

【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29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 鈴木 惣太

【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 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1,120億円)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1,120億円)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1,120億円)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1,120億円)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、2017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=112.00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、2017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

（2017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	39,162,800.11	64.02
	米国	2,924,718.50	4.78
	ケイマン諸島	2,432,186.02	3.98
	小計	44,519,704.63	72.78
公債	日本	12,927,608.00	21.13
	小計	12,927,608.00	21.13
小計		57,447,312.63	93.91
現金・その他の資産 (負債控除後)		3,725,682.73	6.09
合計(純資産総額)		61,172,995.36 (約6,896百万円)	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。

（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、2017年9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＝112.73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

2017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
2016年10月末日	11,552,522.89	1,302,316	113.85	12,834
11月末日	11,393,731.97	1,284,415	109.77	12,374
12月末日	10,821,423.30	1,219,899	109.07	12,295
2017年１月末日	10,626,647.90	1,197,942	108.99	12,286
２月末日	10,837,540.62	1,221,716	110.06	12,407
３月末日	10,673,630.10	1,203,238	109.85	12,383
４月末日	10,736,496.02	1,210,325	110.78	12,488
５月末日	10,777,501.37	1,214,948	111.71	12,593
６月末日	10,553,286.02	1,189,672	111.30	12,547
７月末日	10,544,421.76	1,188,673	111.41	12,559
８月末日	10,411,709.47	1,173,712	112.12	12,639
９月末日	10,390,010.54	1,171,266	111.16	12,531

< 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
2016年10月末日	49,778,072.76	5,611,482	37.85	4,267
11月末日	44,773,245.54	5,047,288	34.00	3,833
12月末日	46,761,606.51	5,271,436	34.88	3,932
2017年１月末日	48,570,563.76	5,475,360	35.70	4,024
２月末日	60,875,358.89	6,862,479	35.99	4,057
３月末日	47,442,799.73	5,348,227	34.89	3,933
４月末日	47,863,105.31	5,395,608	34.77	3,920
５月末日	46,903,402.92	5,287,421	34.05	3,838
６月末日	45,214,982.53	5,097,085	32.85	3,703
７月末日	47,654,499.37	5,372,092	34.43	3,881
８月末日	46,687,984.32	5,263,136	34.00	3,833
９月末日	50,041,181.92	5,641,142	33.07	3,728

< 中国元ヘッジクラス >

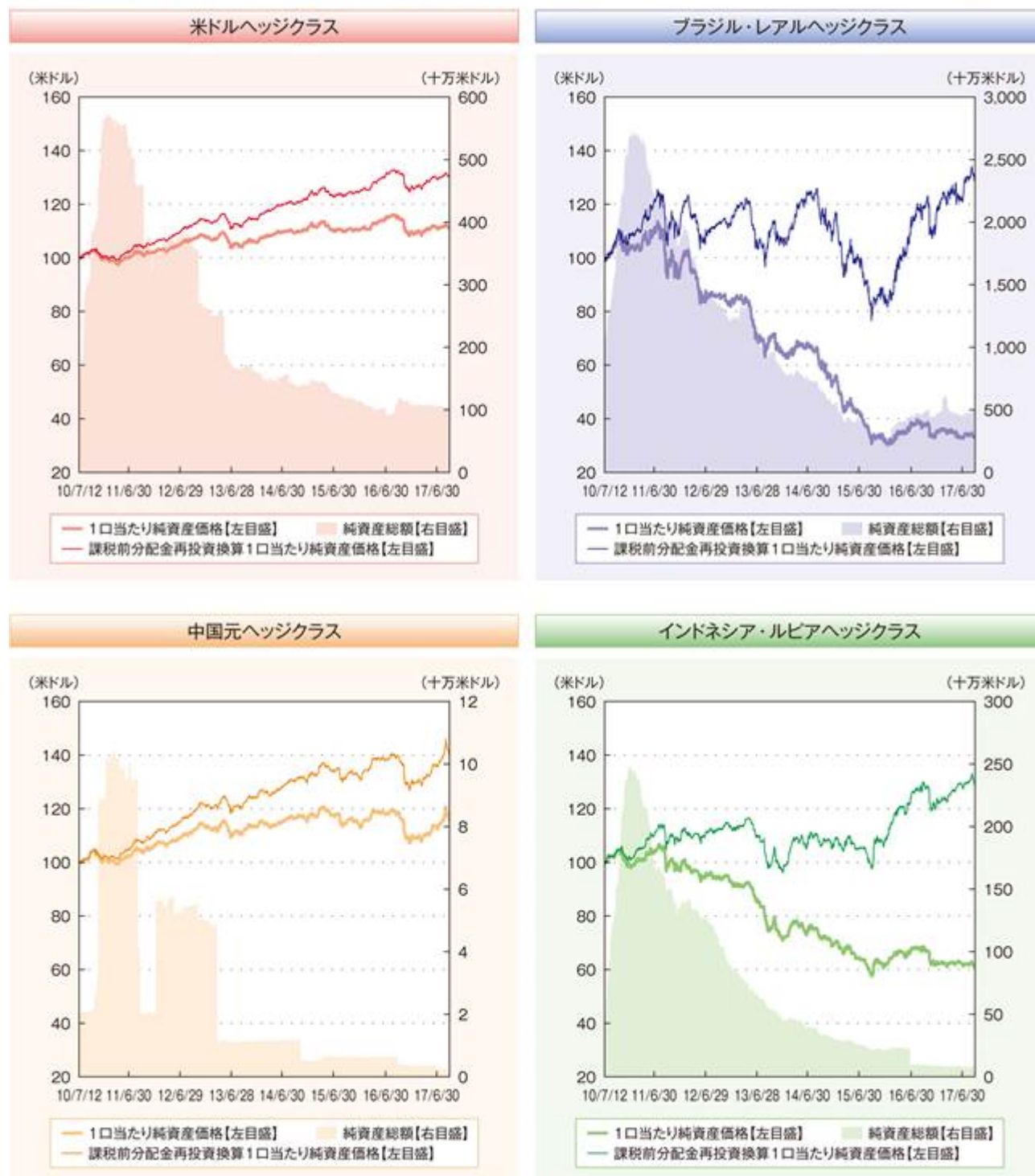
	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2016年10月末日	37,453.20	4,222	115.24	12,991
11月末日	35,607.44	4,014	109.56	12,351
12月末日	35,053.20	3,952	107.86	12,159
2017年 1 月末日	35,435.34	3,995	109.03	12,291
2 月末日	35,755.99	4,031	110.02	12,403
3 月末日	35,672.06	4,021	109.76	12,373
4 月末日	35,976.10	4,056	110.70	12,479
5 月末日	36,735.41	4,141	113.03	12,742
6 月末日	25,513.60	2,876	113.39	12,782
7 月末日	25,791.83	2,908	114.63	12,922
8 月末日	26,507.68	2,988	117.81	13,281
9 月末日	26,145.08	2,947	116.20	13,099

< 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
2016年10月末日	941,515.63	106,137	66.66	7,515
11月末日	876,610.62	98,820	62.06	6,996
12月末日	872,951.02	98,408	61.96	6,985
2017年 1 月末日	862,473.41	97,227	62.29	7,022
2 月末日	832,164.49	93,810	62.62	7,059
3 月末日	828,642.23	93,413	62.35	7,029
4 月末日	832,299.40	93,825	62.63	7,060
5 月末日	835,428.79	94,178	62.86	7,086
6 月末日	828,625.75	93,411	62.35	7,029
7 月末日	732,562.30	82,582	62.13	7,004
8 月末日	732,726.58	82,600	62.15	7,006
9 月末日	715,657.82	80,676	60.70	6,843

< 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~2017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

2017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
2016年10月１日～2017年９月末日	2.40	271

<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
2016年10月１日～2017年９月末日	7.80	879

<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
2016年10月１日～2017年９月末日	3.00	338

<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
2016年10月１日～2017年９月末日	7.20	812

< 参考情報 >

分配の推移（2017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
第7会計年度 (2016年3月1日～2017年2月28日)	2.40
2017年5月	0.20
2017年6月	0.20
2017年7月	0.20
2017年8月	0.20
2017年9月	0.20
直近1年間累計	2.40
設定来累計	17.00

ブラジル・レアルヘッジクラス	
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
第7会計年度 (2016年3月1日～2017年2月28日)	7.80
2017年5月	0.65
2017年6月	0.65
2017年7月	0.65
2017年8月	0.65
2017年9月	0.65
直近1年間累計	7.80
設定来累計	82.25

中国元ヘッジクラス	
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
第7会計年度 (2016年3月1日～2017年2月28日)	3.00
2017年5月	0.25
2017年6月	0.25
2017年7月	0.25
2017年8月	0.25
2017年9月	0.25
直近1年間累計	3.00
設定来累計	21.25

インドネシア・ルピアヘッジクラス	
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
第7会計年度 (2016年3月1日～2017年2月28日)	7.20
2017年5月	0.60
2017年6月	0.60
2017年7月	0.60
2017年8月	0.60
2017年9月	0.60
直近1年間累計	7.20
設定来累計	58.65

収益率の推移

<米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
2016年10月１日～2017年９月末日	- 1.71%

（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）
2016年10月１日～2017年９月末日	7.95%

（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）
2016年10月１日～2017年９月末日	0.46%

（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）
2016年10月１日～2017年９月末日	- 0.24%

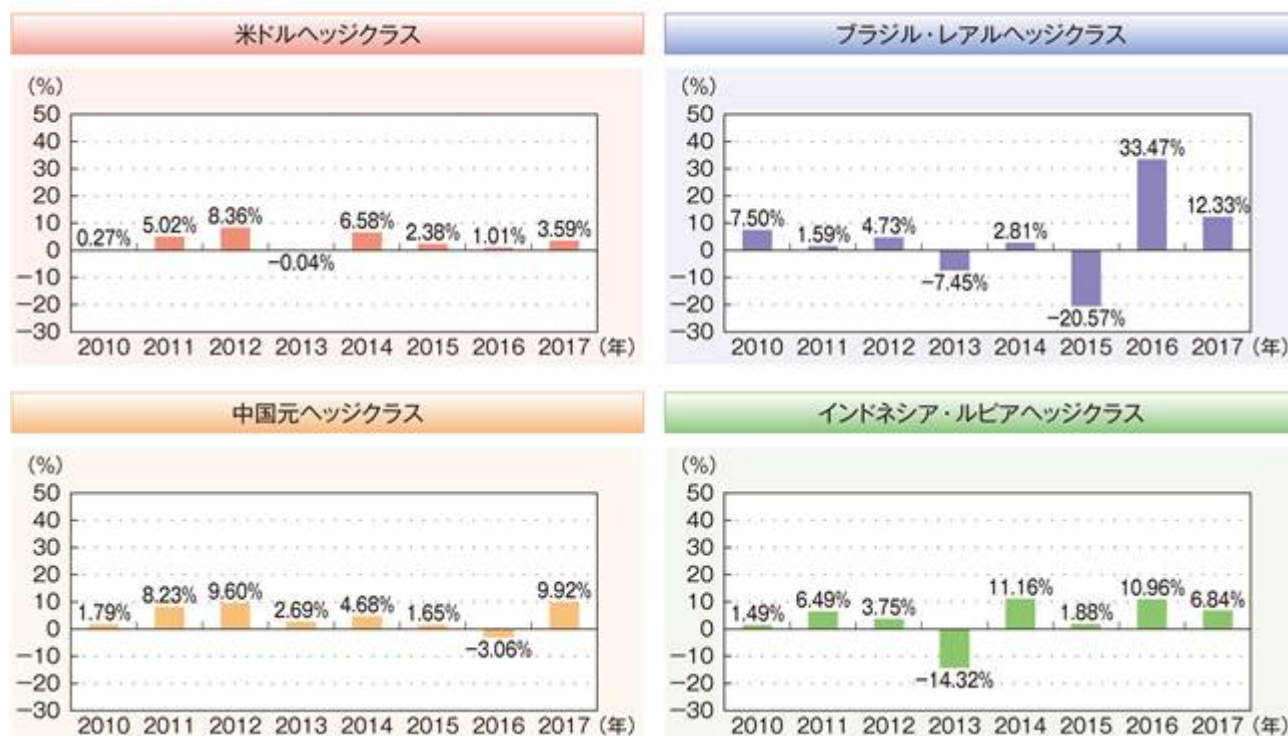
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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、2017年については2017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。2017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

2017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2017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
18,310 (18,310)	26,442 (26,442)	93,469 (93,469)

<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
666,890 (666,890)	413,211 (413,211)	1,513,294 (1,513,294)

<中国元ヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	100 (100)	225 (225)

<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)	2,335 (2,335)	11,790 (11,790)

（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2017年9月29日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝112.73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

2017年 8 月31日現在

	米ドル	千円
資産		
現金	2,760,142.39	311,151
銀行預金 - 基準通貨	2,545,508.09	286,955
銀行預金 - 外国通貨	214,634.30	24,196
ブローカーが保有する現金	270,000.00	30,437
ブローカーが保有する 現金 - 米ドル	270,000.00	30,437
有価証券（取得原価）	53,602,338.76	6,042,592
債券（取得原価）	53,602,338.76	6,042,592
未実現評価損益	1,080,255.05	121,777
未実現時価評価損益	1,298,353.75	146,363
未実現通貨運用損益	(218,098.67)	(24,586)
未実現通貨繰延損益	(0.03)	(0)
未収収益	617,196.38	69,577
債券に係る未収利息	617,196.38	69,577
資産合計：	58,329,932.58	6,575,533

2017年 8 月31日現在

		米ドル	千円
負債			
資本証券		309,590.00	34,900
受益証券買戻未払金		309,590.00	34,900
未払費用		161,414.53	18,196
未払監査費用		21,034.86	2,371
未払保管報酬		12,348.41	1,392
未払報告書作成費用		857.41	97
未払投資顧問報酬		69,129.50	7,793
未払受託報酬		1,687.02	190
未払代行協会員報酬		4,938.22	557
未払販売報酬		48,949.44	5,518
未払副管理報酬		2,469.67	278
負債合計：		471,004.53	53,096
資本			
ファンド受益証券		147,404,699.46	16,616,932
発行済ファンド受益証券（額面価額）		147,787,500.00	16,660,085
ブラジル・レアル	137,299,900.00	15,477,818	
インドネシア・ルピア	1,179,000.00	132,909	
中国元	22,500.00	2,536	
米ドル	9,286,100.00	1,046,822	
受益証券額面超過額		(382,800.54)	(43,153)
ブラジル・レアル	(961,566.91)	(108,397)	
インドネシア・ルピア	2,493,236.29	281,063	
中国元	(61,682.00)	(6,953)	
米ドル	(1,852,787.92)	(208,865)	

2017年 8 月31日現在

	米ドル	千円
分配金支払額	(129,632,503.80)	(14,613,472)
配当金支払額	(129,632,503.80)	(14,613,472)
ブラジル・リアル	(121,007,586.30)	(13,641,185)
インドネシア・ルピア	(4,818,287.70)	(543,166)
中国元	(51,544.00)	(5,811)
米ドル	(3,755,085.80)	(423,311)
利益剰余金	37,340,922.49	4,209,442
利益剰余金	37,340,922.49	4,209,442
ブラジル・リアル	(25,910,831.41)	(2,920,928)
インドネシア・ルピア	1,943,104.77	219,046
中国元	302,681.31	34,121
米ドル	18,764,137.14	2,115,281
中間純利益	2,745,809.90	309,535
資本合計：	57,858,928.05	6,522,437
負債および資本合計	58,329,932.58	6,575,533
純資産額合計	57,858,928.05	6,522,437
発行済受益証券総数	1,477,875.00000口	
受益証券 1 口当たり純資産額 合計	39.15	4,413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

2017年３月１日から2017年８月31日までの期間

	米ドル		千円
収益			
実現損益	1,492,927.01		168,298
為替取引に係る実現利益	3,772,363.04		425,258
ブラジル・リアル	3,612,430.08	407,229	
インドネシア・ルピア	28,444.62	3,207	
中国元	1,426.92	161	
為替取引に係る実現損失	(2,277,629.77)		(256,757)
ブラジル・リアル	(2,127,314.84)	(239,812)	
インドネシア・ルピア	(9,565.52)	(1,078)	
中国元	(456.56)	(51)	
市場に係る実現利益	814,710.71		91,842
市場に係る実現損失	(268,912.59)		(30,315)
通貨に係る実現利益	57,815.48		6,518
通貨に係る実現損失	(605,419.86)		(68,249)
ブラジル・リアル	(0.01)	(0)	
インドネシア・ルピア	(0.01)	(0)	
受取利息	1,021,882.97		115,197
現金に係る受取利息	7,172.88		809
債券に係る受取利息	1,014,710.09		114,388

2017年３月１日から2017年８月31日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	689,691.65	77,749
未実現時価評価損益	478,991.41	53,997
未実現通貨運用損益	210,761.05	23,759
ブラジル・リアル	(367,757.22)	(41,457)
インドネシア・ルピア	(1,911.05)	(215)
中国元	(518.02)	(58)
未実現通貨繰延損益	(60.81)	(7)
収益合計：	3,204,501.63	361,243
費用		
費用 - 報酬	457,171.77	51,537
監査費用	16,921.45	1,908
保管報酬	37,621.79	4,241
報告書作成費用	6,996.58	789
投資顧問報酬	210,681.96	23,750
受託報酬	5,074.67	572
現金支出費用	4,428.88	499
代行協会員報酬	15,048.77	1,696
販売報酬	150,487.08	16,964
副保管報酬	1,995.44	225
ケイマン諸島年間報酬	390.85	44
副管理報酬	7,524.30	848
支払利息	1,519.96	171
当座借越利息	1,519.96	171
費用合計：	458,691.73	51,708
投資純利益	2,745,809.90	309,535

[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 2017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)
現金											
基準通貨現金											
2,545,508.09000	USD CASH	08/31/2017	MUGC	2,545,508.09	2,545,508.09	1.000000000	2,545,508.09	2,545,508.09	0.00	0.00	0.00
	CASHUSD					1.000000000					
2,545,508.09000	基準通貨現金小計			2,545,508.09	2,545,508.09		2,545,508.09	2,545,508.09	0.00	0.00	0.00
2,545,508.09000	現金合計			2,545,508.09	2,545,508.09		2,545,508.09	2,545,508.09	0.00	0.00	0.00
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
630,000.00000	DAI-ICHI LIFE	10/06/2016		618,911.01	618,911.01	100.565002441 ^C	633,559.52	633,559.52	14,648.51	0.00	14,648.51
	FRN PERP/CALL					1.000000000					
	BJPN3050 USJ09748AD66										
2,600,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL	10/23/2014		2,600,000.00	2,600,000.00	107.726997375 ^C	2,800,901.93	2,800,901.93	200,901.93	0.00	200,901.93
	FRN PERP/CALL					1.000000000					
	BJPN303K US23380YAC12										
3,670,000.00000	FUKOKU MUTUAL	07/22/2015		3,683,900.00	3,683,900.00	106.832000732 ^C	3,920,734.43	3,920,734.43	236,834.43	0.00	236,834.43
	FRN PERP/CALL					1.000000000					
	BJPN3042 XS1262602532										
770,000.00000	NIPPON LIFE INS	10/06/2016		836,220.00	836,220.00	105.805999756 ^C	814,706.20	814,706.20	-21,513.80	0.00	-21,513.80
	FRN 01202046					1.000000000					
	BJPN304Z USJ54675AC78										
7,670,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			7,739,031.01	7,739,031.01		8,169,902.08	8,169,902.08	430,871.07	0.00	430,871.07
変動利率											
3,000,000.00000	MITSUMI SUMITOMO	03/09/2012		3,069,389.44	3,069,389.44	115.462997437 ^C	3,463,889.92	3,463,889.92	394,500.48	0.00	394,500.48
	FRN 03152072					1.000000000					
	BJPN3013 USJ45174AF61										

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 2017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											
2,900,000.00000	NIPPON LIFE INS FRN 10182042 BJPN301S USJ54675AA13	10/24/2012		3,005,294.59	3,005,294.59	107.124000549 ^C 1.000000000	3,106,596.02	3,106,596.02	101,301.43	0.00	101,301.43
3,600,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	03/22/2013		3,616,562.07	3,616,562.07	108.956001282 ^C 1.000000000	3,922,416.05	3,922,416.05	305,853.98	0.00	305,853.98
9,500,000.00000	変動利率小計			9,691,246.10	9,691,246.10		10,492,901.99	10,492,901.99	801,655.89	0.00	801,655.89
メディアム・ターム・ノート											
3,150,000.00000	NTT FINANCE 1.9 % 07212021 BJPN304R XS1438319656	07/14/2016		3,106,054.75	3,106,054.75	98.694999695 ^C 1.000000000	3,108,892.49	3,108,892.49	2,837.74	0.00	2,837.74
2,310,000.00000	ORIX CORP 2.65 % 04132021 BJPN304I XS1389922250	04/11/2016		2,310,644.63	2,310,644.63	100.741996765 ^C 1.000000000	2,327,140.13	2,327,140.13	16,495.50	0.00	16,495.50
5,460,000.00000	メディアム・ターム・ノート小計			5,416,699.38	5,416,699.38		5,436,032.62	5,436,032.62	19,333.24	0.00	19,333.24
私募債											
1,400,000.00000	DAIWA SEC GROUP 3.129 % 04192022 BJPN305J US234064AB96	04/12/2017		1,400,000.00	1,400,000.00	101.674003601 ^C 1.000000000	1,423,436.05	1,423,436.05	23,436.05	0.00	23,436.05
1,400,000.00000	私募債小計			1,400,000.00	1,400,000.00		1,423,436.05	1,423,436.05	23,436.05	0.00	23,436.05
公募債											
600,000.00000	BK TOKYO-MIT UFJ 3.2 % 02262023 BJPN3026 USJ0423YBF00	02/19/2013		599,676.00	599,676.00	102.943000793 ^C 1.000000000	617,658.00	617,658.00	17,982.00	0.00	17,982.00

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 2017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											
450,000.00000	CNTRL NIPPON EXP 2.293 % 04232021 BJPN305D XS1391407969	02/14/2017		443,250.00	443,250.00	99.796997070 ^C 1.000000000	449,086.49	449,086.49	5,836.49	0.00	5,836.49
1,950,000.00000	MITSUB UFJ FIN 2.757 % 09132026 BJPN305C US606822AJ33	02/10/2017		1,823,679.00	1,823,679.00	97.372001648 ^C 1.000000000	1,898,754.03	1,898,754.03	75,075.03	0.00	75,075.03
2,050,000.00000	MITSUB UFJ FIN G 3.85 % 03012026 BJPN304L US606822AD62	08/12/2016		2,255,225.50	2,255,225.50	105.681999207 ^C 1.000000000	2,166,480.98	2,166,480.98	-88,744.52	0.00	-88,744.52
2,000,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.2 % 07182022 BCYM055H XS0803109270	07/12/2012		2,003,038.25	2,003,038.25	105.807998657 ^C 1.000000000	2,116,159.97	2,116,159.97	113,121.72	0.00	113,121.72
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	03/20/2014		1,824,132.00	1,824,132.00	107.319999695 ^C 1.000000000	1,931,759.99	1,931,759.99	107,627.99	0.00	107,627.99
500,000.00000	MIZUHO FINANCIAL 4.353 % 10202025 BJPN304W USJ4599LAH53	09/14/2016		544,515.00	544,515.00	106.392997742 ^C 1.000000000	531,964.99	531,964.99	-12,550.01	0.00	-12,550.01
1,850,000.00000	ORIX CORP 3.95 % 01192027 BJPN305B XS1527515321	02/10/2017		1,849,204.50	1,849,204.50	103.708000183 ^C 1.000000000	1,918,598.00	1,918,598.00	69,393.50	0.00	69,393.50
1,800,000.00000	SUMITOMO MITSUI 4.436 % 04022024 BJPN3030 USJ7771XAB58	06/18/2015		1,861,884.00	1,861,884.00	106.803001404 ^C 1.000000000	1,922,454.03	1,922,454.03	60,570.03	0.00	60,570.03

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
カテゴリー・グループ別 2017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											
850,000.00000	SUMITOMO MITSUI 2.632 % 07142026 BJPN304S US86562MAF77	08/12/2016		845,784.00	845,784.00	96.530998230 ^C 1.000000000	820,513.48	820,513.48	-25,270.52	0.00	-25,270.52
1,900,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.364 % 07122027 BJPN305T US86562MAR16	08/14/2017		1,927,037.00	1,927,037.00	102.074996948 ^C 1.000000000	1,939,424.94	1,939,424.94	12,387.94	0.00	12,387.94
15,750,000.00000	公募債小計			15,977,425.25	15,977,425.25		16,312,854.90	16,312,854.90	335,429.65	0.00	335,429.65
39,780,000.00000	社債合計			40,224,401.74	40,224,401.74		41,835,127.64	41,835,127.64	1,610,725.90	0.00	1,610,725.90
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
153,904.44	BRITISH POUND GBP	08/30/2017		153,904.44	199,290.86	1.000000000 ^S 1.288550000	153,904.44	198,313.57	0.00	-977.29	-977.29
505.25000	EURO EUR	08/30/2017		505.25	607.61	1.000000000 ^S 1.188900000	505.25	600.69	0.00	-6.92	-6.92
11,327.42000		08/30/2017		11,327.42	13,622.36	1.000000000 ^S 1.188900000	11,327.42	13,467.17	0.00	-155.19	-155.19
11,832.67000 0.00000	合計 -----			11,832.67	14,229.97		11,832.67	14,067.86	0.00	-162.11	-162.11
121,090.00000	JAPANESE YEN JPY	08/30/2017		121,090	1,113.47	1.000000000 ^S 110.060000000	121,090	1,100.22	0.00	-13.25	-13.25
286,827.11000	非グループ化の有価証券小計			286,827.11	214,634.30		286,827.11	213,481.65	0.00	-1,152.65	-1,152.65
286,827.11000	外貨建現金勘定合計			286,827.11	214,634.30		286,827.11	213,481.65	0.00	-1,152.65	-1,152.65

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。

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 2017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)
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
144,407,680.20000	BRL FORWARD 11 OCT	08/29/2017		144,407,680.20	45,325,700.00	1.000000000F	144,407,680.20	45,610,155.05	0.00	284,455.05	284,455.05
	FBR11OCT		BRH			3.166130000					
146,387,040.52000	BRL FORWARD 11 SEP	08/03/2017		146,387,040.52	46,637,900.00	1.000000000F	146,387,040.52	46,444,676.46	0.00	-193,223.54	-193,223.54
	FBR11SEP		BRH			3.151858333					
-146,387,040.52000		08/29/2017		-146,387,040.52	-46,135,216.05	1.000000000F	-146,387,040.52	-46,444,676.46	0.00	-309,460.41	-309,460.41
			BRH			3.151858333					
0.00000	合計-----			0.00	502,683.95		0.00	0.00	0.00	-502,683.95	-502,683.95
0.00000											
175,836.37	CNY FORWARD 11 OCT	08/29/2017		175,836.37	26,600.00	1.000000000F	175,836.37	26,598.88	0.00	-1.12	-1.12
	FCN11OCT		CNH			6.610669167					
175,940.10	CNY FORWARD 11 SEP	08/03/2017		175,940.10	26,100.00	1.000000000F	175,940.10	26,653.97	0.00	553.97	553.97
	FCN11SEP		CNH			6.600896667					
-175,940.10		08/29/2017		-175,940.10	-26,650.61	1.000000000F	-175,940.10	-26,653.97	0.00	-3.36	-3.36
			CNH			6.600896667					
0.00000	合計-----			0.00	-550.61		0.00	0.00	0.00	550.61	550.61
0.00000											
870.39000	EUR FORWARD 25 OCT	08/16/2017		870.39	1,022.04	1.000000000F	870.39	1,037.92	0.00	15.88	15.88
	FEU25OCT					1.192474023					
12,155.19000		08/16/2017		12,155.19	14,226.43	1.000000000F	12,155.19	14,494.75	0.00	268.32	268.32
						1.192474023					
13,025.58000	合計-----			13,025.58	15,248.47		13,025.58	15,532.67	0.00	284.20	284.20
0.00000											
-128,323.85	GBP FORWARD 25 OCT	08/16/2017		-128,323.85	-165,388.27	1.000000000F	-128,323.85	-165,663.95	0.00	-275.68	-275.68
	FGB25OCT					1.290983333					
-11,075.14		08/16/2017		-11,075.14	-14,226.43	1.000000000F	-11,075.14	-14,297.82	0.00	-71.39	-71.39
						1.290983333					

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 2017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)
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
-5,928.00		08/16/2017		-5,928.00	-7,640.30	1.000000000F 1.290983333	-5,928.00	-7,652.95	0.00	-12.65	-12.65
-145,326.99000	合計 -----			-145,326.99	-187,255.00		-145,326.99	-187,614.72	0.00	-359.72	-359.72
0.00000											
9,668,813,600.00	IDR FORWARD 11 OCT	08/29/2017		9,668,813,600.00	722,200.00	1.000000000F	9,668,813,600.00	721,935.32	0.00	-264.68	-264.68
	FID11OCT		IDH			13,392.908333333					
9,727,402,500.00	IDR FORWARD 11 SEP	08/03/2017		9,727,402,500.00	727,500.00	1.000000000F	9,727,402,500.00	728,370.67	0.00	870.67	870.67
	FID11SEP		IDH			13,355.016666667					
-9,727,402,500.00		08/29/2017		-9,727,402,500.00	-728,371.58	1.000000000F	-9,727,402,500.00	-728,370.67	0.00	0.91	0.91
			IDH			13,355.016666667					
0.00000	合計 -----			0.00	-871.58		0.00	0.00	0.00	871.58	871.58
0.00000											
3,934,131.00000	JPY FORWARD 25 OCT	08/16/2017		3,934,131	35,636.48	1.000000000F	3,934,131	35,838.94	0.00	202.46	202.46
	FJP25OCT					109.772533333					
9,817,198,946.16000	非グループ化の有価証券小計			9,817,198,946.16	46,439,391.71		9,817,198,946.16	46,222,446.14	0.00	-216,945.57	-216,945.57
9,817,198,946.16000	先物（ポジション）合計			9,817,198,946.16	46,439,391.71		9,817,198,946.16	46,222,446.14	0.00	-216,945.57	-216,945.57
国債											
地方債											
2,900,000.00000	JPN FIN ORG MUNI	02/11/2016		2,926,636.00	2,926,636.00	98.651000977C 1.000000000	2,860,879.03	2,860,879.03	-65,756.97	0.00	-65,756.97
	2.375 % 02132025										
	BJPN303P XS1185955306										
2,900,000.00000	地方債小計			2,926,636.00	2,926,636.00		2,860,879.03	2,860,879.03	-65,756.97	0.00	-65,756.97

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 2017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											
公募債											
4,400,000.00000	DEV BANK JAPAN 1.875 % 09012026 BJPN304T XS1482752380	08/25/2016		4,360,544.00	4,360,544.00	94.271003723 ^C 1.000000000	4,147,924.16	4,147,924.16	-212,619.84	0.00	-212,619.84
2,450,000.00000	JAPAN BANK COOP 2.375 % 04202026 BJPN304J US471048AT53	04/12/2016		2,515,180.00	2,515,180.00	98.399002075 ^C 1.000000000	2,410,775.55	2,410,775.55	-104,404.45	0.00	-104,404.45
3,800,000.00000	JICA 2.125 % 10202026 BJPN3054 US47109LAA26	10/13/2016		3,575,577.02	3,575,577.02	95.946998596 ^C 1.000000000	3,645,985.95	3,645,985.95	70,408.93	0.00	70,408.93
10,650,000.00000	公募債小計			10,451,301.02	10,451,301.02		10,204,685.66	10,204,685.66	-246,615.36	0.00	-246,615.36
13,550,000.00000	国債合計			13,377,937.02	13,377,937.02		13,065,564.69	13,065,564.69	-312,372.33	0.00	-312,372.33
証拠金勘定											
証拠金勘定											
270,000.00	USD MARGIN USDMAR	08/21/2017		270,000.00	270,000.00	1.000000000 ^S 1.000000000	270,000.00	270,000.00	0.00	0.00	0.00
270,000.00000	証拠金勘定小計			270,000.00	270,000.00		270,000.00	270,000.00	0.00	0.00	0.00
270,000.00000	証拠金勘定合計			270,000.00	270,000.00		270,000.00	270,000.00	0.00	0.00	0.00
9,873,631,281.36000	ポートフォリオ合計			9,873,903,620.12	103,071,872.86		9,875,201,973.69	104,152,128.21	1,298,353.57	-218,098.22	1,080,255.35

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（2017年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約42億円）
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、2017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	69	6,036,118,728.86

（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、2017年9月29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＝112.73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(財政状態計算書)

2017年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	3,192,717,396	359,915,032
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,125,318,818	239,587,190
040	その他の要求払預金	1,067,398,578	120,327,842
050	売買目的で保有される金融資産	32,109,263	3,619,677
060	デリバティブ	32,109,263	3,619,677
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0	0
110	持分証券		
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
140	売却可能金融資産	1,419,712	160,044
150	持分証券	1,419,712	160,044
160	債務証券		
170	ローンおよび貸付金		
180	ローンおよび未収金	2,424,196,102	273,279,627
190	債務証券		
200	ローンおよび貸付金	2,424,196,102	273,279,627
210	満期保有目的投資有価証券	0	0
220	債務証券		
230	ローンおよび貸付金		
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	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		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	1,082,277	122,005
280	有形固定資産	1,082,277	122,005
290	投資不動産		
300	無形資産	3,093,491	348,729
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,093,491	348,729
330	税金資産	128,929	14,534
340	現行税金資産	128,929	14,534
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	25,112,793	2,830,965
370	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		
380	資産合計	5,679,859,963	640,290,614

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(財政状態計算書)

2017年6月30日現在

(単位:米ドル)

負債

		米ドル	千円
010	売買目的で保有される金融負債	31,711,080	3,574,790
020	デリバティブ	31,711,080	3,574,790
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0	0
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	5,442,558,401	613,539,609
120	預金	5,442,558,401	613,539,609
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債		
150	デリバティブ・ヘッジ会計		
160	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		
170	引当金	27,429	3,092
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金	27,429	3,092
240	税金負債	14,035,257	1,582,195
250	現行税金負債	14,035,257	1,582,195
260	繰延税金負債		
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	14,420,622	1,625,637
290	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		
300	負債合計	5,502,752,789	620,325,322

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(財政状態計算書)

2017年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

		米ドル	千円
010	資本	37,117,969	4,184,309
020	払込資本	37,117,969	4,184,309
030	未払込請求資本		
040	株式発行差金		
050	資本を除く発行済みエクイティ商品	0	0
060	複合金融商品のエクイティ部分		
070	その他の発行済みエクイティ商品		
080	その他のエクイティ		
090	その他の累積包括利益	0	0
095	損益に再分類されることがない項目	0	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または (-)損失		
122	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		
124	子会社、合弁会社および関連会社への投資の その他の認識収益および費用の持分		
128	損益に再分類されることがある項目	0	0
130	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ 〔有効部分〕		
160	売却可能金融資産		
170	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		
180	子会社、合弁会社および関連会社への投資の その他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	4,686	528
200	再評価準備金	1,138,480	128,341
210	その他の準備金	124,372,931	14,020,561
220	子会社、合弁会社および関連会社への投資の準備金または 累積損失		
230	その他	124,372,931	14,020,561
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	14,473,107	1,631,553
260	(-)中間配当		
270	少数株主持分〔非支配持分〕	0	0
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	177,107,173	19,965,292
310	資本および負債合計	5,679,859,963	640,290,614

(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

2017年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

		米ドル	千円
010	利息収益	22,701,007	2,559,085
020	売買目的で保有される金融資産	10,741,314	1,210,868
030	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
040	売却可能金融資産		
050	ローンおよび未収金	10,569,959	1,191,551
060	満期保有目的投資有価証券		
070	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	1,389,735	156,665
085	負債に係る利息収益		
090	(支払利息)	6,082,742	685,708
100	(売買目的で保有される金融負債)	137,479	15,498
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	2,406,534	271,289
130	(デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	3,538,728	398,921
145	(資産に係る支払利息)		
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	750,101	84,559
170	売買目的で保有される金融資産		
180	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
190	売却可能金融資産	750,101	84,559
200	受取手数料	52,382,237	5,905,050
210	(支払手数料)	26,119,513	2,944,453
220	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の認識除外に係る利益または(-)損失、純額	(47)	(5)
230	売却可能金融資産	(47)	(5)
240	ローンおよび未収金	0	0
250	満期保有目的投資有価証券	0	0
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額	2,136,055	240,797
290	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または(-)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
310	為替差額〔利益または(-)損失〕、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
340	その他の事業収益	777,555	87,654
350	(その他の事業費用)	1,175,641	132,530
355	事業収益合計、純額	45,369,013	5,114,449

米ドル

千円

360	（管理費用）	24,912,497	2,808,386
370	（従業員費用）	10,246,298	1,155,065
380	（その他の管理費用）	14,666,199	1,653,321
390	（減価償却）	1,239,946	139,779
400	（有形固定資産）	178,145	20,082
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	1,061,801	119,697
430	（引当金または（－）引当金の戻入）	0	0
440	（コミットメントおよび保証）		
450	（その他の引当金）		
460	（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または（－）減損の戻入）	0	0
470	（取得原価で測定される金融資産）		
480	（売却可能金融資産）		
490	（ローンおよび未収金）		
500	（満期保有目的投資証券）		
510	（子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または（－）減損の戻入）		
520	（非金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	0	0
530	（有形固定資産）		
540	（投資不動産）		
550	（営業権）		
560	（その他の無形資産）		
570	（その他）		
580	損益認識されるマイナスの営業権		
590	子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または（－）損失の持分		
600	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利益または（－）損失		
610	継続事業からの税引前利益または（－）損失	19,216,570	2,166,284
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	4,743,463	534,731
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	14,473,107	1,631,553
640	非継続事業からの税引後利益または（－）損失	0	0
650	非継続事業からの税引前利益または（－）損失		
660	（非継続事業に関する税金費用または（－）収入）		
670	当期利益または（－）損失	14,473,107	1,631,553
680	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
690	親会社株主に帰属する金額	14,473,107	1,631,553

[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 (2017年6月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約42億円)

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 (2017年9月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約42億円)

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、2017年9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 = 112.73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

2017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

2017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

（ 2017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	Development Bank of Japan Inc	日本	公債	1.875	2026/ 9 / 1	4,400,000	0.99	4,360,544.00	0.93	4,095,255.89	7.23
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	1.09	3,920,075.96	6.92
3	Fukoku Mutual Life Insurance Co	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	1.04	3,835,039.96	6.77
4	Japan International Cooperation Agency	日本	公債	2.125	2026/10/20	3,800,000	0.94	3,575,577.02	0.95	3,601,450.06	6.36
5	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	1.15	3,464,669.95	6.12
6	Nippon Life Insurance Co	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	2,900,000	1.04	3,005,294.59	1.07	3,097,577.10	5.47
7	NTT Finance Corp	日本	社債	1.9000	2021/ 7 /21	3,150,000	0.99	3,106,054.75	0.98	3,088,480.41	5.45
8	Japan Finance Organization for Municipalities	日本	公債	2.375	2025/ 2 /13	2,900,000	1.01	2,926,636.00	0.98	2,829,820.05	5.00
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	1.07	2,778,151.93	4.91
10	Central Nippon Expressway Co Ltd	日本	社債	2.293	2021/ 4 /23	2,450,000	0.99	2,413,250.00	0.99	2,428,023.42	4.29
11	Japan Bank for International Cooperation/Japan	日本	公債	2.375	2026/ 4 /20	2,450,000	1.03	2,515,180.00	0.97	2,383,605.02	4.21
12	ORIX Corp	日本	社債	2.650	2021/ 4 /13	2,310,000	1.00	2,310,644.63	1.00	2,317,368.91	4.09
13	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	日本	社債	3.850	2026/ 3 / 1	2,050,000	1.10	2,255,225.50	1.05	2,145,755.45	3.79
14	Mizuho Financial Group Cayman 2 Ltd	ケイマン諸島	社債	4.200	2022/ 7 /18	2,000,000	1.00	2,003,038.25	1.05	2,103,340.00	3.71
15	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	4.436	2024/ 4 / 2	1,800,000	1.03	1,861,884.00	1.06	1,912,410.05	3.38
16	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	1.06	1,911,186.04	3.38
17	ORIX Corp	日本	社債	3.950	2027/ 1 /19	1,850,000	1.00	1,849,204.50	1.03	1,907,498.03	3.37
18	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	日本	社債	2.757	2026/ 9 /13	1,950,000	0.94	1,823,679.00	0.96	1,877,362.53	3.32
19	Daiwa Securities Group Inc	日本	社債	3.129	2022/ 4 /19	1,400,000	1.00	1,400,000.00	1.01	1,413,202.01	2.50
20	Toyota Motor Credit Corp	米国	社債	3.300	2022/ 1 /12	890,000	1.04	921,568.10	1.04	924,006.89	1.63

	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	
21	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	2.632	2026/ 7 /14	850,000	1.00	845,784.00	0.95	810,942.49	1.43
22	Nippon Life Insurance Co	日本	社債	4.700 (2026年 1 月以降変動金利)	2046/ 1 /20	770,000	1.09	836,220.00	1.05	806,359.40	1.42
23	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The	日本	社債	4.000 (2026年 7 月以降変動金利)	永久債	630,000	0.98	618,911.01	1.00	627,234.28	1.11
24	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd/The	日本	社債	3.200	2023/ 2 /26	600,000	1.00	599,676.00	1.01	607,195.80	1.07
25	Mizuho Financial Group Inc	日本	社債	4.353	2025/10/20	500,000	1.09	544,515.00	1.05	527,150.00	0.93

投資不動産物件

該当事項なし。（2017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。（2017年 6 月末日現在）

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

（2017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	SUMITOMO LIFE INSUR	日本	社債	4.000 (2027年 9 月以降変動金利)	2077/ 9 /14	4,500,000	1.00	4,491,750.00	0.98	4,428,630.00	7.24
2	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	日本	公債	1.875	2026/ 9 / 1	4,400,000	0.99	4,360,544.00	0.93	4,103,088.00	6.71
3	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	1.08	3,891,780.12	6.36
4	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	1.06	3,886,823.60	6.35
5	JAPAN INT'L COOP AGENCY	日本	公債	2.125	2026/10/20	3,800,000	0.94	3,575,577.02	0.95	3,602,324.00	5.89
6	ORIX CORP	日本	社債	3.950	2027/ 1 /19	3,450,000	1.01	3,498,852.50	1.03	3,546,117.00	5.80
7	MITSUMI 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	1.15	3,443,220.00	5.63
8	NIPPON LIFE INSURANCE	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	2,900,000	1.04	3,005,294.59	1.07	3,098,186.00	5.06
9	KOMATSU FINANCE AMERICA	米国	社債	2.437	2022/ 9 /11	2,950,000	1.00	2,950,000.00	0.99	2,924,718.50	4.78
10	SUMITOMO CORP	日本	社債	2.500	2022/ 9 /13	2,900,000	1.00	2,896,201.00	0.99	2,874,045.00	4.70
11	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	日本	公債	2.375	2025/ 2 /13	2,900,000	1.01	2,926,636.00	0.98	2,834,083.00	4.63

	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	
12	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	1.07	2,780,205.99	4.54
13	JPN BANK FOR INT'L COOP	日本	公債	2.375	2026/ 4 /20	2,450,000	1.03	2,515,180.00	0.97	2,388,113.00	3.90
14	MITSUBISHI UFJ FIN GRP	日本	社債	3.850	2026/ 3 / 1	2,050,000	1.10	2,255,225.50	1.04	2,139,503.00	3.50
15	SUMITOMO MITSUI FINL GRP	日本	社債	3.364	2027/ 7 /12	1,900,000	1.01	1,927,037.00	1.01	1,913,680.00	3.13
16	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	1.06	1,908,216.02	3.12
17	SUMITOMO MITSUI FINANCIA	日本	社債	4.436	2024/ 4 / 2	1,800,000	1.03	1,861,884.00	1.06	1,905,498.00	3.11
18	MITSUBISHI UFJ FIN GRP	日本	社債	2.757	2026/ 9 /13	1,950,000	0.94	1,823,679.00	0.96	1,877,908.50	3.07
19	DAIWA SECURITIES GROUP	日本	社債	3.129	2022/ 4 /19	1,400,000	1.00	1,400,000.00	1.01	1,417,234.00	2.32
20	NIPPON LIFE INSURANCE	日本	社債	4.700 (2026年 1 月 以降変動金利)	2046/ 1 /20	770,000	1.09	836,220.00	1.05	807,206.40	1.32
21	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	4.000 (2026年 7 月 以降変動金利)	永久債	630,000	0.98	618,911.01	0.99	626,377.50	1.02
22	MIZUHO FINANCIAL GROUP	日本	社債	4.353	2025/10/20	500,000	1.09	544,515.00	1.05	526,385.00	0.86
23	MIZUHO FIN GRP CAYMAN 2	ケイマン 諸島	社債	4.200	2022/ 7 /18	500,000	1.00	500,759.56	1.05	523,970.00	0.86

投資不動産物件

該当事項なし。（2017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。（2017年 9 月末日現在）