

【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】	2019年5月22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】	ロボット戦略 世界分散ファンド
【届出の対象とした募集 内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【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、2018年11月22日付をもって提出した有価証券届出書（2019年2月20日付の有価証券届出書の訂正届出書にて訂正済。以下「原出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に更新し、加えて、原届出書の記載事項のうち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>の記載事項は原届出書の追加の内容を示します。

第一部【証券情報】

（４）発行（売出）価格

<訂正前>

（略）

T & Dアセットマネジメント株式会社

電話番号 03-6722-4810（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

インターネットホームページ <http://www.tdasset.co.jp/>

<訂正後>

（略）

T & Dアセットマネジメント株式会社

電話番号 03-6722-4810（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

インターネットホームページ <https://www.tdasset.co.jp/>

（５）申込手数料

<訂正前>

3.24%（税抜3.0%）を上限として、販売会社が個別に定める率を、発行価格に乗じて得た額とします。

（略）

<訂正後>

3.24%－（税抜3.0%）を上限として、販売会社が個別に定める率を、発行価格に乗じて得た額とします。

消費税率が10%になった場合は、3.30%となります。

（略）

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

(1) ファンドの目的及び基本的性格

ファンドの特色

(略)

<訂正前>

ファンドの運用会社 コンピューター運用の開拓者 AHL

AHLは、1987年の創業以来、約30年、一貫してコンピューター運用の最先端を走っています。

◆AHL パートナーズ LLP(AHL)について



- ・コンピューター運用の開拓者として約30年の運用実績を有する
- ・世界の大手年金基金やソブリンウェルスファンド(政府系ファンド)を顧客に持ち、運用資産残高245億米ドル(約2.7兆円)を誇る世界有数のクオンツ運用マネジャー
- ・堅固なリサーチ体制と最先端のトレーディング・テクノロジーを有する(130名を超える研究者集団(数学博士、物理学博士なども含む))
- ・複数のバックアップ・サイトを保持し、頑健なシステムを構築
- ・英国・オックスフォード大学と提携し、共同で研究所を設立

(2018年6月末現在)

AHLにおける研究・開発の方向性

最近のモデル開発事例
機械学習(マシン・ラーニング)

◆コンピューターが機械学習により過去の膨大な価格変動パターンを基に、将来の姿を予測します。

投資対象市場の拡大
幅広い市場に分散投資

◆AHLでは、450を超える幅広い市場の分析を行っています。

◆オックスフォード・マン定量ファイナンス研究所(OMI)について
2007年に英国・オックスフォード大学と提携し、共同で研究所を設立。
世界最先端の金融技術の研究・開発を行っています。



<訂正後>

ファンドの運用会社 コンピューター運用の開拓者 AHL

AHLは、1987年の創業以来、約30年、一貫してコンピューター運用の最先端を走っています。

◆AHL パートナーズ LLP(AHL)について



- ・コンピューター運用の開拓者として約30年の運用実績を有する
- ・世界の大手年金基金やソブリンウェルスファンド(政府系ファンド)を顧客に持ち、運用資産残高251億米ドル(約2.9兆円)を誇る世界有数のクオンツ運用マネジャー
- ・堅固なリサーチ体制と最先端のトレーディング・テクノロジーを有する(115名を超える研究者集団(数学博士、物理学博士なども含む))
- ・複数のバックアップ・サイトを保持し、頑健なシステムを構築
- ・英国・オックスフォード大学と提携し、共同で研究所を設立

(2018年9月末現在)

AHLにおける研究・開発の方向性

最近のモデル開発事例
機械学習(マシン・ラーニング)

◆コンピューターが機械学習により過去の膨大な価格変動パターンを基に、将来の姿を予測します。

投資対象市場の拡大
幅広い市場に分散投資

◆AHLでは、450を超える幅広い市場の分析を行っています。

◆オックスフォード・マン定量ファイナンス研究所(OMI)について
2007年に英国・オックスフォード大学と提携し、共同で研究所を設立。
世界最先端の金融技術の研究・開発を行っています。



(3) ファンドの仕組み

委託会社の概況

<訂正前>

- a . 資本金
 - 2018年9月末日現在 11億円
 - （略）
- c . 大株主の状況
 - 2019年3月末日現在

<訂正後>

- a . 資本金
 - 2018年9月末日現在 11億円
 - （略）
- c . 大株主の状況
 - 2019年3月末日現在

2 投資方針

(参考)

<更新後>

投資する投資信託証券の概要

ファンド名	マン・アンブレラ・SICAV-マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ-日本円クラス(ヘッジ付) 英名: Man Umbrella SICAV - Man AHL Diversity Alternative - IN H JPY Acc
分類	ルクセンブルク籍/外国投資信託/円建
設定日	2015年7月17日 ※「マン・アンブレラ・SICAV」のサブファンドである「マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ」は2009年11月3日に設定済み。
運用の基本方針	中期的な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。
主な投資対象	先進国および新興国の株価指数先物取引、債券先物取引、金利先物取引および為替先渡取引等を主要投資対象とします。
投資態度	①先進国および新興国の株価指数先物取引、債券先物取引、金利先物取引および為替先渡取引等を積極的に活用し、主として市場動向の方向性にそって多数の先物等についてロングポジションまたはショートポジションを構築することにより、中期的な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。 ②先進国および新興国における多くの市場を対象としたシステムチック運用により、市場の上昇および下落局面においても収益を追求します。 ③原則として、コモディティ市場への投資は行いません。 ④投資運用会社の判断によりレバレッジを活用します。 ⑤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。
ベンチマーク	なし
参考指数	なし
主な投資制限	①有価証券(先物等のデリバティブ取引は含みません)の空売りは行いません。 ②純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 ③一発行会社の発行済株式総数の50%を超えて、当該発行会社の株式に投資しません。 ④流動性にかける資産の組入れは10%以下とします。
決算日	毎年12月31日
分配方針	原則として分配は行いません。
運用報酬	運用報酬: 「日本円クラス(ヘッジ付)」の純資産総額に対して年1.0% 成功報酬: 「日本円クラス(ヘッジ付)」の成功報酬計上前の純資産総額がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、その超過部分に対して15%
管理報酬	「マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ」の純資産総額に対して上限年0.2% 当該報酬には、管理事務代行報酬、保管報酬、登録および名義書換事務代行報酬等が含まれます。その他、管理会社報酬、監査費用、取引費用、弁護士費用等がかかります。
換金時手数料	なし
購入・換金 申込不可日	・ロンドン、ルクセンブルク、ニューヨークの銀行または証券取引所の休業日 ・12月24日
管理会社	MDO マネジメント カンパニー S.A.
投資運用会社	AHL パートナーズ LLP
管理事務代行 会社、保管会社、 登録および 名義書換事務 代行会社	シティバンク ヨーロッパ plc (ルクセンブルク支店)
監査法人	アーンスト & ヤング

概要は、2018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。

ファンド名	T&D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	2012年9月5日
運用の基本方針	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	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。
決算日	9月10日(休業日の場合は翌営業日)
分配方針	分配は行いません。
信託報酬	ありません。
監査報酬	ファンド監査は行いません。
委託会社	T&Dアセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

（３）運用体制

<訂正前>

（略）

委託会社の運用体制等は2018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。

<訂正後>

（略）

委託会社の運用体制等は2019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。

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2018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。

<訂正後>

（略）

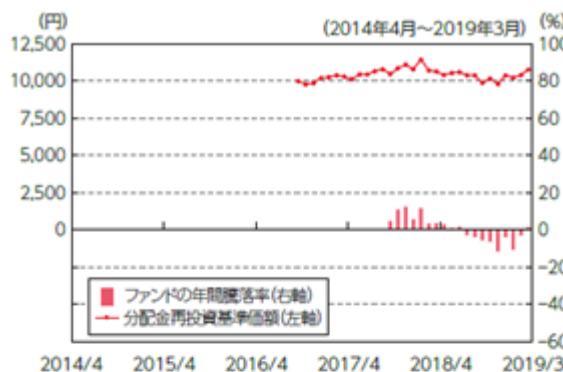
リスクの管理体制は2019年3月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

参考情報

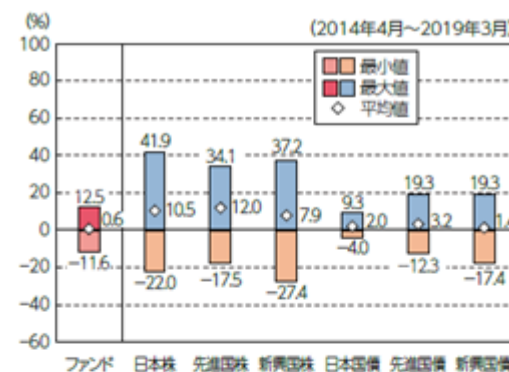
<更新後>

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>



<ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較>



(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、2014年4月から2019年3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2019年3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。

*ファンドは2016年9月に設定されたため、ファンドの騰落率、分配金再投資基準価額は2016年9月末以降のデータをもとに表示しております。

○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 …… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
- 日本国債 …… NOMURA-BPI国債
- 先進国債 …… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債 …… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (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。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・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。

FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモ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JPモルガン社に帰属します。

4 手数料等及び税金

(1) 申込手数料

<訂正前>

3.24%（税抜3.0%）を上限として、販売会社が個別に定める率を、発行価格に乗じて得た額とします。
申込手数料は、ファンドの商品説明、販売に係る事務費用等の対価です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

<訂正後>

3.24%－（税抜3.0%）を上限として、販売会社が個別に定める率を、発行価格に乗じて得た額とします。
消費税率が10%になった場合は、3.30%となります。

申込手数料は、ファンドの商品説明、販売に係る事務費用等の対価です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

(3) 信託報酬等

<訂正前>

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.9936%（税抜0.92%）を乗じて得た額とします。信託報酬の配分については、以下の通りとします。

[信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率] (年率)

支払先	信託報酬率	対価の内容
委託会社	0.4104%（税抜0.38%）	委託した資金の運用等の対価
販売会社	0.5508%（税抜0.51%）	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	0.0324%（税抜0.03%）	運用財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の信託報酬の総額は日々費用計上され、ファンドの基準価額に反映されます。

なお、毎計算期末および信託終了のとき信託財産中から支弁します。

（略）

したがって、ファンドが投資対象とする外国投資信託の信託報酬を加味して、投資者が実質的に負担する

信託報酬率は、年2.1936%－（税抜2.12%）程度＋成功報酬となります。

外国投資信託の信託報酬は、外国投資信託の運用の対価、運用財産の管理等の対価です。

上記の信託報酬の総額は、信託財産中から支弁します。

<訂正後>

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.9936%－（税抜0.92%）を乗じて得た額とします。

消費税率が10%になった場合は、年1.012%となります。

信託報酬の配分については、以下の通りとします。

[信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率] (年率)

支払先	信託報酬率（税抜）	対価の内容
委託会社	0.38%	委託した資金の運用等の対価
販売会社	0.51%	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	0.03%	運用財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の信託報酬の総額は日々費用計上され、ファンドの基準価額に反映されます。

なお、毎計算期末および信託終了のとき信託財産中から支弁します。

（略）

したがいまして、ファンドが投資対象とする外国投資信託の信託報酬を加味して、投資者が実質的に負担する

信託報酬率は、年2.1936%－（税抜2.12%）程度＋成功報酬となります。

消費税率が10%になった場合は、年2.212%程度となります。

外国投資信託の信託報酬は、外国投資信託の運用の対価、運用財産の管理等の対価です。

上記の信託報酬の総額は、信託財産中から支弁します。

（５）課税上の取扱い

<訂正前>

ファンドは、課税上は株式投資信託として取扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

（略）

法人の受益者に対する課税

（略）

上記は2018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。

税金の取扱いの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>

ファンドは、課税上は株式投資信託として取扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。

（略）

法人の受益者に対する課税

（略）

上記は2019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。

税金の取扱いの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

<更新後>

(1) 投資状況

資産の種類別、地域別の投資状況

(2019年3月29日現在)

資産の種類	国名	時価合計（百万円）	投資比率（％）
投資証券	ルクセンブルク	21,342	97.45
親投資信託受益証券	日本	0	0.00
現金・預金・その他の資産 （負債差引後）	日本	558	2.55
合計（純資産総額）	-	21,900	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

a. 評価額上位銘柄（全銘柄）

(2019年3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	ルクセンブルク	投資証券	マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ・日本円クラス（ヘッジ付）	2,022,581.163	10,163.87 20,557,252,005	10,551.67 21,341,608,980	97.45
2	日本	親投資信託受益証券	T & D マネーアカウントマザーファンド	49,921	1.0003 49,935	1.0003 49,935	0.00

(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。

b. 投資有価証券の種類別比率

(2019年3月29日現在)

種類	投資比率（％）
投資証券	97.45
親投資信託受益証券	0.00
合計	97.45

(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

2019年3月末日及び同日前1年以内における各月末及び各計算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 計算期間 (2017年2月22日現在)	14,902	15,047	1.0230	1.0330
第2期 計算期間 (2017年8月22日現在)	18,774	18,957	1.0288	1.0388
第3期 計算期間 (2018年2月22日現在)	23,423	23,649	1.0387	1.0487
2018年3月末日	24,559	-	1.0327	-
2018年4月末日	24,005	-	1.0116	-
2018年5月末日	24,517	-	1.0234	-
2018年6月末日	24,638	-	1.0304	-
2018年7月末日	23,912	-	1.0084	-
第4期 計算期間 (2018年8月22日現在)	24,177	24,413	1.0252	1.0352
2018年8月末日	23,561	-	0.9989	-
2018年9月末日	22,195	-	0.9502	-
2018年10月末日	22,523	-	0.9789	-
2018年11月末日	21,402	-	0.9435	-
2018年12月末日	22,225	-	0.9986	-
2019年1月末日	21,397	-	0.9833	-
第5期 計算期間 (2019年2月22日現在)	21,443	21,443	1.0004	1.0004
2019年2月末日	21,406	-	1.0010	-
2019年3月末日	21,900	-	1.0367	-

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期 計算期間(2017年2月22日)	0.0100
第2期 計算期間(2017年8月22日)	0.0100
第3期 計算期間(2018年2月22日)	0.0100
第4期 計算期間(2018年8月22日)	0.0100
第5期 計算期間(2019年2月22日)	0.0000

収益率の推移

	収益率(%)

第1期 計算期間（2016年9月30日～2017年2月22日）	3.30
第2期 計算期間（2017年2月23日～2017年8月22日）	1.54
第3期 計算期間（2017年8月23日～2018年2月22日）	1.93
第4期 計算期間（2018年2月23日～2018年8月22日）	0.34
第5期 計算期間（2018年8月23日～2019年2月22日）	2.42

（注）収益率とは、計算期間末の基準価額（分配金の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配金の額。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期計算期間においては、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 計算期間（2016年9月30日～2017年2月22日）	16,762,898,719	2,196,171,835
第2期 計算期間（2017年2月23日～2017年8月22日）	10,061,200,845	6,379,551,158
第3期 計算期間（2017年8月23日～2018年2月22日）	10,434,472,481	6,131,443,779
第4期 計算期間（2018年2月23日～2018年8月22日）	3,567,083,837	2,536,387,061
第5期 計算期間（2018年8月23日～2019年2月22日）	907,108,577	3,053,936,486

（注）1 第1期計算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) T & D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

(2019年3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	2	100.00
合計(純資産総額)	-	2	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

<更新後>

(2019年3月29日現在)

基準価額・純資産の推移



分配の推移(1万口当たり、税引前)

2019年2月	0円
2018年8月	100円
2018年2月	100円
2017年8月	100円
2017年2月	100円
設定来累計	400円

主要な資産の状況

●投資比率

マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ・日本円クラス(ヘッジ付)	97.5%
T&Dマネーアカウントマザーファンド	0.0%
現金・預金等	2.5%
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。

●「マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ」の運用概況 2019年3月末現在(現地基準)

セクター別買建/売建比率

種類	買建	売建
株式	67.7%	-4.3%
通貨	141.4%	-141.4%
債券・金利	308.6%	0.0%

※当ファンドはルクセンブルク籍投資法人「マン・アンブレラ・SICAV」のサブファンドである「マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ」が発行する外国投資信託証券「マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ・日本円クラス(ヘッジ付)」に投資を行います。投資対象ファンドの運用概況は、マン・グループ・ジャパン・リミテッドより入手したデータをもとに作成しています。また、データの基準日は現地基準です。

セクター別買建/売建比率(上位市場/通貨)

株式		通貨		債券・金利	
市場	買建/売建比率	通貨	買建/売建比率	市場	買建/売建比率
欧州(英国除く)	25.2%	米ドル	116.9%	欧州(英国除く)	148.9%
アジア(日本除く)	16.0%	ユーロ	-95.2%	北米	74.2%
北米	11.9%	メキシコペソ	22.0%	オーストラリア	26.1%
オーストラリア	7.0%	日本円	-21.8%	日本	24.7%
英国	2.4%	韓国ウォン	-14.1%	英国	22.9%

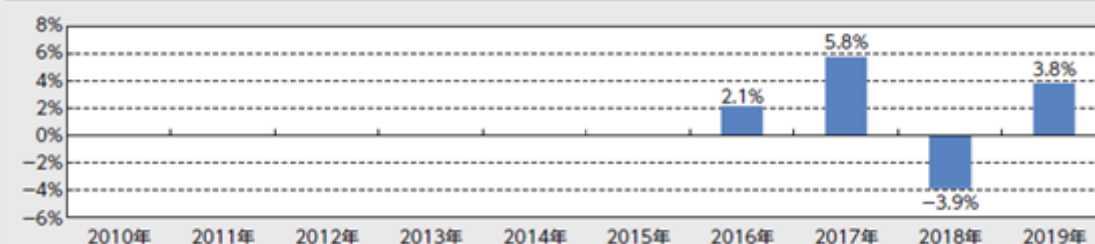
※買建/売建比率は、投資元本に対する株式、通貨、債券・金利の取引の想定元本の割合を示しています。なお、債券・金利セクターにつきましては、個別取引ごとの金利リスクの違いを考慮し、10年国債の想定元本に置き換えています。(例えば、10年国債よりもデュレーション^(注)が短い金利先物の想定元本は小さくなるように調整されます。)通貨の買建/売建比率はAHLが投資している通貨セクターを反映したものであり、為替ヘッジやキャッシュマネジメントは含みません。

(注)デュレーションとは、市場金利の変動に対する債券価格の感応度(変化の割合)を示す指標です。

※セクター別買建/売建比率(上位市場/通貨)は、買建比率から売建比率を差引いた比率の絶対値が大きい順に表示しています。

※買建/売建比率のマイナス表記は売建を表しています。

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価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。

※2016年は設定日(9月30日)から年末まで、2019年は年初から3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2【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

(1) 資産の評価

<訂正前>

(略)

基準価額につきましては、下記においてもご照会いただけます。

T & Dアセットマネジメント株式会社

電話番号 03-6722-4810（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

インターネットホームページ <http://www.tdasset.co.jp/>

<訂正後>

(略)

基準価額につきましては、下記においてもご照会いただけます。

T & Dアセットマネジメント株式会社

電話番号 03-6722-4810（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

インターネットホームページ <https://www.tdasset.co.jp/>

(5) その他

公告

<訂正前>

委託会社が投資者に対してする公告は、原則として電子公告により行い、委託会社のホームページ（<http://www.tdasset.co.jp/>）に掲載します。ただし、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

<訂正後>

委託会社が投資者に対してする公告は、原則として電子公告により行い、委託会社のホームページ（<https://www.tdasset.co.jp/>）に掲載します。ただし、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

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. 当ファンドは、第5期計算期間(2018年8月23日から2019年2月22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、EY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

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	第4期 (2018年8月22日現在)	第5期 (2019年2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	762,376,449	621,549,196
投資証券	23,939,220,191	21,128,149,895
親投資信託受益証券	49,955	49,935
流動資産合計	24,701,646,595	21,749,749,026
資産合計	24,701,646,595	21,749,749,026
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	235,821,020	-
未払解約金	167,422,207	193,728,069
未払受託者報酬	3,901,022	3,617,523
未払委託者報酬	115,730,227	107,319,824
未払利息	1,501	1,262
その他未払費用	2,080,479	1,929,288
流動負債合計	524,956,456	306,595,966
負債合計	524,956,456	306,595,966
純資産の部		
元本等		
元本	23,582,102,049	21,435,274,140
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	594,588,090	7,878,920
元本等合計	24,176,690,139	21,443,153,060
純資産合計	24,176,690,139	21,443,153,060
負債純資産合計	24,701,646,595	21,749,749,026

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位 : 円)

	第4期 (自 2018年2月23日 至 2018年8月22日)	第5期 (自 2018年8月23日 至 2019年2月22日)
営業収益		
有価証券売買等損益	41,300,730	532,911,136
営業収益合計	41,300,730	532,911,136
営業費用		
支払利息	343,812	187,130
受託者報酬	3,901,022	3,617,523
委託者報酬	115,730,227	107,319,824
その他費用	2,080,832	1,935,262
営業費用合計	122,055,893	113,059,739
営業利益	80,755,163	645,970,875
経常利益	80,755,163	645,970,875
当期純利益	80,755,163	645,970,875
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	36,207,700	143,437,878
期首剰余金又は期首欠損金 ()	871,685,541	594,588,090
剰余金増加額又は欠損金減少額	99,375,693	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	99,375,693	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	96,104,661	84,176,173
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	96,104,661	74,423,999
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	9,752,174
分配金	235,821,020	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	594,588,090	7,878,920

(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	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4期 (2018年8月22日現在)	第5期 (2019年2月22日現在)
1 計算期間の末日における受益権の総数 23,582,102,049口	1 計算期間の末日における受益権の総数 21,435,274,140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 1口当たり純資産額 1.0252円 (1万口当たり純資産額 10,252円)	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 1.0004円 (1万口当たり純資産額 10,004円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

期 別	第4期 (自 2018年2月23日 至 2018年8月22日)	第5期 (自 2018年8月23日 至 2019年2月22日)
項 目		
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後配当等収益(0円)、費用控除後有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(764,712,847円)、及び分配準備積立金(65,696,263円)より、分配対象収益は830,409,110円(1万口当たり352円)であり、うち235,821,020円(1万口当たり100円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後配当等収益(0円)、費用控除後有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(134,894,074円)、及び分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は134,894,074円(1万口当たり62円)となりましたが、当期の分配は見送りとさせていただきます。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	第4期 （自 2018年2月23日 至 2018年8月22日）	第5期 （自 2018年8月23日 至 2019年2月22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4期 (2018年8月22日現在)	第5期 (2019年2月22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4期 (自2018年2月23日 至 2018年8月22日)	第5期 (自2018年8月23日 至 2019年2月22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4期 (自 2018年2月23日 至 2018年8月22日)	第5期 (自 2018年8月23日 至 2019年2月22日)
期首元本額	22,551,405,273 円	23,582,102,049 円
期中追加設定元本額	3,567,083,837 円	907,108,577 円
期中一部解約元本額	2,536,387,061 円	3,053,936,486 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

第4期(自 2018年2月23日 至 2018年8月22日)

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
投資証券	38,886,587 円
親投資信託受益証券	15 円
合計	38,886,572 円

第5期(自 2018年8月23日 至 2019年2月22日)

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
投資証券	422,215,015 円
親投資信託受益証券	20 円
合計	422,215,035 円

3 デリバティブ取引関係

第4期（自 2018年2月23日 至 2018年8月22日）

該当事項はありません。

第5期（自 2018年8月23日 至 2019年2月22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

(2019年2月22日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資証券	マン・AHL・ダイバーシ ティ・オルタナティブ - 日 本円クラス（ヘッジ付）	2,078,750.505	21,128,149,895	
合計		2,078,750.505	21,128,149,895	

(注) 投資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。

(2019年2月22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	T & D マネーアカウントマ ザーファンド	49,921	49,935	
合計		49,921	49,935	

(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)「マン・アンブレラ・SICAV マン・AHL・ダイバーシティ・オルタナティブ」の状況

作成基準日 : 2019/2/26

< 残高試算表 >

科目	評価金額 (ドル)
現預金	135,907,462
差入証拠金	29,655,489
国債証券	83,578,010
先物取引	11,401,201
為替先渡取引	-5,331,609
未収入金(為替先渡取引)	9,220
未払金(為替先渡取引)	-9,197
未収入金(定期預金金利)	77,374
未払金	-611,921
純資産総額(試算額)	254,676,028

1. 現預金

種類	評価金額 (ドル)	与信先	与信先所在国
預金	44,023,387	SMBC	日本
預金	44,319,062	BNP Paribas	フランス
預金	43,158,704	THE SUMITOMO TRUST & BANKING	日本
預金	4,406,308	CITIBANK	米国
合計	135,907,462	-	-

2. 差入証拠金

担保種類	評価金額 (ドル)	与信先	与信先所在国
先物取引	3,815,752	JPM	米国
先物取引	2,778,311	Credit Suisse	スイス
先物取引	3,606,003	Merrill Lynch	米国
為替先渡取引	3,245,894	Deutsche Bank	ドイツ
為替先渡取引	6,092,199	HSBC	英国
為替先渡取引	6,235,698	RBS	英国
為替先渡取引	3,881,631	CITIGROUP	米国
合計	29,655,489	-	-

3. 債券現物

銘柄名	利率 (%)	通貨	額面	評価金額 (ドル)	与信先
TREASURY BILL 0% 18-15/AUG/19	0.000	USD	14,812,142	14,824,142	米国
TREASURY BILL 0% 18-07/MAR/19	0.000	USD	15,819,456	15,991,523	米国
TREASURY BILL 0% 18-04/APR/19	0.000	USD	14,834,135	14,964,138	米国
TREASURY BILL 0% 19-05/JUL/19	0.000	USD	9,876,119	9,912,645	米国
TREASURY BILL 0% 18-16/MAY/19	0.000	USD	9,909,730	9,947,224	米国
TREASURY BILL 0% 18-16/MAY/19	0.000	USD	3,953,039	3,978,890	米国
TREASURY BILL 0% 18-11/APR/19	0.000	USD	13,844,343	13,959,449	米国
合計			-	83,578,010	-

4. 先物取引

通貨	銘柄	種類	売買	簿価金額 (ドル)	評価金額 (ドル)	評価損益 (ドル)
EUR	EUX BUXL 30YR 4% 07/03/2019	Bond	買	51,850,131	53,233,575	1,383,445
GBP	90DAY STERLING FU 16/09/2020	Interest Rate	買	11,134,833	11,141,841	7,007
TRY	BIST 30 FUTURES 30/04/2019	Equity Index	売	-492,994	-494,672	-1,678
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 15/06/2020	Interest Rate	買	2,412,884	2,415,314	2,430
EUR	CAC40 10EURO FUT 15/03/2019	Equity Index	買	5,593,738	5,725,843	132,105
USD	SGX FTSE CHINA A50 INDEX FUT 28/03/2019	Equity Index	売	-661,850	-649,220	12,630
SGD	MSCI SING INDEX ETS SIMSCI 28/03/2019	Equity Index	買	2,527,880	2,518,102	-9,778
EUR	EURO-BUND FUTURE 07/03/2019	Bond	買	134,627,228	136,721,460	2,094,232
GBP	90DAY STERLING FU 18/09/2019	Interest Rate	買	8,197,640	8,204,540	6,900
MYR	FTSE KLCI FUTURE 28/02/2019	Equity Index	買	379,744	379,431	-313
GBP	LIF LONG GILT FUTURE 26/06/2019	Bond	買	57,790,720	57,679,214	-111,507
MYR	FTSE KLCI FUTURE 29/03/2019	Equity Index	売	-336,719	-336,682	37
USD	CBOE VOLATILITY INDEX VIX 22/05/2019	Equity Index	売	-263,800	-266,800	-3,000
GBP	90DAY STERLING FU 20/03/2019	Interest Rate	買	820,835	821,158	323
USD	MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX 15/03/2	Equity Index	買	1,636,500	1,658,035	21,535
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 14/12/2020	Interest Rate	買	742,509	743,136	627
USD	CBT US LONG BOND 20YR 6% 19/06/2019	Bond	買	25,544,086	25,582,813	38,727
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 12/09/2019	Interest Rate	買	6,440,070	6,440,193	123
USD	US 10YR NOTE FUT 19/06/2019	Bond	買	97,685,704	97,892,156	206,453
GBP	LIF FTSE 100 INDEX 15/03/2019	Equity Index	買	3,323,356	3,309,249	-14,107
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 18/03/2019	Interest Rate	買	285,565	285,593	28
KRW	KOREA 10Y KBT FUTURE TREASURY BOND 5% 19	Bond	買	36,244,299	36,214,166	-30,133
EUR	DJ EURO STOXX 50 15/03/2019	Equity Index	買	112,125	112,444	319
USD	CME 90DAYS EURO\$ FUTR 16/09/2019	Interest Rate	買	4,134,888	4,139,925	5,038
JPY	SGX NIKKEI 225 INDEX SGA 07/03/2019	Equity Index	買	1,165,303	1,164,896	-407
MXN	MEX BOLSA IDX FUT 15/03/2019	Equity Index	売	-656,709	-684,748	-28,039
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 13/03/2023	Interest Rate	買	973,200	974,850	1,650
USD	CME 90DAYS EURO\$ FUTR JUN 15/06/2020	Interest Rate	買	1,218,600	1,219,375	775
TRY	BIST 30 FUTURES 28/02/2019	Equity Index	売	-60,940	-62,313	-1,373
USD	CBOE VOLATILITY INDEX VIX 17/07/2019	Equity Index	売	-1,658,000	-1,629,600	28,400
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 12/12/2019	Interest Rate	買	4,291,407	4,293,989	2,582
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 14/09/2020	Interest Rate	買	2,920,288	2,927,850	7,563
USD	EURO FX CURRENCY 18/03/2019	Currency	売	-141,369	-142,694	-1,325

CAD	CAN 10YR BOND FUT 19/06/2019	Bond	買	24,920,174	25,010,616	90,442
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT 14/03/2019	Equity Index	買	5,847,474	5,953,896	106,422
NOK	QBX INDEX FUTURE 15/03/2019	Equity Index	買	668,808	668,750	-58
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 15/06/2020	Interest Rate	買	11,109,414	11,124,263	14,848
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 16/12/2019	Interest Rate	買	2,189,713	2,191,388	1,675
USD	MSCI TAIWAN INDEX FUT 28/03/2019	Equity Index	買	3,565,895	3,587,980	22,085
USD	CME S&P500 EMINI FUT 15/03/2019	Equity Index	買	3,212,375	3,210,225	-2,150
GBP	90DAY STERLING FU 18/03/2020	Interest Rate	買	43,421,129	43,451,137	30,009
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 13/06/2022	Interest Rate	買	7,642,959	7,669,894	26,935
GBP	90DAY STERLING FU 15/09/2021	Interest Rate	買	5,727,234	5,728,103	870
GBP	90DAY STERLING FU 16/12/2020	Interest Rate	買	63,015,240	63,063,347	48,107
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 19/09/2022	Interest Rate	買	15,296,893	15,329,793	32,900
EUR	FTSEMIB INDEX FUT 15/03/2019	Equity Index	買	9,260,140	9,558,446	298,306
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 14/03/2022	Interest Rate	買	9,638,226	9,663,709	25,483
KRW	KFE KOREA STOCK PRICE 200 INDEX KOSPI2 1	Equity Index	買	9,379,644	9,517,023	137,380
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 11/03/2021	Interest Rate	買	715,173	715,630	457
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 16/09/2019	Interest Rate	買	3,139,492	3,140,745	1,253
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 14/09/2020	Interest Rate	買	1,299,605	1,300,620	1,016
SEK	OMX STOCKHOLM 30 INDEX OMX 15/03/2019	Equity Index	買	3,852,280	3,855,810	3,529
GBP	90DAY STERLING FU 16/06/2021	Interest Rate	買	9,655,349	9,658,389	3,040
GBP	90DAY STERLING FU 19/06/2019	Interest Rate	買	5,249,522	5,253,821	4,299
AUD	SPI 200 FUTURES 21/03/2019	Equity Index	買	11,903,361	12,285,458	382,097
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 12/03/2020	Interest Rate	買	4,291,706	4,294,305	2,599
USD	CBOE VOLATILITY INDEX VIX 17/04/2019	Equity Index	売	-1,323,000	-1,260,875	62,125
USD	NIFTY-SGX CNX NIFTY INDEX 28/02/2019	Equity Index	売	-1,672,579	-1,688,388	-15,809
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 17/06/2019	Interest Rate	買	3,645,588	3,652,688	7,100
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 14/12/2020	Interest Rate	買	61,764,697	61,844,021	79,324
USD	CME CHF\$ FUTURE MAR 18/03/2019	Currency	売	-4,151	-5,014	-863
USD	DOLLAR INDEX 17/06/2019	Cross Currency	買	23,030,810	22,893,600	-137,210
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 15/03/2021	Interest Rate	買	14,770,138	14,812,363	42,225
EUR	EURO-OAT FUTURE 07/03/2019	Bond	買	155,304,322	157,729,803	2,425,481
EUR	VSTOXX MINI INDEX 19/03/2019	Equity Index	売	-100,468	-87,707	12,761
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 18/03/2019	Interest Rate	買	557,285	557,779	494
GBP	90DAY STERLING FU 17/06/2020	Interest Rate	買	32,447,504	32,455,538	8,034
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 16/12/2019	Interest Rate	買	12,064,069	12,074,104	10,035
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 18/03/2024	Interest Rate	買	242,950	243,375	425
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 16/09/2019	Interest Rate	買	52,861,656	52,956,537	94,881
TWD	TAIEX FUTURES 20/03/2019	Equity Index	買	8,254,161	8,405,565	151,404
THB	SET50 FUTURES 28/03/2019	Equity Index	買	823,223	822,161	-1,062

AUD	AUST 10Y BOND FUT 15/03/2019	Bond	買	55,082,059	56,646,173	1,564,114
EUR	VSTOXX MINI INDEX 17/04/2019	Equity Index	売	-68,898	-67,298	1,600
JPY	JPN 10Y BOND 13/03/2019	Bond	買	95,014,063	95,371,458	357,395
USD	JPY CURRENCY FUTURE 18/03/2019	Currency	買	927	1,133	206
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 19/09/2022	Interest Rate	買	1,216,338	1,219,250	2,913
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 19/06/2023	Interest Rate	買	3,649,963	3,654,563	4,600
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 15/03/2021	Interest Rate	買	3,410,488	3,416,875	6,388
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 16/03/2020	Interest Rate	買	3,164,713	3,168,263	3,550
ZAR	FTSE/JSE TOP 40 20/03/2019	Equity Index	売	-4,621,338	-4,843,632	-222,294
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 15/03/2021	Interest Rate	買	371,416	371,549	133
USD	NIFTY-SGX CNX NIFTY INDEX 28/03/2019	Equity Index	売	-3,418,217	-3,410,040	8,177
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 19/12/2022	Interest Rate	買	4,136,363	4,144,175	7,813
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 11/06/2020	Interest Rate	買	2,860,587	2,862,940	2,353
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 10/12/2020	Interest Rate	買	1,429,873	1,431,365	1,492
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 13/09/2021	Interest Rate	買	51,967,494	52,073,412	105,918
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 17/06/2019	Interest Rate	買	1,998,997	1,998,955	-43
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 18/09/2023	Interest Rate	買	1,700,825	1,704,850	4,025
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 14/12/2020	Interest Rate	売	-6,822,163	-6,831,650	-9,488
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 16/12/2019	Interest Rate	買	4,277,609	4,281,552	3,943
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 13/06/2019	Interest Rate	買	14,307,693	14,308,729	1,036
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 13/12/2021	Interest Rate	買	17,022,313	17,063,854	41,541
GBP	90DAY STERLING FU 17/03/2021	Interest Rate	買	9,166,431	9,170,067	3,636
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 14/06/2021	Interest Rate	買	2,679,225	2,684,688	5,463
EUR	EURO-BTP FUTURE 07/03/2019	Bond	買	67,538,308	68,661,730	1,123,422
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 14/06/2021	Interest Rate	買	14,189,327	14,235,538	46,211
USD	BP CURRENCY FUT 18/03/2019	Currency	売	-739	1,661	2,400
EUR	IBEX 35 INDX FUT 15/03/2019	Equity Index	買	4,764,526	4,835,489	70,964
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 16/03/2020	Interest Rate	買	7,049,631	7,059,789	10,158
USD	C\$ CURRENCY FUTURE 19/03/2019	Currency	売	-490	-1,520	-1,030
HKD	HANG SENG CHINA ENTERPRISES INDEX HSCEI	Equity Index	買	6,018,297	6,031,649	13,352
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 13/09/2021	Interest Rate	売	-6,339,275	-6,345,625	-6,350
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 18/12/2023	Interest Rate	買	1,701,488	1,704,150	2,663
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 13/06/2022	Interest Rate	買	1,460,588	1,463,475	2,888
USD	US ULTRA BOND(CBT) 19/06/2019	Bond	買	14,746,336	14,761,906	15,570
AUD	SFE 90-DAY BANK BILL 10/09/2020	Interest Rate	買	2,145,186	2,147,153	1,967
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 18/03/2019	Interest Rate	買	486,663	487,013	350
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 16/03/2020	Interest Rate	買	86,695,004	86,746,824	51,820
GBP	90DAY STERLING FU 18/12/2019	Interest Rate	買	10,488,443	10,496,510	8,067
USD	DOLLAR INDEX 18/03/2019	Cross Currency	買	12,094,215	11,983,125	-111,090
USD	90 DAY EURO\$ FUTR 14/03/2022	Interest Rate	買	2,435,800	2,439,625	3,825
GBP	90DAY STERLING FU 15/12/2021	Interest Rate	買	491,071	490,831	-240

USD	MEXICAN PESO FUT 18/03/2019	Currency	売	-15	260	275
USD	MINI MSCI EAFE 15/03/2019	Equity Index	売	-1,661,200	-1,788,565	-127,365
USD	EMIN RUSSELL 2000 INDEX 15/03/2019	Equity Index	買	3,805,985	3,784,080	-21,905
EUR	AMSTERDAM IDX FUT 15/03/2019	Equity Index	買	4,670,230	4,700,532	30,302
HKD	HANG SENG IDX FUTURE 28/03/2019	Equity Index	買	8,645,731	8,608,332	-37,399
CAD	BANK ACCEPT FUTURE 17/06/2019	Interest Rate	買	4,452,207	4,461,321	9,114
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 14/09/2020	Interest Rate	買	11,381,540	11,404,945	23,404
CHF	SWISS MKT INDEX FUTURE SMI 15/03/2019	Equity Index	買	16,293,000	16,894,800	601,800
USD	CME 90 DAYS EURO\$ FUTR 13/12/2021	Interest Rate	買	5,841,738	5,856,000	14,263
USD	NASDQA 100 E-MINI 15/03/2019	Equity Index	買	4,934,565	4,982,425	47,860
EUR	LIF 3MO EURO EURIBOR 19/12/2022	Interest Rate	買	4,534,815	4,539,428	4,613
EUR	DAX INDEX FUTURE 15/03/2019	Equity Index	買	981,732	986,401	4,669
合計				-	-	11,401,201

5. 為替先渡取引

通貨 (買)	予約金額 (ドル)	評価金額 (ドル)	評価損益 (ドル)	通貨 (売)	予約金額 (ドル)	評価金額 (ドル)	評価損益 (ドル)
AUD	65,802,684	65,460,226	-342,458				
				EUR	683,340	680,402	-2,938
				GBP	5,897,363	5,933,651	36,289
				JPY	7,633,952	7,506,332	-127,620
				NZD	5,032,470	5,033,881	1,411
				USD	46,555,559	46,305,959	-249,600
BRL	15,494,674	15,576,272	81,598				
				USD	15,494,674	15,576,272	81,598
CAD	52,811,778	52,436,175	-375,603				
				EUR	5,011,160	5,004,214	-6,946
				USD	47,800,618	47,431,960	-368,657
CHF	75,168,773	75,251,289	82,516				
				EUR	4,897,270	4,904,247	6,977
				USD	70,271,503	70,347,042	75,539
CLP	22,724,495	21,609,639	-1,114,855				
				USD	22,724,495	21,609,639	-1,114,855
CNH	10,327,991	10,264,410	-63,581				
				USD	10,327,991	10,264,410	-63,581
COP	4,782,405	4,575,210	-207,195				
				USD	4,782,405	4,575,210	-207,195
EUR	234,306,278	234,259,533	-46,745				
				AUD	9,181,018	9,235,887	54,869
				CAD	27,744,575	27,810,592	66,016
				CHF	567,477	565,594	-1,882
				GBP	14,511,956	14,780,748	268,791
				HUF	9,717,304	9,753,834	36,530
				JPY	11,998,560	11,923,254	-75,306
				NOK	10,546,422	10,500,597	-45,824
				PLN	14,628,881	14,548,104	-80,777
				RON	1,250,929	1,247,510	-3,420
				SEK	9,068,364	8,911,606	-156,758
				USD	125,090,791	124,981,807	-108,984
GBP	64,022,337	62,886,416	-1,135,921				
				AUD	3,251,147	3,189,061	-62,086
				EUR	4,100,040	4,057,611	-42,429
				JPY	4,524,633	4,411,010	-113,623
				USD	52,146,517	51,228,734	-917,783
HKD	2,005,859	2,006,046	187				
				USD	2,005,859	2,006,046	187
HUF	5,744,356	5,696,950	-47,406				
				EUR	3,075,030	3,057,819	-17,211
				USD	2,669,326	2,639,131	-30,195
ILS	17,411,076	17,363,841	-47,235				
				USD	17,411,076	17,363,841	-47,235
INR	1,499,955	1,492,293	-7,662				
				USD	1,499,955	1,492,293	-7,662
JPY	321,146,399	321,305,171	158,771				
				AUD	11,499,200	11,569,154	69,954
				EUR	6,150,060	6,166,036	15,976
				GBP	7,355,138	7,486,941	131,803
				USD	296,142,002	296,083,040	-58,962
KRW	19,615,186	19,442,990	-172,196				

				USD	19,615,186	19,442,990	-172,196
MXN	4,396,261	4,363,676	-32,585				
				USD	4,396,261	4,363,676	-32,585
NOK	54,188,605	54,211,798	23,193				
				EUR	11,502,890	11,496,986	-5,904
				SEK	3,822,161	3,795,198	-26,963
				USD	38,863,554	38,919,614	56,060
NZD	28,405,540	28,159,820	-245,720				
				AUD	2,515,450	2,500,475	-14,975
				USD	25,890,090	25,659,345	-230,745
PEN	3,203,804	3,163,708	-40,095				
				USD	3,203,804	3,163,708	-40,095
PHP	8,439,535	8,420,497	-19,038				
				USD	8,439,535	8,420,497	-19,038
PLN	25,984,606	25,842,611	-141,995				
				EUR	5,694,500	5,681,312	-13,188
				USD	20,290,106	20,161,299	-128,807
RON	797,373	798,594	1,221				
				EUR	797,230	798,451	1,221
				USD	143	143	-0
RUB	12,684,331	12,400,745	-283,586				
				USD	12,684,331	12,400,745	-283,586
SEK	62,074,862	62,504,916	430,054				
				EUR	14,236,250	14,304,755	68,505
				NOK	2,391,797	2,398,736	6,940
				USD	45,446,816	45,801,425	354,609
SGD	33,058,939	32,865,039	-193,899				
				USD	33,058,939	32,865,039	-193,899
THB	6,475,594	6,483,088	7,494				
				USD	6,475,594	6,483,088	7,494
TWD	16,671,391	16,676,332	4,941				
				USD	16,671,391	16,676,332	4,941
USD	1,031,730,105	1,029,933,162	-1,796,943				
				AUD	22,285,346	22,291,478	6,131
				BRL	28,303,873	28,181,409	-122,463
				CAD	56,127,272	56,120,985	-6,286
				CHF	8,700,023	8,705,730	5,707
				CLP	24,070,800	24,705,790	634,990
				CNH	17,793,237	17,872,655	79,418
				COP	5,508,000	5,626,440	118,440
				EUR	13,390,273	13,441,176	50,903
				GBP	55,587,202	56,137,811	550,609
				HUF	6,691,796	6,721,950	30,153
				ILS	1,658,376	1,655,568	-2,808
				INR	16,640,140	16,624,055	-16,085
				JPY	486,079,075	483,263,388	-2,815,686
				KRW	21,185,193	21,229,407	44,214
				MXN	60,729,840	60,736,691	6,852
				NOK	10,908,926	10,768,687	-140,239
				NZD	29,153,558	29,339,973	186,416
				PEN	5,518,599	5,561,978	43,379
				PHP	24,361,350	24,510,890	149,540
				PLN	5,186,596	5,148,818	-37,779
				RUB	17,730,135	17,981,803	251,668
				SEK	162,503	163,709	1,205
				SGD	16,254,728	16,375,110	120,383

				THB	12,217,433	12,229,079	11,647
				TRY	21,835,328	21,819,437	-15,891
				TWD	6,982,985	6,991,648	8,663
				ZAR	56,667,520	55,727,495	-940,025
ZAR	33,757,931	33,951,067	193,136	USD	33,757,931	33,951,067	193,136
総計	2,234,733,123	2,229,401,515	-5,331,609	総計	2,234,733,123	2,229,401,515	-5,331,609

(参考) T & D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「T & D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)

科 目	対象年月日	(2018年8月22日現在)	(2019年2月22日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,501,068	2,200,300
流動資産合計		2,501,068	2,200,300
資産合計		2,501,068	2,200,300
負債の部			
流動負債			
未払利息		4	4
流動負債合計		4	4
負債合計		4	4
純資産の部			
元本等			
元本		2,499,373	2,199,552
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		1,691	744
元本等合計		2,501,064	2,200,296
純資産合計		2,501,064	2,200,296
負債純資産合計		2,501,068	2,200,300

(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)

(2018年8月22日現在)	(2019年2月22日現在)
1 計算期間の末日における受益権の総数 2,499,373口	1 計算期間の末日における受益権の総数 2,199,552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 1口当たり純資産額 1.0007円 (1万口当たり純資産額 10,007円)	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 1.0003円 (1万口当たり純資産額 10,003円)

(その他の注記)

1 元本の移動

項目	対象年月日	(2018年8月22日現在)	(2019年2月22日現在)
期首元本額		4,138,001 円	2,499,373 円
期中追加設定元本額		49,966 円	0 円
期中一部解約元本額		1,688,594 円	299,821 円
期末元本額		2,499,373 円	2,199,552 円
元本の内訳*			
T & D 日本株ファンド (通貨選択型) マネー プールコース		2,399,486 円	2,099,665 円
ロボット戦略 世界分散 ファンド		49,921 円	49,921 円
ロボット戦略 世界成 長ファンド		49,966 円	49,966 円
合計		2,499,373 円	2,199,552 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 2018年2月23日 至 2018年8月22日)
該当事項はありません。

(自 2018年8月23日 至 2019年2月22日)
該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係
(自 2018年2月23日 至 2018年8月22日)
該当事項はありません。

(自 2018年8月23日 至 2019年2月22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

純資産額計算書

（2019年3月29日現在）

資産総額	22,099,493,388 円
負債総額	199,993,021 円
純資産総額（ - ）	21,899,500,367 円
発行済数量	21,123,523,896 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0367 円

（参考）T & D マネーアカウントマザーファンド

資産総額	2,200,172 円
負債総額	2 円
純資産総額（ - ）	2,200,170 円
発行済数量	2,199,552 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0003 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

<更新後>

(1) 資本金の額

2019年3月末日現在の資本金の額	11億円
会社が発行する株式の総数	2,294,100株
発行済株式総数	1,082,500株
過去5年間における資本金の額の増減	該当事項はありません。

(2) 会社の機構

経営体制

10名以内の取締役が、株主総会において選任されます。取締役の選任は株主総会において、総株主の議決権の3分の1以上に当たる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度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。

取締役会は、取締役社長が招集します。取締役社長に事故があるときは、取締役会においてあらかじめ定められた順序により、他の取締役がこれを招集します。取締役会の招集通知は会日の2日前までにこれを発します。ただし、緊急の場合は、この期間を短縮することができます。また取締役および監査役全員の同意がある場合は、これを省略することができます。

取締役会は、法令または定款に定める事項の他、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって行います。

投資信託運用の意思決定と運用の流れ

a. 基本運用方針、月次運用計画の決定

投資政策委員会（原則月1回開催）において投資信託の基本運用方針に関する事項が審議・決定され、各運用部長において月次運用計画に関する事項が決定されます。

b. 運用の実行

月次運用計画に沿って、ファンド・マネージャーからトレーディング部に売買発注指示があり、売買が執行されます。

c. 運用のチェック等

- ・業務管理部において、運用上の諸リスクの管理および運用実績の評価等を行い、運用審査委員会にて報告・審議が行われます。
- ・法務・コンプライアンス部において、日次で有価証券等の取引内容のチェック・運用制限遵守のチェック等が実施され、コンプライアンス委員会および取締役会に報告を行っています。

会社の機構は2019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。

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2019年3月末日現在、261本であり、その純資産総額の合計は1,145,344百万円です（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	146本	461,701百万円
単位型株式投資信託	53本	165,496百万円
単位型公社債投資信託	62本	518,148百万円
合計	261本	1,145,344百万円

[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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条及び57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

2. 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38期事業年度（2017年4月1日から2018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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	第37期 (2017年3月31日現在)		第38期 (2018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			6,642,674		7,254,267
2. 前払費用			39,531		46,019
3. 未収入金			48,324		-
4. 未収委託者報酬			854,047		1,054,036
5. 未収運用受託報酬			383,416		450,583
6. 繰延税金資産			52,937		104,232
流動資産計			8,020,932		8,909,139
固定資産					
1. 有形固定資産			176,527		141,929
(1) 建物	1	114,696		101,837	
(2) 器具備品	1	61,326		39,714	
(3) その他	1	504		378	
2. 無形固定資産			48,795		44,418
(1) 電話加入権		2,862		2,862	
(2) ソフトウェア		42,345		36,077	
(3) ソフトウェア仮勘定		3,586		5,477	
3. 投資その他の資産			296,532		295,596
(1) 投資有価証券		38,529		37,527	
(2) 関係会社株式		5,386		5,386	
(3) 長期差入保証金		122,433		117,140	
(4) 繰延税金資産		103,847		116,050	
(5) その他		26,335		19,491	
固定資産計			521,854		481,944
資産合計			8,542,787		9,391,083

区分	注記 番号	第37期 (2017年3月31日現在)		第38期 (2018年3月31日現在)	
		内訳 (千円)	金額 (千円)	内訳 (千円)	金額 (千円)
(負債の部)					
流動負債					
1. 預り金			14,970		10,633
2. 未払金			396,503		608,077
(1) 未払収益分配金		1,704		1,330	
(2) 未払償還金		5,660		5,660	
(3) 未払手数料		343,787		408,586	
(4) その他未払金		45,350		192,500	
3. 未払費用			583,303		752,818
4. 未払法人税等			11,174		31,501
5. 未払消費税等			38,997		42,128
6. 前受収益			-		54
7. 賞与引当金			91,112		241,535
8. 役員賞与引当金			6,458		22,308
流動負債計			1,142,521		1,709,058
固定負債					
1. 退職給付引当金			408,206		437,211
2. 役員退職慰労引当金			19,356		23,890
固定負債計			427,562		461,101
負債合計			1,570,083		2,170,159
(純資産の部)					
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			5,594,927		5,843,079
(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		2,282,136		2,530,288	
株主資本計			6,972,595		7,220,746
評価・換算差額等					
1. その他有価証券評価差額金			108		176
評価・換算差額等計			108		176
純資産合計			6,972,703		7,220,923
負債純資産合計			8,542,787		9,391,083

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	第37期 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		第38期 (自 2017年4月1日 至 2018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			4,248,077		5,898,485
2. 運用受託報酬			1,289,990		1,846,568
営業収益計			5,538,067		7,745,053
営業費用					
1. 支払手数料			1,860,395		2,510,004
2. 広告宣伝費			2,604		1,235
3. 調査費			1,492,104		2,396,244
(1) 調査費		129,459		185,225	
(2) 委託調査費		988,082		1,851,949	
(3) 情報機器関連費		373,672		358,074	
(4) 図書費		888		995	
4. 委託計算費			181,296		207,692
5. 営業雑経費			104,940		102,102
(1) 通信費		7,672		6,944	
(2) 印刷費		87,593		86,366	
(3) 協会費		5,876		5,655	
(4) 諸会費		3,797		3,135	
営業費用計			3,641,341		5,217,280
一般管理費					
1. 給料			1,133,594		1,183,052
(1) 役員報酬		68,848		70,882	
(2) 給料・手当		1,010,113		1,004,735	
(3) 賞与		54,633		107,434	
2. 法定福利費			169,520		202,059
3. 退職金			6,136		3,276
4. 福利厚生費			3,723		3,869
5. 交際費			2,273		3,108
6. 旅費交通費			11,895		14,213
7. 事務委託費			94,455		104,724
8. 租税公課			68,018		124,851
9. 不動産賃借料			125,103		125,103
10. 退職給付費用			51,318		50,494
11. 役員退職慰労引当金繰入			4,451		4,534
12. 賞与引当金繰入			91,112		241,535
13. 役員賞与引当金繰入			6,458		22,308
14. 固定資産減価償却費			63,703		50,503
15. 諸経費			62,410		54,047
一般管理費計			1,894,176		2,187,683
営業利益			2,549		340,089

区分	注記 番号	第37期 (自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月31日)		第38期 (自 2017年 4月 1日 至 2018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			1,096		1,073
2. 受取利息			68		68
3. 時効成立分配金・償還金			-		374
4. 雑収入			751		676
営業外収益計			1,916		2,193
営業外費用					
1. 為替差損			526		641
2. 雑損失			651		630
営業外費用計			1,177		1,272
経常利益			3,288		341,010
特別利益					
1. 投資有価証券売却益			725		213
特別利益計			725		213
特別損失					
1. 固定資産除却損	1		50		21
2. 投資有価証券売却損			6,007		1
特別損失計			6,057		22
税引前当期純利益または 税引前当期純損失()			2,043		341,201
法人税、住民税及び事業税			45,696		156,577
法人税等調整額			29,030		63,527
当期純利益			14,622		248,151

(3) 株主資本等変動計算書

第37期（自 2016年4月1日 至 2017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 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		
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								
当期純利益						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			
当期純利益			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

第38期(自 2017年4月1日 至 2018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		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,282,136	5,594,927	6,972,595
当期変動額								
当期純利益						248,151	248,151	248,151
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	248,151	248,151	248,151
当期末残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,530,288	5,843,079	7,220,746

	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	108	108	6,972,703
当期変動額			
当期純利益			248,151
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	68	68	68
当期変動額合計	68	68	248,220
当期末残高	176	176	7,220,923

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、1998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2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、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。

注記事項

（貸借対照表関係）

第37期 (2017年3月31日現在)		第38期 (2018年3月31日現在)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 21,507千円		建物 34,366千円
	器具備品 92,906千円		器具備品 115,139千円
	その他 392千円		その他 518千円

（損益計算書関係）

第37期 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		第38期 (自 2017年4月1日 至 2018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。	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 21千円
	ソフトウェア 48千円		

（株主資本等変動計算書関係）

第37期（自 2016年4月1日 至 2017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

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38期（自 2017年4月1日 至 2018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

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。

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37期（自 2016年4月1日 至 2017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、(2) 未収入金、(3) 未収委託者報酬、(4) 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。

(5) 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、(2) 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
合計	35,586

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いません。

(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

第38期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額(*)	時価(*)	差額
(1) 預金	7,254,267	7,254,267	-
(2) 未収委託者報酬	1,054,036	1,054,036	-
(3) 未収運用受託報酬	450,583	450,583	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	7,327	7,327	-
資産計	8,766,214	8,766,214	-
(1) 未払金			
未払収益分配金	(1,330)	(1,330)	-
未払償還金	(5,660)	(5,660)	-
未払手数料	(408,586)	(408,586)	-
その他未払金	(192,500)	(192,500)	-
(2) 未払費用	(752,818)	(752,818)	-
負債計	(1,360,896)	(1,360,896)	-

(*) 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、(2) 未収委託者報酬、(3) 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。

(4) 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、(2) 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
合計	35,586

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いません。

(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	7,254,267	-	-
未収委託者報酬	1,054,036	-	-
未収運用受託報酬	450,583	-	-
投資有価証券			
其他有価証券のうち 満期があるもの(その他)	2,011	3,941	1,374
合計	8,760,898	3,941	1,374

(有価証券関係)

第37期(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

其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、其他有価証券において、種類ごとの貸借対照表計上額、取得原価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(*)	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	(1) その他	3,515	3,250	265
	小計	3,515	3,250	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	4,813	4,922	109
	小計	4,813	4,922	109
合計		8,329	8,172	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。

第38期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

その他有価証券の当事業年度中の売却額は2,212千円であり、売却益の合計額は213千円、売却損の合計額は1千円であります。また、その他有価証券において、種類ごとの貸借対照表計上額、取得原価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(*)	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	(1) その他	4,233	3,924	309
	小計	4,233	3,924	309
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	(1) その他	3,093	3,147	54
	小計	3,093	3,147	54
合計		7,327	7,072	254

(*) 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37期（自 2016年4月1日 至 2017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設けております。また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

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
<u>退職給付の支払額</u>	<u>44,904千円</u>
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

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

(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
--------------	---------

第38期（自 2017年4月1日 至 2018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設けております。また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

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	408,206千円
退職給付費用	44,140千円
退職給付の支払額	15,136千円
退職給付引当金の期末残高	437,211千円

(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	437,211千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	437,211千円

退職給付引当金	437,211千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	437,211千円

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	44,140千円
----------------	----------

3. 確定拠出制度

確定拠出制度への要拠出額	6,353千円
--------------	---------

(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37期（2017年3月31日現在）	第38期（2018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	28,117	73,958
未払事業税	2,741	8,944
未払社会保険料	4,731	12,118
退職給付引当金	130,989	141,151
連結納税加入に伴う有価証券 時価評価益	15,056	15,056
繰越欠損金	39,461	11,374
その他	9,222	10,270
小計	230,321	272,873
評価性引当額	73,487	52,512
繰延税金資産計	156,833	220,361
（繰延税金負債）		
その他有価証券評価差額金	47	77
繰延税金負債計	47	77
繰延税金資産の純額	156,785	220,283

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37期（2017年3月31日現在）	第38期（2018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。	法定実効税率 (調整)	30.9%
	交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5
	住民税均等割	0.7
	評価性引当額	6.1
	その他	0.6
	税効果会計適用後の法人税率の負担率	27.3

(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37期（自 2016年4月1日 至 2017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38期（自 2017年4月1日 至 2018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37期（自 2016年4月1日 至 2017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	㈱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。

第38期（自 2017年4月1日 至 2018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	㈱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	連結納税に伴う支払予定額(*1)	144,109	未払金	144,109

(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、連結納税親会社へ支払う金額であります。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第37期（自 2016年4月1日 至 2017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)
親会社の子会社	大同生命保険㈱	大阪市西区	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。

第38期（自 2017年4月1日 至 2018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)
親会社の子会社	大同生命保険㈱	大阪市西区	110,000	生命保険業	-	投資顧問契約の締結	投資顧問契約(*1)	321,424	未収運用受託報酬	83,978

(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 & 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37期 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		第38期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1株当たり純資産額	6,441.29円	1株当たり純資産額	6,670.59円
1株当たり当期純利益	13.50円	1株当たり当期純利益	229.23円
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
当期純利益（千円）	14,622	当期純利益（千円）	248,151
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利益（千円）	14,622	普通株式に係る当期純利益（千円）	248,151
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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

		第39期中間会計期間末 (2018年9月30日)	
区分	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)			
流動資産			
1. 預金			7,098,232
2. 前払費用			82,190
3. 未収入金			87
4. 未収委託者報酬			1,049,324
5. 未収運用受託報酬			393,207
6. その他			831
流動資産計			8,623,872
固定資産			
1. 有形固定資産			
(1) 建物	1	96,398	
(2) 器具備品	1	52,072	
(3) その他	1	331	
2. 無形固定資産			
(1) 電話加入権		2,862	
(2) ソフトウェア		37,922	
(3) ソフトウェア仮勘定		2,106	
3. 投資その他の資産			
(1) 投資有価証券		38,254	
(2) 関係会社株式		5,386	
(3) 長期差入保証金		114,494	
(4) 繰延税金資産		172,692	
(5) その他		20,211	
固定資産計			542,731
資産合計			9,166,604

		第39期中間会計期間末 (2018年9月30日)	
区分	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
(負債の部)			
流動負債			
1. 預り金			12,558
2. 未払金			465,404
(1) 未払収益分配金		1,330	
(2) 未払償還金		5,660	
(3) 未払手数料		394,423	
(4) その他未払金		63,990	
3. 未払費用			703,224
4. 未払法人税等			15,007
5. 未払消費税等	2		21,571
6. 前受収益			28
7. 賞与引当金			113,236
8. 役員賞与引当金			7,500
流動負債計			1,338,530
固定負債			
1. 退職給付引当金			440,483
2. 役員退職慰労引当金			26,531
固定負債計			467,015
負債合計			1,805,545
(純資産の部)			
株主資本			
1. 資本金			1,100,000
2. 資本剰余金			277,667
(1) 資本準備金		277,667	
3. 利益剰余金			5,983,425
(1) 利益準備金		175,000	
(2) その他利益剰余金			
別途積立金		3,137,790	
繰越利益剰余金		2,670,635	
株主資本計			7,361,093
評価・換算差額等			
1. その他有価証券評価差額金			34
評価・換算差額等計			34
純資産合計			7,361,058
負債純資産合計			9,166,604

(2) 中間損益計算書

		第39期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
区分	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業収益			
1. 委託者報酬			2,998,694
2. 運用受託報酬			762,778
営業収益計			3,761,472
営業費用			
1. 支払手数料			1,222,625
2. 広告宣伝費			742
3. 調査費			1,137,214
(1) 調査費		105,075	
(2) 委託調査費		851,523	
(3) 情報機器関連費		180,178	
(4) 図書費		437	
4. 委託計算費			107,600
5. 営業雑経費			47,585
(1) 通信費		3,472	
(2) 印刷費		38,767	
(3) 協会費		3,493	
(4) 諸会費		1,852	
営業費用計			2,515,768
一般管理費			
1. 給料			557,013
(1) 役員報酬		37,044	
(2) 給料・手当		511,591	
(3) 賞与		8,377	
2. 法定福利費			84,356
3. 退職金			281
4. 福利厚生費			2,146
5. 交際費			1,232
6. 旅費交通費			5,906
7. 事務委託費			48,102
8. 租税公課			68,254
9. 不動産賃借料			66,830
10. 退職給付費用			26,986
11. 役員退職慰労引当金繰入			2,641
12. 賞与引当金繰入			113,236
13. 役員賞与引当金繰入			7,500
14. 固定資産減価償却費	1		22,208
15. 諸経費			34,800
一般管理費計			1,041,498
営業利益			204,205

		第39期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
区分	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
営業外収益			
1. 受取配当金			958
2. 受取利息			35
3. 雑収入			405
営業外収益計			1,400
営業外費用			
1. 為替差損			419
2. 雑損失			70
営業外費用計			489
経常利益			205,115
特別利益			
1. 投資有価証券売却益			397
特別利益計			397
特別損失			
1. 投資有価証券売却損			488
特別損失計			488
税引前中間純利益			205,024
法人税、住民税及び事業税			16,994
法人税等調整額			47,683
中間純利益			140,346

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30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	2,530,288	5,843,079	7,220,746
当中間会計期間 変動額								
中間純利益						140,346	140,346	140,346
株主資本以外の項 目の当中間会計期 間変動額（純額）								
当中間会計期間 変動額合計	-	-	-	-	-	140,346	140,346	140,346
当中間会計期間末 残高	1,100,000	277,667	277,667	175,000	3,137,790	2,670,635	5,983,425	7,361,093

	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	176	176	7,220,923
当中間会計期間 変動額			
中間純利益			140,346
株主資本以外の項 目の当中間会計期 間変動額（純額）	211	211	211
当中間会計期間 変動額合計	211	211	140,134
当中間会計期間末 残高	34	34	7,361,058

重要な会計方針

	第39期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)						
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 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。 その他有価証券 時価のあるもの 中間会計期間末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。</p>						
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998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2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、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。</p> <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>3～50年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>2～15年</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>8年</td> </tr> </table> <p>(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。</p>	建物	3～50年	器具備品	2～15年	その他	8年
建物	3～50年						
器具備品	2～15年						
その他	8年						
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員の賞与の支出に備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間にかかる額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員賞与の支出に備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間にかかる額を計上しております。</p> <p>(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、当中間会計期間末における必要額を計上しております。</p> <p>(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、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>						
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 税抜方式によっております。</p> <p>(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。</p>						

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間より適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末 (2018年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。
	建物 39,806千円
	器具備品 124,094千円
	その他 565千円
2	消費税等の取扱い
	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ流動負債の「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1	固定資産の減価償却実施額は次の通りであります。
	有形固定資産 14,441千円
	無形固定資産 7,767千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当期首株式数 (千株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
普通株式	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) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

2018年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと。）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額(*)	時価(*)	差額
(1) 預金	7,098,232	7,098,232	-
(2) 未収委託者報酬	1,049,324	1,049,324	-
(3) 未収運用受託報酬	393,207	393,207	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	8,054	8,054	-
資産計	8,548,818	8,548,818	-
(1) 未払金			
未払収益分配金	(1,330)	(1,330)	-
未払償還金	(5,660)	(5,660)	-
未払手数料	(394,423)	(394,423)	-
その他未払金	(63,990)	(63,990)	-
(2) 未払費用	(703,224)	(703,224)	-
負債計	(1,168,629)	(1,168,629)	-

(*) 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、(2) 未収委託者報酬、(3) 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。

(4) 投資有価証券（投資信託）

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、(2) 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	中間貸借対照表計上額
非上場株式	30,200
子会社株式	5,386
合計	35,586

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いません。

（有価証券関係）

第39期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

その他有価証券において、種類ごとの中間貸借対照表計上額、取得原価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	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1) その他	2,524	2,200	324
	小計	2,524	2,200	324
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1) その他	5,529	5,904	374
	小計	5,529	5,904	374
合計		8,054	8,104	50

（セグメント情報等）

第39期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

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。

関連情報

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、中間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

(1) 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中間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。

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1株当たり純資産額	6,800円05銭
1株当たり中間純利益	129円65銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間純利益(千円)	140,346
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	140,346
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

野村信託銀行株式会社

・資本金の額 30,000百万円(2018年3月末日現在)

(略)

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (単位：百万円) (2018年3月末日現在)	事業の内容
今村証券株式会社	857	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	
めぶき証券株式会社	3,000	
高木証券株式会社	11,069	
楽天証券株式会社	7,495	
水戸証券株式会社	12,272	
第四証券株式会社	600	
中銀証券株式会社	2,000	
ちばぎん証券株式会社	4,374	
西日本シティTT証券株式会社	3,000	
ワイエム証券株式会社	1,270	
静岡東海証券株式会社	600	
フィデリティ証券株式会社	8,557	
株式会社愛媛銀行	21,359	
株式会社十六銀行	36,839	
株式会社山形銀行	12,008	
株式会社イオン銀行	51,250	
株式会社福島銀行	18,127	
株式会社西日本シティ銀行	85,745	
株式会社高知銀行	19,544	
株式会社東和銀行	38,653	
株式会社長崎銀行	6,121	

<訂正後>

(1) 受託会社

野村信託銀行株式会社

・資本金の額 30,000百万円(2018年9月末日現在)

(略)

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (単位：百万円) (2018年9月末日現在)	事業の内容
今村証券株式会社	857	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323	
めぶき証券株式会社	3,000	
高木証券株式会社	11,069	
楽天証券株式会社	7,495	
水戸証券株式会社	12,272	
第四証券株式会社	600	
中銀証券株式会社	2,000	
ちばぎん証券株式会社	4,374	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000	
ワイエム証券株式会社	1,270	
静岡東海証券株式会社	600	
フィデリティ証券株式会社	8,557	
株式会社愛媛銀行	21,363	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社十六銀行	36,839	
株式会社山形銀行	12,008	
株式会社イオン銀行	51,250	
株式会社福島銀行	18,127	
株式会社西日本シティ銀行	85,745	
株式会社高知銀行	19,544	
株式会社東和銀行	38,653	
株式会社長崎銀行	6,121	

3 資本関係

<訂正前>

(持株比率5.0%以上を記載します。)

2018年9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。)

2019年3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

2018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2017年4月1日から2018年3月31日までの第38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2018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

2019年4月18日

T & Dアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY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	羽柴 則央
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているロボット戦略 世界分散ファンドの2018年8月23日から2019年2月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ロボット戦略 世界分散ファンドの2019年2月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月4日

T & Dアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY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	羽柴 則夫
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2018年4月1日から2019年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、T & Dアセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- (注) 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[前へ](#)