

## 【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30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】 デュプティ・マネージング・ディレクター 小林 央明

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健  
同 下瀬 伸彦

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健  
同 下瀬 伸彦  
同 大西 信治

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

【電話番号】 03(6212)8316

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

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】 米ドルヘッジクラス：  
10億アメリカ合衆国ドル(約1,105億4,000万円)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1,105億4,000万円)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1,105億4,000万円)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1,105億4,000万円)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、2018年6月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧  
客電信売買相場の仲値(1米ドル=110.54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、2018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、さらに、信用リスクの管理に係る投資制限を追加するため、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<br>第1<br>5<br>ファンド情報<br>ファンドの状況<br>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<br>または<br>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<br>1<br>ファンドの経理状況<br>財務諸表                 |                  | 3 ファンドの経理状況  |                  | 追加              |
| 第三部<br>第1<br>1<br>特別情報<br>管理会社の概況<br>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

（2018年9月末日現在）

| 資産の種類                | 地域名    | 時価合計<br>(アメリカ合衆国ドル)          | 投資比率(%) |
|----------------------|--------|------------------------------|---------|
| 社債                   | 日本     | 14,421,837.15                | 69.45   |
|                      | ケイマン諸島 | 814,681.82                   | 3.92    |
|                      | 小計     | 15,236,518.97                | 73.37   |
| 公債                   | 日本     | 3,885,968.20                 | 18.71   |
|                      | 小計     | 3,885,968.20                 | 18.71   |
| 小計                   |        | 19,122,487.17                | 92.09   |
| 現金・その他の資産<br>(負債控除後) |        | 1,642,854.85                 | 7.91    |
| 合計(純資産総額)            |        | 20,765,342.02<br>(約2,358百万円) | 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、2018年9月28日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝113.57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

2018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。

## &lt; 米ドルヘッジクラス &gt;

|            | 純資産総額         |           | １口当たり純資産価格 |        |
|------------|---------------|-----------|------------|--------|
|            | 米ドル           | 千円        | 米ドル        | 円      |
| 2017年10月末日 | 10,269,358.01 | 1,166,291 | 110.85     | 12,589 |
| 11月末日      | 10,178,568.50 | 1,155,980 | 110.47     | 12,546 |
| 12月末日      | 9,980,379.64  | 1,133,472 | 110.16     | 12,511 |
| 2018年１月末日  | 8,791,694.49  | 998,473   | 108.88     | 12,366 |
| ２月末日       | 8,777,827.32  | 996,898   | 107.55     | 12,214 |
| ３月末日       | 8,921,933.51  | 1,013,264 | 107.38     | 12,195 |
| ４月末日       | 8,758,330.16  | 994,684   | 106.32     | 12,075 |
| ５月末日       | 8,672,371.70  | 984,921   | 106.28     | 12,070 |
| ６月末日       | 8,596,440.78  | 976,298   | 106.11     | 12,051 |
| ７月末日       | 8,284,369.14  | 940,856   | 106.03     | 12,042 |
| ８月末日       | 8,211,250.37  | 932,552   | 106.39     | 12,083 |
| ９月末日       | 8,089,663.27  | 918,743   | 105.58     | 11,991 |

## &lt; ブラジル・レアルヘッジクラス &gt;

|            | 純資産総額         |           | １口当たり純資産価格 |       |
|------------|---------------|-----------|------------|-------|
|            | 米ドル           | 千円        | 米ドル        | 円     |
| 2017年10月末日 | 47,909,003.96 | 5,441,026 | 31.72      | 3,602 |
| 11月末日      | 46,916,944.08 | 5,328,357 | 31.19      | 3,542 |
| 12月末日      | 15,200,167.85 | 1,726,283 | 30.39      | 3,451 |
| 2018年１月末日  | 17,110,445.04 | 1,943,233 | 31.03      | 3,524 |
| ２月末日       | 17,006,322.42 | 1,931,408 | 29.52      | 3,353 |
| ３月末日       | 16,939,812.62 | 1,923,855 | 28.32      | 3,216 |
| ４月末日       | 16,049,441.16 | 1,822,735 | 26.38      | 2,996 |
| ５月末日       | 14,808,049.91 | 1,681,750 | 24.36      | 2,767 |
| ６月末日       | 13,708,289.53 | 1,556,850 | 23.14      | 2,628 |
| ７月末日       | 13,614,631.98 | 1,546,214 | 23.27      | 2,643 |
| ８月末日       | 12,007,124.30 | 1,363,649 | 20.62      | 2,342 |
| ９月末日       | 12,184,408.85 | 1,383,783 | 21.01      | 2,386 |

## &lt; 中国元ヘッジクラス &gt;

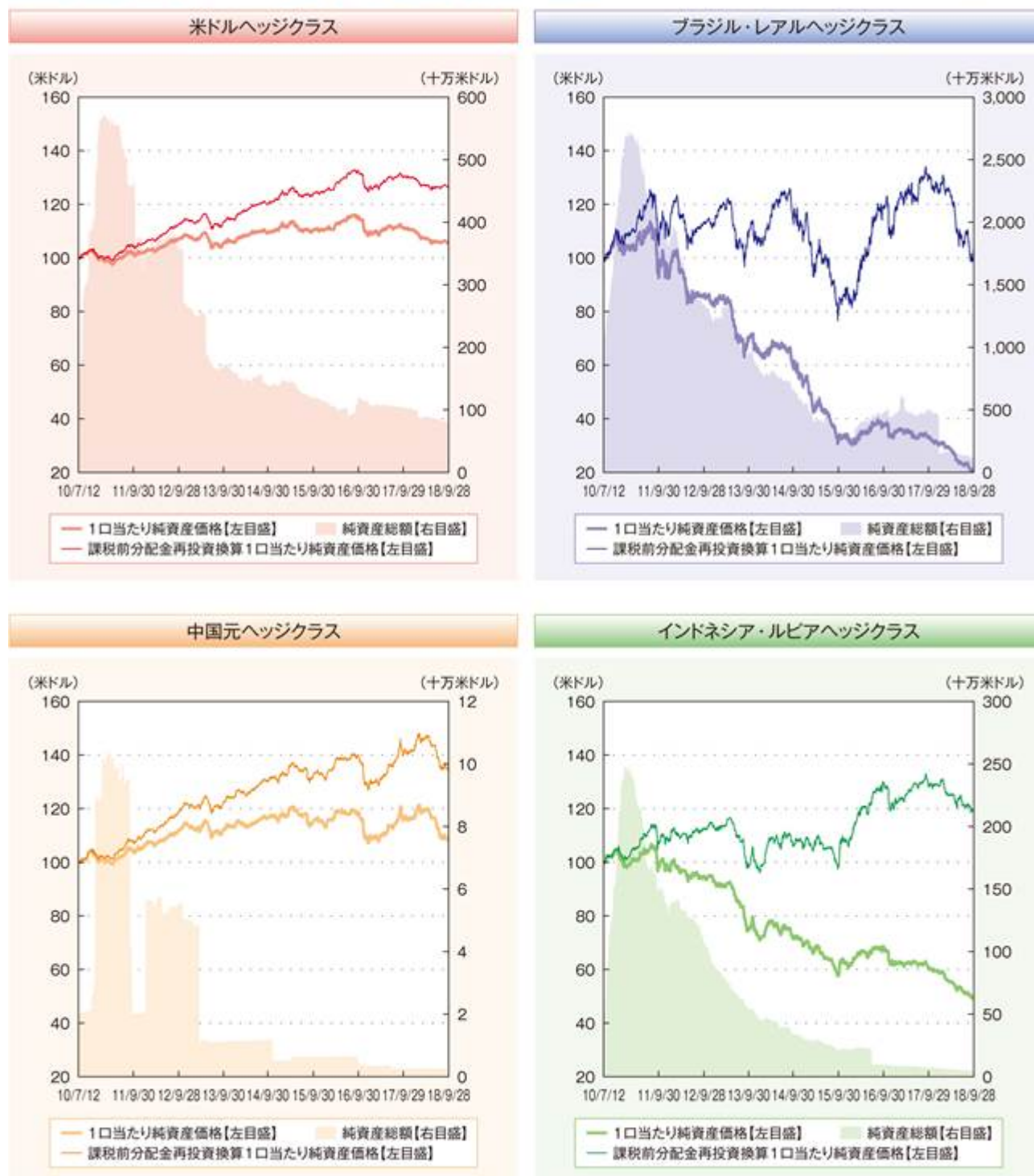
|             | 純資産総額     |       | １口当たり純資産価格 |        |
|-------------|-----------|-------|------------|--------|
|             | 米ドル       | 千円    | 米ドル        | 円      |
| 2017年10月末日  | 26,084.29 | 2,962 | 115.93     | 13,166 |
| 11月末日       | 26,183.14 | 2,974 | 116.37     | 13,216 |
| 12月末日       | 26,491.64 | 3,009 | 117.74     | 13,372 |
| 2018年 1 月末日 | 27,250.19 | 3,095 | 121.11     | 13,754 |
| 2 月末日       | 26,785.62 | 3,042 | 119.05     | 13,521 |
| 3 月末日       | 26,985.59 | 3,065 | 119.94     | 13,622 |
| 4 月末日       | 26,554.61 | 3,016 | 118.02     | 13,404 |
| 5 月末日       | 26,281.66 | 2,985 | 116.81     | 13,266 |
| 6 月末日       | 25,380.52 | 2,882 | 112.80     | 12,811 |
| 7 月末日       | 24,636.34 | 2,798 | 109.49     | 12,435 |
| 8 月末日       | 24,674.03 | 2,802 | 109.66     | 12,454 |
| 9 月末日       | 24,365.59 | 2,767 | 108.29     | 12,298 |

## &lt; インドネシア・ルピアヘッジクラス &gt;

|             | 純資産総額      |        | １口当たり純資産価格 |       |
|-------------|------------|--------|------------|-------|
|             | 米ドル        | 千円     | 米ドル        | 円     |
| 2017年10月末日  | 703,900.76 | 79,942 | 59.70      | 6,780 |
| 11月末日       | 700,885.01 | 79,600 | 59.45      | 6,752 |
| 12月末日       | 634,379.48 | 72,046 | 58.79      | 6,677 |
| 2018年 1 月末日 | 632,178.69 | 71,797 | 58.59      | 6,654 |
| 2 月末日       | 603,409.99 | 68,529 | 55.92      | 6,351 |
| 3 月末日       | 597,826.04 | 67,895 | 55.41      | 6,293 |
| 4 月末日       | 567,098.96 | 64,405 | 53.91      | 6,123 |
| 5 月末日       | 563,371.91 | 63,982 | 53.55      | 6,082 |
| 6 月末日       | 546,861.89 | 62,107 | 51.98      | 5,903 |
| 7 月末日       | 494,883.20 | 56,204 | 51.42      | 5,840 |
| 8 月末日       | 484,421.21 | 55,016 | 50.33      | 5,716 |
| 9 月末日       | 466,904.31 | 53,026 | 49.28      | 5,597 |

## &lt; 参考情報 &gt;

## 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～2018年9月末日）



（注１）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。

（注２）ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではない。以下同じ。

## 分配の推移

2018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。

## &lt;米ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | １口当たり分配金 |     |
|----------------------|----------|-----|
|                      | 米ドル      | 円   |
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | 2.40     | 273 |

## &lt;ブラジル・レアルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | １口当たり分配金 |     |
|----------------------|----------|-----|
|                      | 米ドル      | 円   |
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | 6.00     | 681 |

## &lt;中国元ヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | １口当たり分配金 |     |
|----------------------|----------|-----|
|                      | 米ドル      | 円   |
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | 3.00     | 341 |

## &lt;インドネシア・ルピアヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | １口当たり分配金 |     |
|----------------------|----------|-----|
|                      | 米ドル      | 円   |
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | 7.20     | 818 |

## &lt; 参考情報 &gt;

## 分配の推移（2018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4会計年度<br>(2013年3月1日～2014年2月28日) | 2.40  |
| 第5会計年度<br>(2014年3月1日～2015年2月28日) | 2.40  |
| 第6会計年度<br>(2015年3月1日～2016年2月29日) | 2.40  |
| 第7会計年度<br>(2016年3月1日～2017年2月28日) | 2.40  |
| 第8会計年度<br>(2017年3月1日～2018年2月28日) | 2.40  |
| 2018年5月                          | 0.20  |
| 2018年6月                          | 0.20  |
| 2018年7月                          | 0.20  |
| 2018年8月                          | 0.20  |
| 2018年9月                          | 0.20  |
| 直近1年間累計                          | 2.40  |
| 設定来累計                            | 19.40 |

| ブラジル・レアルヘッジクラス                   |       |
|----------------------------------|-------|
| 第4会計年度<br>(2013年3月1日～2014年2月28日) | 13.80 |
| 第5会計年度<br>(2014年3月1日～2015年2月28日) | 13.80 |
| 第6会計年度<br>(2015年3月1日～2016年2月29日) | 9.80  |
| 第7会計年度<br>(2016年3月1日～2017年2月28日) | 7.80  |
| 第8会計年度<br>(2017年3月1日～2018年2月28日) | 7.05  |
| 2018年5月                          | 0.50  |
| 2018年6月                          | 0.50  |
| 2018年7月                          | 0.50  |
| 2018年8月                          | 0.50  |
| 2018年9月                          | 0.50  |
| 直近1年間累計                          | 6.00  |
| 設定来累計                            | 88.25 |

| 中国元ヘッジクラス                        |       |
|----------------------------------|-------|
| 第4会計年度<br>(2013年3月1日～2014年2月28日) | 3.00  |
| 第5会計年度<br>(2014年3月1日～2015年2月28日) | 3.00  |
| 第6会計年度<br>(2015年3月1日～2016年2月29日) | 3.00  |
| 第7会計年度<br>(2016年3月1日～2017年2月28日) | 3.00  |
| 第8会計年度<br>(2017年3月1日～2018年2月28日) | 3.00  |
| 2018年5月                          | 0.25  |
| 2018年6月                          | 0.25  |
| 2018年7月                          | 0.25  |
| 2018年8月                          | 0.25  |
| 2018年9月                          | 0.25  |
| 直近1年間累計                          | 3.00  |
| 設定来累計                            | 24.25 |

| インドネシア・ルピアヘッジクラス                 |       |
|----------------------------------|-------|
| 第4会計年度<br>(2013年3月1日～2014年2月28日) | 9.00  |
| 第5会計年度<br>(2014年3月1日～2015年2月28日) | 9.00  |
| 第6会計年度<br>(2015年3月1日～2016年2月29日) | 8.25  |
| 第7会計年度<br>(2016年3月1日～2017年2月28日) | 7.20  |
| 第8会計年度<br>(2017年3月1日～2018年2月28日) | 7.20  |
| 2018年5月                          | 0.60  |
| 2018年6月                          | 0.60  |
| 2018年7月                          | 0.60  |
| 2018年8月                          | 0.60  |
| 2018年9月                          | 0.60  |
| 直近1年間累計                          | 7.20  |
| 設定来累計                            | 65.85 |

## 収益率の推移

## &lt;米ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 収益率（注）  |
|----------------------|---------|
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | - 2.86% |

（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

## &lt;ブラジル・レアルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 収益率（注）   |
|----------------------|----------|
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | - 18.32% |

（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

## &lt;中国元ヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 収益率（注）  |
|----------------------|---------|
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | - 4.23% |

（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

## &lt;インドネシア・ルピアヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 収益率（注）  |
|----------------------|---------|
| 2017年10月１日～2018年９月末日 | - 6.95% |

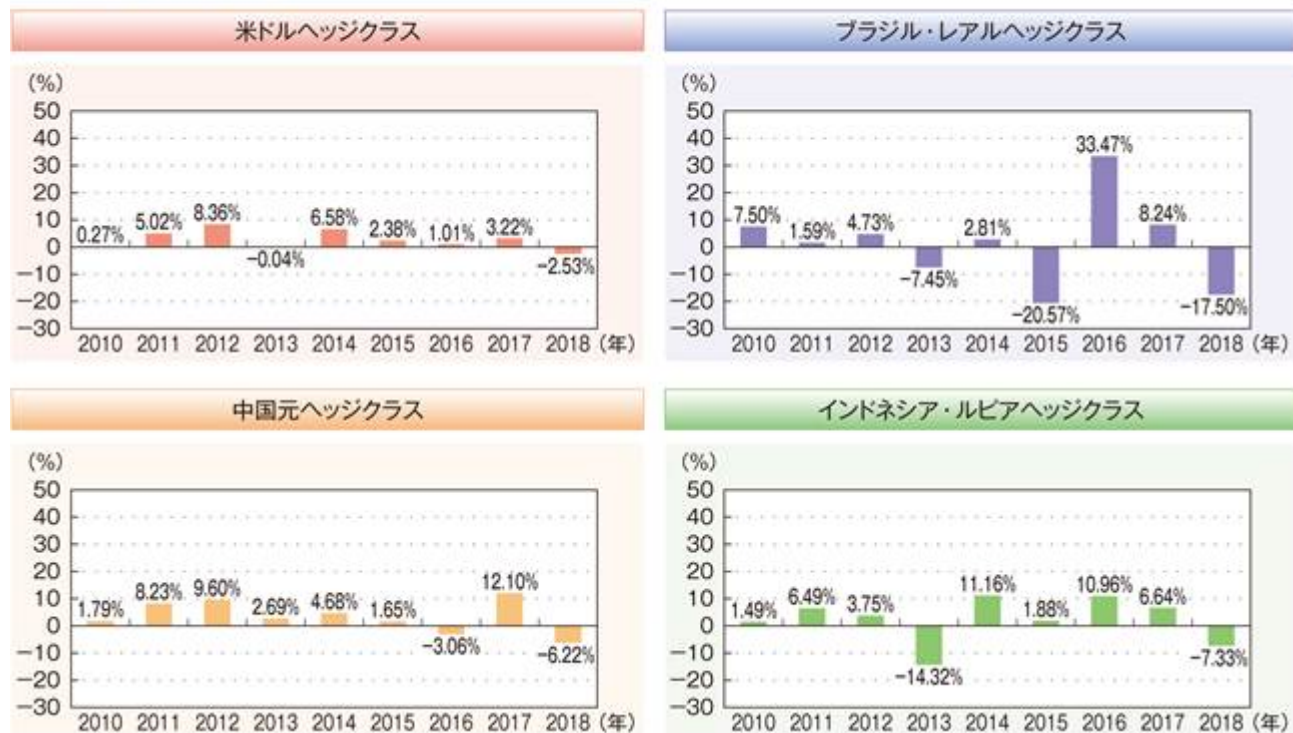
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

## &lt; 参考情報 &gt;

## 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、2018年については2018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。2018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

2018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2018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              |
|------------------|--------------------|--------------------|
| 6,745<br>(6,745) | 23,591<br>(23,591) | 76,623<br>(76,623) |

### <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                |
|----------------------|--------------------------|----------------------|
| 176,150<br>(176,150) | 1,109,537<br>(1,109,537) | 579,907<br>(579,907) |

### <中国元ヘッジクラス>

| 販売口数     | 買戻口数     | 発行済口数        |
|----------|----------|--------------|
| 0<br>(0) | 0<br>(0) | 225<br>(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<br>(0) | 2,315<br>(2,315) | 9,475<br>(9,475) |

（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ＵＦＪ銀行の2018年9月28日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝113.57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

2018年 8 月31日現在

|                    | 米ドル            | 千円        |
|--------------------|----------------|-----------|
| 資産                 |                |           |
| 現金                 | 1,231,092.01   | 139,815   |
| 銀行預金 - 基準通貨        | 1,172,255.97   | 133,133   |
| 銀行預金 - 外国通貨        | 58,836.04      | 6,682     |
| ブローカーが保有する現金       | 650,000.00     | 73,821    |
| ブローカーが保有する現金 - 米ドル | 650,000.00     | 73,821    |
| 有価証券（取得原価）         | 20,097,527.05  | 2,282,476 |
| 債券（取得原価）           | 20,097,527.05  | 2,282,476 |
| 未実現評価損益            | (1,350,317.05) | (153,356) |
| 未実現時価評価損益          | (430,922.52)   | (48,940)  |
| 未実現通貨運用損益          | (919,394.53)   | (104,416) |
| 未収収益               | 237,114.35     | 26,929    |
| 現金に係る未収利息          | 1,092.88       | 124       |
| 債券に係る未収利息          | 236,021.47     | 26,805    |
| 投資有価証券売却未収金        | 207,376.67     | 23,552    |
| 投資有価証券売却未収金        | 207,376.67     | 23,552    |
| 資本証券               | 172,465.20     | 19,587    |
| 受益証券販売未収金          | 172,465.20     | 19,587    |
| 資産合計：              | 21,245,258.23  | 2,412,824 |

2018年 8 月31日現在

|                       |                | 米ドル            | 千円         |
|-----------------------|----------------|----------------|------------|
| <b>負債</b>             |                |                |            |
| 投資有価証券購入未払金           |                | 298,611.00     | 33,913     |
| 投資有価証券購入未払金           |                | 298,611.00     | 33,913     |
| 資本証券                  |                | 35,245.44      | 4,003      |
| 受益証券買戻未払金             |                | 35,245.44      | 4,003      |
| 未払費用                  |                | 89,296.69      | 10,141     |
| 未払監査費用                |                | 33,909.07      | 3,851      |
| 未払保管報酬                |                | 4,712.60       | 535        |
| 未払報告書作成費用             |                | 865.55         | 98         |
| 未払投資顧問報酬              |                | 26,365.08      | 2,994      |
| 未払受託報酬                |                | 1,785.50       | 203        |
| 未払代行協会員報酬             |                | 1,884.45       | 214        |
| 未払販売報酬                |                | 18,832.01      | 2,139      |
| 未払副管理報酬               |                | 942.43         | 107        |
| 負債合計：                 |                | 423,153.13     | 48,058     |
| <b>資本</b>             |                |                |            |
| ファンド受益証券              |                | 122,341,229.15 | 13,894,293 |
| 発行済ファンド受益証券<br>（額面価額） |                | 66,924,900.00  | 7,600,661  |
| ブラジル・リアル              | 58,222,100.00  | 6,612,284      |            |
| インドネシア・ルピア            | 962,500.00     | 109,311        |            |
| 中国元                   | 22,500.00      | 2,555          |            |
| 米ドル                   | 7,717,800.00   | 876,511        |            |
| 受益証券額面超過額             |                | 55,416,329.15  | 6,293,633  |
| ブラジル・リアル              | 54,875,633.26  | 6,232,226      |            |
| インドネシア・ルピア            | 2,589,231.64   | 294,059        |            |
| 中国元                   | (61,682.00)    | (7,005)        |            |
| 米ドル                   | (1,986,853.75) | (225,647)      |            |

2018年８月31日現在

|                 | 米ドル              | 千円           |
|-----------------|------------------|--------------|
| 分配金支払額          | (135,403,718.35) | (15,377,800) |
| 配当金支払額          | (135,403,718.35) | (15,377,800) |
| ブラジル・リアル        | (126,495,341.85) | (14,366,076) |
| インドネシア・ルピア      | (4,896,311.70)   | (556,074)    |
| 中国元             | (52,219.00)      | (5,931)      |
| 米ドル             | (3,959,845.80)   | (449,720)    |
| 利益剰余金           | 37,324,681.61    | 4,238,964    |
| 利益剰余金           | 37,324,681.61    | 4,238,964    |
| ブラジル・リアル        | (38,856,925.17)  | (4,412,981)  |
| インドネシア・ルピア      | 2,005,284.59     | 227,740      |
| 中国元             | 357,720.09       | 40,626       |
| 米ドル             | 22,679,052.50    | 2,575,660    |
| 中間純利益           | (3,440,087.31)   | (390,691)    |
| 資本合計：           | 20,822,105.10    | 2,364,766    |
| 負債および資本合計       | 21,245,258.23    | 2,412,824    |
| 純資産額合計          | 20,822,105.10    | 2,364,766    |
| 発行済受益証券総数       | 669,249.00000口   |              |
| 受益証券１口当たり純資産額合計 | 31.11            | 3,533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

2018年３月１日から2018年８月31日までの期間

|             | 米ドル            | 千円        |
|-------------|----------------|-----------|
| 収益          |                |           |
| 実現損益        | (2,633,431.28) | (299,079) |
| 為替取引に係る実現利益 | 996,359.92     | 113,157   |
| ブラジル・リアル    | 961,591.88     | 109,208   |
| インドネシア・ルピア  | 20,390.36      | 2,316     |
| 中国元         | 1,164.01       | 132       |
| 為替取引に係る実現損失 | (3,420,084.62) | (388,419) |
| ブラジル・リアル    | (3,366,241.41) | (382,304) |
| インドネシア・ルピア  | (37,738.96)    | (4,286)   |
| 中国元         | (2,120.31)     | (241)     |
| 市場に係る実現利益   | 36,603.57      | 4,157     |
| 市場に係る実現損失   | (244,466.27)   | (27,764)  |
| 通貨に係る実現利益   | 615.93         | 70        |
| ブラジル・リアル    | 0.01           | 0         |
| インドネシア・ルピア  | 0.02           | 0         |
| 中国元         | 0.01           | 0         |
| 通貨に係る実現損失   | (2,459.81)     | (279)     |
| ブラジル・リアル    | (0.01)         | (0)       |
| インドネシア・ルピア  | (0.01)         | (0)       |
| 中国元         | (0.01)         | (0)       |
| 受取利息        | 476,185.72     | 54,080    |
| 現金に係る受取利息   | 10,757.02      | 1,222     |
| 債券に係る受取利息   | 465,428.70     | 52,859    |

2018年３月１日から2018年８月31日までの期間

|            | 米ドル            | 千円        |
|------------|----------------|-----------|
| 未実現評価損益    | (1,085,054.45) | (123,230) |
| 未実現時価評価損益  | (92,733.78)    | (10,532)  |
| 未実現通貨運用損益  | (992,320.67)   | (112,698) |
| ブラジル・リアル   | (986,551.46)   | (112,043) |
| インドネシア・ルピア | (10,710.39)    | (1,216)   |
| 中国元        | (800.52)       | (91)      |
| 収益合計：      | (3,242,300.01) | (368,228) |
| 費用         |                |           |
| 費用 - 報酬    | 197,663.66     | 22,449    |
| 監査費用       | 15,294.08      | 1,737     |
| 保管報酬       | 15,144.14      | 1,720     |
| 報告書作成費用    | 921.75         | 105       |
| 弁護士費用      | 2,201.84       | 250       |
| 投資顧問報酬     | 84,806.34      | 9,631     |
| 受託報酬       | 5,168.84       | 587       |
| 現金支出費用     | 2,727.04       | 310       |
| 代行協会員報酬    | 6,057.61       | 688       |
| 販売報酬       | 60,575.82      | 6,880     |
| 副保管報酬      | 1,737.41       | 197       |
| 副管理報酬      | 3,028.79       | 344       |
| 支払利息       | 123.64         | 14        |
| 当座借越利息     | 123.64         | 14        |
| 費用合計：      | 197,787.30     | 22,463    |
| 投資純利益      | (3,440,087.31) | (390,691) |

[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 2018年 8 月31日現在

| 口数 / 金額                   | 種類                                                        | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注 1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注 2)<br>(米ドル) | 基準価格                                      | 価額<br>(表示通貨)<br>(注 1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注 2)<br>(米ドル) | 市場<br>(米ドル) | 未実現損益<br>通貨<br>(米ドル) | 合計<br>(米ドル) |
|---------------------------|-----------------------------------------------------------|------------|-------------------|-------------------------|----------------------------------|-------------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------|----------------------|-------------|
| <b>社債</b>                 |                                                           |            |                   |                         |                                  |                                           |                       |                                |             |                      |             |
| <b>固定利率から変動利率に転換される社債</b> |                                                           |            |                   |                         |                                  |                                           |                       |                                |             |                      |             |
| 550,000.00000             | DAI-ICHI LIFE<br>FRN PERP/CALL<br>BJPN3050 USJ09748AD66   | 10/6/2016  |                   | 541,151.26              | 541,151.26                       | 94.484000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 519,662.00            | 519,662.00                     | -21,489.26  | 0.00                 | -21,489.26  |
| 970,000.00000             | DAI-ICHI MUTUAL<br>FRN PERP/CALL<br>BJPN303K US23380YAC12 | 10/23/2014 |                   | 970,000.00              | 970,000.00                       | 102.124000549 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 990,602.81            | 990,602.81                     | 20,602.81   | 0.00                 | 20,602.81   |
| 1,320,000.00000           | FUKOKU MUTUAL<br>FRN PERP/CALL<br>BJPN3042 XS1262602532   | 7/22/2015  |                   | 1,324,999.46            | 1,324,999.46                     | 99.997001648 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 1,319,960.42          | 1,319,960.42                   | -5,039.04   | 0.00                 | -5,039.04   |
| 1,040,000.00000           | NIPPON LIFE INS<br>FRN 01202046<br>BJPN304Z USJ54675AC78  | 10/6/2016  |                   | 1,090,953.41            | 1,090,953.41                     | 99.463000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 1,034,415.20          | 1,034,415.20                   | -56,538.21  | 0.00                 | -56,538.21  |
| 1,750,000.00000           | SUMITOMO LIFE<br>FRN 09142077<br>BJPN305V USJ77549AC73    | 9/7/2017   |                   | 1,746,791.67            | 1,746,791.67                     | 94.040000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 1,645,700.00          | 1,645,700.00                   | -101,091.67 | 0.00                 | -101,091.67 |
| 5,630,000.00000           | 固定利率から変動利率に転換される社債小計                                      |            |                   | 5,673,895.80            | 5,673,895.80                     |                                           | 5,510,340.43          | 5,510,340.43                   | -163,555.37 | 0.00                 | -163,555.37 |
| <b>変動利率</b>               |                                                           |            |                   |                         |                                  |                                           |                       |                                |             |                      |             |
| 1,300,000.00000           | mitsui SUMITOMO<br>FRN 03152072<br>BJPN3013 USJ45174AF61  | 3/9/2012   |                   | 1,352,350.80            | 1,352,350.80                     | 108.700000000 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 1,413,100.00          | 1,413,100.00                   | 60,749.20   | 0.00                 | 60,749.20   |
| 600,000.00000             | NIPPON LIFE INS<br>FRN 10182042<br>BJPN301S USJ54675AA13  | 10/24/2012 |                   | 621,785.08              | 621,785.08                       | 102.685000000 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 616,110.00            | 616,110.00                     | -5,675.08   | 0.00                 | -5,675.08   |

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 2018年 8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類                                                            | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 基準価格                                      | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 市場<br>(米ドル) | 未実現損益<br>通貨<br>(米ドル) | 合計<br>(米ドル) |
|-----------------|---------------------------------------------------------------|------------|-------------------|------------------------|---------------------------------|-------------------------------------------|----------------------|-------------------------------|-------------|----------------------|-------------|
| <b>社債</b>       |                                                               |            |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| <b>変動利率</b>     |                                                               |            |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| 1,420,000.00000 | SOMPO JAPAN INS<br>FRN 03282073<br>BJPN302D USJ7620TAB73      | 3/22/2013  |                   | 1,426,532.82           | 1,426,532.82                    | 103.959999084 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 1,476,231.99         | 1,476,231.99                  | 49,699.17   | 0.00                 | 49,699.17   |
| 3,320,000.00000 | 変動利率小計                                                        |            |                   | 3,400,668.70           | 3,400,668.70                    |                                           | 3,505,441.99         | 3,505,441.99                  | 104,773.29  | 0.00                 | 104,773.29  |
| <b>公募債</b>      |                                                               |            |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| 1,030,000.00000 | MITSUB UFJ FIN<br>2.757 % 09132026<br>BJPN305C US606822AJ33   | 2/10/2017  |                   | 964,674.23             | 964,674.23                      | 92.338000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 951,081.40           | 951,081.40                    | -13,592.83  | 0.00                 | -13,592.83  |
| 720,000.00000   | MITSUB UFJ FIN G<br>3.85 % 03012026<br>BJPN304L US606822AD62  | 8/12/2016  |                   | 792,079.20             | 792,079.20                      | 99.815000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 718,668.00           | 718,668.00                    | -73,411.20  | 0.00                 | -73,411.20  |
| 810,000.00000   | MIZUHO FIN GROUP<br>4.6 % 03272024<br>BCYM058L USG6180BAB39   | 3/20/2014  |                   | 820,859.40             | 820,859.40                      | 101.803001404 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 824,604.31           | 824,604.31                    | 3,744.91    | 0.00                 | 3,744.91    |
| 220,000.00000   | MIZUHO FINANCIAL<br>4.353 % 10202025<br>BJPN304W USJ4599LAH53 | 9/14/2016  |                   | 239,586.60             | 239,586.60                      | 100.489000000 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 221,075.80           | 221,075.80                    | -18,510.80  | 0.00                 | -18,510.80  |
| 690,000.00000   | MIZUHO FINANCIAL<br>3.17 % 09112027<br>BJPN305Z US60687YAM12  | 12/18/2017 |                   | 672,481.80             | 672,481.80                      | 94.298000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 650,656.20           | 650,656.20                    | -21,825.60  | 0.00                 | -21,825.60  |
| 1,550,000.00000 | ORIX CORP<br>3.95 % 01192027<br>BJPN305B XS1527515321         | 2/10/2017  |                   | 1,571,948.22           | 1,571,948.22                    | 99.249000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 1,538,359.50         | 1,538,359.50                  | -33,588.72  | 0.00                 | -33,588.72  |
| 530,000.00000   | SUMITOMO MITSUI<br>4.436 % 04022024<br>BJPN3030 USJ7771XAB58  | 6/18/2015  |                   | 545,769.65             | 545,769.65                      | 101.171000000 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 536,206.30           | 536,206.30                    | -9,563.35   | 0.00                 | -9,563.35   |

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。

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 2018年 8月31日現在

| 口数 / 金額            | 種類                                                           | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 基準価格                                      | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 市場<br>(米ドル) | 未実現損益<br>通貨<br>(米ドル) | 合計<br>(米ドル) |
|--------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|-------------------|------------------------|---------------------------------|-------------------------------------------|----------------------|-------------------------------|-------------|----------------------|-------------|
| <b>社債</b>          |                                                              |           |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| <b>公募債</b>         |                                                              |           |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| 850,000.00000      | SUMITOMO MITSUI<br>3.364 % 07122027<br>BJPN305T US86562MAR16 | 8/14/2017 |                   | 862,095.50             | 862,095.50                      | 96.155000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 817,317.50           | 817,317.50                    | -44,778.00  | 0.00                 | -44,778.00  |
| 280,000.00000      | SUMITOMO MITSUI<br>3.544 % 01172028<br>BJPN3063 US86562MAY66 | 1/30/2018 |                   | 276,976.00             | 276,976.00                      | 97.367000000 <sup>C</sup><br>1.000000000  | 272,627.60           | 272,627.60                    | -4,348.40   | 0.00                 | -4,348.40   |
| 6,680,000.00000    | 公募債小計                                                        |           |                   | 6,746,470.60           | 6,746,470.60                    |                                           | 6,530,596.61         | 6,530,596.61                  | -215,873.99 | 0.00                 | -215,873.99 |
| 15,630,000.00000   | 社債合計                                                         |           |                   | 15,821,035.10          | 15,821,035.10                   |                                           | 15,546,379.03        | 15,546,379.03                 | -274,656.07 | 0.00                 | -274,656.07 |
| <b>外貨建現金勘定</b>     |                                                              |           |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| <b>非グループ化の有価証券</b> |                                                              |           |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| 1,904.63           | BRITISH POUND<br>GBP                                         | MultiLot  |                   | 1,904.63               | 2,497.63                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>1.299750000   | 1,904.63             | 2,475.54                      | 0.00        | -22.09               | -22.09      |
| 26,637.17000       | EURO<br>EUR                                                  | 7/23/2018 |                   | 26,637.17              | 31,177.48                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>1.163500000   | 26,637.17            | 30,992.35                     | 0.00        | -185.13              | -185.13     |
| 2,797,596.00000    | JAPANESE YEN<br>JPY                                          | MultiLot  |                   | 2,797,596              | 25,160.93                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>110.885000000 | 2,797,596            | 25,229.71                     | 0.00        | 68.78                | 68.78       |
| 2,826,137.80000    | 非グループ化の有価証券小計                                                |           |                   | 2,826,137.80           | 58,836.04                       |                                           | 2,826,137.80         | 58,697.60                     | 0.00        | -138.44              | -138.44     |
| 2,826,137.80000    | 外貨建現金勘定合計                                                    |           |                   | 2,826,137.80           | 58,836.04                       |                                           | 2,826,137.80         | 58,697.60                     | 0.00        | -138.44              | -138.44     |
| <b>先物（ポジション）</b>   |                                                              |           |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| <b>非グループ化の有価証券</b> |                                                              |           |                   |                        |                                 |                                           |                      |                               |             |                      |             |
| 51,491,559.36000   | BRL FORWARD 12 SEP<br>FBR12SEP                               | 7/10/2018 |                   | 51,491,559.36          | 13,338,400.00                   | 1.000000000 <sup>F</sup><br>4.125540000   | 51,491,559.36        | 12,481,168.37                 | 0.00        | -857,231.63          | -857,231.63 |
| -2,264,000.00000   | BRL FORWARD 12 SEP<br>FBR12SEP                               | 8/17/2018 |                   | -2,264,000.00          | -573,483.97                     | 1.000000000 <sup>F</sup><br>4.125540000   | -2,264,000.00        | -548,776.64                   | 0.00        | 24,707.33            | 24,707.33   |
| 170,470.67         | CNY FORWARD 12 SEP<br>FCN12SEP                               | 7/10/2018 |                   | 170,470.67             | 25,700.00                       | 1.000000000 <sup>F</sup><br>6.829620000   | 170,470.67           | 24,960.49                     | 0.00        | -739.51              | -739.51     |

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 2018年 8月31日現在

| 口数／金額               | 種類                                                                           | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 基準価格                             | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 市場<br>(米ドル) | 未実現損益<br>通貨<br>(米ドル) | 合計<br>(米ドル) |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------|-----------|-------------------|------------------------|---------------------------------|----------------------------------|----------------------|-------------------------------|-------------|----------------------|-------------|
| <b>先物（ポジション）</b>    |                                                                              |           |                   |                        |                                 |                                  |                      |                               |             |                      |             |
| <b>非グループ化の有価証券</b>  |                                                                              |           |                   |                        |                                 |                                  |                      |                               |             |                      |             |
| -33,947.52000       | EUR FORWARD 26 SEP<br>FEU26SEP                                               | 7/5/2018  |                   | -33,947.52             | -39,914.48                      | 1.000000000F<br>1.165744000      | -33,947.52           | -39,574.12                    | 0.00        | 340.36               | 340.36      |
| 7,707,616,000.00    | IDR FORWARD 12 SEP<br>FID12SEP                                               | 7/10/2018 |                   | 7,707,616,000.00       | 532,000.00                      | 1.000000000F<br>14,751.400000000 | 7,707,616,000.00     | 522,500.64                    | 0.00        | -9,499.36            | -9,499.36   |
| -546,630,000.00     | IDR FORWARD 12 SEP<br>FID12SEP                                               | 7/11/2018 |                   | -546,630,000.00        | -37,675.24                      | 1.000000000F<br>14,751.400000000 | -546,630,000.00      | -37,056.14                    | 0.00        | 619.10               | 619.10      |
| -6,565,869.00000    | JPY FORWARD 26 SEP<br>FJP26SEP                                               | 7/5/2018  |                   | -6,565,869             | -59,640.65                      | 1.000000000F<br>110.683283333    | -6,565,869           | -59,321.23                    | 0.00        | 319.42               | 319.42      |
| 7,203,784,213.51000 | 非グループ化の有価証券小計                                                                |           |                   | 7,203,784,213.51       | 13,185,385.66                   |                                  | 7,203,784,213.51     | 12,343,901.37                 | 0.00        | -841,484.29          | -841,484.29 |
| 7,203,784,213.51000 | 先物（ポジション）合計                                                                  |           |                   | 7,203,784,213.51       | 13,185,385.66                   |                                  | 7,203,784,213.51     | 12,343,901.37                 | 0.00        | -841,484.29          | -841,484.29 |
| <b>国債</b>           |                                                                              |           |                   |                        |                                 |                                  |                      |                               |             |                      |             |
| <b>地方債</b>          |                                                                              |           |                   |                        |                                 |                                  |                      |                               |             |                      |             |
| 1,770,000.00000     | JPN FIN ORG MUNI<br>2.375 % 02132025<br>BJPN303P XS1185955306                | 2/11/2016 |                   | 1,761,350.15           | 1,761,350.15                    | 94.435000000C<br>1.000000000     | 1,671,499.50         | 1,671,499.50                  | -89,850.65  | 0.00                 | -89,850.65  |
| 1,770,000.00000     | 地方債小計                                                                        |           |                   | 1,761,350.15           | 1,761,350.15                    |                                  | 1,671,499.50         | 1,671,499.50                  | -89,850.65  | 0.00                 | -89,850.65  |
| 830,000.00000       | メディアム・ターム・ノート<br>DEV BANK JAPAN<br>2.625 % 09012027<br>BJPN3064 XS1668899104 | 1/30/2018 |                   | 795,709.40             | 795,709.40                      | 95.111000000C<br>1.000000000     | 789,421.30           | 789,421.30                    | -6,288.10   | 0.00                 | -6,288.10   |
| 830,000.00000       | メディアム・ターム・ノート小計                                                              |           |                   | 795,709.40             | 795,709.40                      |                                  | 789,421.30           | 789,421.30                    | -6,288.10   | 0.00                 | -6,288.10   |
| <b>公募債</b>          |                                                                              |           |                   |                        |                                 |                                  |                      |                               |             |                      |             |
| 300,000.00000       | DEV BANK JAPAN<br>3.125 % 09062023<br>BJPN306M XS1865126004                  | 8/29/2018 |                   | 298,611.00             | 298,611.00                      | 99.855000000C<br>1.000000000     | 299,565.00           | 299,565.00                    | 954.00      | 0.00                 | 954.00      |

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 2018年 8月31日現在

| 口数 / 金額             | 種類                                                | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(米ドル) | 市場<br>(米ドル) | 未実現損益<br>通貨<br>(米ドル) | 合計<br>(米ドル)   |
|---------------------|---------------------------------------------------|------------|-------------------|------------------------|---------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-------------------------------|-------------|----------------------|---------------|
| <b>国債</b>           |                                                   |            |                   |                        |                                 |                                          |                      |                               |             |                      |               |
| <b>公募債</b>          |                                                   |            |                   |                        |                                 |                                          |                      |                               |             |                      |               |
| 1,510,000.00000     | JICA<br>2.125 % 10202026<br>BJPN3054 US47109LAA26 | 10/13/2016 |                   | 1,420,821.40           | 1,420,821.40                    | 91.721000000 <sup>C</sup><br>1.000000000 | 1,384,987.10         | 1,384,987.10                  | -35,834.30  | 0.00                 | -35,834.30    |
| 1,810,000.00000     | 公募債小計                                             |            |                   | 1,719,432.40           | 1,719,432.40                    |                                          | 1,684,552.10         | 1,684,552.10                  | -34,880.30  | 0.00                 | -34,880.30    |
| 4,410,000.00000     | 国債合計                                              |            |                   | 4,276,491.95           | 4,276,491.95                    |                                          | 4,145,472.90         | 4,145,472.90                  | -131,019.05 | 0.00                 | -131,019.05   |
| <b>証拠金勘定</b>        |                                                   |            |                   |                        |                                 |                                          |                      |                               |             |                      |               |
| <b>証拠金勘定</b>        |                                                   |            |                   |                        |                                 |                                          |                      |                               |             |                      |               |
| 650,000.00          | USD MARGIN<br>USDMAR                              | MultiLot   |                   | 650,000.00             | 650,000.00                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>1.000000000  | 650,000.00           | 650,000.00                    | 0.00        | 0.00                 | 0.00          |
| 650,000.00000       | 証拠金勘定小計                                           |            |                   | 650,000.00             | 650,000.00                      |                                          | 650,000.00           | 650,000.00                    | 0.00        | 0.00                 | 0.00          |
| 650,000.00000       | 証拠金勘定合計                                           |            |                   | 650,000.00             | 650,000.00                      |                                          | 650,000.00           | 650,000.00                    | 0.00        | 0.00                 | 0.00          |
| 7,227,300,351.31000 | ポートフォリオ合計                                         |            |                   | 7,227,357,878.36       | 33,991,748.75                   |                                          | 7,226,952,203.24     | 32,744,450.90                 | -405,675.12 | -841,622.73          | -1,247,297.85 |

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(2018年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約213億円)  
発行済株式総数 5,051,655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、2018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 | 55 | 5,074,163,077.60 |

### (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、2018年9月28日現在における株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝113.57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)

2018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              | 4,279,499,530 | 486,022,762 |
| 020 | 手元現金                                     |               |             |
| 030 | 中央銀行における現金残高                             | 2,379,029,912 | 270,186,427 |
| 040 | その他の要求払預金                                | 1,900,469,617 | 215,836,334 |
| 050 | 売買目的で保有される金融資産                           | 22,937,469    | 2,605,008   |
| 060 | デリバティブ                                   | 22,937,469    | 2,605,008   |
| 070 | 持分証券                                     |               |             |
| 080 | 債務証券                                     |               |             |
| 090 | ローンおよび貸付金                                |               |             |
| 096 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される<br>売買目的保有以外の金融資産 | 0             | 0           |
| 097 | 持分証券                                     |               |             |
| 098 | 債務証券                                     |               |             |
| 099 | 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ものとして<br>指定した金融資産     | 0             | 0           |
| 120 | 債務証券                                     |               |             |
| 130 | ローンおよび貸付金                                |               |             |
| 141 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産               | 14,570        | 1,655       |
| 142 | 持分証券                                     | 14,570        | 1,655       |
| 143 | 債務証券                                     |               |             |
| 144 | ローンおよび貸付金                                |               |             |
| 181 | 償却後原価における金融資産                            | 2,188,797,422 | 248,581,723 |
| 182 | 債務証券                                     |               |             |
| 183 | ローンおよび貸付金                                | 2,188,797,422 | 248,581,723 |
| 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<br>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                                     | 811,922       | 92,210      |
| 280 | 有形固定資産                                   | 811,922       | 92,210      |
| 290 | 投資不動産                                    |               |             |
| 300 | 無形資産                                     | 3,102,911     | 352,398     |
| 310 | 営業権                                      |               |             |
| 320 | その他の無形資産                                 | 3,102,911     | 352,398     |
| 330 | 税金資産                                     | 781           | 89          |
| 340 | 現行税金資産                                   | 781           | 89          |
| 350 | 繰延税金資産                                   |               |             |
| 360 | その他の資産                                   | 22,293,804    | 2,531,907   |
| 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                                     | 6,517,458,408 | 740,187,751 |

## 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)

2018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                    | 23,820,080    | 2,705,246   |
| 020 | デリバティブ                            | 23,820,080    | 2,705,246   |
| 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ものとして指定した金融負債  | 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                   | 6,095,386,173 | 692,253,008 |
| 120 | 預金                                | 6,095,386,173 | 692,253,008 |
| 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                               | 0             | 0           |
| 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                           |               |             |
| 240 | 税金負債                              | 15,054,113    | 1,709,696   |
| 250 | 現行税金負債                            | 15,054,113    | 1,709,696   |
| 260 | 繰延税金負債                            |               |             |
| 270 | 要求払株式資本                           |               |             |
| 280 | その他の負債                            | 20,180,190    | 2,291,864   |
| 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                              | 6,154,440,556 | 698,959,814 |

## 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)

2018年6月30日現在

(単位:米ドル)

## 資本

|     |                                               | 米ドル         | 千円         |
|-----|-----------------------------------------------|-------------|------------|
| 010 | 資本                                            | 187,117,966 | 21,250,987 |
| 020 | 払込資本                                          | 187,117,966 | 21,250,987 |
| 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、合併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          |             |            |
| 320 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動             |             |            |
| 330 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性 |             |            |
| 340 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動(ヘッジ項目)      |             |            |
| 350 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動(ヘッジ手段)      |             |            |
| 360 | 負債の信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動 |             |            |
| 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・ヘッジ準備金(有効部分)             |             |            |
| 155 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動             |             |            |
| 165 | ヘッジ手段(指定されていない要素)                             |             |            |
| 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、合併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                                         | 3,259       | 370        |
| 200 | 再評価準備金                                        |             |            |
| 210 | その他の準備金                                       | 158,191,749 | 17,965,837 |
| 220 | 持分法を用いて計上される子会社、合併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                                           | 158,191,749 | 17,965,837 |
| 240 | (-)自己株式                                       |             |            |
| 250 | 親会社株主に帰属する損益                                  | 17,704,878  | 2,010,743  |

米ドル

千円

|     |               |               |             |
|-----|---------------|---------------|-------------|
| 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          | 363,017,853   | 41,227,938  |
| 310 | 資本および負債合計     | 6,517,458,408 | 740,187,751 |

## (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

2018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                                                      | 38,370,885 | 4,357,781 |
| 020 | 売買目的で保有される金融資産                                            | 18,514,145 | 2,102,651 |
| 025 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される<br>売買目的保有以外の金融資産                  |            |           |
| 030 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして<br>指定した金融資産                      |            |           |
| 041 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産                                |            |           |
| 051 | 償却後原価における金融資産                                             | 16,501,150 | 1,874,036 |
| 070 | デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク                                        |            |           |
| 080 | その他の資産                                                    | 909,780    | 103,324   |
| 085 | 負債に係る利息収益                                                 | 2,445,810  | 277,771   |
| 090 | (支払利息)                                                    | 18,287,902 | 2,076,957 |
| 100 | (売買目的で保有される金融負債)                                          | 212,615    | 24,147    |
| 110 | (損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして<br>指定した金融負債)                    |            |           |
| 120 | (償却後原価で測定される金融負債)                                         | 11,892,224 | 1,350,600 |
| 130 | (デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)                                      |            |           |
| 140 | (その他の負債)                                                  | 0          | 0         |
| 145 | (資産に係る支払利息)                                               | 6,183,063  | 702,210   |
| 150 | (要求払株式資本に係る費用)                                            |            |           |
| 160 | 受取配当                                                      | 92         | 10        |
| 170 | 売買目的で保有される金融資産                                            |            |           |
| 175 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される<br>売買目的保有以外の金融資産                  |            |           |
| 191 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産                                | 92         | 10        |
| 192 | 持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および<br>関連会社への投資                  |            |           |
| 200 | 受取手数料                                                     | 56,423,901 | 6,408,062 |
| 210 | (支払手数料)                                                   | 28,467,551 | 3,233,060 |
| 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<br>債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額    | 0          | 0         |
| 231 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産                                |            |           |
| 241 | 償却後原価における金融資産                                             |            |           |
| 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<br>(-)損失、純額                   | 2,440,541  | 277,172   |
| 287 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保<br>有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額  |            |           |
| 290 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した<br>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                                                  | 1,491,772  | 169,421   |
| 350 | (その他の事業費用)                                                | 1,399,998  | 158,998   |
| 355 | 事業収益合計、純額                                                 | 50,571,740 | 5,743,433 |

米ドル

千円

|     |                                                       |            |           |
|-----|-------------------------------------------------------|------------|-----------|
| 360 | （管理費用）                                                | 25,508,536 | 2,897,004 |
| 370 | （従業員費用）                                               | 10,251,013 | 1,164,208 |
| 380 | （その他の管理費用）                                            | 15,257,523 | 1,732,797 |
| 390 | （減価償却）                                                | 904,300    | 102,701   |
| 400 | （有形固定資産）                                              | 148,413    | 16,855    |
| 410 | （投資不動産）                                               |            |           |
| 420 | （その他の無形資産）                                            | 755,888    | 85,846    |
| 425 | 修正利益または（－）損失、純額                                       | 0          | 0         |
| 426 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産                            |            |           |
| 427 | 償却後原価における金融資産                                         |            |           |
| 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）            | 411,503    | 46,734    |
| 481 | （その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産）                          |            |           |
| 491 | （償却後原価における金融資産）                                       | 411,503    | 46,734    |
| 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 | 持分法を用いて計上される子会社、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                                  | 23,747,401 | 2,696,992 |
| 620 | （継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）                           | 6,042,522  | 686,249   |
| 630 | 継続事業からの税引後利益または（－）損失                                  | 17,704,879 | 2,010,743 |
| 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                                 | 0          | 0         |
| 660 | （非継続事業に関する税金費用または（－）収入）                               | 0          | 0         |
| 670 | 当期利益または（－）損失                                          | 17,704,879 | 2,010,743 |
| 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                                          | 17,704,879 | 2,010,743 |

[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 ( 2018年 6 月末日現在 )

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル ( 約207億円 )

発行済株式総数 5,051,655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。

##### ( ) 会社の沿革

( 後略 )

< 訂正後 >

( 前略 )

##### ( ) 資本金の額 ( 2018年 9 月末日現在 )

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル ( 約213億円 )

発行済株式総数 5,051,655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、2018年 9 月28日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値

( 1 米ドル = 113.57円 ) による。

##### ( ) 会社の沿革

( 後略 )

#### ２ 投資方針

##### (5) 投資制限

< 訂正前 >

( 前略 )

- (ハ) 管理会社の運用する証券投資信託およびミューチュアル・ファンドの全体において、一発行会社の議決権総数の50%を超えて投資を行ってはならない。かかる制限は、他の投資信託に対する投資には適用されない。

( 注 ) 上記の比率の計算は、買付時点基準または時価基準のいずれかによることができる。

( 中略 )

- (ヘ) 管理会社が自己または第三者の利益を図る目的で行う取引等、受益者の保護に欠け、またはファンドの資産の適正な運用を害するファンドのための管理会社の取引は、すべて禁止される。

ファンドの投資対象の価値の変化、再構成、合併、ファンドの資産からの支払またはファンドの受益証券の買戻しの結果としてファンドに適用される制限を超えた場合、管理会社は、直ちにファンドの投資対象を売却する必要はない。しかし、管理会社は、ファンドの受益者の利益を考

慮した上で、違反が判明してから合理的な期間内にファンドに適用ある制限を遵守するために合理的に可能な措置を講じるものとする。

<訂正後>

(前略)

(ハ) ファンドおよび管理会社の運用するミューチュアル・ファンドの全体において、一発行会社の議決権総数の50%を超えて投資を行ってはならない。かかる制限は、他の投資信託に対する投資には適用されない。

(注) 上記の比率の計算は、買付時点基準または時価基準のいずれかによることができる。

(中略)

(ヘ) 管理会社、投資顧問会社または副投資顧問会社が自己または第三者の利益を図る目的で行う取引等、受益者の保護に欠け、またはファンドの資産の適正な運用を害するファンドのための管理会社、投資顧問会社または副投資顧問会社の取引は、すべて禁止される。

(ト) ファンドは、単一の発行体の株式または受益証券の価額(以下「株式等エクスポージャー」という。)が、純資産総額の10%を超える場合(かかる株式等エクスポージャーは、日本証券業協会のガイドラインに従って計算される。)、当該会社の株式または当該投資信託の受益証券を保有しないものとする。

(チ) ファンドは、デリバティブのポジションからある単一のカウンターパーティーに対して生じるネット・エクスポージャー(以下「デリバティブ等エクスポージャー」という。))が、純資産総額の10%を超える場合(かかるデリバティブ等エクスポージャーは、日本証券業協会のガイドラインに従って計算される。)、単一のカウンターパーティーに対してデリバティブのポジションを保有しないものとする(120日以内に予約期日が到来する為替予約取引(店頭デリバティブ取引に該当するものは除く。))については、この限りでない。)

(リ) ファンドは、単一の法主体によって発行され、組成され、または、負担される有価証券、金銭債権および匿名組合出資持分(以下これらを「債券等エクスポージャー」という。))の価額が純資産総額の10%を超える場合(かかる債券等エクスポージャーは、日本証券業協会のガイドラインに従って計算される。)、( )有価証券(上記(ト)に記載される株式または受益証券を除く。)、( )金銭債権(上記(チ)に記載されるデリバティブを除く。))および( )匿名組合出資持分を保有しないものとする。

(注) 担保付の取引の場合には当該担保の評価額、当該発行者等に対する債務がある場合には当該債務額を差し引くことができる。

(ヌ) ファンドは、単一の発行体またはカウンターパーティーに対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーが合計で純資産総額の20%を超える場合、単一の発行体もしくはカウンターパーティーにおいて、または、単一の発行体もしくはカウンターパーティーに対してポジションを保有しないものとする。

ファンドの投資対象の価値の変化、再構成、合併、ファンドの資産からの支払またはファンドの受益証券の買戻しの結果としてファンドに適用される制限を超えた場合、管理会社は、直ちにファンドの投資対象を売却する必要はない。しかし、管理会社は、ファンドの受益者の利益を考慮した上で、違反が判明してから合理的な期間内にファンドに適用ある制限を遵守するために合理的に可能な措置を講じるものとする。

## 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

2018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

2018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

&lt; 訂正前 &gt;

## 投資有価証券の主要銘柄

（ 2018年 6 月末日現在 ）

|    | 銘柄                                            | 地域     | 種類 | 利率<br>( % )                  | 満期日        | 数量        | 取得価格 ( 米ドル ) |              | 時価 ( 米ドル ) |              | 投資<br>比率<br>( % ) |
|----|-----------------------------------------------|--------|----|------------------------------|------------|-----------|--------------|--------------|------------|--------------|-------------------|
|    |                                               |        |    |                              |            |           | 単価           | 金額           | 単価         | 金額           |                   |
| 1  | Sompo Japan Nipponkoa Insurance Inc           | 日本     | 社債 | 5.325<br>( 2023年 3 月以降変動金利 ) | 2073/03/28 | 1,620,000 | 1.00         | 1,627,452.93 | 1.03       | 1,668,956.45 | 7.30              |
| 2  | Japan Finance Organization for Municipalities | 日本     | 公債 | 2.375                        | 2025/02/13 | 1,770,000 | 1.00         | 1,761,350.15 | 0.94       | 1,665,570.00 | 7.28              |
| 3  | Fukoku Mutual Life Insurance Co               | 日本     | 社債 | 5.000<br>( 2025年 7 月以降変動金利 ) | 永久債        | 1,650,000 | 1.00         | 1,656,249.32 | 0.99       | 1,637,113.53 | 7.16              |
| 4  | Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd              | 日本     | 社債 | 7.000<br>( 2022年 3 月以降変動金利 ) | 2072/03/15 | 1,500,000 | 1.04         | 1,560,404.77 | 1.09       | 1,633,695.00 | 7.14              |
| 5  | Sumitomo Life Insurance Co                    | 日本     | 社債 | 4.000<br>( 2027年 9 月以降変動金利 ) | 2077/09/14 | 1,750,000 | 1.00         | 1,746,791.67 | 0.93       | 1,629,687.50 | 7.12              |
| 6  | Japan International Cooperation Agency        | 日本     | 公債 | 2.125                        | 2026/10/20 | 1,710,000 | 0.94         | 1,609,009.66 | 0.91       | 1,564,479.00 | 6.84              |
| 7  | ORIX Corp                                     | 日本     | 社債 | 3.950                        | 2027/01/19 | 1,550,000 | 1.01         | 1,571,948.22 | 0.99       | 1,536,329.00 | 6.72              |
| 8  | Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The            | 日本     | 社債 | 5.100<br>( 2024年10月以降変動金利 )  | 永久債        | 1,170,000 | 1.00         | 1,170,000.00 | 1.02       | 1,196,933.42 | 5.23              |
| 9  | Development Bank of Japan Inc                 | 日本     | 公債 | 2.625                        | 2027/09/01 | 1,220,000 | 0.96         | 1,169,596.95 | 0.95       | 1,159,219.60 | 5.07              |
| 10 | Nippon Life Insurance Co                      | 日本     | 社債 | 4.700<br>( 2026年 1 月以降変動金利 ) | 2046/01/20 | 1,040,000 | 1.05         | 1,090,953.41 | 0.99       | 1,031,201.60 | 4.51              |
| 11 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc            | 日本     | 社債 | 2.757                        | 2026/09/13 | 1,030,000 | 0.94         | 964,674.23   | 0.92       | 948,115.00   | 4.14              |
| 12 | Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd           | ケイマン諸島 | 社債 | 4.600                        | 2024/03/27 | 810,000   | 1.01         | 820,859.40   | 1.02       | 824,750.09   | 3.61              |
| 13 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc           | 日本     | 社債 | 3.364                        | 2027/07/12 | 850,000   | 1.01         | 862,095.50   | 0.96       | 815,116.00   | 3.56              |
| 14 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc            | 日本     | 社債 | 3.850                        | 2026/03/01 | 720,000   | 1.10         | 792,079.20   | 1.00       | 717,206.40   | 3.14              |
| 15 | Mizuho Financial Group Inc                    | 日本     | 社債 | 3.170                        | 2027/09/11 | 690,000   | 0.97         | 672,481.80   | 0.94       | 647,240.70   | 2.83              |
| 16 | Nippon Life Insurance Co                      | 日本     | 社債 | 5.000<br>( 2022年10月以降変動金利 )  | 2042/10/18 | 600,000   | 1.04         | 621,785.08   | 1.02       | 612,840.00   | 2.68              |
| 17 | Tokyo Metropolitan Government                 | 日本     | 公債 | 3.250                        | 2023/06/01 | 600,000   | 1.00         | 597,672.00   | 1.00       | 599,772.00   | 2.62              |
| 18 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc           | 日本     | 社債 | 4.436                        | 2024/04/02 | 530,000   | 1.03         | 545,769.65   | 1.01       | 536,460.70   | 2.34              |

|    | 銘柄                                  | 地域 | 種類 | 利率<br>(%)                | 満期日        | 数量      | 取得価格（米ドル） |            | 時価（米ドル） |            | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------------------|----|----|--------------------------|------------|---------|-----------|------------|---------|------------|-----------------|
|    |                                     |    |    |                          |            |         | 単価        | 金額         | 単価      | 金額         |                 |
| 19 | Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The  | 日本 | 社債 | 4.000<br>(2026年7月以降変動金利) | 永久債        | 550,000 | 0.98      | 541,151.26 | 0.94    | 517,236.50 | 2.26            |
| 20 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 日本 | 社債 | 3.544                    | 2028/01/17 | 280,000 | 0.99      | 276,976.00 | 0.97    | 271,846.40 | 1.19            |
| 21 | ORIX Corp                           | 日本 | 社債 | 3.250                    | 2024/12/04 | 270,000 | 1.00      | 269,649.00 | 0.96    | 258,927.30 | 1.13            |
| 22 | Mizuho Financial Group Inc          | 日本 | 社債 | 4.353                    | 2025/10/20 | 220,000 | 1.09      | 239,586.60 | 1.00    | 219,062.80 | 0.96            |

## 投資不動産物件

該当事項なし。（2018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。（2018年6月末日現在）

## &lt;訂正後&gt;

## 投資有価証券の主要銘柄

（2018年9月末日現在）

|    | 銘柄                       | 地域     | 種類 | 利率<br>(%)                 | 満期日        | 数量        | 取得価格（米ドル） |              | 時価（米ドル） |              | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------------------|--------|----|---------------------------|------------|-----------|-----------|--------------|---------|--------------|-----------------|
|    |                          |        |    |                           |            |           | 単価        | 金額           | 単価      | 金額           |                 |
| 1  | SUMITOMO LIFE INSUR      | 日本     | 社債 | 4.000<br>(2027年9月以降変動金利)  | 2077/09/14 | 1,750,000 | 1.00      | 1,746,791.67 | 0.94    | 1,637,370.00 | 7.89            |
| 2  | ORIX CORP                | 日本     | 社債 | 3.950                     | 2027/01/19 | 1,550,000 | 1.01      | 1,571,948.22 | 0.98    | 1,518,674.50 | 7.31            |
| 3  | SOMPO JAPAN NIPPONKOA    | 日本     | 社債 | 5.325<br>(2023年3月以降変動金利)  | 2073/03/28 | 1,420,000 | 1.00      | 1,426,532.82 | 1.04    | 1,472,000.44 | 7.09            |
| 4  | JAPAN FIN ORG MUNICIPAL  | 日本     | 公債 | 2.375                     | 2025/02/13 | 1,540,000 | 1.00      | 1,532,474.14 | 0.93    | 1,438,082.80 | 6.93            |
| 5  | mitsui sumitomo INSURANC | 日本     | 社債 | 7.000<br>(2022年3月以降変動金利)  | 2072/03/15 | 1,300,000 | 1.04      | 1,352,350.80 | 1.09    | 1,413,347.00 | 6.81            |
| 6  | FUKOKU MUTUAL LIFE INSUR | 日本     | 社債 | 5.000<br>(2025年7月以降変動金利)  | 永久債        | 1,320,000 | 1.00      | 1,324,999.46 | 1.00    | 1,315,221.61 | 6.33            |
| 7  | JAPAN INT'L COOP AGENCY  | 日本     | 公債 | 2.125                     | 2026/10/20 | 1,300,000 | 0.94      | 1,223,223.72 | 0.91    | 1,176,617.00 | 5.67            |
| 8  | NIPPON LIFE INSURANCE    | 日本     | 社債 | 4.700<br>(2026年1月以降変動金利)  | 2046/01/20 | 1,040,000 | 1.05      | 1,090,953.41 | 0.99    | 1,029,475.20 | 4.96            |
| 9  | DAI-ICHI LIFE INSURANCE  | 日本     | 社債 | 5.100<br>(2024年10月以降変動金利) | 永久債        | 970,000   | 1.00      | 970,000.00   | 1.02    | 985,762.50   | 4.75            |
| 10 | mitsubishi UFJ FIN GRP   | 日本     | 社債 | 2.757                     | 2026/09/13 | 1,030,000 | 0.94      | 964,674.23   | 0.91    | 936,414.20   | 4.51            |
| 11 | MIZUHO FIN GRP CAYMAN 3  | ケイマン諸島 | 社債 | 4.600                     | 2024/03/27 | 810,000   | 1.01      | 820,859.40   | 1.01    | 814,681.82   | 3.92            |
| 12 | SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 日本     | 社債 | 3.364                     | 2027/07/12 | 850,000   | 1.01      | 862,095.50   | 0.95    | 804,066.00   | 3.87            |

|    | 銘柄                        | 地域 | 種類 | 利率<br>(%)                 | 満期日        | 数量      | 取得価格（米ドル） |            | 時価（米ドル） |            | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------------------------|----|----|---------------------------|------------|---------|-----------|------------|---------|------------|-----------------|
|    |                           |    |    |                           |            |         | 単価        | 金額         | 単価      | 金額         |                 |
| 13 | DEVELOPMENT BK OF JAPAN   | 日本 | 公債 | 2.625                     | 2027/09/01 | 830,000 | 0.96      | 795,709.40 | 0.94    | 777,942.40 | 3.75            |
| 14 | MITSUBISHI UFJ FIN GRP    | 日本 | 社債 | 3.850                     | 2026/03/01 | 720,000 | 1.10      | 792,079.20 | 0.98    | 708,120.00 | 3.41            |
| 15 | NIPPON LIFE INSURANCE     | 日本 | 社債 | 5.000<br>(2022年10月以降変動金利) | 2042/10/18 | 600,000 | 1.04      | 621,785.08 | 1.03    | 615,234.00 | 2.96            |
| 16 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL | 日本 | 社債 | 4.436                     | 2024/04/02 | 530,000 | 1.03      | 545,769.65 | 1.00    | 529,920.50 | 2.55            |
| 17 | DAI-ICHI LIFE INSURANCE   | 日本 | 社債 | 4.000<br>(2026年7月以降変動金利)  | 永久債        | 550,000 | 0.98      | 541,151.26 | 0.94    | 516,659.00 | 2.49            |
| 18 | MIZUHO FINANCIAL GROUP    | 日本 | 社債 | 3.170                     | 2027/09/11 | 490,000 | 0.97      | 477,559.54 | 0.93    | 454,357.40 | 2.19            |
| 19 | DEVELOPMENT BK OF JAPAN   | 日本 | 公債 | 3.125                     | 2023/9/6   | 300,000 | 1.00      | 298,611.00 | 0.99    | 297,114.00 | 1.43            |
| 20 | SUMITOMO MITSUI FINL GRP  | 日本 | 社債 | 3.544                     | 2028/01/17 | 280,000 | 0.99      | 276,976.00 | 0.96    | 267,828.40 | 1.29            |
| 21 | MIZUHO FINANCIAL GROUP    | 日本 | 社債 | 4.353                     | 2025/10/20 | 220,000 | 1.09      | 239,586.60 | 0.99    | 217,386.40 | 1.05            |
| 22 | DEVELOPMENT BK OF JAPAN   | 日本 | 公債 | 3.250                     | 2028/9/6   | 200,000 | 0.98      | 196,016.00 | 0.98    | 196,212.00 | 0.94            |

## 投資不動産物件

該当事項なし。（2018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。（2018年9月末日現在）