

【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26年11月28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 磯村 尚賢

【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、
アールン通り 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

【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 大西 信治
同 白川 剛士

【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1,013億6,000万円）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1,013億6,000万円）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1,013億6,000万円）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1,013億6,000万円）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26年6月30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＝101.36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26年8月29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 第1 5 ファンド情報 ファンドの状況 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 1 ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第1 1 特別情報 管理会社の概況 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26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	47,317,423.44	57.35
	ケイマン諸島	15,970,144.62	19.36
	米国	5,677,559.12	6.88
	小計	68,965,127.18	83.59
公債	日本	13,775,584.96	16.70
	小計	13,775,584.96	16.70
小計		82,740,712.14	100.28
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 233,372.32	- 0.28
合計（純資産総額）		82,507,339.82 （約9,030百万円）	100.00

（注１）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26年９月30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＝109.45円）による。以下、米ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

（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26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25年10月末日	17,045,025.06	1,865,578	107.07	11,719
11月末日	16,311,406.29	1,785,283	106.44	11,650
12月末日	15,914,032.61	1,741,791	105.59	11,557
平成26年1月末日	15,429,792.03	1,688,791	107.59	11,776
2月末日	14,877,285.37	1,628,319	108.19	11,841
3月末日	14,894,462.47	1,630,199	108.13	11,835
4月末日	14,617,845.90	1,599,923	108.96	11,926
5月末日	14,275,310.25	1,562,433	110.11	12,052
6月末日	15,207,866.49	1,664,501	109.93	12,032
7月末日	15,657,484.85	1,713,712	109.74	12,011
8月末日	14,397,214.67	1,575,775	110.63	12,108
9月末日	13,922,808.72	1,523,851	109.26	11,959

< 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25年10月末日	95,772,845.61	10,482,338	71.62	7,839
11月末日	85,840,549.41	9,395,248	66.13	7,238
12月末日	81,168,839.64	8,883,929	64.41	7,050
平成26年1月末日	77,547,204.45	8,487,542	63.27	6,925
2月末日	79,273,419.67	8,676,476	65.36	7,154
3月末日	80,501,300.11	8,810,867	67.08	7,342
4月末日	79,035,220.07	8,650,405	67.54	7,392
5月末日	76,696,124.33	8,394,391	67.67	7,406
6月末日	75,794,588.62	8,295,718	68.23	7,468
7月末日	72,841,480.29	7,972,500	65.85	7,207
8月末日	73,097,283.16	8,000,498	66.28	7,254
9月末日	65,082,072.47	7,123,233	59.64	6,528

< 中国元ヘッジクラス >

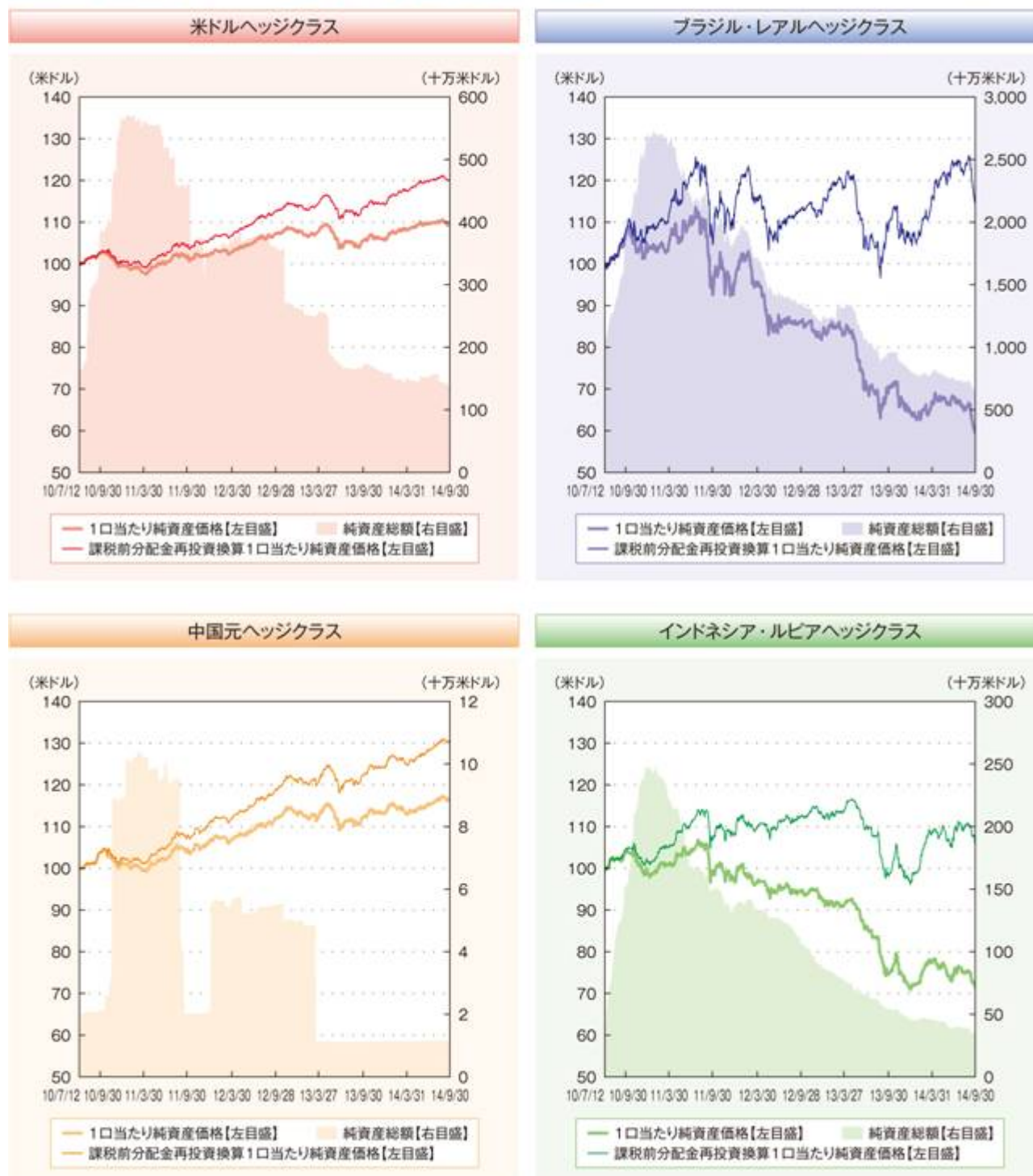
	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成25年10月末日	114,173.98	12,496	114.17	12,496
11月末日	113,641.72	12,438	113.64	12,438
12月末日	112,984.12	12,366	112.98	12,366
平成26年 1 月末日	115,343.27	12,624	115.34	12,624
2 月末日	114,408.04	12,522	114.41	12,522
3 月末日	112,885.04	12,355	112.89	12,356
4 月末日	113,416.34	12,413	113.42	12,414
5 月末日	114,833.94	12,569	114.83	12,568
6 月末日	115,503.03	12,642	115.50	12,641
7 月末日	116,054.72	12,702	116.05	12,702
8 月末日	117,352.43	12,844	117.35	12,844
9 月末日	116,393.49	12,739	116.39	12,739

< 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25年10月末日	5,428,290.37	594,126	78.80	8,625
11月末日	4,887,660.62	534,954	73.02	7,992
12月末日	4,488,283.19	491,243	70.86	7,756
平成26年 1 月末日	4,543,014.13	497,233	72.35	7,919
2 月末日	4,744,483.50	519,284	76.23	8,343
3 月末日	4,572,931.43	500,507	77.67	8,501
4 月末日	4,414,509.31	483,168	76.36	8,358
5 月末日	4,277,500.88	468,172	76.37	8,359
6 月末日	3,920,203.23	429,066	74.57	8,162
7 月末日	3,984,892.40	436,146	76.10	8,329
8 月末日	3,912,947.03	428,272	75.51	8,265
9 月末日	3,386,065.14	370,605	71.43	7,818

< 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～2014年9月末日）



（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26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25年10月1日～平成26年9月末日	2.40	263

<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25年10月1日～平成26年9月末日	13.80	1,510

<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25年10月1日～平成26年9月末日	3.00	328

<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25年10月1日～平成26年9月末日	9.00	985

< 参考情報 >

分配の推移（2014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		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)	1.20	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)	2.40	第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	13.00
第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	2.40	第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	13.80
第4会計年度 (2013年3月1日～2014年2月28日)	2.40	第4会計年度 (2013年3月1日～2014年2月28日)	13.80
2014年5月	0.20	2014年5月	1.15
2014年6月	0.20	2014年6月	1.15
2014年7月	0.20	2014年7月	1.15
2014年8月	0.20	2014年8月	1.15
2014年9月	0.20	2014年9月	1.15
直近1年間累計	2.40	直近1年間累計	13.80
設定来累計	9.80	設定来累計	54.35

中国元ヘッジクラス		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)	1.50	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)	3.00	第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	8.40
第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	3.00	第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	9.00
第4会計年度 (2013年3月1日～2014年2月28日)	3.00	第4会計年度 (2013年3月1日～2014年2月28日)	9.00
2014年5月	0.25	2014年5月	0.75
2014年6月	0.25	2014年6月	0.75
2014年7月	0.25	2014年7月	0.75
2014年8月	0.25	2014年8月	0.75
2014年9月	0.25	2014年9月	0.75
直近1年間累計	3.00	直近1年間累計	9.00
設定来累計	12.25	設定来累計	35.25

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25年10月1日～平成26年9月末日	5.77%

（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・リアルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成25年10月1日～平成26年9月末日	5.05%

（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25年10月1日～平成26年9月末日	6.40%

（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25年10月1日～平成26年9月末日	7.86%

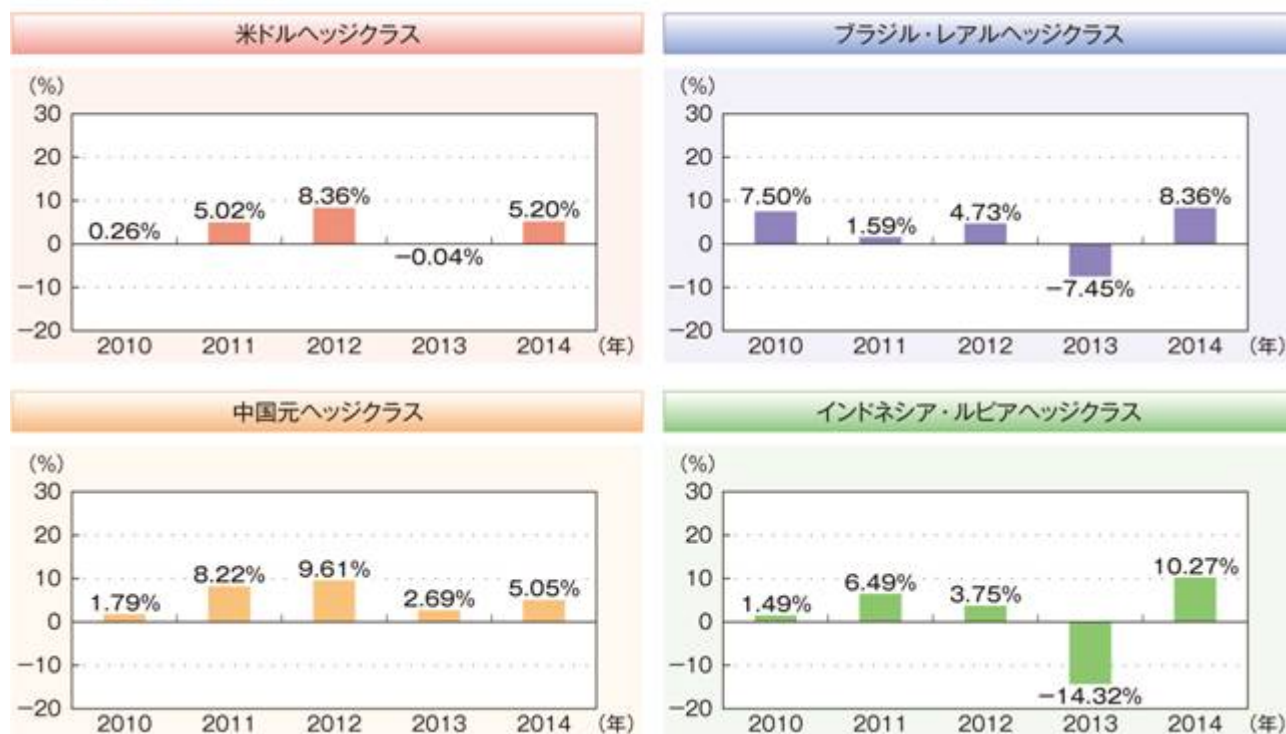
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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、2014年については2014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。2014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26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26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
33,746 (33,746)	69,342 (69,342)	127,424 (127,424)

<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
127,213 (127,213)	397,123 (397,123)	1,091,339 (1,091,339)

<中国元ヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	0 (0)	1,000 (1,000)

<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
0 (0)	24,436 (24,436)	47,402 (47,402)

（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・ファンドの日本文の中間財務書類は、ルクセンブルグ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。日本文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26年9月30日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝109.45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。
- d．サブ・ファンドの評価日は、取引日の翌営業日であり、取引日とは、(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をいう。営業日とは、ロンドン、ルクセンブルグ、ニューヨークおよび東京において銀行が営業している日かつニューヨーク証券取引所が取引を行っている日である。平成26年8月におけるサブ・ファンドの最終評価日は、平成26年8月28日であった。そのため、第5期の中間財務書類は平成26年8月28日付で作成されている。

[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

2014年 8 月28日現在

米ドル

千円

		米ドル	千円
資産			
現金		2,191,067.73	239,812
銀行預金 - 基準通貨		743,975.76	81,428
銀行預金 - 外国通貨		1,447,091.97	158,384
有価証券（取得原価）		79,616,999.54	8,714,081
債券（取得原価）		79,616,999.54	8,714,081
未実現評価損益		8,961,840.68	980,873
未実現時価評価損益		6,302,934.24	689,856
未実現通貨運用損益		2,662,755.37	291,439
未実現通貨繰延損益		(3,848.93)	(421)
未収収益		1,101,102.20	120,516
債券に係る未収利息		1,101,102.20	120,516
資本証券		459,233.59	50,263
受益証券販売未収金		459,233.59	50,263
資産合計：		92,330,243.74	10,105,545
負債			
資本証券		547,886.26	59,966
受益証券買戻未払金		547,886.26	59,966
未払費用		257,560.19	28,190
未払監査費用		45,809.58	5,014
未払保管報酬		22,424.31	2,454
未払報告書作成費用		2,774.88	304
未払投資顧問報酬		103,566.40	11,335
未払受託報酬		1,611.35	176
未払代行協会員報酬		7,397.60	810
未払販売報酬		73,976.07	8,097
負債合計：		805,446.45	88,156

2014年 8 月28日現在

	米ドル	千円
資本		
ファンド受益証券	147,338,639.27	16,126,214
発行済ファンド受益証券（額面価額）	128,585,100.00	14,073,639
ブラジル・リアル	110,289,600.00	12,071,197
インドネシア・ルピア	5,182,200.00	567,192
中国元	100,000.00	10,945
米ドル	13,013,300.00	1,424,306
受益証券額面超過額	18,753,539.27	2,052,575
ブラジル・リアル	19,164,768.25	2,097,584
インドネシア・ルピア	1,159,078.45	126,861
中国元	(48,569.05)	(5,316)
米ドル	(1,521,738.38)	(166,554)
分配金支払額	(96,373,119.60)	(10,548,038)
分配金支払額	(96,373,119.60)	(10,548,038)
ブラジル・リアル	(89,236,444.90)	(9,766,929)
インドネシア・ルピア	(4,098,744.45)	(448,608)
中国元	(47,245.25)	(5,171)
米ドル	(2,990,685.00)	(327,330)
利益剰余金	30,718,034.37	3,362,089
利益剰余金	30,718,034.37	3,362,089
ブラジル・リアル	34,046,075.82	3,726,343
インドネシア・ルピア	2,246,894.78	245,923
中国元	147,580.03	16,153
米ドル	7,367,518.57	806,375
当期純利益	9,841,243.25	1,077,124
資本合計：	91,524,797.29	10,017,389
負債および資本合計	92,330,243.74	10,105,545
純資産額合計	91,524,797.29	10,017,389
発行済受益証券総数	1,285,851.00000口	
受益証券 1 口当たり純資産額合計	71.18	7,791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

2014年3月1日から
2014年8月28日までの期間

米ドル

千円

収益

実現損益

7,753,836.01

848,657

為替取引に係る実現利益

13,258,636.16

1,451,158

ブラジル・リアル

8,777,536.17

960,701

インドネシア・ルピア

404,956.85

44,323

中国元

2,746.89

301

為替取引に係る実現損失

(6,383,202.22)

(698,641)

ブラジル・リアル

(1,117,312.81)

(122,290)

インドネシア・ルピア

(174,438.58)

(19,092)

中国元

(2,804.68)

(307)

市場に係る実現利益

743,714.77

81,400

市場に係る実現損失

(42,211.00)

(4,620)

通貨に係る実現利益

213,019.35

23,315

通貨に係る実現損失

(36,121.05)

(3,953)

ブラジル・リアル

(0.01)

(0)

受取利息

1,995,317.24

218,387

債券に係る受取利息

1,995,317.24

218,387

2014年3月1日から
2014年8月28日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	766,946.39	83,942
未実現時価評価損益	1,194,801.68	130,771
未実現通貨運用損益	(411,776.60)	(45,069)
ブラジル・リアル	(1,066,841.50)	(116,766)
インドネシア・ルピア	(161,135.62)	(17,636)
中国元	673.33	74
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(10,025.46)	(1,097)
未実現通貨繰延損益	(6,053.23)	(663)
収益合計：	10,516,099.64	1,150,987
費用		
費用 - 報酬	674,856.39	73,863
監査費用	16,563.72	1,813
保管報酬	71,442.11	7,819
報告書作成費用	(14,944.64)	(1,636)
投資顧問報酬	332,315.95	36,372
受託報酬	4,974.00	544
現金支出費用	654.74	72
代行協会員報酬	23,736.80	2,598
販売報酬	237,368.73	25,980
副保管報酬	2,744.98	300
費用合計：	674,856.39	73,863
投資純利益	9,841,243.25	1,077,124

[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 2014年 8 月28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） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （米ドル）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （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											
743,975.76000	米ドル現金	8/28/2014	MUGC	743,975.76	743,975.76	1.000000000	743,975.76	743,975.76	0.00	0.00	0.00
	現金米ドル					1.000000000					
743,975.76000	基準通貨現金		小計	743,975.76	743,975.76		743,975.76	743,975.76	0.00	0.00	0.00
743,975.76000	現金合計			743,975.76	743,975.76		743,975.76	743,975.76	0.00	0.00	0.00
社債											
変動利率											
7,300,000.00000	MITSUI SUMITOMO	3/9/2012		7,468,847.63	7,468,847.63	118.214996300 ^C	8,629,694.73	8,629,694.73	1,160,847.10	0.00	1,160,847.10
	FRN 03152072					1.000000000					
	BJPN3013 USJ45174AF61										
4,800,000.00	MUFG CAP FIN 5	7/13/2012		5,004,000.00	7,708,161.62	108.009002600 ^C	5,184,432.12	8,596,306.92	299,174.51	588,970.79	888,145.30
	FRN 01292049					1.658100002					
	BCYM055G XS0282533115										
8,050,000.00000	NIPPON LIFE INS	10/24/2012		8,342,283.26	8,342,283.26	107.085998500 ^C	8,620,422.88	8,620,422.88	278,139.62	0.00	278,139.62
	FRN 10182042					1.000000000					
	BJPN301S USJ54675AA13										
500,000.00000	SMFG PREF CAP	8/16/2010		492,980.77	492,980.77	108.570999100 ^C	542,855.00	542,855.00	49,874.23	0.00	49,874.23
	FRN 01252049					1.000000000					
	BCYM0484 USG8227UAA46										
5,800,000.00000	SOMPO JAPAN INS	3/22/2013		5,783,800.00	5,783,800.00	107.680999700 ^C	6,245,497.98	6,245,497.98	461,697.98	0.00	461,697.98
	FRN 03282073					1.000000000					
	BJPN302D USJ7620TAB73										
26,450,000.00000	変動利率 小計			27,091,911.66	29,796,073.28		29,222,902.71	32,634,777.51	2,249,733.44	588,970.79	2,838,704.23

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注 1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

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 2014年 8 月28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) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
ミディアム・ターム・ノート											
4,500,000.00	EAST JAPAN RAILWAY 4.75% 12082031 BJPN2981 XS0276809927	7/13/2010		4,476,848.54	6,919,922.30	116.640998800 ^C 1.658100002	5,248,844.95	8,703,109.81	1,280,047.24	503,140.27	1,783,187.51
4,500,000.00000	ミディアム・ターム・ノート	小計		4,476,848.54	6,919,922.30		5,248,844.95	8,703,109.81	1,280,047.24	503,140.27	1,783,187.51
公募債											
1,200,000.00000	BK TOKYO-MIT UFJ 3.2 % 02262023 BJPN3026 USJ0423YBF00	2/19/2013		1,197,552.00	1,197,552.00	101.487998900 ^C 1.000000000	1,217,855.99	1,217,855.99	20,303.99	0.00	20,303.99
1,800,000.00000	CNTRL NIPPON EXP 2.17 % 08052019 BJPN303F XS1090178259	7/24/2014		1,800,000.00	1,800,000.00	100.485000600 ^C 1.000000000	1,808,730.01	1,808,730.01	8,730.01	0.00	8,730.01
5,000,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL LIF 7.25 % 07252049 BJPN2998 USJ09748AB01	5/10/2011		5,014,750.00	5,014,750.00	119.708000100 ^C 1.000000000	5,985,400.01	5,985,400.01	970,650.01	0.00	970,650.01
6,403,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.2 % 07182022 BCYM055H XS0803109270	7/12/2012		6,412,726.98	6,412,726.98	105.241996700 ^C 1.000000000	6,738,645.05	6,738,645.05	325,918.07	0.00	325,918.07
2,400,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	3/20/2014		2,394,096.00	2,394,096.00	105.957000700 ^C 1.000000000	2,542,968.02	2,542,968.02	148,872.02	0.00	148,872.02
2,300,000.00000	NIPPON TEL & TEL 2.15 % 02262020 BJPN3025 XS0891657172	2/19/2013		2,298,068.00	2,298,068.00	99.531997600 ^C 1.000000000	2,289,235.94	2,289,235.94	-8,832.06	0.00	-8,832.06

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

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 2014年8月28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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
公募債											
4,910,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.95 % 01122022 BJPN3007 USJ7771KPK71	1/5/2012		4,894,337.10	4,894,337.10	107.379997200 ^C 1.000000000	5,272,357.86	5,272,357.86	378,020.76	0.00	378,020.76
5,510,000.00000	TOYOTA MTR CRED 3.3 % 01122022 BUSA8365 US89233P5T93	1/13/2012		5,696,992.70	5,696,992.70	104.463996800 ^C 1.000000000	5,755,966.22	5,755,966.22	58,973.52	0.00	58,973.52
29,523,000.00000	公募債 小計			29,708,522.78	29,708,522.78		31,611,159.10	31,611,159.10	1,902,636.32	0.00	1,902,636.32
60,473,000.00000	社債合計			61,277,282.98	66,424,518.36		66,082,906.76	72,949,046.42	5,432,417.00	1,092,111.06	6,524,528.06
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
114,785.00	BRITISH POUND GBP	8/21/2014		114,785.00	191,966.43	1.000000000 ^S 1.658100002	114,785.00	190,325.01	0.00	-1,641.42	-1,641.42
3,331.51		8/21/2014		3,331.51	5,571.62	1.000000000 ^S 1.658100002	3,331.51	5,523.98	0.00	-47.64	-47.64
660,312.77		8/13/2014		660,312.77	1,109,622.59	1.000000000 ^S 1.658100002	660,312.77	1,094,864.61	0.00	-14,757.98	-14,757.98
778,429.28000 0.00000	合計			778,429.28	1,307,160.64		778,429.28	1,290,713.60	0.00	-16,447.04	-16,447.04
45,122.69000	EURO EUR	8/13/2014		45,122.69	60,272.64	1.000000000 ^S 1.317550001	45,122.69	59,451.40	0.00	-821.24	-821.24
8,139,923.00000	JAPANESE YEN JPY	8/13/2014		8,139,923	79,658.69	1.000000000 ^S 103.755000000	8,139,923	78,453.31	0.00	-1,205.38	-1,205.38
8,963,474.97000	非グループ化の有価証券 小計			8,963,474.97	1,447,091.97		8,963,474.97	1,428,618.31	0.00	-18,473.66	-18,473.66
8,963,474.97000	外貨建現金勘定合計			8,963,474.97	1,447,091.97		8,963,474.97	1,428,618.31	0.00	-18,473.66	-18,473.66

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

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 2014年8月28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） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （米ドル）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （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											
107,033,025.52000	BRL FORWARD 15 OCT FBR15OCT	8/5/2014	BRH	107,033,025.52	46,182,700.00	1.000000000 ^F 2.282130000	107,033,025.52	46,900,494.50	0.00	717,794.50	717,794.50
60,011,595.00000		8/5/2014	BRH	60,011,595.00	25,900,000.00	1.000000000 ^F 2.282130000	60,011,595.00	26,296,308.71	0.00	396,308.71	396,308.71
3,118,225.00000		7/24/2014	BRH	3,118,225.00	1,375,000.00	1.000000000 ^F 2.282130000	3,118,225.00	1,366,366.07	0.00	-8,633.93	-8,633.93
170,162,845.52000 0.00000	合計			170,162,845.52	73,457,700.00		170,162,845.52	74,563,169.28	0.00	1,105,469.28	1,105,469.28
6,174.50	CNY FORWARD 15 OCT FCN15OCT	8/13/2014	CNH	6,174.50	1,000.00	1.000000000 ^F 6.176320000	6,174.50	999.71	0.00	-0.29	-0.29
711,977.50		8/5/2014	CNH	711,977.50	115,300.00	1.000000000 ^F 6.176320000	711,977.50	115,275.36	0.00	-24.64	-24.64
718,152.00000 0.00000	合計			718,152.00	116,300.00		718,152.00	116,275.07	0.00	-24.93	-24.93
8,030,024.00000	EUR FORWARD 15 OCT FEU15OCT	7/30/2014		8,030,024.00	10,764,809.27	1.000000000 ^F 1.317937973	8,030,024.00	10,583,073.55	0.00	-181,735.72	-181,735.72
1,100,690.47000		7/30/2014		1,100,690.47	1,476,135.99	1.000000000 ^F 1.317937973	1,100,690.47	1,450,641.77	0.00	-25,494.22	-25,494.22
3,183,781.36000		7/30/2014		3,183,781.36	4,268,081.78	1.000000000 ^F 1.317937973	3,183,781.36	4,196,026.35	0.00	-72,055.43	-72,055.43
1,826,301.88000		7/30/2014		1,826,301.88	2,448,248.99	1.000000000 ^F 1.317937973	1,826,301.88	2,406,952.60	0.00	-41,296.39	-41,296.39
8,742,289.48000		7/30/2014		8,742,289.48	11,724,284.42	1.000000000 ^F 1.317937973	8,742,289.48	11,521,795.27	0.00	-202,489.15	-202,489.15

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

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 2014年8月28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) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (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											
6,245,392.32000		7/30/2014		6,245,392.32	8,355,398.12	1.000000000 ^F 1.317937973	6,245,392.32	8,231,039.69	0.00	-124,358.43	-124,358.43
-29,106,644.11000		7/30/2014		-29,106,644.11	-39,018,475.16	1.000000000 ^F 1.317937973	-29,106,644.11	-38,360,751.53	0.00	657,723.63	657,723.63
21,835.40000 0.00000	合計			21,835.40	18,483.41		21,835.40	28,777.70	0.00	10,294.29	10,294.29
-50,544.43	GBP FORWARD 15 OCT FGB15OCT	7/30/2014		-50,544.43	-85,551.50	1.000000000 ^F 1.657447939	-50,544.43	-83,774.76	0.00	1,776.74	1,776.74
-6,086,816.96		7/30/2014		-6,086,816.96	-10,302,546.39	1.000000000 ^F 1.657447939	-6,086,816.96	-10,088,582.22	0.00	213,964.17	213,964.17
-871,711.63		7/30/2014		-871,711.63	-1,476,135.98	1.000000000 ^F 1.657447939	-871,711.63	-1,444,816.64	0.00	31,319.34	31,319.34
-4,041,122.01		7/30/2014		-4,041,122.01	-6,840,063.73	1.000000000 ^F 1.657447939	-4,041,122.01	-6,697,949.34	0.00	142,114.39	142,114.39
-6,923,674.71		7/30/2014		-6,923,674.71	-11,724,284.42	1.000000000 ^F 1.657447939	-6,923,674.71	-11,475,630.37	0.00	248,654.05	248,654.05
-4,946,225.81		7/30/2014		-4,946,225.81	-8,355,398.11	1.000000000 ^F 1.657447939	-4,946,225.81	-8,198,111.77	0.00	157,286.34	157,286.34
5,823,217.33		7/30/2014		5,823,217.33	9,856,494.12	1.000000000 ^F 1.657447939	5,823,217.33	9,651,679.56	0.00	-204,814.56	-204,814.56
2,329,448.64		7/30/2014		2,329,448.64	3,942,708.30	1.000000000 ^F 1.657447939	2,329,448.64	3,860,939.85	0.00	-81,768.45	-81,768.45
-14,767,429.58000 0.00000	合計			-14,767,429.58	-24,984,777.71		-14,767,429.58	-24,476,245.69	0.00	508,532.02	508,532.02

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

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・bond・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2014年 8 月28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) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (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											
18,418,920,000.00	IDR FORWARD 15 OCT	8/5/2014		18,418,920,000.00	1,560,000.00	1.000000000 ^F	18,418,920,000.00	1,560,700.58	0.00	700.58	700.58
	FID15OCT		IDH			11,801.700000000					
28,433,523,000.00		8/5/2014		28,433,523,000.00	2,408,600.00	1.000000000 ^F	28,433,523,000.00	2,409,273.49	0.00	673.49	673.49
			IDH			11,801.700000000					
-589,800,000.00		8/7/2014		-589,800,000.00	-49,335.01	1.000000000 ^F	-589,800,000.00	-49,975.85	0.00	-640.84	-640.84
			IDH			11,801.700000000					
46,262,643,000.00000	合計			46,262,643,000.00	3,919,264.99		46,262,643,000.00	3,919,998.22	0.00	733.23	733.23
0.00000											
46,418,778,403.34000	非グループ化の有価証券	小計		46,418,778,403.34	52,526,970.69		46,418,778,403.34	54,151,974.58	0.00	1,625,003.89	1,625,003.89
46,418,778,403.34000	先物 (ポジション) 合計			46,418,778,403.34	52,526,970.69		46,418,778,403.34	54,151,974.58	0.00	1,625,003.89	1,625,003.89
国債											
公募債											
4,000,000.00	JAPAN BANK COOP	2/27/2014		3,987,320.00	6,647,261.18	101.853996200 ^C	4,074,159.85	6,755,364.45	143,989.15	-35,885.88	108,103.27
	2.625 % 12152020					1.658100002					
	BJPN3033 XS1041602399										
6,600,000.00000	JAPAN FIN ORG MUNI	1/6/2011		6,545,220.00	6,545,220.00	110.178001400 ^C	7,271,748.09	7,271,748.09	726,528.09	0.00	726,528.09
	4% 01132021										
	BJPN2995 XS0568671555					1.000000000					
10,600,000.00000	公募債 小計			10,532,540.00	13,192,481.18		11,345,907.94	14,027,112.54	870,517.24	-35,885.88	834,631.36
10,600,000.00000	国債合計			10,532,540.00	13,192,481.18		11,345,907.94	14,027,112.54	870,517.24	-35,885.88	834,631.36
46,499,558,854.07000	ポートフォリオ合計			46,500,295,677.05	134,335,037.96		46,505,914,668.77	143,300,727.61	6,302,934.24	2,662,755.41	8,965,689.65

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（平成26年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約41億円）

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へ要求した場合。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26年８月末日現在、以下の投資信託の管理を行っている。

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	73	9,786,155,657.33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。日本文の中間財務書類には、円貨換算が併記されている。日本円への換算には平成26年9月30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＝109.45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

2014年 6 月30日現在

(単位：米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	166,643,749.00	18,239,158
1.2	売買目的で保有される金融資産	12,741,166.00	1,394,521
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	12,741,166.00	1,394,521
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	10,579,181.00	1,157,891
1.4.1	持分証券	10,579,181.00	1,157,891
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）	2,051,387,292.00	224,524,339
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	2,051,387,292.00	224,524,339
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	2,123,168.00	232,381
1.9.1	有形固定資産	2,123,168.00	232,381
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	5,758,216.00	630,237
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	5,758,216.00	630,237
1.12	税金資産	153,854.00	16,839
1.12.1	現行税金資産	153,854.00	16,839
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	29,475,495.00	3,226,093
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	2,278,862,121.00	249,421,459

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2014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	12,492,671.00	1,367,323
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	12,492,671.00	1,367,323
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	債務証書（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	債務証書（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	2,116,343,159.00	231,633,759
2.4.1	金融機関からの預金	770,002,106.00	84,276,731
2.4.2	金融機関以外からの預金	1,346,341,053.00	147,357,028
2.4.3	債務証書（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		
2.9	税金負債	6,652,544.00	728,121
2.9.1	現行税金負債	2,871,321.00	314,266
2.9.2	繰延税金負債	3,781,223.00	413,855
2.10	その他の負債	15,318,840.00	1,676,647
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	2,150,807,214.00	235,405,850

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2014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	4,062,562
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	4,062,562
3.1.2	未払込請求資本		
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：	2,906,721.00	318,141
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	2,906,721.00	318,141
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	0.00	0
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	77,823,159.00	8,517,745
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	10,207,058.00	1,117,162
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	128,054,907.00	14,015,610
3.11	負債および資本合計	2,278,862,121.00	249,421,459

（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

2014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（＋／－）	34,909,076.00	3,820,798
5.2	利息収益	4,009,074.00	438,793
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	28,541.00	3,124
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）	1,493,866.00	163,504
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。）	2,486,667.00	272,166
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）（－）	684,576.00	74,927
5.3.1	中央銀行からの預金	430.00	47
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）	40,022.00	4,380
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	644,124.00	70,499
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（＋）	0.00	0
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	0.00	0
5.6	受取手数料（＋）	52,937,310.00	5,793,989
5.7	（支払手数料）（－）	23,120,092.00	2,530,494
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（＋／－）	69.00	8
5.8.1	売却可能金融資産	69.00	8
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（＋／－）	2,250,805.00	246,351
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	2,250,805.00	246,351
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（＋／－）		
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（＋）	458,262.00	50,157

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	941,776.00	103,077
5.16	一般管理費（－）	19,461,134.00	2,130,021
5.16.1	従業員費用（－）	8,939,148.00	978,390
5.16.2	一般管理費用（－）	10,521,986.00	1,151,631
5.17	減価償却（＋／－）	917,408.00	100,410
5.17.1	有形固定資産	200,660.00	21,962
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	716,748.00	78,448
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（＋／－）	14,530,534.00	1,590,367
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,323,476.00	473,204
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	10,207,058.00	1,117,162
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（＋／－）	10,207,058.00	1,117,162

[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26年6月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約38億円)

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26年9月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約41億円)

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26年9月30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 = 109.45円) による。

(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26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	NIPPON LIFE INS	日本	社債	5.000 (2022年10月 以降変動金利)	2042/10/18	8,550,000	1.04	8,860,437.50	1.08	9,239,129.79	9.72
2	EAST JAPAN RAILWAY	日本	社債	4.750	2031/12/ 8	4,850,000	1.54	7,458,138.48	1.90	9,226,704.64	9.71
3	JAPAN FIN ORG MUNI	日本	公債	4.000	2021/ 1 /13	8,400,000	0.99	8,330,280.00	1.10	9,221,687.80	9.70
4	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.000 (2022年 3 月 以降変動金利)	2072/ 3 /15	7,670,000	1.02	7,847,405.66	1.19	9,147,012.18	9.62
5	MUFG CAP FIN 5	ケイマン 諸島	社債	6.299 (2017年 1 月 以降変動金利)	永久債	4,900,000	1.61	7,868,748.32	1.85	9,072,488.31	9.55
6	JAPAN BANK COOP	日本	公債	2.625	2020/12/15	4,000,000	1.66	6,647,261.18	1.71	6,839,263.29	7.20
7	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン 諸島	社債	4.200	2022/ 7 /18	6,403,000	1.00	6,412,726.98	1.04	6,662,321.69	7.01
8	SOMPO JAPAN INS	日本	社債	5.325 (2023年 3 月 以降変動金利)	2073/ 3 /28	5,800,000	1.00	5,783,800.00	1.08	6,273,221.80	6.60
9	DAI-ICHI MUTUAL LIF	日本	社債	7.250	永久債	5,000,000	1.00	5,014,750.00	1.21	6,045,650.10	6.36
10	TOYOTA MTR CRED	米国	社債	3.300	2022/ 1 /12	5,510,000	1.03	5,696,992.70	1.03	5,680,534.57	5.98
11	SUMITOMO MITSUI	日本	社債	3.950	2022/ 1 /12	4,910,000	1.00	4,894,337.10	1.06	5,212,161.37	5.48
12	SMFG PREF CAP	ケイマン 諸島	社債	6.078 (2017年 1 月 以降変動金利)	永久債	2,600,000	0.99	2,563,500.00	1.09	2,836,989.94	2.99
13	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン 諸島	社債	4.600	2024/ 3 /27	2,400,000	1.00	2,394,096.00	1.05	2,520,383.97	2.65
14	NIPPON TEL & TEL	日本	社債	2.150	2020/ 2 /26	2,300,000	1.00	2,298,068.00	1.00	2,292,180.08	2.41
15	BK TOKYO-MIT UFJ	日本	社債	3.200	2023/ 2 /26	1,200,000	1.00	1,197,552.00	1.00	1,205,292.02	1.27

投資不動産物件

該当事項なし。(平成26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26年 6 月末日現在)

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

（平成26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	NIPPON LIFE INS	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	8,050,000	1.04	8,342,283.26	1.05	8,450,004.64	10.24
2	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.000 (2022年3月以降変動金利)	2072/3/15	7,100,000	1.02	7,264,221.67	1.16	8,266,600.98	10.02
3	EAST JAPAN RAILWAY	日本	社債	4.750	2031/12/8	4,350,000	1.54	6,689,258.22	1.88	8,166,430.55	9.90
4	JAPAN FIN ORG MUNI	日本	公債	4.000	2021/1/13	6,600,000	0.99	6,545,220.00	1.09	7,203,702.20	8.73
5	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン諸島	社債	4.200	2022/7/18	6,403,000	1.00	6,412,726.98	1.04	6,662,897.65	8.08
6	JAPAN BANK COOP	日本	公債	2.625	2020/12/15	4,000,000	1.66	6,647,261.18	1.64	6,571,882.76	7.97
7	MUFG CAP FIN 5	ケイマン諸島	社債	6.299 (2017年1月以降変動金利)	永久債	3,600,000	1.61	5,781,121.21	1.75	6,289,899.97	7.62
8	SOMPO JAPAN INS	日本	社債	5.325 (2023年3月以降変動金利)	2073/3/28	5,800,000	1.00	5,783,800.00	1.05	6,100,324.08	7.39
9	DAI-ICHI MUTUAL LIF	日本	社債	7.250	永久債	5,000,000	1.00	5,014,750.00	1.17	5,868,999.86	7.11
10	TOYOTA MTR CRED	米国	社債	3.300	2022/1/12	5,510,000	1.03	5,696,992.70	1.03	5,677,559.12	6.88
11	SUMITOMO MITSUI	日本	社債	3.950	2022/1/12	4,910,000	1.00	4,894,337.10	1.06	5,196,351.23	6.30
12	MIZUHO FIN GROUP	ケイマン諸島	社債	4.600	2024/3/27	2,400,000	1.00	2,394,096.00	1.03	2,478,672.00	3.00
13	NIPPON TEL & TEL	日本	社債	2.150	2020/2/26	2,300,000	1.00	2,298,068.00	0.99	2,271,802.05	2.75
14	CNTRL NIPPON EXP	日本	社債	2.170	2019/8/5	1,800,000	1.00	1,800,000.00	1.00	1,796,958.02	2.18
15	BK TOKYO-MIT UFJ	日本	社債	3.200	2023/2/26	1,200,000	1.00	1,197,552.00	1.00	1,199,952.03	1.45
16	SMFG PREF CAP	ケイマン諸島	社債	6.078 (2017年1月以降変動金利)	永久債	500,000	0.99	492,980.77	1.08	538,675.00	0.65

投資不動産物件

該当事項なし。（平成26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26年9月末日現在）

第2 管理及び運営

5 受益者の権利等

（3）本邦における代理人

<訂正前>

（前略）

なお、関東財務局長に対するファンド証券の募集、継続開示等に関する届出代理人および金融庁長官に対する届出代理人は、

弁護士 三浦 健

同 下瀬 伸彦

同 大西 信治

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

である。

<訂正後>

（前略）

なお、関東財務局長に対するファンド証券の募集、継続開示等に関する届出代理人および金融庁長官に対する届出代理人は、

弁護士 三浦 健

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

である。