

【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24年11月30日

【発行者名】 三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ
(Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.)

【代表者の役職氏名】 マネージング・ディレクター 皆川 宏

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、
アーロン通り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦
同 大西 信治

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
東京海上ストラテジック・トラスト - 東京海上Roggeニッポン・ボ
ンド・ファンド・カレンシー・セレクション
(Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Nippon
Bond Fund Currency Selection)

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
米ドルヘッジクラス：
10億アメリカ合衆国ドル（約793億1,000万円）を上限とする。
ブラジル・リアルヘッジクラス：
10億アメリカ合衆国ドル（約793億1,000万円）を上限とする。
中国元ヘッジクラス：
10億アメリカ合衆国ドル（約793億1,000万円）を上限とする。
インドネシア・ルピアヘッジクラス：
10億アメリカ合衆国ドル（約793億1,000万円）を上限とする。
(注) アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」または「ドル」という。）の円貨
換算は、便宜上、平成24年6月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の
対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝79.31円）による。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成24年8月31日に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より追加・訂正するため、また記載事項のうち訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
	2 事業の内容及び営業の概況		(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
3 管理会社の経理状況		5 管理会社の経理の概況		更新
5 その他	(4) 訴訟事件その他の重要事項	4 管理会社の概況	(3) その他	追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

東京海上ストラテジック・トラスト（Tokio Marine Strategic Trust）（以下「トラスト」という。）のサブ・ファンドである東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション（Tokio Marine Rogge Nippon Bond Fund Currency Selection）（以下「ファンド」という。）の運用状況は以下のとおりである。

（１）投資状況

資産別および地域別の投資状況

（平成24年9月末日現在）

資産の種類	地域名	時価合計 （アメリカ合衆国ドル）	投資比率（％）
社債	日本	97,903,403.80	53.65
	ケイマン諸島	31,149,044.04	17.07
	米国	28,740,579.79	15.75
	小計	157,793,027.63	86.46
公債	日本	18,601,956.30	10.19
	小計	18,601,956.30	10.19
変動利付債	ケイマン諸島	2,859,840.72	1.57
	小計	2,859,840.72	1.57
小計		179,254,824.65	98.22
現金・その他の資産 （負債控除後）		3,239,455.38	1.78
合計（純資産総額）		182,494,280.03 （約14,162百万円）	100.00

（注１）投資比率とは、各サブ・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う。以下同じ。

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」または「ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、平成24年9月28日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝77.60円）による。

（注３）ファンドは、ケイマン法に基づいて設定されているが、ファンド証券は米ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨をもって行う。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

(2) 運用実績

純資産の推移

平成24年9月末日までの1年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

<米ドルヘッジクラス>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成23年10月末日	36,908,243.44	2,864,080	101.36	7,866
11月末日	37,502,259.15	2,910,175	101.70	7,892
12月末日	34,597,046.85	2,684,731	102.01	7,916
平成24年1月末日	35,015,100.30	2,717,172	103.30	8,016
2月末日	36,578,386.49	2,838,483	103.31	8,017
3月末日	37,012,723.25	2,872,187	102.90	7,985
4月末日	37,954,510.18	2,945,270	103.56	8,036
5月末日	37,013,441.32	2,872,243	104.46	8,106
6月末日	37,457,736.95	2,906,720	104.89	8,139
7月末日	37,740,680.01	2,928,677	106.14	8,236
8月末日	37,873,880.07	2,939,013	106.72	8,281
9月末日	36,387,274.32	2,823,652	107.32	8,328

<ブラジル・リアルヘッジクラス>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成23年10月末日	207,813,702.14	16,126,343	102.77	7,975
11月末日	189,310,590.33	14,690,502	96.74	7,507
12月末日	180,866,546.58	14,035,244	93.29	7,239
平成24年1月末日	193,692,783.64	15,030,560	100.50	7,799
2月末日	187,990,524.44	14,588,065	102.12	7,925
3月末日	171,361,561.18	13,297,657	95.37	7,401
4月末日	159,883,396.68	12,406,952	92.21	7,155
5月末日	147,503,429.68	11,446,266	86.41	6,705
6月末日	143,395,790.99	11,127,513	86.38	6,703
7月末日	138,336,434.66	10,734,907	85.54	6,638
8月末日	137,076,363.27	10,637,126	85.64	6,646
9月末日	134,902,933.35	10,468,468	86.29	6,696

< 中国元ヘッジクラス >

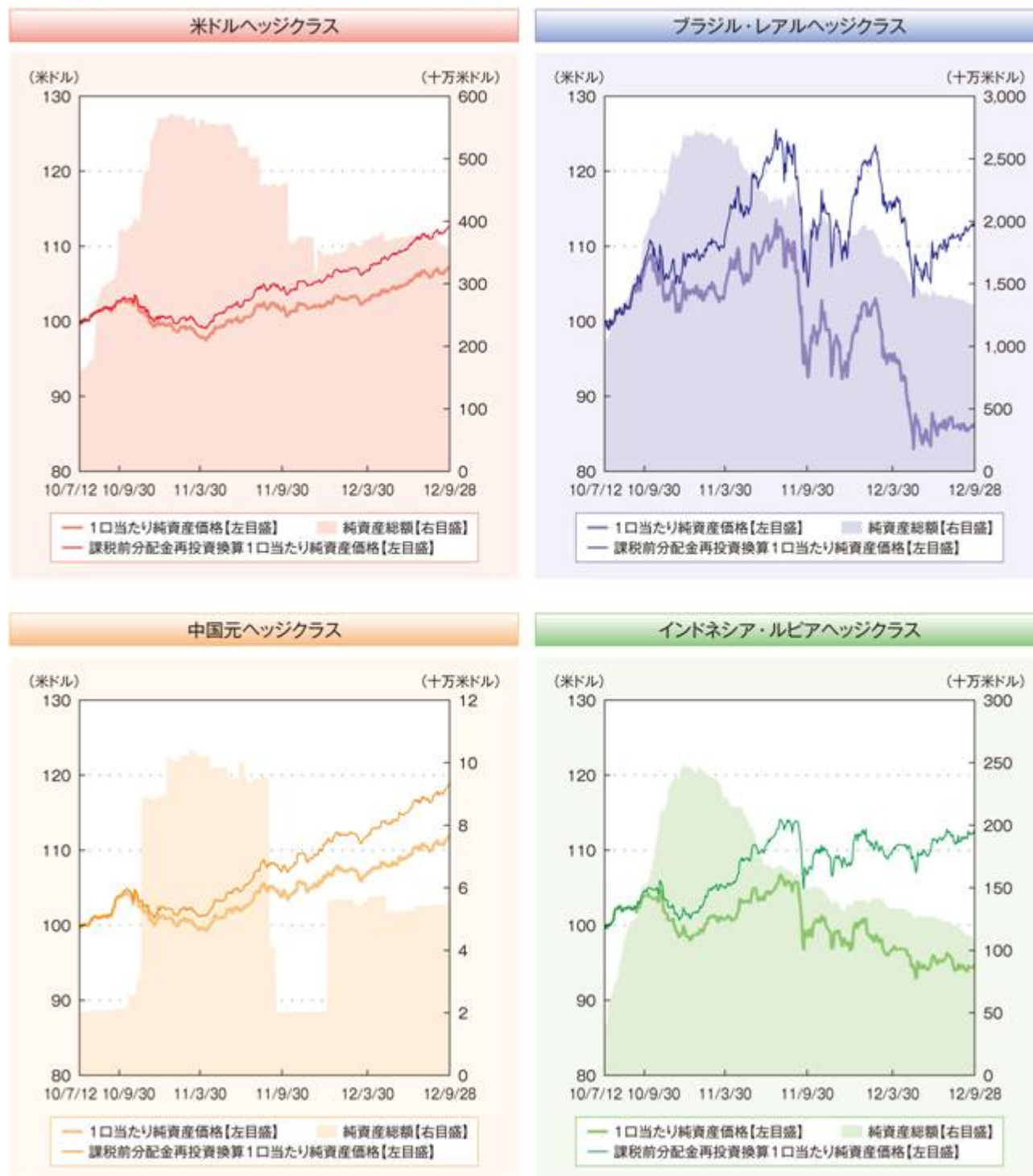
	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成23年10月末日	202,182.33	15,689	104.65	8,121
11月末日	202,334.61	15,701	104.73	8,127
12月末日	204,690.73	15,884	105.95	8,222
平成24年 1 月末日	563,531.36	43,730	107.71	8,358
2 月末日	563,053.34	43,693	107.62	8,351
3 月末日	554,986.21	43,067	106.93	8,298
4 月末日	572,765.11	44,447	107.76	8,362
5 月末日	519,356.57	40,302	107.86	8,370
6 月末日	525,010.78	40,741	109.04	8,462
7 月末日	542,301.02	42,083	110.34	8,562
8 月末日	545,013.62	42,293	110.89	8,605
9 月末日	551,241.12	42,776	112.15	8,703

< インドネシア・ルピアヘッジクラス >

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成23年10月末日	14,897,795.44	1,156,069	101.38	7,867
11月末日	13,738,135.84	1,066,079	98.29	7,627
12月末日	13,636,381.21	1,058,183	97.48	7,564
平成24年 1 月末日	13,921,514.64	1,080,310	100.28	7,782
2 月末日	14,218,283.14	1,103,339	98.85	7,671
3 月末日	13,380,267.79	1,038,309	96.97	7,525
4 月末日	13,332,840.85	1,034,628	96.90	7,519
5 月末日	12,557,398.68	974,454	93.34	7,243
6 月末日	12,654,188.35	981,965	95.52	7,412
7 月末日	12,250,937.07	950,673	95.89	7,441
8 月末日	11,615,650.57	901,374	94.17	7,308
9 月末日	10,652,831.24	826,660	94.79	7,356

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2010年7月12日～2012年9月28日）



（注）課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、各クラスの公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金（課税前）をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なる。以下同じ。

分配の推移

平成24年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成23年10月1日～平成24年9月末日	2.40	186

<ブラジル・レアルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成23年10月1日～平成24年9月末日	13.80	1,071

<中国元ヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成23年10月1日～平成24年9月末日	3.00	233

<インドネシア・ルピアヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成23年10月1日～平成24年9月末日	9.00	698

< 参考情報 >

分配の推移（2012年9月末現在）

（単位：米ドル、1口当たり課税前）

米ドルヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	1.20
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	2.40
2012年5月	0.20
2012年6月	0.20
2012年7月	0.20
2012年8月	0.20
2012年9月	0.20
直近1年間累計	2.40
設定来累計	5.00

ブラジル・レアルヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	5.70
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	13.00
2012年5月	1.15
2012年6月	1.15
2012年7月	1.15
2012年8月	1.15
2012年9月	1.15
直近1年間累計	13.80
設定来累計	26.75

中国元ヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	1.50
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	3.00
2012年5月	0.25
2012年6月	0.25
2012年7月	0.25
2012年8月	0.25
2012年9月	0.25
直近1年間累計	3.00
設定来累計	6.25

インドネシア・ルピアヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	3.60
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	8.40
2012年5月	0.75
2012年6月	0.75
2012年7月	0.75
2012年8月	0.75
2012年9月	0.75
直近1年間累計	9.00
設定来累計	17.25

収益率の推移

<米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成23年10月1日～平成24年9月末日	8.09%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<ブラジル・レアルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成23年10月1日～平成24年9月末日	6.73%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<中国元ヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成23年10月1日～平成24年9月末日	10.85%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<インドネシア・ルピアヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成23年10月1日～平成24年9月末日	5.48%

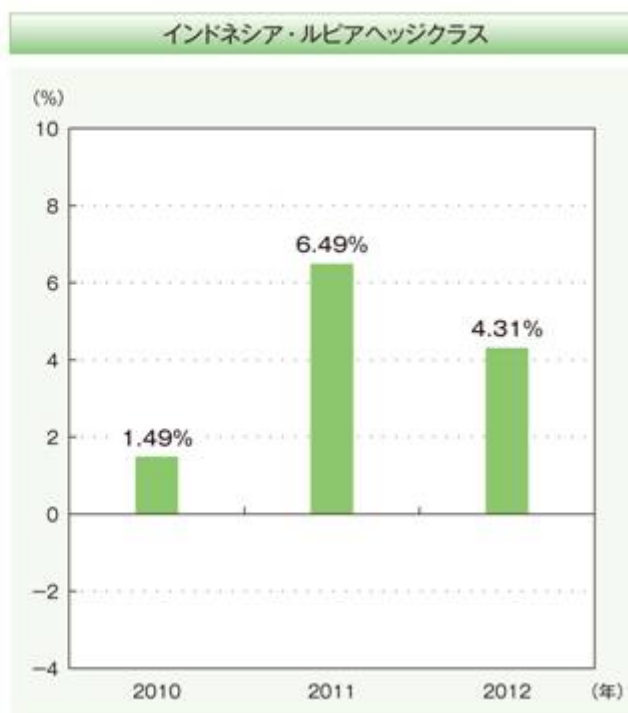
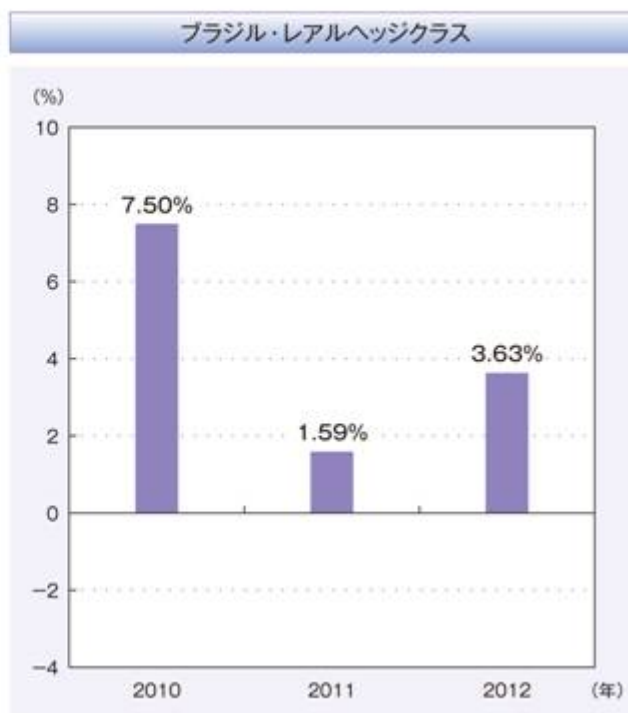
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

< 参考情報 >

年間収益率の推移



(注1) 収益率 (%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算 1 口当たり純資産価格

ただし、2012年については2012年 9 月末日における 1 口当たり純資産価格

b = 当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算 1 口当たり純資産価格（ただし、2010年の場合は当初発行価格（100米ドル））

(注2) 2010年は 7 月 12 日（運用開始日）から 12 月末日までの収益率である。2012年は 1 月 1 日から 9 月末日までの収益率である。

(注3) ファンドおよび各クラスに、ベンチマークはない。

2 販売及び買戻しの実績

平成24年9月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに平成24年9月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

<米ドルヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
183,008 (183,008)	296,734 (296,734)	339,065 (339,065)

<ブラジル・レアルヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
396,289 (396,289)	867,577 (867,577)	1,563,424 (1,563,424)

<中国元ヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
3,625 (3,625)	642 (642)	4,915 (4,915)

<インドネシア・ルピアヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
22,713 (22,713)	61,281 (61,281)	112,379 (112,379)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a．サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の平成24年9月28日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝77.60円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

[次へ](#)

(１) 資産及び負債の状況

貸借対照表

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション

2012年 8 月31日現在

米ドル

千円

資産		
現金	1,917,409.57	148,791
銀行預金 - 基準通貨	1,161,289.09	90,116
銀行預金 - 外国通貨	756,120.48	58,675
有価証券（取得原価）	175,759,240.10	13,638,917
債券（取得原価）	175,759,240.10	13,638,917
未実現評価損益	8,724,273.64	677,004
未実現時価評価損益	10,569,555.35	820,197
未実現通貨運用損益	(1,837,504.85)	(142,590)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	0.01	0
未実現通貨繰延損益	(7,776.87)	(603)
未収収益	2,335,246.58	181,215
債券に係る未収利息	2,335,246.58	181,215
資本証券	796,943.00	61,843
受益証券販売未収金	796,943.00	61,843
前払費用	72,659.66	5,638
設立費用	72,659.66	5,638
資産合計：	189,605,772.55	14,713,408
負債		
資本証券	1,476,514.17	114,577
受益証券買戻未払金	1,476,514.17	114,577
未払費用	541,734.10	42,039
未払監査費用	44,734.69	3,471
未払保管報酬	51,658.67	4,009
未払報告書作成費用	11,565.75	898
未払投資顧問報酬	240,922.84	18,696
未払受託報酬	3,487.73	271
未払代行協会員報酬	17,214.95	1,336
未払販売報酬	172,149.47	13,359
負債合計：	2,018,248.27	156,616

2012年8月31日現在

	米ドル	千円
資本		
ファンド受益証券	212,538,547.19	16,492,991
発行済ファンド受益証券（額面価額）	207,931,200.00	16,135,461
ブラジル・レアル	159,710,700.00	12,393,550
インドネシア・ルピア	12,234,400.00	949,389
中国元	491,500.00	38,140
米ドル	35,494,600.00	2,754,381
受益証券額面超過額	4,607,347.19	357,530
ブラジル・レアル	4,060,726.65	315,112
インドネシア・ルピア	267,460.87	20,755
中国元	1,981.85	154
米ドル	277,177.82	21,509
分配金支払額	(56,286,262.30)	(4,367,814)
分配金支払額	(56,286,262.30)	(4,367,814)
ブラジル・レアル	(51,446,519.15)	(3,992,250)
インドネシア・ルピア	(2,729,011.20)	(211,771)
中国元	(35,087.75)	(2,723)
米ドル	(2,075,644.20)	(161,070)
利益剰余金	46,238,641.41	3,588,119
利益剰余金	46,238,641.41	3,588,119
ブラジル・レアル	60,215,823.35	4,672,748
インドネシア・ルピア	2,355,277.59	182,770
中国元	61,819.30	4,797
米ドル	2,239,294.24	173,769
当期純損失	(14,903,402.02)	(1,156,504)
資本合計：	187,587,524.28	14,556,792
負債および資本合計	189,605,772.55	14,713,408
純資産額合計	187,587,524.28	14,556,792
発行済受益証券総数	2,079,312.00000口	
受益証券1口当たり純資産額合計	90.22	7,001円

損益計算書

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション

2012年3月1日から
2012年8月31日までの期間

米ドル

千円

収益

実現損益

(18,209,797.35)

(1,413,080)

為替取引に係る実現利益

29,681,095.58

2,303,253

ブラジル・レアル

21,944,144.40

1,702,866

インドネシア・ルピア

535,102.16

41,524

中国元

14,585.98

1,132

為替取引に係る実現損失

(50,511,700.10)

(3,919,708)

ブラジル・レアル

(44,991,690.61)

(3,491,355)

インドネシア・ルピア

(1,082,773.63)

(84,023)

中国元

(14,986.91)

(1,163)

市場に係る実現利益

4,496,980.69

348,966

市場に係る実現損失

(70,412.57)

(5,464)

通貨に係る実現利益

162,551.64

12,614

ブラジル・レアル

0.03

0

インドネシア・ルピア

0.03

0

通貨に係る実現損失

(1,968,312.59)

(152,741)

ブラジル・レアル

(0.03)

(0)

インドネシア・ルピア

(0.03)

(0)

中国元

(0.01)

(0)

受取利息

4,104,247.76

318,490

債券に係る受取利息

4,104,247.76

318,490

2012年3月1日から
2012年8月31日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	786,903.30	61,064
未実現時価評価損益	2,021,102.42	156,838
未実現通貨運用損益	(1,226,948.53)	(95,211)
ブラジル・リアル	(369,984.19)	(28,711)
インドネシア・ルピア	(16,938.48)	(1,314)
中国元	493.10	38
未決済取引にかかる未実現為替差損益	6,001.42	466
未実現通貨繰延損益	(13,252.01)	(1,028)
収益合計：	(13,318,646.29)	(1,033,527)
費用		
費用 - 報酬	1,584,755.73	122,977
監査費用	13,946.99	1,082
保管報酬	156,054.58	12,110
報告書作成費用	2,348.29	182
弁護士費用	761.04	59
投資顧問報酬	728,104.42	56,501
受託報酬	10,482.86	813
設立費用償却	77,621.44	6,023
代行協会員報酬	52,013.56	4,036
販売報酬	520,136.36	40,363
副保管報酬	7,666.32	595
ケイマン諸島における年次報告書に係る報酬	2,206.95	171
その他の費用	30.00	2
専門家報酬	13,382.92	1,039
費用合計：	1,584,755.73	122,977
投資純損失	(14,903,402.02)	(1,156,504)

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2012年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
現金											
基準通貨現金											
1,161,289.09000	米ドル現金	10/16/2012		1,161,289.09	1,161,289.09	1.000000000	1,161,289.09	1,161,289.09	0.00	0.00	0.00
						1.000000000					
1,161,289.09000	基準通貨現金 小計			1,161,289.09	1,161,289.09		1,161,289.09	1,161,289.09	0.00	0.00	0.00
1,161,289.09000	現金合計			1,161,289.09	1,161,289.09		1,161,289.09	1,161,289.09	0.00	0.00	0.00
社債											
変動利率											
9,090,000.00000	MITSUI SUMITOMO	3/9/2012		9,300,250.00	9,300,250.00	108.850444000 C	9,894,505.36	9,894,505.36	594,255.36	0.00	594,255.36
	FRN 03152072					1.000000000					
9,940,000.00	MUFG CAP FIN 5	7/13/2012		10,362,450.00	15,962,318.00	107.666999800 C	10,702,099.78	16,998,680.20	539,482.73	496,879.47	1,036,362.20
	FRN 01292049					1.588350002					
19,030,000.00000	変動利率 小計			19,662,700.00	25,262,568.00		20,596,605.14	26,893,185.56	1,133,738.09	496,879.47	1,630,617.56
ミディアム・ターム・ノート											
4,500,000.00	EAST JAPAN RAILWAY	7/13/2010		4,382,167.00	6,802,439.48	117.426002500 C	5,284,170.11	8,393,111.61	1,432,696.65	157,975.48	1,590,672.13
	4.75% 12082031					1.588350002					
3,680,000.00000	MITSUBISHI CORP	9/8/2010		3,708,555.73	3,708,555.73	103.712997400 C	3,816,638.30	3,816,638.30	108,082.57	0.00	108,082.57
	2.75% 09162015					1.000000000					
4,400,000.00000	MITSUBISHI CORP	7/9/2012		4,377,472.00	4,377,472.00	99.851997300 C	4,393,487.88	4,393,487.88	16,015.88	0.00	16,015.88
	1.875 % 07132017					1.000000000					
5,400,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT	2/18/2011		5,391,306.00	8,738,498.34	111.948997400 C	6,045,245.86	9,601,966.27	1,038,685.38	(175,217.45)	863,467.93
	4% 12072017					1.588350002					
17,980,000.00000	ミディアム・ターム・ノート 小計			17,859,500.73	23,626,965.55		19,539,542.15	26,205,204.06	2,595,480.48	(17,241.97)	2,578,238.51

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2012年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
私募債											
2,750,000.00000	BK TOKYO-MIT UFJ 2.35 % 02232017	2/14/2012		2,748,460.00	2,748,460.00	103.271003700 C 1.000000000	2,839,952.60	2,839,952.60	91,492.60	0.00	91,492.60
4,790,000.00000	MIZUHO CORP BANK 2.55 % 03172017	3/14/2012		4,827,190.00	4,827,190.00	103.566001800 C 1.000000000	4,960,811.49	4,960,811.49	133,621.49	0.00	133,621.49
5,135,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 5.79 % 04152014	10/20/2011		5,556,309.50	5,556,309.50	104.454620000 C 1.000000000	5,363,744.74	5,363,744.74	(192,564.76)	0.00	(192,564.76)
9,950,000.00000	NISSAN MOTOR ACC 1.95 % 09122017	9/5/2012		9,941,045.00	9,941,045.00	99.910000000 1.000000000	9,941,045.00	9,941,045.00	0.00	0.00	0.00
6,450,000.00000	RESONA BANK FRN 09152049	3/23/2012		6,764,700.00	6,764,700.00	107.449996900 C 1.000000000	6,930,524.80	6,930,524.80	165,824.80	0.00	165,824.80
9,700,000.00000	TAKEDA PHARMACEU 1.625 % 03172017	7/9/2012		9,700,000.00	9,700,000.00	100.581001200 C 1.000000000	9,756,357.12	9,756,357.12	56,357.12	0.00	56,357.12
38,775,000.00000	私募債 小計			39,537,704.50	39,537,704.50		39,792,435.75	39,792,435.75	254,731.25	0.00	254,731.25
公募債											
5,000,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL LIF 7.25 % 07252049	5/10/2011		5,014,750.00	5,014,750.00	111.286003100 C 1.000000000	5,564,300.16	5,564,300.16	549,550.16	0.00	549,550.16
3,500,000.00000	MITSUBISHI CORP 2.25% 09142016	9/7/2011		3,480,960.00	3,480,960.00	102.308998100 C 1.000000000	3,580,814.93	3,580,814.93	99,854.93	0.00	99,854.93
8,000,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.2 % 07182022	7/12/2012		7,973,520.00	7,973,520.00	100.782997100 C 1.000000000	8,062,639.77	8,062,639.77	89,119.77	0.00	89,119.77
2,250,000.00000	NIPPON TEL & TEL 1.4 % 07182017	7/11/2012		2,246,962.50	2,246,962.50	100.865997300 C 1.000000000	2,269,484.94	2,269,484.94	22,522.44	0.00	22,522.44
5,050,000.00000	NISSAN MOTOR ACC 4.5% 01302015	7/14/2010		5,312,471.21	5,312,471.21	107.194999600 C 1.000000000	5,413,347.48	5,413,347.48	100,876.27	0.00	100,876.27
9,500,000.00000	ORIX CORP 5 % 01122016	10/20/2011		9,733,000.00	9,733,000.00	106.809997500 C 1.000000000	10,146,949.76	10,146,949.76	413,949.76	0.00	413,949.76
5,350,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.95 % 01122022	1/5/2012		5,332,933.50	5,332,933.50	106.828002900 C 1.000000000	5,715,298.16	5,715,298.16	382,364.66	0.00	382,364.66

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2012年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （米ドル）	取得原価 （基準通貨） （米ドル）	基準価格	価額 （表示通貨） （米ドル）	価額 （基準通貨） （米ドル）	市場 （米ドル）	通貨 （米ドル）	合計 （米ドル）
社債											
公募債											
12,530,000.00000	SUMITOMO MITSUI BK 4% 11092020	10/29/2010		12,306,369.18	16,956,408.49	104.864997800 C 1.260500001	13,139,584.22	16,562,445.93	1,050,267.56	(1,444,230.12)	(393,962.56)
3,270,000.00000	TOYOTA MTR CRED 3.3 % 01122022	1/13/2012		3,292,988.10	3,292,988.10	107.978996200 C 1.000000000	3,530,913.18	3,530,913.18	237,925.08	0.00	237,925.08
54,450,000.00000	公募債 小計			54,693,954.49	59,343,993.80		57,423,332.60	60,846,194.31	2,946,430.63	(1,444,230.12)	1,502,200.51
130,235,000.00000	社債合計			131,753,859.72	147,771,231.85		137,351,915.64	153,737,019.68	6,930,380.45	(964,592.62)	5,965,787.83
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
131,322.99	BRITISH POUND	MultiLot		131,322.99	212,690.71	1.000000000 S 1.588350002	131,322.99	208,586.87	0.00	(4,103.84)	(4,103.84)
622,143.26000	EURO	MultiLot		622,143.26	810,226.70	1.000000000 S 1.260500001	622,143.26	784,211.58	0.00	(26,015.12)	(26,015.12)
4,386,779.00000	JAPANESE YEN	8/16/2012		4,386,779	55,676.85	1.000000000 S 78.300000000	4,386,779	56,025.27	0.00	348.42	348.42
5,140,245.25000	非グループ化の有価証券 小計			5,140,245.25	1,078,594.26		5,140,245.25	1,048,823.72	0.00	(29,770.54)	(29,770.54)
5,140,245.25000	外貨建現金勘定合計			5,140,245.25	1,078,594.26		5,140,245.25	1,048,823.72	0.00	(29,770.54)	(29,770.54)
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
(2,529,000.00000)	BRL FORWARD 19 NOV	10/11/2012		(2,529,000.00)	(1,235,647.63)	1.000000000 2.046699997	(2,529,000.00)	(1,235,647.63)	0.00	0.00	0.00
271,634,054.98000	BRL FORWARD 19 NOV	MultiLot		271,634,054.98	133,280,100.00	1.000000000 2.038069112	271,634,054.98	133,280,100.00	0.00	0.00	0.00
3,468,996.90	CNY FORWARD 14 DEC	9/28/2012		3,468,996.90	546,600.00	1.000000000 6.346500000	3,468,996.90	546,600.00	0.00	0.00	0.00
22,367,837.19000	EUR FORWARD 13 DEC	MultiLot		22,367,837.19	29,066,950.82	1.000000000 1.299497603	22,367,837.19	29,066,950.82	0.00	0.00	0.00
(36,067,906.36000)	EUR FORWARD 13 DEC	MultiLot		(36,067,906.36)	(46,780,335.71)	1.000000000 1.297007241	(36,067,906.36)	(46,780,335.71)	0.00	0.00	0.00

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2012年 8 月31日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
58,435,743.55000	EUR FORWARD 17 OCT	MultiLot		58,435,743.55	74,514,075.20	1.000000000 F 1.261181399	58,435,743.55	73,698,072.82	0.00	(816,002.38)	(816,002.38)
(58,435,743.55000)	EUR FORWARD 17 OCT	MultiLot		(58,435,743.55)	(73,639,364.00)	1.000000000 F 1.261181399	(58,435,743.55)	(73,698,072.82)	0.00	(58,708.82)	(58,708.82)
(28,835,606.91)	GBP FORWARD 13 DEC	MultiLot		(28,835,606.91)	(46,371,125.19)	1.000000000 1.608120312	(28,835,606.91)	(46,371,125.19)	0.00	0.00	0.00
6,757,873.31	GBP FORWARD 13 DEC	MultiLot		6,757,873.31	10,836,811.82	1.000000000 1.603583158	6,757,873.31	10,836,811.82	0.00	0.00	0.00
(36,451,844.48)	GBP FORWARD 17 OCT	MultiLot		(36,451,844.48)	(57,187,774.43)	1.000000000 F 1.588095408	(36,451,844.48)	(57,889,006.84)	0.00	(701,232.41)	(701,232.41)
36,451,844.48	GBP FORWARD 17 OCT	MultiLot		36,451,844.48	58,285,859.45	1.000000000 F 1.588095408	36,451,844.48	57,889,006.84	0.00	(396,852.61)	(396,852.61)
101,679,658,300.00	IDR FORWARD 14 DEC	MultiLot		101,679,658,300.00	10,538,300.00	1.000000000 9,648.582627179	101,679,658,300.00	10,538,300.00	0.00	0.00	0.00
(1,355,574,000.00)	IDR FORWARD 14 DEC	10/12/2012		(1,355,574,000.00)	(139,908.56)	1.000000000 9,688.999729538	(1,355,574,000.00)	(139,908.56)	0.00	0.00	0.00
26,861,765.00000	JPY FORWARD 13 DEC	MultiLot		26,861,765	343,676.68	1.000000000 78.159987463	26,861,765	343,676.68	0.00	0.00	0.00
(23,169,544.00000)	JPY FORWARD 13 DEC	MultiLot		(23,169,544)	(297,072.95)	1.000000000 77.992775849	(23,169,544)	(297,072.95)	0.00	0.00	0.00
50,062,926.00000	JPY FORWARD 17 OCT	MultiLot		50,062,926	639,606.02	1.000000000 F 78.268275000	50,062,926	639,632.42	0.00	26.40	26.40
(50,062,924.00000)	JPY FORWARD 17 OCT	MultiLot		(50,062,924)	(639,562.73)	1.000000000 F 78.268275000	(50,062,924)	(639,632.39)	0.00	(69.66)	(69.66)
100,564,572,772.11000	非グループ化の有価証券 小計			100,564,572,772.11	91,761,188.79		100,564,572,772.11	89,788,349.31	0.00	(1,972,839.48)	(1,972,839.48)
100,564,572,772.11000	先物（ポジション）合計			100,564,572,772.11	91,761,188.79		100,564,572,772.11	89,788,349.31	0.00	(1,972,839.48)	(1,972,839.48)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2012年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
国債											
公募債											
2,300,000.00000	JAPAN FIN CORP 2.125 % 02072019	1/31/2012		2,293,606.00	2,293,606.00	103.547996500 C 1.000000000	2,381,603.92	2,381,603.92	87,997.92	0.00	87,997.92
12,400,000.00000	JAPAN FIN ORG MUNI 4% 01132021	1/6/2011		12,297,080.00	12,297,080.00	116.162002500 C 1.000000000	14,404,088.31	14,404,088.31	2,107,008.31	0.00	2,107,008.31
14,700,000.00000	公募債 小計			14,590,686.00	14,590,686.00		16,785,692.23	16,785,692.23	2,195,006.23	0.00	2,195,006.23
14,700,000.00000	国債合計			14,590,686.00	14,590,686.00		16,785,692.23	16,785,692.23	2,195,006.23	0.00	2,195,006.23
変動利付債											
変動金利											
2,600,000.00000	SMFG PREF CAP FRN 01252049	8/16/2010		2,563,500.00	2,563,500.00	110.307355000 C 1.000000000	2,867,991.23	2,867,991.23	304,491.23	0.00	304,491.23
2,600,000.00000	変動金利 小計			2,563,500.00	2,563,500.00		2,867,991.23	2,867,991.23	304,491.23	0.00	304,491.23
2,600,000.00000	変動利付債合計			2,563,500.00	2,563,500.00		2,867,991.23	2,867,991.23	304,491.23	0.00	304,491.23
100,718,409,306.45000	ポートフォリオ合計			100,719,782,352.17	258,926,489.99		100,727,879,905.55	265,389,165.26	9,429,877.91	(2,967,202.64)	6,462,675.27

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（平成24年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約29億円）

発行済株式総数 1,002,080株

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命を解除することができる。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の４分の３以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の４分の３を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合、管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不履行、誠実に行為しないこと、過失、詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視の場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、（ ）ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは（ ）かかる者の行為に関係し、もしくはこれらから生じ、もしくはこれらに基づき、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が現実に一時的に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、かかる行為が故意の不履行、誠実に行為しないこと、過失、詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、平成24年９月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産価格の合計（通貨別）
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	33	7,246,435,186.98米ドル

（３）その他

本書提出前６か月以内において、訴訟事件その他管理会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

[次へ](#)

5 管理会社の経理の概況

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、円貨換算が併記されている。日本円への換算には平成24年9月28日現在における株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝77.60円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(１) 資産及び負債の状況

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2012年 6 月30日現在

(単位：米ドル)

資産

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	16,368,514.00	1,270,197
1.2	売買目的で保有される金融資産	12,334,406.00	957,150
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	12,334,406.00	957,150
1.2.2	持分証券		
1.2.3	債務証券		
1.2.4	ローンおよび貸付金		
1.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0.00	0
1.3.1	持分証券		
1.3.2	債務証券		
1.3.3	ローンおよび貸付金		
1.4	売却可能金融資産	2,491,535.00	193,343
1.4.1	持分証券	2,491,535.00	193,343
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	2,359,607,712.00	183,105,558
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	2,359,607,712.00	183,105,558
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
1.9	有形資産	1,433,755.00	111,259
1.9.1	有形固定資産	1,433,755.00	111,259
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	1,397,420.00	108,440
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	1,397,420.00	108,440
1.12	税金資産	1,490,731.00	115,681
1.12.1	現行税金資産	1,490,731.00	115,681
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	25,423,680.00	1,972,878
1.14	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
1.15	資産合計	2,420,547,753.00	187,834,506

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2012年 6月30日現在

（単位：米ドル）

負債

		米ドル	千円
2.1	中央銀行預金		
2.2	売買目的で保有される金融負債	3,102,373.00	240,744
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	3,102,373.00	240,744
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証券（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証券（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	2,287,212,414.00	177,487,683
2.4.1	金融機関からの預金	1,454,816,358.00	112,893,749
2.4.2	金融機関以外からの預金	832,396,056.00	64,593,934
2.4.3	債務証券（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
2.8	引当金	0.00	0
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務		
2.8.3	年金およびその他の退職後給付金債務		
2.8.4	ローン契約および保証		
2.8.5	有償契約		
2.8.99	その他の引当金	0.00	0
2.9	税金負債	17,443,138.00	1,353,588
2.9.1	現行税金負債	15,826,833.00	1,228,162
2.9.2	繰延税金負債	1,616,305.00	125,425
2.10	その他の負債	11,343,994.00	880,294
2.11	要求払株式資本（例えば、共同株式）		
2.12	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
2.13	負債合計	2,319,101,919.00	179,962,309

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2012年6月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	2,880,354
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	2,880,354
3.1.2	未払込請求資本	0.00	0
3.2	株式発行差金		
3.3	その他のエクイティ	0.00	0
3.3.1	複合金融商品のエクイティ部分		
3.3.99	その他のエクイティ商品		
3.4	再評価準備金およびその他の評価差額：	1,636,454.00	126,989
3.4.1	有形資産		
3.4.2	無形資産		
3.4.3	外国事業純投資のヘッジ（有効部分）		
3.4.4	外貨換算		
3.4.5	キャッシュ・フロー・ヘッジ（有効部分）		
3.4.6	売却可能金融資産	1,636,454.00	126,989
3.4.7	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	50,727,180.00	3,936,429
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	11,964,231.00	928,424
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	101,445,834.00	7,872,197
3.11	負債および資本合計	2,420,547,753.00	187,834,506

（２）損益の状況

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

損益計算書

2012年６月30日に終了した期間

（単位：米ドル）

		米ドル	千円
5.1	金融および運用収益および費用（＋／－）	30,722,966.00	2,384,102
5.2	利息収益	7,324,242.00	568,361
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	1,884,285.00	146,221
5.2.2	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）	2,457,546.00	190,706
5.2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.2.4	売却可能金融資産		
5.2.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）	2,982,411.00	231,435
5.2.6	満期保有目的投資有価証券		
5.2.7	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
5.2.99	その他の資産		
5.3	（支払利息）（－）	3,074,304.00	238,566
5.3.1	中央銀行からの預金	0.00	0
5.3.2	売買目的で保有される金融負債（区別して計上される場合）	112,604.00	8,738
5.3.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債		
5.3.4	償却後原価で測定される金融負債	2,961,700.00	229,828
5.3.5	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
5.3.99	その他の負債		
5.4	要求払株式資本に係る費用（－）		
5.5	受取配当（＋）	15.00	1
5.5.1	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）		
5.5.2	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.5.3	売却可能金融資産	15.00	1
5.6	受取手数料（＋）	47,565,588.00	3,691,090
5.7	（支払手数料）（－）	21,450,414.00	1,664,552
5.8	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負債に係る実現利益（損失）、純額（＋／－）	0.00	0
5.8.1	売却可能金融資産		
5.8.2	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）		
5.8.3	満期保有目的投資有価証券		
5.8.4	償却後原価で測定される金融負債		
5.8.99	その他		
5.9	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）	808,053.00	62,705
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	808,053.00	62,705
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）		

米ドル

千円

5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（＋／－）		
5.12	為替差額、純額（＋／－）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.14	その他の事業収益（＋）	101,124.00	7,847
5.15	その他の事業費用（－）	551,338.00	42,784
5.16	一般管理費（－）	14,893,907.00	1,155,767
5.16.1	従業員費用（－）	6,582,921.00	510,835
5.16.2	一般管理費用（－）	8,310,986.00	644,933
5.17	減価償却（＋／－）	470,156.00	36,484
5.17.1	有形固定資産	108,287.00	8,403
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	361,869.00	28,081
5.18	引当金（＋／－）	0.00	0
5.19	減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1.1	取得原価で測定される金融資産（値付けされていないエクイティ）		
5.19.1.2	売却可能金融資産		
5.19.1.3	償却後原価で測定されるローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）		
5.19.1.4	償却後原価で測定される満期保有目的投資証券		
5.19.2	非金融資産に係る減損、純額（＋／－）	0.00	0
5.19.2.1	有形固定資産		
5.19.2.2	投資不動産		
5.19.2.3	営業権		
5.19.2.4	その他の無形資産		
5.19.2.99	その他		
5.20	直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）		
5.22	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される除却グループからの損益（＋／－）		
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	15,358,903.00	1,191,851
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	3,394,672.00	263,427
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	11,964,231.00	928,424
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	11,964,231.00	928,424

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第一部 証券情報

(4) 発行（売出）価格

< 訂正前 >

(前略)

(注 2) 「取引日」とは、平成22年7月12日に開始して償還日の前営業日に終了する期間において、(1) 次の暦日が営業日であるすべての営業日、および(2) 営業日である金曜日で、次の月曜日も営業日である場合、または管理会社が随時定めるその他の日をいう。

(注 3) 「評価日」とは、平成22年7月13日に開始して償還日に終了する期間において、取引日の翌営業日、または管理会社が随時定めるその他の日をいう。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(注 2) 「取引日」とは、償還日の前営業日に終了するまでの期間において、(1) 次の暦日が営業日であるすべての営業日、および(2) 営業日である金曜日で、次の月曜日も営業日である場合、または管理会社が随時定めるその他の日をいう。

(注 3) 「評価日」とは、償還日までの期間において、取引日の翌営業日、または管理会社が随時定めるその他の日をいう。

(後略)

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

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

() 資本金の額 (平成24年6月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約29億円)

発行済株式総数 1,002,080株 (一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

() 資本金の額 (平成24年9月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約29億円)

発行済株式総数 1,002,080株（一株37.04米ドルの記名式額面株式）

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

（注）米ドルの円貨換算は、便宜上、平成24年9月28日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝77.60円）による。

（後略）

（５）開示制度の概要

（Ａ）ケイマン諸島における開示

受益者に対する開示

< 訂正前 >

トラストの会計年度末は、毎年２月末日である。第一回の監査済年次財務書類は、平成23年２月末日までの期間について作成された。会計書類は、米国ＧＡＡＰに従って作成される。会計年度末から６か月以内に、毎年の年次受益者集会前までに、監査済会計書類の写しが受益者に送付される。また、管理会社によって、未監査の半期報告書の写しが受益者に送付される。

< 訂正後 >

トラストの会計年度末は、毎年２月末日である。第一回の監査済年次財務書類は、平成23年２月末日までの期間について作成された。会計書類は、米国ＧＡＡＰに従って作成され、会計年度末から６か月以内に受益者に送付される。また、未監査の半期報告書が作成され、毎年８月末日から３か月以内に受益者に送付される。

４ 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

（Ａ）日本

< 訂正前 >

平成24年７月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

< 訂正後 >

平成24年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

５ 運用状況

（２）投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄

（平成24年６月末日現在）

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格（米ドル）		時価（米ドル）		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	SUMITOMO MITSUI BK	日本	社債	4	2020/11/ 9	14,400,000	1.35	19,487,013.74	1.31	18,799,158.78	9.69
2	MUFG CAPITAL FIN 2	ケイマン諸島	変動利付債	変動金利	2049/ 7 /25	14,050,000	1.19	16,653,681.36	1.31	18,369,871.31	9.47
3	JAPAN FIN ORG MUNI	日本	公債	4	2021/ 1 /13	15,500,000	0.99	15,371,350.00	1.16	17,908,080.48	9.23
4	NISSAN MOTOR ACC	米国	社債	4.5	2015/ 1 /30	16,750,000	1.05	17,620,572.83	1.07	17,873,590.02	9.21
5	MITSUBISHI CORP	日本	社債	2.75	2015/ 9 /16	11,310,000	1.01	11,397,762.29	1.04	11,740,345.53	6.05
6	ORIX CORP	日本	社債	5	2016/ 1 /12	9,500,000	1.02	9,733,000.00	1.05	9,996,184.95	5.15
7	MITSUMI SUMITOMO	日本	社債	変動金利	2072/ 3 /15	9,090,000	1.02	9,300,250.00	1.05	9,504,322.07	4.90
8	AMERICAN HONDA FIN	米国	社債	2.5	2015/ 9 /21	9,160,000	1.01	9,214,113.96	1.04	9,484,538.73	4.89
9	TOYOTA MOTOR CREDIT	米国	社債	4	2017/12/ 7	5,400,000	1.62	8,738,498.34	1.72	9,279,665.66	4.78
10	EAST JAPAN RAILWAY	日本	社債	4.75	2031/12/ 8	4,500,000	1.51	6,802,439.48	1.74	7,823,608.98	4.03
11	TOKYO METRO GOVT	日本	公債	1.875	2017/ 1 /27	7,000,000	1.00	6,991,110.00	1.02	7,149,450.15	3.68
12	RESONA BANK	日本	社債	変動金利	2049/ 4 /15	6,450,000	1.05	6,764,700.00	1.04	6,680,264.97	3.44
13	BK TOKYO-MIT UFJ	日本	社債	2.35	2017/ 2 /23	6,260,000	1.00	6,256,494.40	1.02	6,404,167.89	3.30
14	SUMITOMO MITSUI	日本	社債	3.95	2022/ 1 /12	5,350,000	1.00	5,332,933.50	1.06	5,669,983.65	2.92
15	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン諸島	社債	5.79	2014/ 4 /15	5,135,000	1.08	5,556,309.50	1.06	5,446,052.63	2.81
16	DAI-ICHI MUTUAL LIF	日本	社債	7.25	2049/ 7 /25	5,000,000	1.00	5,014,750.00	1.07	5,358,599.85	2.76
17	MIZUHO CORP BANK	日本	社債	2.55	2017/ 3 /17	4,790,000	1.01	4,827,190.00	1.02	4,877,561.34	2.51
18	DEVELOP BK OF JAPAN	日本	公債	5.125	2017/ 2 / 1	3,300,000	1.15	3,799,657.92	1.17	3,876,344.88	2.00
19	MITSUBISHI CORP	日本	社債	2.25	2016/ 9 /14	3,500,000	0.99	3,480,960.00	1.02	3,573,710.10	1.84
20	TOYOTA MTR CRED	米国	社債	3.3	2022/ 1 /12	3,270,000	1.01	3,292,988.10	1.05	3,440,039.90	1.77
21	SMFG PREF CAP	ケイマン諸島	変動利付債	変動金利	2049/ 1 /25	2,600,000	0.99	2,563,500.00	1.08	2,795,962.07	1.44
22	JAPAN FIN CORP	日本	公債	2.125	2019/ 2 / 7	2,300,000	1.00	2,293,606.00	1.03	2,362,537.04	1.22
23	NISSAN MOTOR ACCEPT	米国	社債	4.5	2015/ 1 /30	520,000	1.06	553,080.67	1.07	554,241.99	0.29

投資不動産物件

該当事項なし。（平成24年６月末日現在）

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（平成24年６月末日現在）

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

（平成24年9月末日現在）

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格（米ドル）		時価（米ドル）		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	MUFG CAP FIN 5	ケイマン諸島	社債	変動金利	2049/ 1 /29	10,080,000	1.61	16,187,139.38	1.74	17,569,755.49	9.63
2	SUMITOMO MITSUI BK	日本	社債	4.00	2020/11/ 9	12,780,000	1.35	17,294,724.70	1.35	17,315,170.20	9.49
3	JAPAN FIN ORG MUNI	日本	公債	4.00	2021/ 1 /13	13,900,000	0.99	13,784,630.00	1.17	16,204,620.25	8.88
4	ORIX CORP	日本	社債	5.00	2016/ 1 /12	9,500,000	1.02	9,733,000.00	1.08	10,246,605.10	5.61
5	NETS MITSUBISHI	日本	社債	変動金利	2072/ 3 /15	9,090,000	1.02	9,300,250.00	1.11	10,092,172.64	5.53
6	NISSAN MOTOR ACC	米国	社債	1.95	2017/ 9 /12	9,950,000	1.00	9,941,045.00	1.01	10,071,191.23	5.52
7	TAKEDA PHARMACEU	日本	社債	1.625	2017/ 3 /17	9,700,000	1.00	9,700,000.00	1.01	9,816,108.85	5.38
8	TOYOTA MOTOR CREDIT	米国	社債	4.00	2017/12/ 7	5,400,000	1.62	8,738,498.34	1.80	9,704,573.36	5.32
9	EAST JAPAN RAILWAY	日本	社債	4.75	2031/12/ 8	4,500,000	1.51	6,802,439.48	1.85	8,343,582.73	4.57
10	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン諸島	社債	4.20	2022/ 7 /18	8,000,000	1.00	7,973,520.00	1.03	8,225,999.75	4.51
11	RESONA BANK	日本	社債	変動金利	2049/ 4 /15	6,450,000	1.05	6,764,700.00	1.08	6,933,750.00	3.80
12	SUMITOMO MITSUI	日本	社債	3.95	2022/ 1 /12	5,350,000	1.00	5,332,933.50	1.08	5,776,930.18	3.17
13	DAI-ICHI MUTUAL LIF	日本	社債	7.25	2049/ 7 /25	5,000,000	1.00	5,014,750.00	1.12	5,595,650.10	3.07
14	NISSAN MOTOR ACC	米国	社債	4.50	2015/ 1 /30	5,050,000	1.05	5,312,471.21	1.08	5,432,790.09	2.98
15	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン諸島	社債	5.79	2014/ 4 /15	5,135,000	1.08	5,556,309.50	1.04	5,353,288.80	2.93
16	MIZUHO CORP BANK	日本	社債	2.55	2017/ 3 /17	4,790,000	1.01	4,827,190.00	1.05	5,011,872.98	2.75
17	BK TOKYO-MIT UFJ	日本	社債	2.35	2017/ 2 /23	4,460,000	1.00	4,457,502.40	1.04	4,632,378.90	2.54
18	MITSUBISHI CORP	日本	社債	1.875	2017/ 7 /13	4,400,000	0.99	4,377,472.00	1.01	4,430,667.93	2.43
19	MITSUBISHI CORP	日本	社債	2.75	2015/ 9 /16	3,680,000	1.01	3,708,555.73	1.04	3,827,236.78	2.10
20	MITSUBISHI CORP	日本	社債	2.25	2016/ 9 /14	3,500,000	0.99	3,480,960.00	1.03	3,601,149.98	1.97
21	TOYOTA MTR CRED	米国	社債	3.30	2022/ 1 /12	3,270,000	1.01	3,292,988.10	1.08	3,532,025.11	1.94
22	SMFG PREF CAP	ケイマン諸島	変動利付債	変動金利	2049/ 1 /25	2,600,000	0.99	2,563,500.00	1.10	2,859,840.72	1.57
23	JAPAN FIN CORP	日本	公債	2.125	2019/ 2 / 7	2,300,000	1.00	2,293,606.00	1.04	2,397,336.05	1.31
24	NIPPON TEL & TEL	日本	社債	1.40	2017/ 7 /18	2,250,000	1.00	2,246,962.50	1.01	2,280,127.43	1.25

投資不動産物件

該当事項なし。（平成24年9月末日現在）

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（平成24年9月末日現在）