

平成25年3月25日

受益者の皆様へ

T & Dアセットマネジメント株式会社

「T & D通貨トレード新興国社債ファンド（毎月分配型）」
マネーアカウントマザーファンド運用報告書添付過誤について

拝啓 時下益々ご清栄のこととお喜び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、このたび「T & D通貨トレード新興国社債ファンド（毎月分配型）」の各コースにおける運用報告書に添付すべきマネーアカウントマザーファンドの運用報告書に、下記の通り添付過誤がございました。つきましては、本来添付すべきマネーアカウントマザーファンドの第5期運用報告書を添付いたしますので、お読み替えをお願い申し上げます。

また、次回作成期の運用報告書におきましても、同様の運用報告書を添付する予定でございます。

このたびの件につきまして、深くお詫び申し上げますとともに、今後かかることのないよう、最大限の注意を払う所存ですので、何卒ご理解賜りますようお願い申し上げます。

敬具

記

【運用報告書】

追加型証券投資信託 「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	（第2作成期）
円ヘッジ・コース	（第2作成期）
米ドルベア・コース	（第2作成期）
ユーロブル・コース	（第2作成期）
ユーロベア・コース	（第2作成期）
豪ドルブル・コース	（第2作成期）
リアルブル・コース	（第2作成期）
豪ドルベア・コース	（第1期）
インドネシアルピアブル・コース	（第1期）

【過誤内容】

上記運用報告書に添付するマネーアカウントマザーファンドの運用報告書について、正しくは直前の計算期間の報告となる第5期運用報告書を添付すべきところ、誤って第4期運用報告書を添付いたしました。

以上

マネーアカウントマザーファンド

第5期運用報告書〔決算日 2012年6月11日〕
 (計算期間 2011年12月13日から2012年6月11日まで)

「マネーアカウントマザーファンド」は、2012年6月11日に第5期決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は原則無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目標として運用を行います。
主要運用対象	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。
組入制限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。

設定以来の運用実績、基準価額の推移等

設定以来の運用実績

決算期	基準価額	期騰落率		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期騰	落率			
設定日	円	%		%	%	百万円
2010年2月26日	10,000	-		-	-	195
1期(2010年6月10日)	10,003	0.0		77.2	-	220
2期(2010年12月10日)	10,008	0.0		77.2	-	220
3期(2011年6月10日)	10,012	0.0		78.4	-	140
4期(2011年12月12日)	10,017	0.0		83.0	-	879
5期(2012年6月11日)	10,022	0.0		82.1	-	608

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額には、当初元本を用いております。

(注) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		
		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	債 券 先 物 比 率
期首(前期末)	円	%	%	%
2011年12月12日	10,017	—	83.0	—
12月末	10,018	0.0	83.0	—
2012年1月末	10,019	0.0	83.0	—
2月末	10,019	0.0	81.8	—
3月末	10,019	0.0	83.8	—
4月末	10,020	0.0	83.9	—
5月末	10,022	0.0	82.1	—
期 末				
2012年6月11日	10,022	0.0	82.1	—

(注) 基準価額は1万円当たり。騰落率は期首比。

(注) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期の運用状況と今後の運用方針

■市況概況

【国内短期金融市場】

日銀は2012年2月14日に開催した金融政策決定会合において、資産買入等の基金を10兆円程度増額して65兆円程度とすることを決定しました。更に4月27日に開催した金融政策決定会合では、資産買入等の基金を5兆円程度増額して70兆円程度とするとともに、買入対象とする国債および社債の残存期間を従来の「1年以上2年以下」から「1年以上3年以下」へ延長することなどを決定しました。国庫短期証券3ヵ月もの利回りは、日銀が積極的に金融緩和を行うなかで、運用難の国内投資家からの旺盛な需要に加えて欧州債務懸念を受けた質への逃避買いの動きを背景に、0.10%程度で安定的に推移しました。

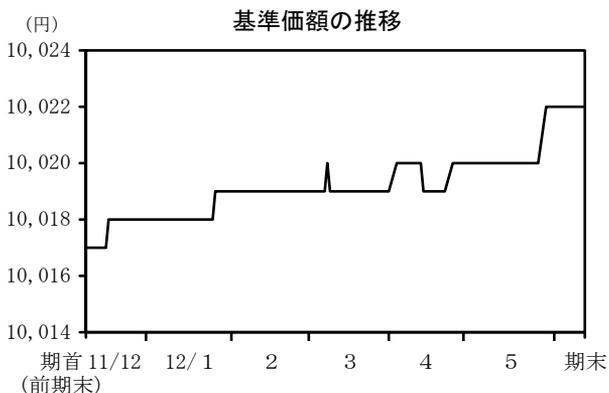
■運用の概況

1. 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、期首の10,017円からスタートし、期末は10,022円となりました。

2. 運用の概況

純資産総額は、2012年3月以降に資金の流出が続いたため、期首の879百万円から減少し、期末には608百万円となりました。期中の短期国債の組入比率は73～84%程度で推移し、残りについては、全額コールローン等で運用を行いました。



■今後の運用方針

1. 運用環境

景気動向については復興需要を背景に緩やかな回復が予想されますが、欧州債務問題や世界的な景気減速の兆しを背景とした景気下振れリスクが存在しており、下振れリスクが高まった場合には、更なる金融緩和の実施が予想されます。短期金利については、日銀の金融緩和スタンスの長期化観測や需給のひっ迫を背景に、引続き低位安定での推移が予想されます。

2. 運用方針

相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、引続き短期国債を中心とした安定的な運用を行います。

1万口（元本10,000円）当たりの費用明細（2011年12月13日から2012年6月11日まで）

当期において発生した費用はありません。

売買および取引の状況（2011年12月13日から2012年6月11日まで）

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 1,219,704	千円 149,978 (1,300,000)

(注) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)。単位未満は切捨て。

(注) ()内は償還による減少分です。

当期中の主要な売買銘柄（2011年12月13日から2012年6月11日まで）

公社債

買付銘柄	金額	売付銘柄	金額
	千円		千円
第261回国庫短期証券	699,826	第261回国庫短期証券	149,978
第283回国庫短期証券	299,926		
第281回国庫短期証券	199,955		
第257回国庫短期証券	19,995		

(注) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)。単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2011年12月13日から2012年6月11日まで)

当期における利害関係人との取引はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細 (2012年6月11日現在)

下記は、マネーアカウントマザーファンド全体 (607,625千口) の内容です。

公社債

(A) 国内 (邦貨建) 公社債<種類別>

区 分	当 期				末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	500,000 (500,000)	499,898 (499,898)	82.1 (82.1)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	82.1 (82.1)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(B) 国内 (邦貨建) 公社債<銘柄別>

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	第281回国庫短期証券	—	200,000	199,961	2012/ 8/20
	第283回国庫短期証券	—	300,000	299,936	2012/ 8/27
合計	銘柄数 金額	2銘柄	500,000	499,898	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成 (2012年6月11日現在)

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
	千円		%
公 社 債	499,898		82.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	109,081		17.9
投 資 信 託 財 産 総 額	608,979		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本および基準価額ならびに損益の状況

資産、負債、元本および基準価額の状況

2012年6月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	608,979,159円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	109,080,430
公 社 債 (評価額)	499,898,580
未 収 利 息	149
(B) 純 資 産 総 額 (A)	608,979,159
元 本	607,625,969
次 期 繰 越 損 益 金	1,353,190
(C) 受 益 権 総 口 数	607,625,969口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (B/C)	10,022円

(注) 期首元本額 878,089,144円
 期中追加設定元本額 9,981,037円
 期中一部解約元本額 280,444,212円

(注) 1口当たり純資産額は1.0022円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本の内訳

中国A株ファンド	37,223,613円
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	304,277,634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・コース	22,100,435円
T&D 通貨トレード 新興国社債ファンド(毎月分配型)米ドルベア・コース	29,923,619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・コース	1,597,484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	63,077,768円
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・コース	68,808,473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・コース	80,616,943円

損益の状況

当期 自2011年12月13日 至2012年6月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	359,321円
受 取 利 息	359,321
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	607
売 買 益	101,706
売 買 損	△ 101,099
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	359,928
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,530,087
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	18,963
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 555,788
(G) 合 計 (C+D+E+F)	1,353,190
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	1,353,190

(注) 損益の状況の中で

(B) 有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
 (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。
 (F) 解約差損益金とあるのは、一部解約の際、元本から解約価額を差引いた差額分をいいます。