22,156	16,635	5,520
	小計	22,156	16,635	5,520
合計		36,509	32,850	3,659

(\*) 当事業年度中において、保有目的が変更となった有価証券はありません。

第37期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

その他有価証券の当事業年度中の売却額は39,705千円であり、売却益の合計額は725千円、売却損の合計額は6,007千円であります。また、その他有価証券において、種類ごとの取得原価、貸借対照表計上額及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	種類(*)	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1) その他の証券	3,250	3,515	265
	小計	3,250	3,515	265
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1) その他の証券	4,922	4,813	109
	小計	4,922	4,813	109
合計		8,172	8,329	156

(\*) 当事業年度中において、保有目的が変更となった有価証券はありません。

## （退職給付関係）

第36期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を採用しております。なお、従業員の一部について平成16年7月より確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を開始しました。

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．確定給付制度

## (1)簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	402,572千円
退職給付費用	47,397千円
退職給付の支払額	39,691千円
退職給付引当金の期末残高	410,278千円

## (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及び前払年金費用の調整表

退職一時金制度の退職給付債務	410,278千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	410,278千円

退職給付引当金	410,278千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	410,278千円

## (3)退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	47,397千円
----------------	----------

## 3. 確定拠出制度

確定拠出制度への要拠出額	8,275千円
--------------	---------

## 第37期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を採用しております。なお、従業員の一部について平成16年7月より確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を開始しました。

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. 確定給付制度

## (1)簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	410,278千円
退職給付費用	42,832千円
退職給付の支払額	44,904千円
退職給付引当金の期末残高	408,206千円

## (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及び前払年金費用の調整表

退職一時金制度の退職給付債務	408,206千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	408,206千円

退職給付引当金	408,206千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	408,206千円

## (3)退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	42,832千円
----------------	----------

## 3. 確定拠出制度

確定拠出制度への要拠出額	8,486千円
--------------	---------

## （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

	第36期（平成28年3月31日現在）	第37期（平成29年3月31日現在）
	（単位：千円）	（単位：千円）
（繰延税金資産）		
賞与引当金	35,621	28,117
未払事業税	-	2,741
未払社会保険料	5,848	4,731
退職給付引当金	133,942	130,989
子会社株式評価損	1,246	1,246
連結納税加入に伴う有価証券 時価評価益	15,056	15,056
減価償却超過額否認	2,962	-
長期差入保証金	29,925	2,700
本社移転費用	24,338	75
繰越欠損金	24,938	39,461
その他有価証券評価差額金	1,120	-
その他	5,468	5,200
小計	280,470	230,321
評価性引当額	93,346	73,487
繰延税金資産計	187,123	156,833
（繰延税金負債）		
未収事業税	139	-
その他有価証券評価差額金	-	47
繰延税金負債計	139	47
繰延税金資産の純額	186,983	156,785

## 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要な項目別の内訳

第36期（平成28年3月31日現在）	第37期（平成29年3月31日現在）
税引前当期純損失を計上しているため 注記を省略しております。	税引前当期純損失を計上しているため 注記を省略しております。

## （資産除去債務関係）

## 1．当該資産除去債務の概要

本社の賃貸借契約に伴う原状回復義務であります。

## 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

当社は、資産除去債務の負債計上に代えて、賃貸借契約に関連する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積もり、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

	第36期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	第37期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
期首残高	163,632千円	158,204千円
貸借契約締結にともなう増加額	52,929	-
見積りの変更による増加額（減少額）	58,356	5,382
資産除去債務の履行による減少額	-	99,893
期末残高	158,204	52,929

## (セグメント情報等)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用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。

## 2. 関連情報

第36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

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 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

外部顧客への営業収益のうち、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、記載はありません。

第37期（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

## (1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 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

外部顧客への営業収益のうち、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、記載はありません。

## (関連当事者との取引)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

第36期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)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)
親会社	(株)T&Dホールディングス	東京都中央区	207,111	持株会社	(被所有)直接 100	経営管理役員の兼任	連結納税に伴う受取予定額(*1)	113,644	未収入金	113,644

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1)連結法人税額のうち当社の個別帰属額であり、連結納税親会社から受け取る金額であります。

第37期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)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)
親会社	(株)T&Dホールディングス	東京都中央区	207,111	持株会社	(被所有)直接 100	経営管理役員の兼任	連結納税に伴う受取予定額(*1)	48,324	未収入金	48,324

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1)連結法人税額のうち当社の個別帰属額であり、連結納税親会社から受け取る金額であります。

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第36期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)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)
同一の親会社を持つ会社	大同生命保険(株)	大阪府大阪市	110,000	生命保険業	-	投資顧問契約の締結役員の兼任	投資顧問契約(*1)	311,115	未収運用受託報酬	90,373

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1)投資顧問料については、運用の種類・受託資産の規模等を勘案し総合的に決定しております。

第37期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)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)
同一の親会社を持つ会社	大同生命保険㈱	大阪府大阪市	110,000	生命保険業	-	投資顧問契約の締結 役員の兼任	投資顧問契約(*1)	321,896	未収運用受託報酬	86,177

(注) 1.上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2.取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 投資顧問契約にかかる報酬については、運用の種類・受託資産の規模等を勘案し総合的に決定しております。

2.親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

株式会社T &amp; Dホールディングス（東京証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

第36期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第37期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	6,425.34円	1株当たり純資産額	6,441.29円
1株当たり当期純損失金額	390.40円	1株当たり当期純利益金額	13.50円
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純損失金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純損失金額の算定上の基礎		1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
当期純損失(千円)	422,613	当期純利益(千円)	14,622
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る当期純損失(千円)	422,613	普通株式に係る当期純利益(千円)	14,622
期中平均株式数(千株)	1,082	期中平均株式数(千株)	1,082

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 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

#### <訂正前>

##### (1) 受託会社

三井住友信託銀行株式会社

- ・ 資本金の額 342,037百万円（平成28年9月末日現在）  
（略）

[信託事務の一部委託先]

日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成28年9月末日現在）  
（略）

##### (2) 販売会社

大和証券株式会社

- ・ 資本金の額 100,000百万円（平成28年9月末日現在）  
（略）

#### <訂正後>

##### (1) 受託会社

三井住友信託銀行株式会社

- ・ 資本金の額 342,037百万円（平成29年3月末日現在）  
（略）

[信託事務の一部委託先]

日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成29年3月末日現在）  
（略）

##### (2) 販売会社

大和証券株式会社

- ・ 資本金の額 100,000百万円（平成29年3月末日現在）  
（略）

### 3 資本関係

#### <訂正前>

（持株比率5.0%以上を記載します。）

平成29年3月末日現在、該当事項はありません。

#### <訂正後>

（持株比率5.0%以上を記載します。）

平成29年9月末日現在、該当事項はありません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月5日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	蒲谷 剛史
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 雅人

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T & Dアセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第37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、T & Dアセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び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、当社が、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。
2. X B R L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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）円ヘッジ・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）円ヘッジ・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。

2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルブル・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルブル・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。

2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルペア・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）米ドルペア・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。

2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロブル・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロブル・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。
2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロベア・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）ユーロベア・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。
2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルブル・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルブル・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。
2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルペア・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）豪ドルペア・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。
2. X B R L 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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）リアルブル・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）リアルブル・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。

2. X B R L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11月13日

T & Dアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	蒲谷 剛史
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人
業務執行社員		

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき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T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）インドネシアルピアブル・コースの平成29年3月16日から平成29年9月15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、T & D 通貨トレード 新興国社債ファンド（毎月分配型）インドネシアルピアブル・コースの平成29年9月15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

T & Dアセットマネジメント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、当社が、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。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#)