

【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28年11月30日

【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)

【代表者の役職氏名】 マネージング・ディレクター 寺脇 恒

【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

【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

【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1,029億1,000万円)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1,029億1,000万円)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1,029億1,000万円)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1,029億1,000万円)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28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=102.91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28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。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するため、また、その他一部情報の時点を更新するため、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		追加
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28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	35,837,890.66	59.31
	ケイマン諸島	5,847,153.89	9.68
	米国	3,599,574.90	5.96
	小計	45,284,619.45	74.94
公債	日本	12,931,482.49	21.40
	小計	12,931,482.49	21.40
小計		58,216,101.94	96.34
現金・その他の資産 (負債控除後)		2,212,770.57	3.66
合計(純資産総額)		60,428,872.51 (約6,111百万円)	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28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＝101.12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28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27年10月末日	11,890,829.81	1,202,401	110.72	11,196
11月末日	11,595,646.74	1,172,552	110.55	11,179
12月末日	11,464,821.23	1,159,323	110.30	11,154
平成28年１月末日	11,084,474.88	1,120,862	111.26	11,251
２月末日	10,609,345.73	1,072,817	110.74	11,198
３月末日	10,258,364.62	1,037,326	112.46	11,372
４月末日	9,959,075.91	1,007,062	112.75	11,401
５月末日	10,187,590.19	1,030,169	113.67	11,494
６月末日	10,326,999.18	1,044,266	114.51	11,579
７月末日	9,203,062.47	930,614	115.53	11,682
８月末日	9,652,145.42	976,025	115.98	11,728
９月末日	11,738,308.49	1,186,978	115.53	11,682

<ブラジル・レアルヘッジクラス>

	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27年10月末日	31,436,466.08	3,178,855	33.51	3,389
11月末日	29,817,560.29	3,015,152	32.57	3,293
12月末日	29,190,089.55	2,951,702	32.65	3,302
平成28年１月末日	27,394,880.07	2,770,170	31.36	3,171
２月末日	35,435,322.28	3,583,220	31.31	3,166
３月末日	41,007,967.41	4,146,726	35.34	3,574
４月末日	40,583,142.37	4,103,767	35.06	3,545
５月末日	40,699,183.46	4,115,501	34.55	3,494
６月末日	46,381,966.74	4,690,144	38.76	3,919
７月末日	46,308,628.07	4,682,728	38.50	3,893
８月末日	46,961,286.54	4,748,725	38.43	3,886
９月末日	47,690,678.06	4,822,481	37.86	3,828

< 中国元ヘッジクラス >

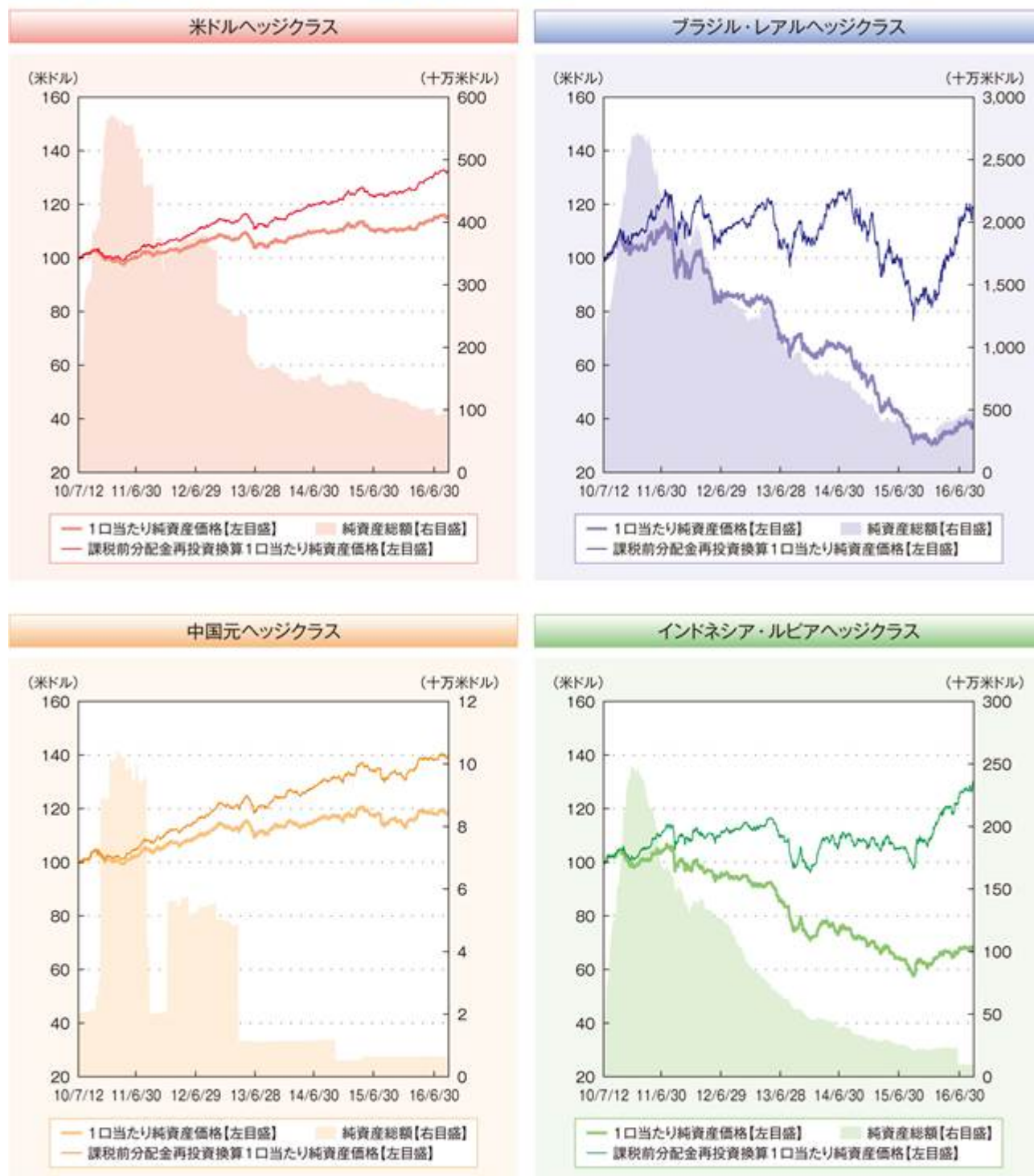
	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成27年10月末日	63,067.94	6,377	116.79	11,810
11月末日	62,280.10	6,298	115.33	11,662
12月末日	61,651.68	6,234	114.17	11,545
平成28年 1 月末日	62,296.96	6,299	115.36	11,665
2 月末日	62,433.56	6,313	115.62	11,691
3 月末日	64,235.70	6,496	118.96	12,029
4 月末日	64,062.38	6,478	118.63	11,996
5 月末日	63,771.08	6,449	118.09	11,941
6 月末日	63,721.44	6,444	118.00	11,932
7 月末日	64,226.65	6,495	118.94	12,027
8 月末日	64,200.33	6,492	118.89	12,022
9 月末日	38,566.03	3,900	118.66	11,999

< 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27年10月末日	2,212,348.94	223,713	62.98	6,369
11月末日	2,190,401.71	221,493	62.35	6,305
12月末日	2,188,745.32	221,326	62.30	6,300
平成28年 1 月末日	2,224,267.42	224,918	63.32	6,403
2 月末日	2,280,557.09	230,610	64.92	6,565
3 月末日	2,324,383.31	235,042	66.35	6,709
4 月末日	2,290,384.13	231,604	66.48	6,722
5 月末日	2,223,671.62	224,858	64.55	6,527
6 月末日	948,927.86	95,956	67.18	6,793
7 月末日	964,367.90	97,517	68.27	6,903
8 月末日	952,018.39	96,268	67.40	6,815
9 月末日	961,319.93	97,209	68.06	6,882

< 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~2016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、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものである。以下同じ。

分配の推移

平成28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27年10月１日～平成28年９月末日	2.40	243

<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27年10月１日～平成28年９月末日	7.80	789

<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27年10月１日～平成28年９月末日	3.00	303

<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27年10月１日～平成28年９月末日	7.20	728

< 参考情報 >

分配の推移（2016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2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	2.40
第3会計年度 (2012年3月1日～2013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)	2.40
第5会計年度 (2014年3月1日～2015年2月28日)	2.40
第6会計年度 (2015年3月1日～2016年2月29日)	2.40
2016年5月	0.20
2016年6月	0.20
2016年7月	0.20
2016年8月	0.20
2016年9月	0.20
直近1年間累計	2.40
設定来累計	14.60

ブラジル・レアルヘッジクラス	
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)	13.80
第4会計年度 (2013年3月1日～2014年2月28日)	13.80
第5会計年度 (2014年3月1日～2015年2月28日)	13.80
第6会計年度 (2015年3月1日～2016年2月29日)	9.80
2016年5月	0.65
2016年6月	0.65
2016年7月	0.65
2016年8月	0.65
2016年9月	0.65
直近1年間累計	7.80
設定来累計	74.45

中国元ヘッジクラス	
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	3.00
第3会計年度 (2012年3月1日～2013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)	3.00
第5会計年度 (2014年3月1日～2015年2月28日)	3.00
第6会計年度 (2015年3月1日～2016年2月29日)	3.00
2016年5月	0.25
2016年6月	0.25
2016年7月	0.25
2016年8月	0.25
2016年9月	0.25
直近1年間累計	3.00
設定来累計	18.25

インドネシア・ルピアヘッジクラス	
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)	9.00
第4会計年度 (2013年3月1日～2014年2月28日)	9.00
第5会計年度 (2014年3月1日～2015年2月28日)	9.00
第6会計年度 (2015年3月1日～2016年2月29日)	8.25
2016年5月	0.60
2016年6月	0.60
2016年7月	0.60
2016年8月	0.60
2016年9月	0.60
直近1年間累計	7.20
設定来累計	51.45

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27年10月１日～平成28年９月末日	6.74%

（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27年10月１日～平成28年９月末日	40.58%

（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27年10月１日～平成28年９月末日	5.31%

（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27年10月１日～平成28年９月末日	29.11%

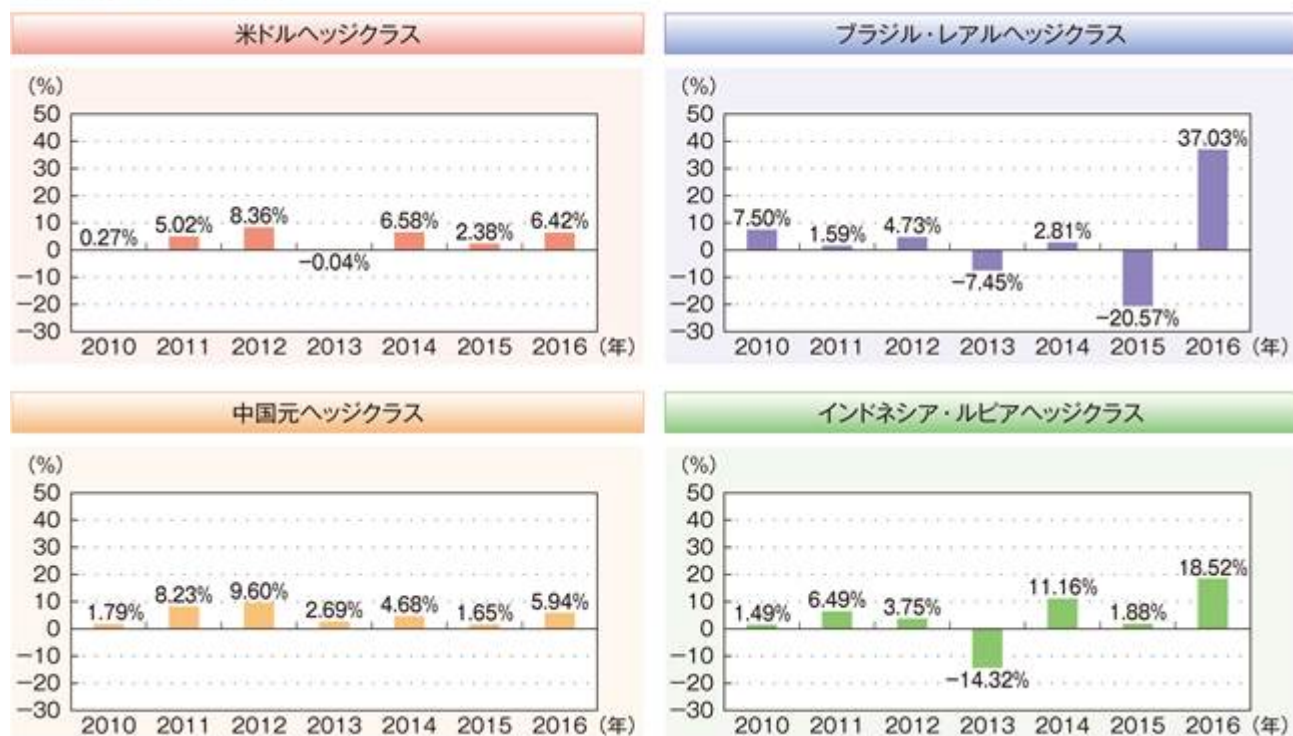
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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、2016年については2016年 9 月末日における課税前分配金再投資換算 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。2016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28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28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
30,963 (30,963)	37,223 (37,223)	101,601 (101,601)

<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
442,070 (442,070)	124,654 (124,654)	1,259,615 (1,259,615)

<中国元ヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	215 (215)	325 (325)

<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)	21,175 (21,175)	14,125 (14,125)

（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．ファンドの日本語の中間財務書類は、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．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．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28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＝101.12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

2016年 8 月31日現在

	米ドル	千円
資産		
現金	1,199,638.40	121,307
銀行預金 - 基準通貨	1,062,161.79	107,406
銀行預金 - 外国通貨	137,476.61	13,902
有価証券（取得原価）	52,249,612.11	5,283,481
債券（取得原価）	52,249,612.11	5,283,481
未実現評価損益	3,647,979.02	368,884
未実現時価評価損益	3,819,085.75	386,186
未実現通貨運用損益	(163,912.96)	(16,575)
未実現通貨繰延損益	(7,193.77)	(727)
未収収益	636,830.24	64,396
債券に係る未収利息	636,830.24	64,396
投資売却未収金	2,190,439.69	221,497
投資売却未収金	2,190,439.69	221,497
資本証券	229,021.20	23,159
受益証券販売未収金	229,021.20	23,159
資産合計：	60,153,520.66	6,082,724

2016年 8 月31日現在

		米ドル	千円
負債			
投資購入未払金		2,279,024.00	230,455
投資購入未払金		2,279,024.00	230,455
資本証券		88,807.82	8,980
受益証券買戻未払金		88,807.82	8,980
未払費用		156,038.16	15,779
未払監査費用		19,147.80	1,936
未払保管報酬		12,043.32	1,218
未払報告書作成費用		790.08	80
未払投資顧問報酬		67,420.95	6,818
未払受託報酬		1,682.33	170
未払代行協会員報酬		4,816.06	487
未払販売報酬		47,728.93	4,826
未払副管理報酬		2,408.69	244
負債合計：		2,523,869.98	255,214
資本			
ファンド受益証券		140,497,178.79	14,207,075
発行済ファンド受益証券（額面価額）		131,995,700.00	13,347,405
ブラジル・リアル	122,206,800.00	12,357,552	
インドネシア・ルピア	1,412,500.00	142,832	
中国元	54,000.00	5,460	
米ドル	8,322,400.00	841,561	
受益証券額面超過額		8,501,478.79	859,670
ブラジル・リアル	8,215,479.41	830,749	
インドネシア・ルピア	2,404,347.51	243,128	
中国元	(56,345.45)	(5,698)	
米ドル	(2,062,002.68)	(208,510)	

2016年 8 月31日現在

	米ドル	千円
分配金支払額	(118,634,725.15)	(11,996,343)
配当金支払額	(118,634,725.15)	(11,996,343)
ブラジル・リアル	(110,343,989.20)	(11,157,984)
インドネシア・ルピア	(4,720,703.70)	(477,358)
中国元	(50,565.25)	(5,113)
米ドル	(3,519,467.00)	(355,889)
利益剰余金	22,178,006.48	2,242,640
利益剰余金	22,178,006.48	2,242,640
ブラジル・リアル	(13,014,144.47)	(1,315,990)
インドネシア・ルピア	1,891,898.45	191,309
中国元	250,748.16	25,356
米ドル	14,868,308.59	1,503,483
中間純利益	13,589,190.56	1,374,139
資本合計：	57,629,650.68	5,827,510
負債および資本合計	60,153,520.66	6,082,724
純資産額合計	57,629,650.68	5,827,510
発行済受益証券総数	1,319,957.00000口	
受益証券 1 口当たり純資産額合計	43.66	4,415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

2016年３月１日から2016年８月31日までの期間

		米ドル	千円
収益			
実現損益		12,294,541.26	1,243,224
為替取引に係る実現利益		16,208,360.91	1,638,989
ブラジル・リアル	14,891,212.06		1,505,799
インドネシア・ルピア	275,969.04		27,906
中国元	2,182.43		221
為替取引に係る実現損失		(3,986,979.39)	(403,163)
ブラジル・リアル	(3,637,350.18)		(367,809)
インドネシア・ルピア	(86,158.58)		(8,712)
中国元	(1,556.64)		(157)
市場に係る実現利益		281,586.74	28,474
市場に係る実現損失		(32,865.82)	(3,323)
通貨に係る実現利益		175,571.18	17,754
インドネシア・ルピア	0.01		0
通貨に係る実現損失		(351,132.36)	(35,507)
受取利息		991,554.39	100,266
債券に係る受取利息		991,554.39	100,266

2016年３月１日から2016年８月31日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	712,573.14	72,055
未実現時価評価損益	2,186,309.01	221,080
未実現通貨運用損益	(1,468,324.93)	(148,477)
ブラジル・レアル	(788,178.67)	(79,701)
インドネシア・ルピア	(128,153.49)	(12,959)
中国元	(1,674.00)	(169)
未実現通貨繰延損益	(5,410.94)	(547)
収益合計：	13,998,668.79	1,415,545
費用		
費用 - 報酬	409,478.23	41,406
監査費用	15,294.08	1,547
保管報酬	34,303.02	3,469
報告書作成費用	854.59	86
投資顧問報酬	192,593.91	19,475
受託報酬	5,015.67	507
現金支出費用	2,522.15	255
代行協会員報酬	13,741.97	1,390
販売報酬	136,750.59	13,828
副保管報酬	1,541.60	156
副管理報酬	6,860.65	694
費用合計：	409,478.23	41,406
投資純利益	13,589,190.56	1,374,139

[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
カテゴリー・グループ別 2016年 8 月31日現在

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) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
現金										
基準通貨現金										
1,062,161.79000	USD CASH	08/31/2016	MUGC	1,062,161.79	1,062,161.79	1.000000000	1,062,161.79	1,062,161.79	0.00	0.00
	CASHUSD					1.000000000				
1,062,161.79000	基準通貨現金小計			1,062,161.79	1,062,161.79		1,062,161.79	1,062,161.79	0.00	0.00
1,062,161.79000	現金合計			1,062,161.79	1,062,161.79		1,062,161.79	1,062,161.79	0.00	0.00
社債										
固定利率から変動利率に転換される社債										
2,600,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL	10/23/2014		2,600,000.00	2,600,000.00	111.059997559 ^C 1.000000000	2,887,559.94	2,887,559.94	287,559.94	0.00
	BJPN303K US23380YAC12									
3,670,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL	07/22/2015		3,683,900.00	3,683,900.00	109.217002869 ^C 1.000000000	4,008,264.01	4,008,264.01	324,364.01	0.00
	BJPN3042 XS1262602532									
6,270,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			6,283,900.00	6,283,900.00		6,895,823.95	6,895,823.95	611,923.95	0.00
変動利率										
3,000,000.00000	mitsui SUMITOMO FRN 03152072	03/09/2012		3,069,389.44	3,069,389.44	121.214996338 ^C 1.000000000	3,636,449.89	3,636,449.89	567,060.45	0.00
	BJPN3013 USJ45174AF61									
1,290,000.00	MUFG CAP FIN 5 FRN 01292049	07/13/2012		1,344,825.00	2,071,568.44	102.024002075 ^C 1.309700000	1,316,109.63	1,723,708.78	-37,608.52	-310,251.14
	BCYM055G XS0282533115									
3,600,000.00000	NIPPON LIFE INS FRN 10182042	10/24/2012		3,730,710.52	3,730,710.52	109.968002319 ^C 1.000000000	3,958,848.08	3,958,848.08	228,137.56	0.00
	BJPN301S USJ54675AA13									

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
カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

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) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
社債											
変動利率											
3,600,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	03/22/2013		3,616,562.07	3,616,562.07	112.815002441 ^C 1.000000000	4,061,340.09	4,061,340.09	444,778.02	0.00	444,778.02
11,490,000.00000	変動利率小計			11,761,487.03	12,488,230.47		12,972,747.69	13,380,346.84	1,202,367.51	-310,251.14	892,116.37
ミディアム・ターム・ノート											
2,050,000.00	EAST JAPAN RAILWAY 4.75% 12082031 BJPN2981 XS0276809927	07/13/2010		2,142,172.49	3,259,656.41	141.126000000 ^C 1.309700000	2,893,083.00	3,789,070.81	983,467.49	-454,053.10	529,414.39
1,400,000.00000	JAPAN TOBACCO 2 % 04132021 BJPN304H XS1394760182	04/07/2016		1,399,664.00	1,399,664.00	100.532997131 ^C 1.000000000	1,407,461.96	1,407,461.96	7,797.96	0.00	7,797.96
1,900,000.00000	NTT FINANCE 1.9 % 07212021 BJPN304R XS1438319656	07/14/2016		1,896,656.00	1,896,656.00	99.471000671 ^C 1.000000000	1,889,949.01	1,889,949.01	-6,706.99	0.00	-6,706.99
2,310,000.00000	ORIX CORP 2.65 % 04132021 BJPN304I XS1389922250	04/11/2016		2,310,644.63	2,310,644.63	101.577003479 ^C 1.000000000	2,346,428.78	2,346,428.78	35,784.15	0.00	35,784.15
7,660,000.00000	ミディアム・ターム・ノート小計			7,749,137.12	8,866,621.04		8,536,922.75	9,432,910.56	1,020,342.61	-454,053.10	566,289.51
公募債											
600,000.00000	BK TOKYO-MIT UFJ 3.2 % 02262023 BJPN3026 USJ0423YBF00	02/19/2013		599,676.00	599,676.00	104.766998291 ^C 1.000000000	628,601.99	628,601.99	28,925.99	0.00	28,925.99
2,050,000.00000	MITSUB UFJ FIN G 3.85 % 03012026 BJPN304L US606822AD62	08/12/2016		2,255,225.50	2,255,225.50	109.360000610 ^C 1.000000000	2,241,880.01	2,241,880.01	-13,345.49	0.00	-13,345.49

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
カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

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) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
社債											
公募債											
2,000,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.2 % 07182022 BCYM055H XS0803109270	07/12/2012		2,003,038.25	2,003,038.25	108.398002625 ^C 1.000000000	2,167,960.05	2,167,960.05	164,921.80	0.00	164,921.80
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	03/20/2014		1,824,132.00	1,824,132.00	110.549003601 ^C 1.000000000	1,989,882.06	1,989,882.06	165,750.06	0.00	165,750.06
1,700,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.95 % 01122022 BJPN3007 USJ7771KPK71	01/05/2012		1,694,577.00	1,694,577.00	108.573997498 ^C 1.000000000	1,845,757.96	1,845,757.96	151,180.96	0.00	151,180.96
1,800,000.00000	SUMITOMO MITSUI 4.436 % 04022024 BJPN3030 USJ7771XAB58	06/18/2015		1,861,884.00	1,861,884.00	110.064002991 ^C 1.000000000	1,981,152.05	1,981,152.05	119,268.05	0.00	119,268.05
850,000.00000	SUMITOMO MITSUI 2.632 % 07142026 BJPN304S US86562MAF77	08/12/2016		845,784.00	845,784.00	99.142997742 ^C 1.000000000	842,715.48	842,715.48	-3,068.52	0.00	-3,068.52
3,350,000.00000	TOYOTA MTR CRED 3.3 % 01122022 BUSA8365 US89233P5T93	01/13/2012		3,463,688.85	3,463,688.85	107.251998901 ^C 1.000000000	3,592,941.96	3,592,941.96	129,253.11	0.00	129,253.11
14,150,000.00000	公募債小計			14,548,005.60	14,548,005.60		15,290,891.56	15,290,891.56	742,885.96	0.00	742,885.96
39,570,000.00000	社債合計			40,342,529.75	42,186,757.11		43,696,385.95	44,999,972.91	3,577,520.03	-764,304.24	2,813,215.79
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
50,406.54	BRITISH POUND GBP	08/18/2016		50,406.54	65,594.03	1.000000000 ^S 1.309700000	50,406.54	66,017.45	0.00	423.42	423.42
37,946.27000	EURO EUR	08/10/2016		37,946.27	42,165.89	1.000000000 ^S 1.113750000	37,946.27	42,262.66	0.00	96.77	96.77

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
カテゴリー・グループ別 2016年 8 月31日現在

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) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
627,711.00000	JAPANESE YEN JPY	04/18/2016		627,711	5,772.85	1.000000000S 103.435000000	627,711	6,068.65	0.00	295.80	295.80
1,225,462.00000		06/20/2016		1,225,462	11,751.09	1.000000000S 103.435000000	1,225,462	11,847.65	0.00	96.56	96.56
1,222,872.00000		08/18/2016		1,222,872	12,192.75	1.000000000S 103.435000000	1,222,872	11,822.61	0.00	-370.14	-370.14
3,076,045.00000	合計 -----			3,076,045.00	29,716.69		3,076,045.00	29,738.91	0.00	22.22	22.22
0.00000											
3,164,397.81000	非グループ化の有価証券小計			3,164,397.81	137,476.61		3,164,397.81	138,019.02	0.00	542.41	542.41
3,164,397.81000	外貨建現金勘定合計			3,164,397.81	137,476.61		3,164,397.81	138,019.02	0.00	542.41	542.41
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
58,290,631.44000	BRL FORWARD 14 OCT FBR14OCT	08/02/2016	BRH	58,290,631.44	17,526,800.00	1.000000000F 3.278020000	58,290,631.44	17,782,268.39	0.00	255,468.39	255,468.39
91,769,365.80000		08/02/2016	BRH	91,769,365.80	27,594,000.00	1.000000000F 3.278020000	91,769,365.80	27,995,364.82	0.00	401,364.82	401,364.82
1,055,914.00000		08/16/2016	BRH	1,055,914.00	326,000.00	1.000000000F 3.278020000	1,055,914.00	322,119.45	0.00	-3,880.55	-3,880.55
1,662,838.20000		08/16/2016	BRH	1,662,838.20	513,000.00	1.000000000F 3.278020000	1,662,838.20	507,269.08	0.00	-5,730.92	-5,730.92
152,778,749.44000	合計 -----			152,778,749.44	45,959,800.00		152,778,749.44	46,607,021.74	0.00	647,221.74	647,221.74
0.00000											
417,067.86	CNY FORWARD 14 OCT FCN14OCT	08/02/2016	CNH	417,067.86	62,700.00	1.000000000F 6.691206667	417,067.86	62,330.74	0.00	-369.26	-369.26
60,000.00000	EUR FORWARD 18 OCT FEU18OCT	08/19/2016		60,000.00	67,968.00	1.000000000F 1.116068793	60,000.00	66,964.13	0.00	-1,003.87	-1,003.87

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
カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

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) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-46,974.42000		08/08/2016		-46,974.42	-52,236.00	1.000000000F 1.116068793	-46,974.42	-52,426.68	0.00	-190.68	-190.68
13,025.58000	合計 -----			13,025.58	15,732.00		13,025.58	14,537.45	0.00	-1,194.55	-1,194.55
0.00000											
40,000.00	GBP FORWARD 18 OCT	08/08/2016		40,000.00	52,236.00	1.000000000F 1.311087632	40,000.00	52,443.51	0.00	207.51	207.51
	FGB18OCT										
-80,269.40		08/08/2016		-80,269.40	-105,000.00	1.000000000F 1.311087632	-80,269.40	-105,240.22	0.00	-240.22	-240.22
-2,947,000.00		08/09/2016		-2,947,000.00	-3,837,937.04	1.000000000F 1.311087632	-2,947,000.00	-3,863,775.25	0.00	-25,838.21	-25,838.21
-481,043.15		08/09/2016		-481,043.15	-626,472.12	1.000000000F 1.311087632	-481,043.15	-630,689.72	0.00	-4,217.60	-4,217.60
-295,784.44		08/09/2016		-295,784.44	-385,197.12	1.000000000F 1.311087632	-295,784.44	-387,799.32	0.00	-2,602.20	-2,602.20
-237,433.94		08/09/2016		-237,433.94	-309,217.34	1.000000000F 1.311087632	-237,433.94	-311,296.70	0.00	-2,079.36	-2,079.36
-51,974.40		08/19/2016		-51,974.40	-67,968.00	1.000000000F 1.311087632	-51,974.40	-68,142.99	0.00	-174.99	-174.99
-4,053,505.33000	合計 -----			-4,053,505.33	-5,279,555.62		-4,053,505.33	-5,314,500.69	0.00	-34,945.07	-34,945.07
0.00000											
12,609,960,000.00	IDR FORWARD 14 OCT	08/02/2016		12,609,960,000.00	955,300.00	1.000000000F 13,353.733333333	12,609,960,000.00	944,302.22	0.00	-10,997.78	-10,997.78
	FID14OCT		IDH								
-1,219,563.00000	JPY FORWARD 18 OCT	08/09/2016		-1,219,563	-11,949.12	1.000000000F 103.218600000	-1,219,563	-11,815.34	0.00	133.78	133.78
	FJP18OCT										
12,757,895,774.55000	非グループ化の有価証券小計			12,757,895,774.55	41,702,027.26		12,757,895,774.55	42,301,876.12	0.00	599,848.86	599,848.86
12,757,895,774.55000	先物（ポジション）合計			12,757,895,774.55	41,702,027.26		12,757,895,774.55	42,301,876.12	0.00	599,848.86	599,848.86

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
カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

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) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
国債											
地方債											
2,350,000.00000	JPN FIN ORG MUNI 2.375 % 02132025 BJPN303P XS1185955306	02/11/2016		2,369,376.00	2,369,376.00	101.856002808 ^C 1.000000000	2,393,616.07	2,393,616.07	24,240.07	0.00	24,240.07
2,350,000.00000	地方債小計			2,369,376.00	2,369,376.00		2,393,616.07	2,393,616.07	24,240.07	0.00	24,240.07
公募債											
2,300,000.00000	DEV BANK JAPAN 1.875 % 09012026 BJPN304T XS1482752380	08/25/2016		2,279,024.00	2,279,024.00	99.345001221 ^C 1.000000000	2,284,935.03	2,284,935.03	5,911.03	0.00	5,911.03
1,950,000.00000	JAPAN BANK COOP 2.75 % 01212026 BJPN304A US471048AR97	02/10/2016		2,006,745.00	2,006,745.00	107.345001221 ^C 1.000000000	2,093,227.52	2,093,227.52	86,482.52	0.00	86,482.52
2,450,000.00000	JAPAN BANK COOP 2.375 % 04202026 BJPN304J US471048AT53	04/12/2016		2,515,180.00	2,515,180.00	104.120002747 ^C 1.000000000	2,550,940.07	2,550,940.07	35,760.07	0.00	35,760.07
900,000.00000	JAPAN FIN ORG MUNI 4% 01132021 BJPN2995 XS0568671555	01/06/2011		892,530.00	892,530.00	109.078002930 ^C 1.000000000	981,702.03	981,702.03	89,172.03	0.00	89,172.03
7,600,000.00000	公募債小計			7,693,479.00	7,693,479.00		7,910,804.65	7,910,804.65	217,325.65	0.00	217,325.65
9,950,000.00000	国債合計			10,062,855.00	10,062,855.00		10,304,420.72	10,304,420.72	241,565.72	0.00	241,565.72
12,811,642,334.15000	ポートフォリオ合計			12,812,527,718.90	95,151,277.77		12,816,123,140.82	98,806,450.56	3,819,085.75	-163,912.97	3,655,172.78

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28年９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

（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。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、信託証書に基づく義務の履行に関する故意の不適切な行為もしくは重過失、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()管理会社の行為に関係し、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、かかる行為が信託証書に基づく義務の履行に関する故意の不適切な行為もしくは重過失または詐欺を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、平成28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	75	6,588,755,740.00

（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、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、平成28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＝101.12円）で換算されている。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

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016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	1,899,536,172.00	192,081,098
1.2	売買目的で保有される金融資産	51,327,462.00	5,190,233
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	51,327,462.00	5,190,233
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	11,888,375.00	1,202,152
1.4.1	持分証券	11,888,375.00	1,202,152
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)	3,195,536,480.00	323,132,649
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	3,195,536,480.00	323,132,649
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	1,343,232.00	135,828
1.9.1	有形固定資産	1,343,232.00	135,828
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	3,743,860.00	378,579
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	3,743,860.00	378,579
1.12	税金資産	124,840.00	12,624
1.12.1	現行税金資産	124,840.00	12,624
1.12.2	繰延税金資産	0.00	0
1.13	その他の資産	21,344,120.00	2,158,317
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	5,184,844,541.00	524,291,480

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016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	43,298,019.00	4,378,296
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	43,298,019.00	4,378,296
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	4,949,902,146.00	500,534,105
2.4.1	金融機関からの預金	1,525,457,379.00	154,254,250
2.4.2	金融機関以外からの預金	3,424,444,767.00	346,279,855
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	274,539.00	27,761
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務	274,539.00	27,761
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	11,045,467.00	1,116,918
2.9.1	現行税金負債	11,045,467.00	1,116,918
2.9.2	繰延税金負債	0.00	0
2.10	その他の負債	15,048,412.00	1,521,695
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	5,019,568,583.00	507,578,775

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016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	3,753,369
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	3,753,369
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:	3,388,782.00	342,674
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	3,388,782.00	342,674
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)	110,531,939.00	11,176,990
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	14,237,268.00	1,439,673
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	165,275,958.00	16,712,705
3.11	負債および資本合計	5,184,844,541.00	524,291,480

(2) 損益の状況

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

損益計算書

2016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(+/-)	39,434,012.00	3,987,567
5.2	利息収益	12,948,861.00	1,309,389
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	2,800.00	283
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)	6,627,225.00	670,145
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。)	6,318,836.00	638,961
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)(-)	3,570,906.00	361,090
5.3.1	中央銀行からの預金	2,427,476.00	245,466
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)	86,859.00	8,783
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	1,056,571.00	106,840
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(+)	1,540,573.00	155,783
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	1,540,573.00	155,783
5.6	受取手数料(+)	50,949,549.00	5,152,018
5.7	(支払手数料)(-)	24,944,611.00	2,522,399
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	0.00	0
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(+/-)	2,533,259.00	256,163
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	2,533,259.00	256,163
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(+)	650,711.00	65,800

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	673,424.00	68,097
5.16	一般管理費（－）	22,071,208.00	2,231,841
5.16.1	従業員費用（－）	9,275,931.00	937,982
5.16.2	一般管理費用（－）	12,795,277.00	1,293,858
5.17	減価償却（＋／－）	1,091,868.00	110,410
5.17.1	有形固定資産	190,017.00	19,215
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	901,851.00	91,195
5.18	引当金（＋／－）	(2,237,832.00)	(226,290)
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（＋／－）	0.00	0
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	18,508,768.00	1,871,607
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,271,500.00	431,934
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	14,237,268.00	1,439,673
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（＋／－）	14,237,268.00	1,439,673

[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28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28年9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。

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、平成28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 = 101.12円) による。

(後略)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

(A) 日本

平成28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 >

(前略)

(A) 日本

平成28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28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	EAST JAPAN RAILWAY CO	日本	社債	4.750	2031/12/8	2,500,000	1.59	3,975,190.75	1.73	4,329,026.17	7.50
2	SOMPO JAPAN NIPPONKOA INSURANCE INC	日本	社債	5.325 (2023年３月以降変動金利)	2073/3/28	3,600,000	1.00	3,616,562.07	1.10	3,969,539.98	6.88
3	NIPPON LIFE INSURANCE CO	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	3,600,000	1.04	3,730,710.52	1.08	3,885,444.03	6.73
4	FUKOKU MUTUAL	日本	社債	5.000 (2025年７月以降変動金利)	永久債	3,670,000	1.00	3,683,900.00	1.06	3,872,290.44	6.71
5	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	米国	社債	3.300	2022/1/12	3,350,000	1.03	3,463,688.85	1.08	3,624,063.49	6.28
6	MITSUI SUMITOMO INSURANCE CO LTD	日本	社債	7.000 (2022年３月以降変動金利)	2072/3/15	3,000,000	1.02	3,069,389.44	1.19	3,578,160.10	6.20
7	ORIX CORP	日本	社債	2.650	2021/4/13	3,200,000	1.00	3,200,893.00	1.01	3,243,520.02	5.62
8	MUFG CAPITAL FINANCE 5 LTD	ケイマン諸島	社債	6.299 (2017年１月以降変動金利)	永久債	2,250,000	1.61	3,613,200.76	1.37	3,073,941.45	5.33
9	DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD/THE	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	2,600,000	1.00	2,600,000.00	1.09	2,842,423.93	4.92
10	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	日本	社債	3.950	2022/1/12	2,400,000	1.00	2,392,344.00	1.09	2,606,232.06	4.52
11	MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN 3 LTD	ケイマン諸島	社債	4.200	2022/7/18	2,000,000	1.00	2,003,038.25	1.08	2,158,939.97	3.74
12	JAPAN BANK FOR INTERNATIONAL COOPERATION/JAPAN	日本	公債	2.750	2026/1/21	1,950,000	1.03	2,006,745.00	1.07	2,094,904.50	3.63
13	MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN 3 LTD	ケイマン諸島	社債	4.600	2024/3/27	1,800,000	1.01	1,824,132.00	1.10	1,971,089.95	3.41
14	SUMITOMO MITSUI BANKING CORP	日本	社債	4.436	2024/4/2	1,800,000	1.03	1,861,884.00	1.08	1,942,793.98	3.37
15	JAPAN FINANCE ORGANIZATION FOR MUNICIPALITIES	日本	公債	2.375	2025/2/13	1,800,000	1.00	1,804,482.00	1.02	1,829,160.05	3.17
16	JAPAN TOBACCO	日本	社債	2.000	2021/4/13	1,400,000	1.00	1,399,664.00	1.01	1,412,222.02	2.45
17	JAPAN FINANCE ORGANIZATION FOR MUNICIPALITIES	日本	公債	4.000	2021/1/13	900,000	0.99	892,530.00	1.10	988,667.98	1.71
18	JAPAN BANK FOR INTERNATIONAL COOPERATION/JAPAN	日本	公債	2.375	2026/4/20	900,000	1.00	895,554.00	1.04	938,033.98	1.63
19	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP	米国	社債	2.125	2020/3/3	700,000	1.01	704,627.00	1.01	709,422.00	1.23
20	BANK OF TOKYO-MITSUBISHI UFJ LTD/THE	日本	社債	3.200	2023/2/26	600,000	1.00	599,676.00	1.05	627,324.01	1.09
21	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	日本	公債	2.125	2021/4/13	550,000	1.00	548,790.00	1.02	559,278.48	0.97

投資不動産物件

該当事項なし。（平成28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28年６月末日現在）

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

（平成28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	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	日本	公債	1.875	2026/ 9 / 1	4,400,000	0.99	4,360,544.00	0.99	4,356,220.00	7.21
2	SOMPO JAPAN NIPPONKOA	日本	社債	5.325 (2023年３月以降変動金利)	2073/ 3 / 28	3,600,000	1.00	3,616,562.07	1.12	4,032,864.07	6.67
3	FUKOKU MUTUAL LIFE INSUR	日本	社債	5.000 (2025年７月以降変動金利)	永久債	3,670,000	1.00	3,683,900.00	1.09	3,987,345.02	6.60
4	NIPPON LIFE INSURANCE	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	3,600,000	1.04	3,730,710.52	1.09	3,925,547.97	6.50
5	EAST JAPAN RAILWAY CO	日本	社債	4.750	2031/12/ 8	2,050,000	1.59	3,259,656.41	1.80	3,683,658.73	6.10
6	mitsui sumitomo INSURANC	日本	社債	7.000 (2022年３月以降変動金利)	2072/ 3 / 15	3,000,000	1.02	3,069,389.44	1.20	3,607,740.10	5.97
7	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	米国	社債	3.300	2022/ 1 / 12	3,350,000	1.03	3,463,688.85	1.07	3,599,574.90	5.96
8	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	日本	公債	2.375	2025/ 2 / 13	2,900,000	1.01	2,926,636.00	1.01	2,937,178.00	4.86
9	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	2,600,000	1.00	2,600,000.00	1.10	2,861,404.02	4.74
10	JPN BANK FOR INT'L COOP	日本	公債	2.375	2026/ 4 / 20	2,450,000	1.03	2,515,180.00	1.04	2,556,917.96	4.23
11	ORIX CORP	日本	社債	2.650	2021/ 4 / 13	2,310,000	1.00	2,310,644.63	1.02	2,354,906.41	3.90
12	mitsubishi UFJ FIN GRP	日本	社債	3.850	2026/ 3 / 1	2,050,000	1.10	2,255,225.50	1.09	2,239,030.51	3.71
13	MIZUHO FIN GRP CAYMAN 2	ケイマン諸島	社債	4.200	2022/ 7 / 18	2,000,000	1.00	2,003,038.25	1.08	2,166,499.94	3.59
14	JPN BANK FOR INT'L COOP	日本	公債	2.750	2026/ 1 / 21	1,950,000	1.03	2,006,745.00	1.08	2,097,322.51	3.47
15	MIZUHO FIN GRP CAYMAN 3	ケイマン諸島	社債	4.600	2024/ 3 / 27	1,800,000	1.01	1,824,132.00	1.10	1,981,349.95	3.28
16	SUMITOMO MITSUI FINANCIA	日本	社債	4.436	2024/ 4 / 2	1,800,000	1.03	1,861,884.00	1.10	1,979,676.04	3.28
17	NTT FINANCE CORP	日本	社債	1.900	2021/ 7 / 21	1,900,000	1.00	1,896,656.00	1.00	1,898,290.07	3.14
18	SUMITOMO MITSUI BANKING	日本	社債	3.950	2022/ 1 / 12	1,700,000	1.00	1,694,577.00	1.08	1,832,797.20	3.03
19	MUFG CAPITAL FIN 5 LTD	ケイマン諸島	社債	6.299 (2017年１月以降変動金利)	永久債	1,290,000	1.61	2,071,568.44	1.32	1,699,304.00	2.81
20	JAPAN TOBACCO INC	日本	社債	2.000	2021/ 4 / 13	1,400,000	1.00	1,399,664.00	1.01	1,412,572.04	2.34
21	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	日本	公債	4.000	2021/ 1 / 13	900,000	0.99	892,530.00	1.09	983,844.02	1.63
22	SUMITOMO MITSUI FINL GRP	日本	社債	2.632	2026/ 7 / 14	850,000	1.00	845,784.00	0.99	842,562.50	1.39

23	BK TOKYO-MITSUBISHI UFJ	日本	社債	3.200	2023/ 2 /26	600,000	1.00	599,676.00	1.05	628,445.98	1.04
24	MIZUHO FINANCIAL GROUP	日本	社債	4.353	2025/10/20	500,000	1.09	544,515.00	1.10	551,050.00	0.91

投資不動産物件

該当事項なし。(平成28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28年9月末日現在)