

【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】 令和2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・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 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1,077億4,000万円)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1,077億4,000万円)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1,077億4,000万円)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1,077億4,000万円)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、2020年6月30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=107.74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、2020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等を更新するため、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

* 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

(2020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	9,821,445.05	63.62
	米国	1,021,035.62	6.61
	ケイマン諸島	669,590.88	4.34
	小計	11,512,071.55	74.57
公債	日本	3,376,693.01	21.87
	小計	3,376,693.01	21.87
小計		14,888,764.56	96.45
現金・その他の資産 (負債控除後)		548,212.09	3.55
合計(純資産総額)		15,436,976.65 (約1,633百万円)	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、2020年9月30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=105.80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

2020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
2019年10月末日	7,856,497.02	831,217	112.21	11,872
11月末日	7,780,367.18	823,163	112.46	11,898
12月末日	7,690,327.29	813,637	111.77	11,825
2020年1月末日	7,687,674.62	813,356	112.98	11,953
2月末日	7,730,659.42	817,904	114.04	12,065
3月末日	7,317,275.13	774,168	108.50	11,479
4月末日	7,306,941.18	773,074	111.88	11,837
5月末日	7,399,646.87	782,883	113.02	11,958
6月末日	7,472,529.18	790,594	113.79	12,039
7月末日	7,520,168.63	795,634	114.79	12,145
8月末日	7,600,145.51	804,095	114.64	12,129
9月末日	7,393,379.36	782,220	113.75	12,035

<ブラジル・リアルヘッジクラス>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2019年10月末日	11,599,844.46	1,227,264	19.34	2,046
11月末日	10,930,947.27	1,156,494	18.26	1,932
12月末日	11,131,262.12	1,177,688	18.77	1,986
2020年1月末日	10,497,062.90	1,110,589	17.92	1,896
2月末日	9,880,907.99	1,045,400	17.06	1,805
3月末日	8,087,482.02	855,656	14.03	1,484
4月末日	7,629,998.58	807,254	13.24	1,401
5月末日	8,299,877.95	878,127	14.03	1,484
6月末日	8,068,584.93	853,656	13.67	1,446
7月末日	8,547,409.49	904,316	14.46	1,530
8月末日	7,851,867.76	830,728	13.35	1,412
9月末日	7,683,971.86	812,964	13.11	1,387

<中国元ヘッジクラス>

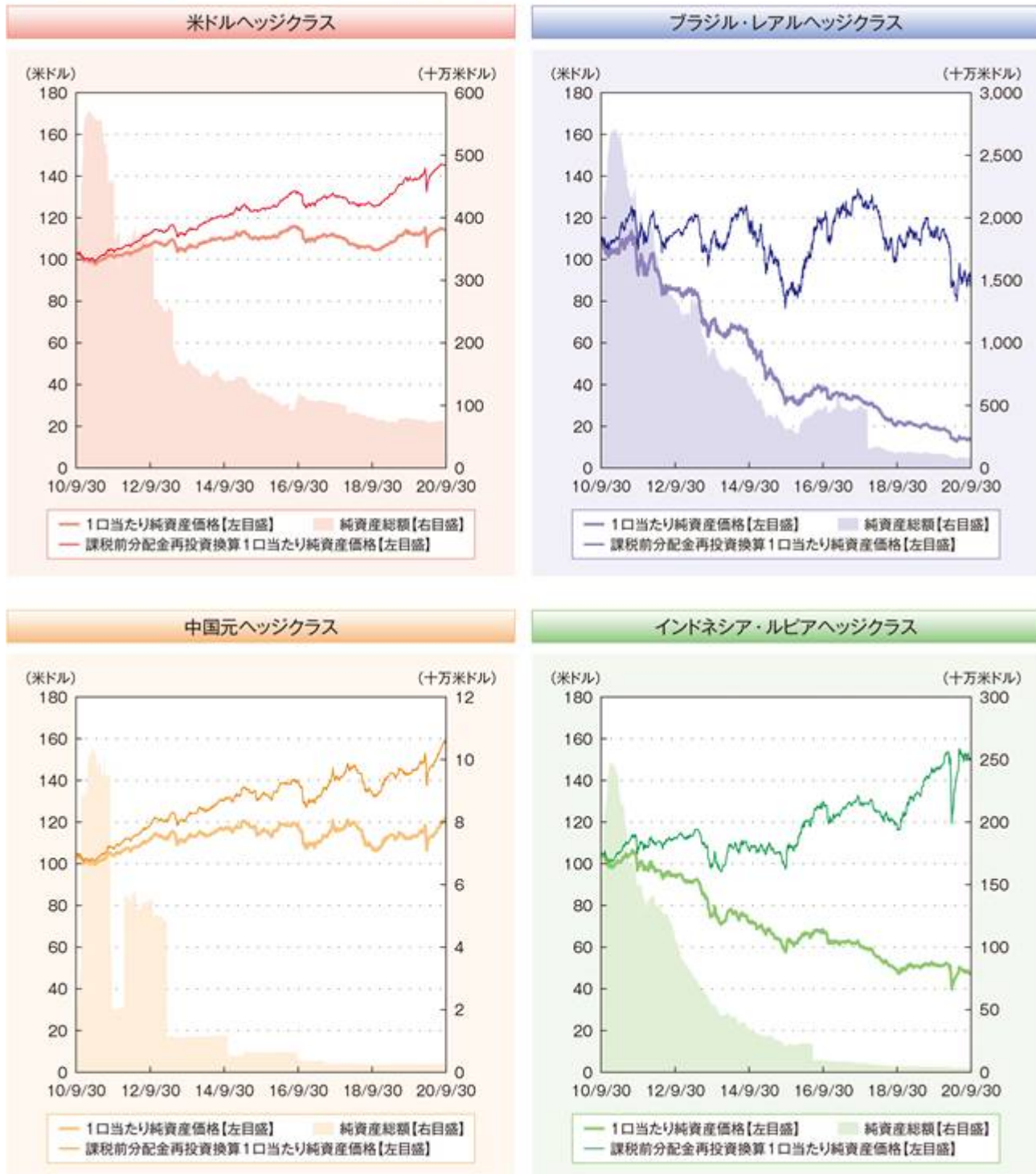
	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2019年10月末日	25,330.37	2,680	112.58	11,911
11月末日	25,544.30	2,703	113.53	12,011
12月末日	25,516.11	2,700	113.40	11,998
2020年1月末日	26,120.29	2,764	116.09	12,282
2月末日	26,187.13	2,771	116.39	12,314
3月末日	24,588.58	2,601	109.28	11,562
4月末日	25,404.59	2,688	112.91	11,946
5月末日	25,425.40	2,690	113.00	11,955
6月末日	25,968.14	2,747	115.41	12,210
7月末日	26,604.22	2,815	118.24	12,510
8月末日	27,020.48	2,859	120.09	12,706
9月末日	27,151.91	2,873	120.68	12,768

<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
2019年10月末日	431,453.76	45,648	51.62	5,461
11月末日	427,257.61	45,204	51.12	5,408
12月末日	426,840.53	45,160	51.07	5,403
2020年1月末日	437,679.94	46,307	52.37	5,541
2月末日	387,850.72	41,035	49.99	5,289
3月末日	321,131.65	33,976	41.39	4,379
4月末日	350,326.85	37,065	45.16	4,778
5月末日	368,255.11	38,961	47.47	5,022
6月末日	361,569.59	38,254	49.27	5,213
7月末日	343,816.40	36,376	48.71	5,154
8月末日	341,034.83	36,081	48.32	5,112
9月末日	332,473.52	35,176	47.11	4,984

< 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9月末日~2020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

2020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
2019年10月1日～2020年9月末日	4.20	444

<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
2019年10月1日～2020年9月末日	1.96	207

<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
2019年10月1日～2020年9月末日	3.00	317

<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
2019年10月1日～2020年9月末日	6.48	686

< 参考情報 >

分配の推移 (2020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
第8会計年度 (2017年3月1日~2018年2月28日)	2.40
第9会計年度 (2018年3月1日~2019年2月28日)	2.40
第10会計年度 (2019年3月1日~2020年2月29日)	3.30
2020年5月	0.35
2020年6月	0.35
2020年7月	0.35
2020年8月	0.35
2020年9月	0.35
直近1年間累計	4.20
設定来累計	26.15

ブラジル・リアルヘッジクラス	
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
第8会計年度 (2017年3月1日~2018年2月28日)	7.05
第9会計年度 (2018年3月1日~2019年2月28日)	5.20
第10会計年度 (2019年3月1日~2020年2月29日)	3.02
2020年5月	0.15
2020年6月	0.15
2020年7月	0.13
2020年8月	0.13
2020年9月	0.11
直近1年間累計	1.96
設定来累計	93.94

中国元ヘッジクラス	
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
第8会計年度 (2017年3月1日~2018年2月28日)	3.00
第9会計年度 (2018年3月1日~2019年2月28日)	3.00
第10会計年度 (2019年3月1日~2020年2月29日)	3.00
2020年5月	0.25
2020年6月	0.25
2020年7月	0.25
2020年8月	0.25
2020年9月	0.25
直近1年間累計	3.00
設定来累計	30.25

インドネシア・ルピアヘッジクラス	
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
第8会計年度 (2017年3月1日~2018年2月28日)	7.20
第9会計年度 (2018年3月1日~2019年2月28日)	7.20
第10会計年度 (2019年3月1日~2020年2月29日)	7.20
2020年5月	0.48
2020年6月	0.48
2020年7月	0.48
2020年8月	0.48
2020年9月	0.48
直近1年間累計	6.48
設定来累計	79.53

収益率の推移

<米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率(注)
2019年10月1日～2020年9月末日	4.59%

(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)
2019年10月1日～2020年9月末日	- 20.18%

(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)
2019年10月1日～2020年9月末日	10.74%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<インドネシア・ルピアヘッジクラス>

計算期間	収益率(注)
2019年10月1日～2020年9月末日	3.98%

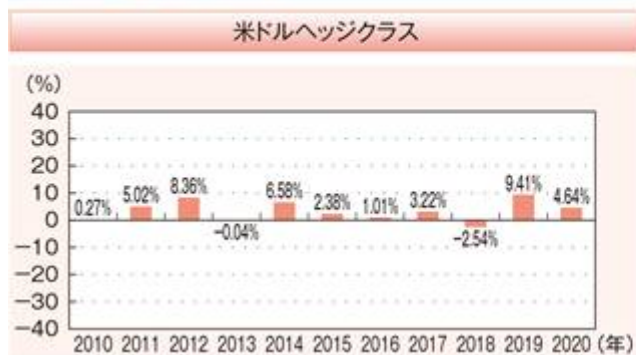
(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

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、2020年については2020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。2020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

2020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2020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
2,355 (2,355)	7,376 (7,376)	64,995 (64,995)

<ブラジル・リアルヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
17,800 (17,800)	31,830 (31,830)	586,038 (586,038)

<中国元ヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	0 (0)	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)	1,500 (1,500)	7,058 (7,058)

(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2020年9月30日現在における対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=105.80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

2020年8月末日現在

	米ドル	千円
資産		
現金	685,677.35	72,545
銀行預金 - 基準通貨	631,639.10	66,827
銀行預金 - 外国通貨	54,038.25	5,717
ブローカーが保有する現金	290,000.00	30,682
ブローカーが保有する現金 - 米ドル	290,000.00	30,682
有価証券(取得原価)	14,034,738.28	1,484,875
債券(取得原価)	14,034,738.28	1,484,875
未実現評価損益	731,290.02	77,370
未実現時価評価損益	1,142,838.19	120,912
未実現通貨運用損益	(411,548.17)	(43,542)
未収収益	154,131.04	16,307
現金に係る未収利息	183.97	19
債券に係る未収利息	153,947.07	16,288
資産合計:	15,895,836.69	1,681,780

2020年8月末日現在

	米ドル	千円
負債		
資本証券	2,668.00	282
受益証券買戻未払金	2,668.00	282
未払費用	73,100.11	7,734
未払監査費用	32,924.39	3,483
未払保管報酬	3,223.26	341
未払報告費用	2,747.97	291
未払投資顧問報酬	17,779.87	1,881
未払受託報酬	1,604.36	170
未払代行協会員報酬	1,271.35	135
未払販売報酬	12,904.18	1,365
未払副管理報酬	644.73	68
負債合計：	75,768.11	8,016
資本		
ファンド受益証券	121,173,961.61	12,820,205
発行済ファンド受益証券 (額面価額)	66,167,900.00	7,000,564
ブラジル・リアル	58,810,100.00	6,222,109
インドネシア・ルピア	705,800.00	74,674
中国元	22,500.00	2,381
米ドル	6,629,500.00	701,401
受益証券額面超過額	55,006,061.61	5,819,641
ブラジル・リアル	54,411,511.35	5,756,738
インドネシア・ルピア	2,716,290.30	287,384
中国元	(61,682.00)	(6,526)
米ドル	(2,060,058.04)	(217,954)

2020年8月末日現在

	米ドル	千円
分配金支払額	(139,561,180.98)	(14,765,573)
配当金支払額	(139,561,180.98)	(14,765,573)
ブラジル・リアル	(130,078,492.78)	(13,762,305)
インドネシア・ルピア	(5,014,124.10)	(530,494)
中国元	(53,569.00)	(5,668)
米ドル	(4,414,995.10)	(467,106)
利益剰余金	35,680,013.68	3,774,945
利益剰余金	35,680,013.68	3,774,945
ブラジル・リアル	(69,099,571.47)	(7,310,735)
インドネシア・ルピア	2,224,497.03	235,352
中国元	467,840.79	49,498
米ドル	31,462,294.76	3,328,711
中間純利益	(1,472,725.73)	(155,814)
資本合計:	15,820,068.58	1,673,763
負債および資本合計	15,895,836.69	1,681,780
純資産額合計	15,820,068.58	1,673,763
発行済受益証券総数	661,679.00000口	
受益証券1口当たり純資産額合計	23.91	2,530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

2020年3月1日から2020年8月末日までの期間

	米ドル		千円	
収益				
実現損益		(1,915,445.70)		(202,654)
為替取引に係る実現利益		2,299,365.14		243,273
ブラジル・リアル	2,194,535.20		232,182	
インドネシア・ルピア	81,678.07		8,642	
中国元	1,258.29		133	
為替取引に係る実現損失		(4,507,750.00)		(476,920)
ブラジル・リアル	(4,389,398.18)		(464,398)	
インドネシア・ルピア	(99,439.88)		(10,521)	
中国元	(1,477.81)		(156)	
市場に係る実現利益		329,834.29		34,896
市場に係る実現損失		(35,256.48)		(3,730)
通貨に係る実現利益		6,492.69		687
インドネシア・ルピア	0.01		0	
通貨に係る実現損失		(8,131.34)		(860)
受取利息		270,339.07		28,602
現金に係る受取利息		1,020.25		108
債券に係る受取利息		269,318.82		28,494

2020年3月1日から2020年8月末日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	310,190.32	32,818
未実現時価評価損益	(73,670.56)	(7,794)
未実現通貨運用損益	383,860.88	40,612
ブラジル・リアル	365,731.01	38,694
インドネシア・ルピア	20,504.95	2,169
中国元	791.19	84
収益合計：	(1,334,916.31)	(141,234)
費用		
費用 - 報酬	137,772.77	14,576
監査費用	15,044.72	1,592
保管報酬	9,977.49	1,056
報告費用	1,036.35	110
投資顧問報酬	55,874.61	5,912
受託報酬	4,959.40	525
現金支出費用	3,711.94	393
代行協会員報酬	3,991.18	422
販売報酬	39,910.17	4,222
副保管報酬	1,271.35	135
副管理報酬	1,995.56	211
支払利息	36.65	4
当座借越利息	36.65	4
費用合計：	137,809.42	14,580
投資純利益	(1,472,725.73)	(155,814)

[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 2020年8月末現在

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) (米ドル)	単価/為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	未実現損益 通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
現金											
基準通貨現金											
631,639.10000	USD CASH CASHUSD	08/27/2020	MUGC	631,639.10	631,639.10	1.000000000 1.000000000	631,639.10	631,639.10	0.00	0.00	0.00
631,639.10000	基準通貨現金小計			631,639.10	631,639.10		631,639.10	631,639.10	0.00	0.00	0.00
631,639.10000	現金合計			631,639.10	631,639.10		631,639.10	631,639.10	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											
550,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		550,000.00	550,000.00	112.596000671 ^C 1.000000000	619,278.00	619,278.00	69,278.00	0.00	69,278.00
700,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN3042 XS1262602532	07/22/2015		702,651.23	702,651.23	111.252000000 ^C 1.000000000	778,764.00	778,764.00	76,112.77	0.00	76,112.77
630,000.00000	NIPPON LIFE INS FRN 01202046 BJPN304Z USJ54675AC78	10/06/2016		667,581.68	667,581.68	113.803000000 ^C 1.000000000	716,958.90	716,958.90	49,377.22	0.00	49,377.22
460,000.00000	SUMITOMO LIFE FRN 09142077 BJPN305V USJ77549AC73	09/07/2017		459,156.67	459,156.67	113.450000000 ^C 1.000000000	521,870.00	521,870.00	62,713.33	0.00	62,713.33
2,340,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			2,379,389.58	2,379,389.58		2,636,870.90	2,636,870.90	257,481.32	0.00	257,481.32
変動利率											
1,000,000.00000	mitsui SUMITOMO FRN 03152072 BJPN3013 USJ45174AF61	03/09/2012		1,040,269.85	1,040,269.85	108.556000000 ^C 1.000000000	1,085,560.00	1,085,560.00	45,290.15	0.00	45,290.15
720,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	03/22/2013		723,312.41	723,312.41	108.702003479 ^C 1.000000000	782,654.43	782,654.43	59,342.02	0.00	59,342.02
1,720,000.00000	変動利率小計			1,763,582.26	1,763,582.26		1,868,214.43	1,868,214.43	104,632.17	0.00	104,632.17

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 2020年8月末現在

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) (米ドル)	単価/為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	未実現損益 通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
メディアム・ターム・ノート											
480,000.00000	AMERICAN HONDA F 1.2 % 07082025 BUSA9EDX US02665WDL28	07/07/2020		481,046.40	481,046.40	100.942000000 ^C 1.000000000	484,521.60	484,521.60	3,475.20	0.00	3,475.20
480,000.00000	メディアム・ターム・ノート小計			481,046.40	481,046.40		484,521.60	484,521.60	3,475.20	0.00	3,475.20
公募債											
910,000.00000	KOMATSU FIN AMER 2.437 % 09112022 BUSA9BVO XS1678457463	03/26/2020		919,778.80	919,778.80	102.943000793 ^C 1.000000000	936,781.31	936,781.31	17,002.51	0.00	17,002.51
1,030,000.00000	MITSUB UFJ FIN 2.757 % 09132026 BJPN305C US606822AJ33	02/10/2017		964,674.23	964,674.23	109.278000000 ^C 1.000000000	1,125,563.40	1,125,563.40	160,889.17	0.00	160,889.17
610,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	03/20/2014		618,178.07	618,178.07	110.051002502 ^C 1.000000000	671,311.12	671,311.12	53,133.05	0.00	53,133.05
390,000.00000	MIZUHO FINANCIAL 3.17 % 09112027 BJPN305Z US60687YAM12	12/18/2017		384,343.04	384,343.04	110.237000000 ^C 1.000000000	429,924.30	429,924.30	45,581.26	0.00	45,581.26
480,000.00000	NOMURA HOLDINGS 1.851 % 07162025 BJPN308B US65535HAR03	07/07/2020		479,977.60	479,977.60	101.861000000 ^C 1.000000000	488,932.80	488,932.80	8,955.20	0.00	8,955.20
890,000.00000	ORIX CORP 3.95 % 01192027 BJPN305B XS1527515321	02/10/2017		902,602.52	902,602.52	113.746000000 ^C 1.000000000	1,012,339.40	1,012,339.40	109,736.88	0.00	109,736.88
530,000.00000	SUMITOMO MITSUI 4.436 % 04022024 BJPN3030 USJ7771XAB58	06/18/2015		545,769.65	545,769.65	109.794998169 ^C 1.000000000	581,913.49	581,913.49	36,143.84	0.00	36,143.84
130,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.364 % 07122027 BJPN305T US86562MAR16	08/14/2017		131,849.90	131,849.90	112.051000000 ^C 1.000000000	145,666.30	145,666.30	13,816.40	0.00	13,816.40

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 2020年8月末現在

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) (米ドル)	単価/為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	未実現損益 通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
公募債											
280,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.544 % 01172028 BJPN3063 US86562MAY66	01/30/2018		276,976.00	276,976.00	112.229700000 ^C	314,243.16	314,243.16	37,267.16	0.00	37,267.16
760,000.00000	TAKEDA PHARM 2.05 % 03312030 BJPN308A US874060AX48	06/29/2020		758,510.40	758,510.40	102.033996582 ^C 1.000000000	775,458.37	775,458.37	16,947.97	0.00	16,947.97
6,010,000.00000	公募債小計			5,982,660.21	5,982,660.21		6,482,133.65	6,482,133.65	499,473.44	0.00	499,473.44
10,550,000.00000	社債合計			10,606,678.45	10,606,678.45		11,471,740.58	11,471,740.58	865,062.13	0.00	865,062.13
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,636.13	BRITISH POUND GBP	05/19/2020		1,636.13	2,004.34	1.000000000 ^S 1.319000000	1,636.13	2,158.06	0.00	153.72	153.72
8,000.00		07/28/2020		8,000.00	10,316.80	1.000000000 ^S 1.319000000	8,000.00	10,552.00	0.00	235.20	235.20
9,636.13000 0.00000	合計-----			9,636.13	12,321.14		9,636.13	12,710.06	0.00	388.92	388.92
513.00000	EURO EUR	07/28/2020		513.00	604.19	1.000000000 ^S 1.179000000	513.00	604.83	0.00	0.64	0.64
14,934.88000		07/28/2020		14,934.88	17,589.56	1.000000000 ^S 1.179000000	14,934.88	17,608.22	0.00	18.66	18.66
15,447.88000 0.00000	合計-----			15,447.88	18,193.75		15,447.88	18,213.05	0.00	19.30	19.30
2,473,364.00000	JAPANESE YEN JPY	07/28/2020		2,473,364	23,523.36	1.000000000 ^S 106.445000000	2,473,364	23,236.07	0.00	-287.29	-287.29
2,498,448.01000	非グループ化の有価証券小計			2,498,448.01	54,038.25		2,498,448.01	54,159.18	0.00	120.93	120.93
2,498,448.01000	外貨建現金勘定合計			2,498,448.01	54,038.25		2,498,448.01	54,159.18	0.00	120.93	120.93

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 2020年8月末現在

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) (米ドル)	単価/為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	未実現損益 通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
先物(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
44,384,031.30000	BRL FORWARD 14 SEP FBR14SEP	08/04/2020		44,384,031.30	8,331,900.00	1.000000000F	44,384,031.30	7,920,246.42	0.00	-411,653.58	-411,653.58
			BRH			5.603870000					
181,668.20	CNY FORWARD 14 SEP FCN14SEP	08/04/2020		181,668.20	25,940.00	1.000000000F	181,668.20	26,374.94	0.00	434.94	434.94
			CNH			6.887910000					
-16,400.00000	EUR FORWARD 13 OCT FEU13OCT	07/14/2020		-16,400.00	-18,628.07	1.000000000F	-16,400.00	-19,354.93	0.00	-726.86	-726.86
						1.180178590					
-8,000.00	GBP FORWARD 13 OCT FGB13OCT	07/14/2020		-8,000.00	-10,024.88	1.000000000F	-8,000.00	-10,554.73	0.00	-529.85	-529.85
						1.319340726					
5,036,634,000.00	IDR FORWARD 14 SEP FID14SEP	08/04/2020		5,036,634,000.00	342,000.00	1.000000000F	5,036,634,000.00	342,976.97	0.00	976.97	976.97
			IDH			14,685.050000000					
-2,562,595.00000	JPY FORWARD 13 OCT FJP13OCT	07/14/2020		-2,562,595	-23,917.13	1.000000000F	-2,562,595	-24,088.00	0.00	-170.87	-170.87
						106.384722500					
5,078,612,704.50000	非グループ化の有価証券小計			5,078,612,704.50	8,647,269.92		5,078,612,704.50	8,235,600.67	0.00	-411,669.25	-411,669.25
5,078,612,704.50000	先物(ポジション)合計			5,078,612,704.50	8,647,269.92		5,078,612,704.50	8,235,600.67	0.00	-411,669.25	-411,669.25
国債											
地方債											
790,000.00000	JPN FIN ORG MUNI 2.375% 02132025	02/11/2016		786,449.60	786,449.60	107.368000000C	848,207.20	848,207.20	61,757.60	0.00	61,757.60
						1.000000000					
990,000.00000	BJPN303P XS1185955306 TOKYO METRO GOVT 2.625% 05292024	06/20/2019		1,047,702.70	1,047,702.70	107.321000000C	1,062,477.90	1,062,477.90	14,775.20	0.00	14,775.20
						1.000000000					
1,780,000.00000	地方債小計			1,834,152.30	1,834,152.30		1,910,685.10	1,910,685.10	76,532.80	0.00	76,532.80
メディアム・ターム・ノート											
750,000.00000	DEV BANK JAPAN 1.875% 08282029	09/12/2019		739,232.60	739,232.60	107.288002014C	804,660.02	804,660.02	65,427.42	0.00	65,427.42
						1.000000000					
750,000.00000	BJPN307P XS2045822462 メディアム・ターム・ノート小計			739,232.60	739,232.60		804,660.02	804,660.02	65,427.42	0.00	65,427.42

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 2020年8月末現在

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) (米ドル)	単価/為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	未実現損益 通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
国債											
公募債											
200,000.00000	DEV BANK JAPAN 3.25% 09062028 BJPN3060 XS1865126343	09/19/2018		196,016.00	196,016.00	118.033000000 ^C 1.000000000	236,066.00	236,066.00	40,050.00	0.00	40,050.00
700,000.00000	JICA 2.125% 10202026 BJPN3054 US47109LAA26	10/13/2016		658,658.93	658,658.93	107.775001526 ^C 1.000000000	754,425.01	754,425.01	95,766.08	0.00	95,766.08
900,000.00000	公募債小計			854,674.93	854,674.93		990,491.01	990,491.01	135,816.08	0.00	135,816.08
3,430,000.00000	国債合計			3,428,059.83	3,428,059.83		3,705,836.13	3,705,836.13	277,776.30	0.00	277,776.30
証拠金勘定											
証拠金勘定											
40,000.00	USD MARGIN USDMAR	08/19/2020		40,000.00	40,000.00	1.000000000 ^S 1.000000000	40,000.00	40,000.00	0.00	0.00	0.00
250,000.00		08/19/2020		250,000.00	250,000.00	1.000000000 ^S 1.000000000	250,000.00	250,000.00	0.00	0.00	0.00
290,000.00000 0.00000	合計-----			290,000.00	290,000.00		290,000.00	290,000.00	0.00	0.00	0.00
290,000.00000	証拠金勘定小計			290,000.00	290,000.00		290,000.00	290,000.00	0.00	0.00	0.00
290,000.00000	証拠金勘定合計			290,000.00	290,000.00		290,000.00	290,000.00	0.00	0.00	0.00
5,096,012,791.61000	ポートフォリオ合計			5,096,067,529.89	23,657,685.55		5,097,210,368.32	24,388,975.66	1,142,838.43	-411,548.32	731,290.11

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(2020年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約198億円)

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、2020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	32	4,918,614,219.52米ドル

(3) その他

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社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。日本円による金額は、2020年9月30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=105.80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。

[次へ](#)

(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)

2020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	4,337,018,208	458,856,526
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,855,171,572	302,077,152
040	その他の要求払預金	1,481,846,636	156,779,374
050	売買目的で保有される金融資産	27,207,999	2,878,606
060	デリバティブ	27,207,999	2,878,606
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 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 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	2,784	295
142	持分証券	2,784	295
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	3,021,982,786	319,725,779
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	3,021,982,786	319,725,779
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	5,168,539	546,831
280	有形固定資産	5,168,539	546,831
290	投資不動産		
300	無形資産	3,009,484	318,403
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,009,484	318,403
330	税金資産	751	79
340	現行税金資産	751	79
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	25,770,032	2,726,469
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	7,420,160,584	785,052,990

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)

2020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	45,589,584	4,823,378
020	デリバティブ	45,589,584	4,823,378
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	6,884,536,105	728,383,920
120	預金	6,880,136,553	727,918,447
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	4,399,552	465,473
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	14,432,457	1,526,954
250	現行税金負債	14,159,986	1,498,127
260	繰延税金負債	272,471	28,827
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	16,811,084	1,778,613
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	6,961,369,230	736,512,865

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)

2020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	19,797,081
020	払込資本	187,117,966	19,797,081
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	1,810	191
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	247,675,774	26,204,097
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	247,675,774	26,204,097
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	23,995,804	2,538,756

米ドル

千円

		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	458,791,354	48,540,125
310	資本および負債合計	7,420,160,584	785,052,990

(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

2020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	34,935,989	3,696,228
020	売買目的で保有される金融資産	15,216,383	1,609,893
025	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 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	14,121,622	1,494,068
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	646,408	68,390
085	負債に係る利息収益	4,951,576	523,877
090	(支払利息)	14,741,325	1,559,632
100	(売買目的で保有される金融負債)	89,472	9,466
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 指定した金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	3,914,625	414,167
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	1,338	142
145	(資産に係る支払利息)	10,735,889	1,135,857
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	0	0
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 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		
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合弁会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	70,505,130	7,459,443
210	(支払手数料)	35,524,547	3,758,497
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	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 (-)損失、純額	4,699,042	497,159
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 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 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	1,263,523	133,681
350	(その他の事業費用)	1,095,269	115,879
355	事業収益合計、純額	60,042,543	6,352,501

米ドル

千円

		米ドル	千円
360	(管理費用)	24,876,507	2,631,934
370	(従業員費用)	10,360,793	1,096,172
380	(その他の管理費用)	14,515,714	1,535,763
385	(破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金)	1,594,626	168,711
390	(減価償却)	1,352,769	143,123
400	(有形固定資産)	719,564	76,130
410	(投資不動産)		
420	(その他の無形資産)	633,205	66,993
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
435	(破綻処理基金および預金保証制度に支払うコミットメント)		
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)	378,022	39,995
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)	0	0
491	(償却後原価における金融資産)	378,022	39,995
510	(子会社、合弁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、合弁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売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	31,840,619	3,368,737
620	(継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入)	7,844,815	829,981
630	継続事業からの税引後利益または(-)損失	23,995,804	2,538,756
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	23,995,804	2,538,756
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	23,995,804	2,538,756

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第一部 証券情報

(8) 申込取扱場所

<訂正前>

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

東京都千代田区丸の内二丁目5番2号

(中略)

(注) 上記販売会社の日本における本支店において、申込みの取扱いを行う。

<訂正後>

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

東京都千代田区丸の内二丁目5番2号^(*)

(中略)

(注) 上記販売会社の日本における本支店において、申込みの取扱いを行う。

(*) 2020年12月21日を変更予定日として、以下に変更される。
東京都千代田区大手町一丁目9番2号

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(2020年6月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約202億円)

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(2020年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約198億円)

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、2020年9月30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=105.80円)による。

() 会社の沿革

(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

2020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

2020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

(2020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	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	日本	社債	2.757	2026/09/13	1,030,000	0.94	964,674.23	1.07	1,102,841.60	6.92
2	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd	日本	社債	7.000 (2022年3月 以降変動金利)	2072/03/15	1,000,000	1.04	1,040,269.85	1.08	1,084,290.01	6.81
3	Japan Finance Organization for Municipalities	日本	公債	2.375	2025/02/13	1,000,000	1.00	995,505.82	1.07	1,070,920.00	6.72
4	Tokyo Metropolitan Government	日本	公債	2.625	2024/05/29	990,000	1.06	1,047,702.70	1.07	1,062,398.74	6.67
5	Fukoku Mutual Life Insurance Co	日本	社債	5.000 (2025年7月 以降変動金利)	永久債	920,000	1.00	923,484.48	1.09	1,004,161.60	6.30
6	ORIX Corp	日本	社債	3.950	2027/01/19	890,000	1.01	902,602.52	1.12	993,907.50	6.24
7	Komatsu Finance America Inc	米国	社債	2.437	2022/09/11	910,000	1.01	919,778.80	1.03	934,997.71	5.87
8	Nippon Life Insurance Co	日本	社債	4.700 (2026年1月 以降変動金利)	2046/01/20	840,000	1.06	890,108.91	1.11	932,500.80	5.85
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	770,000	1.00	770,000.00	1.11	852,836.62	5.35
10	Development Bank of Japan Inc	日本	公債	1.875	2029/08/28	750,000	0.99	739,232.60	1.07	801,330.00	5.03
11	Sompo Japan Nipponkoa Insurance Inc	日本	社債	5.325 (2023年3月 以降変動金利)	2073/03/28	720,000	1.00	723,312.41	1.08	779,457.62	4.89
12	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	日本	社債	2.050	2030/03/31	760,000	1.00	758,510.40	1.00	761,079.20	4.78
13	Japan International Cooperation Agency	日本	公債	2.125	2026/10/20	700,000	0.94	658,658.93	1.07	746,760.00	4.69
14	Sumitomo Life Insurance Co	日本	社債	4.000 (2027年9月 以降変動金利)	2077/09/14	680,000	1.00	678,753.34	1.08	732,672.81	4.60
15	Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd	ケイマン 諸島	社債	4.600	2024/03/27	610,000	1.01	618,178.07	1.09	665,296.51	4.18
16	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	4.436	2024/04/02	530,000	1.03	545,769.65	1.09	578,049.80	3.63
17	Mizuho Financial Group Inc	日本	社債	3.170	2027/09/11	390,000	0.99	384,343.04	1.07	418,941.90	2.63
18	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	3.544	2028/01/17	280,000	0.99	276,976.00	1.11	311,354.39	1.95
19	Development Bank of Japan Inc	日本	公債	3.250	2028/09/06	200,000	0.98	196,016.00	1.17	234,516.01	1.47

	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	
20	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	3.364	2027/07/12	130,000	1.01	131,849.90	1.10	143,062.40	0.90

投資不動産物件

該当事項なし。(2020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。(2020年6月末日現在)

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

(2020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	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	日本	社債	2.757	2026/09/13	1,030,000	0.94	964,674.23	1.09	1,118,899.30	7.25
2	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd	日本	社債	7.000 (2022年3月 以降変動金利)	2072/03/15	1,000,000	1.04	1,040,269.85	1.08	1,078,890.00	6.99
3	ORIX CORP	日本	社債	3.950	2027/01/19	890,000	1.01	902,602.52	1.14	1,013,701.10	6.57
4	Japan Finance Organization for Municipalities	日本	公債	2.375	2025/02/13	790,000	1.00	786,449.60	1.07	848,460.00	5.50
5	Development Bank of Japan Inc	日本	公債	1.875	2029/08/28	750,000	0.99	739,232.60	1.08	807,315.00	5.23
6	Sompo Japan Nipponkoa Insurance Inc	日本	社債	5.325 (2023年3月 以降変動金利)	2073/03/28	720,000	1.00	723,312.41	1.07	773,115.12	5.01
7	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	日本	社債	5.000 (2025年7月 以降変動金利)	永久債	700,000	1.00	702,651.23	1.10	772,926.00	5.01
8	Fukoku Mutual Life Insurance Co	日本	社債	2.050	2030/03/31	760,000	1.00	758,510.40	1.02	772,175.20	5.00
9	Japan International Cooperation Agency	日本	公債	2.125	2026/10/20	700,000	0.94	658,658.93	1.08	755,300.01	4.89
10	Tokyo Metropolitan Government	日本	公債	2.625	2024/05/29	680,000	1.06	719,634.18	1.07	729,198.00	4.72
11	Nippon Life Insurance Co	日本	社債	4.700 (2026年1月 以降変動金利)	2046/01/20	630,000	1.06	667,581.68	1.13	709,008.30	4.59
12	Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd	ケイマン 諸島	社債	4.600	2024/03/27	610,000	1.01	618,178.07	1.10	669,590.88	4.34
13	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	550,000	1.00	550,000.00	1.12	613,574.49	3.97
14	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	4.436	2024/04/02	530,000	1.03	545,769.65	1.10	581,945.30	3.77

	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	
15	Komatsu Finance America Inc	米国	社債	2.437	2022/09/11	520,000	1.01	525,587.89	1.03	536,936.42	3.48
16	Sumitomo Life Insurance Co	日本	社債	4.000 (2027年9月 以降変動金利)	2077/09/14	460,000	1.00	459,156.67	1.11	511,556.80	3.31
17	Central Nippon Expressway	日本	社債	0.886	2025/09/29	500,000	1.00	500,000.00	1.00	501,335.00	3.25
18	Nomura Holdings	日本	社債	1.851	2025/07/16	480,000	1.00	479,977.60	1.02	488,366.40	3.16
19	American Honda Finance	米国	社債	1.200	2025/07/08	480,000	1.00	481,046.40	1.01	484,099.20	3.14
20	Mizuho Financial Group Inc	日本	社債	3.170	2027/09/11	390,000	0.99	384,343.04	1.10	427,350.30	2.77
21	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	3.544	2028/01/17	280,000	0.99	276,976.00	1.12	313,330.64	2.03
22	Development Bank of Japan Inc	日本	公債	3.250	2028/09/06	200,000	0.98	196,016.00	1.18	236,420.00	1.53
23	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	3.364	2027/07/12	130,000	1.01	131,849.90	1.12	145,271.10	0.94

投資不動産物件

該当事項なし。(2020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。(2020年9月末日現在)