

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年11月30日
【計算期間】	第2期中（自 平成23年3月1日 至 平成23年8月31日）
【ファンド名】	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）
【発行者名】	三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ （Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.）
【代表者の役職氏名】	マネージング・ディレクター 皆川 宏
【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
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

1【ファンドの運用状況】

東京海上ストラテジック・トラスト（Tokio Marine Strategic Trust）（以下「トラスト」という。）のサブ・ファンドである東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション（Tokio Marine Rogge Nippon Bond Fund Currency Selection）（以下「ファンド」という。）の運用状況は以下のとおりである。

（１）【投資状況】

資産別および地域別の投資状況

（平成23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	58,223,028.56	23.12
	米国	57,245,667.36	22.73
	英国	20,041,187.62	7.96
	小計	135,509,883.54	53.81
公債	日本	55,495,421.02	22.04
	米国	16,214,398.43	6.44
	小計	71,709,819.45	28.47
変動利付債	ケイマン諸島	38,436,991.08	15.26
	オランダ領 アンティル諸島	9,985,087.34	3.96
	小計	48,422,078.42	19.23
小計		255,641,781.41	101.51
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 3,806,621.83	- 1.51
合計（純資産総額）		251,835,159.58 （約19,303百万円）	100.00

（注１）投資比率とは、各サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」または「ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、平成23年9月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝76.65円）による。

（注３）ファンドは、ケイマン法に基づいて設定されているが、ファンド証券は米ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨をもって行う。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

平成23年９月末日までの１年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

<米ドルヘッジクラス>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成22年10月末日	40,371,768.27	3,094,496	102.28	7,840
11月末日	47,970,753.52	3,676,958	101.36	7,769
12月末日	56,169,953.65	4,305,427	99.48	7,625
平成23年１月末日	57,439,005.61	4,402,700	99.73	7,644
２月末日	56,843,093.04	4,357,023	99.35	7,615
３月末日	56,239,894.49	4,310,788	97.96	7,509
４月末日	55,649,031.62	4,265,498	98.48	7,548
５月末日	55,659,962.55	4,266,336	99.80	7,650
６月末日	51,743,006.23	3,966,101	99.88	7,656
７月末日	49,979,053.38	3,830,894	101.09	7,749
８月末日	45,562,207.10	3,492,343	101.84	7,806
９月末日	45,963,006.79	3,523,064	101.51	7,781

<ブラジル・リアルヘッジクラス>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成22年10月末日	214,842,563.12	16,467,682	105.16	8,061
11月末日	244,375,464.07	18,731,379	103.53	7,936
12月末日	265,431,322.91	20,345,311	103.67	7,946
平成23年１月末日	271,279,277.50	20,793,557	104.24	7,990
２月末日	269,344,174.34	20,645,231	104.60	8,018
３月末日	263,608,104.10	20,205,561	105.05	8,052
４月末日	255,507,233.34	19,584,629	109.33	8,380
５月末日	242,497,162.62	18,587,408	109.29	8,377
６月末日	223,447,120.10	17,127,222	110.74	8,488
７月末日	217,152,737.87	16,644,757	112.10	8,592
８月末日	224,084,728.25	17,176,094	110.59	8,477
９月末日	190,818,431.18	14,626,233	93.78	7,188

< 中国元ヘッジクラス >

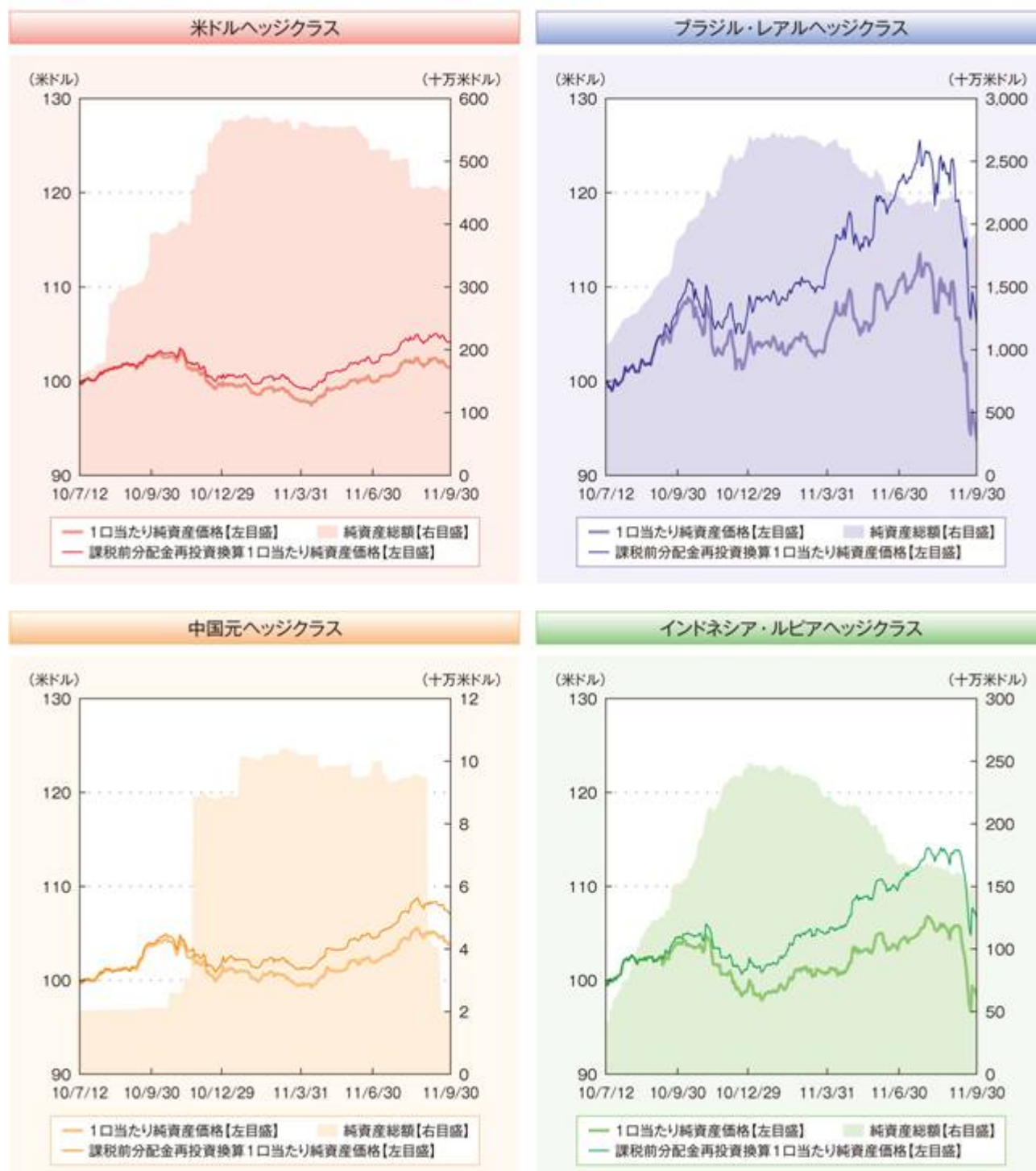
	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成22年10月末日	258,225.47	19,793	103.21	7,911
11月末日	887,745.00	68,046	102.02	7,820
12月末日	887,281.32	68,010	100.80	7,726
平成23年 1 月末日	1,015,144.49	77,811	100.99	7,741
2 月末日	1,024,122.96	78,499	100.88	7,732
3 月末日	1,020,186.70	78,197	99.61	7,635
4 月末日	979,025.41	75,042	100.50	7,703
5 月末日	991,607.76	76,007	101.79	7,802
6 月末日	999,270.96	76,594	101.95	7,814
7 月末日	938,925.60	71,969	103.50	7,933
8 月末日	953,323.41	73,072	105.08	8,054
9 月末日	200,705.22	15,384	103.88	7,962

< インドネシア・ルピアヘッジクラス >

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成22年10月末日	20,036,558.83	1,535,802	103.30	7,918
11月末日	23,079,700.84	1,769,059	100.66	7,716
12月末日	24,643,210.49	1,888,902	99.13	7,598
平成23年 1 月末日	24,254,097.32	1,859,077	98.73	7,568
2 月末日	24,023,343.91	1,841,389	101.12	7,751
3 月末日	22,174,999.14	1,699,714	100.87	7,732
4 月末日	21,165,202.03	1,622,313	101.87	7,808
5 月末日	19,894,493.23	1,524,913	104.20	7,987
6 月末日	16,848,692.89	1,291,452	103.81	7,957
7 月末日	16,685,874.25	1,278,972	105.72	8,103
8 月末日	15,887,359.71	1,217,766	105.47	8,084
9 月末日	14,853,016.39	1,138,484	98.40	7,542

<参考情報>

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2010年7月12日～2011年9月30日）



（注）課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、各クラスの公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金（課税前）をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なる。以下同じ。

【分配の推移】

平成23年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成22年10月1日～平成23年9月末日	2.40	184

<ブラジル・レアルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成22年10月1日～平成23年9月末日	12.00	920

<中国元ヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成22年10月1日～平成23年9月末日	3.00	230

<インドネシア・ルピアヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成22年10月1日～平成23年9月末日	7.65	586

< 参考情報 >

分配の推移（2011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	
2011年 9月	0.20
2011年 8月	0.20
2011年 7月	0.20
2011年 6月	0.20
2011年 5月	0.20
2011年 4月	0.20
2011年 3月	0.20
2011年 2月	0.20
2011年 1月	0.20
2010年12月	0.20
2010年11月	0.20
2010年10月	0.20
2010年 9月	0.20
直近1年間累計	2.40
設定来累計	2.60

ブラジル・レアルヘッジクラス	
2011年 9月	1.15
2011年 8月	1.15
2011年 7月	1.15
2011年 6月	0.95
2011年 5月	0.95
2011年 4月	0.95
2011年 3月	0.95
2011年 2月	0.95
2011年 1月	0.95
2010年12月	0.95
2010年11月	0.95
2010年10月	0.95
2010年 9月	0.95
直近1年間累計	12.00
設定来累計	12.95

中国元ヘッジクラス	
2011年 9月	0.25
2011年 8月	0.25
2011年 7月	0.25
2011年 6月	0.25
2011年 5月	0.25
2011年 4月	0.25
2011年 3月	0.25
2011年 2月	0.25
2011年 1月	0.25
2010年12月	0.25
2010年11月	0.25
2010年10月	0.25
2010年 9月	0.25
直近1年間累計	3.00
設定来累計	3.25

インドネシア・ルピアヘッジクラス	
2011年 9月	0.75
2011年 8月	0.75
2011年 7月	0.75
2011年 6月	0.60
2011年 5月	0.60
2011年 4月	0.60
2011年 3月	0.60
2011年 2月	0.60
2011年 1月	0.60
2010年12月	0.60
2010年11月	0.60
2010年10月	0.60
2010年 9月	0.60
直近1年間累計	7.65
設定来累計	8.25

【収益率の推移】

<米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成22年10月1日～平成23年9月末日	1.43%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<ブラジル・リアルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成22年10月1日～平成23年9月末日	- 0.97%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<中国元ヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成22年10月1日～平成23年9月末日	3.14%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<インドネシア・ルピアヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成22年10月1日～平成23年9月末日	2.10%

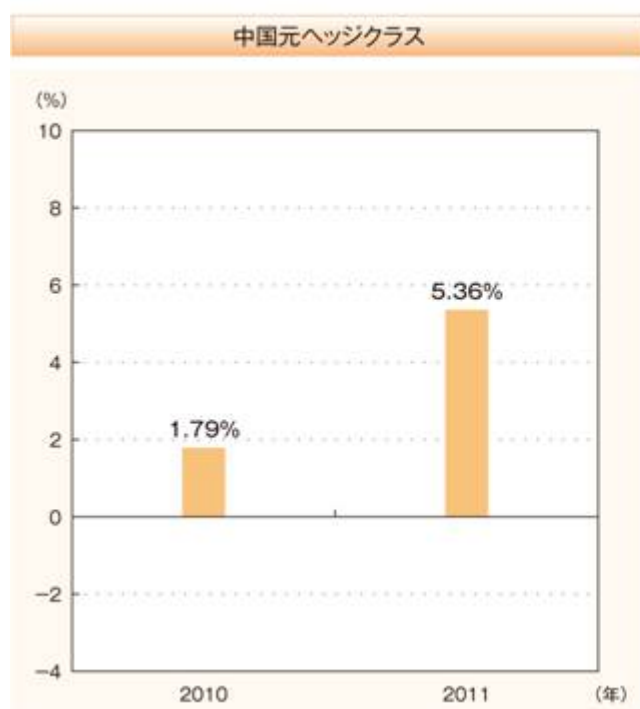
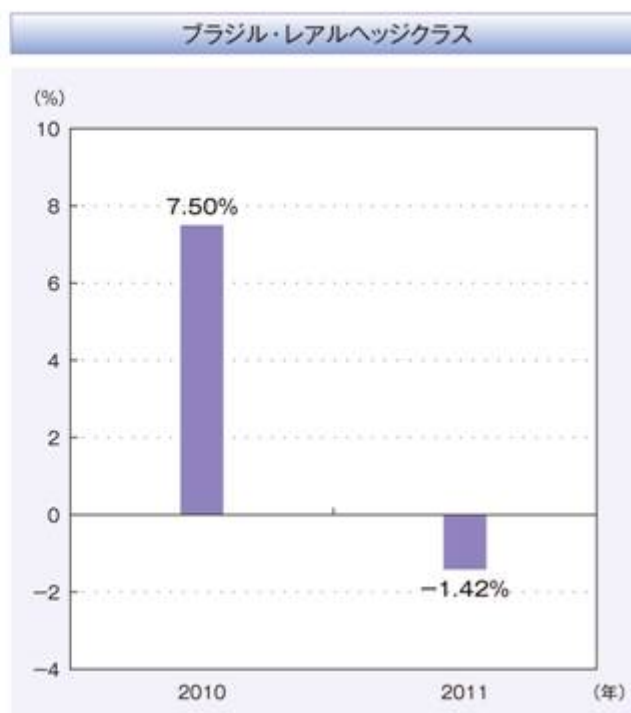
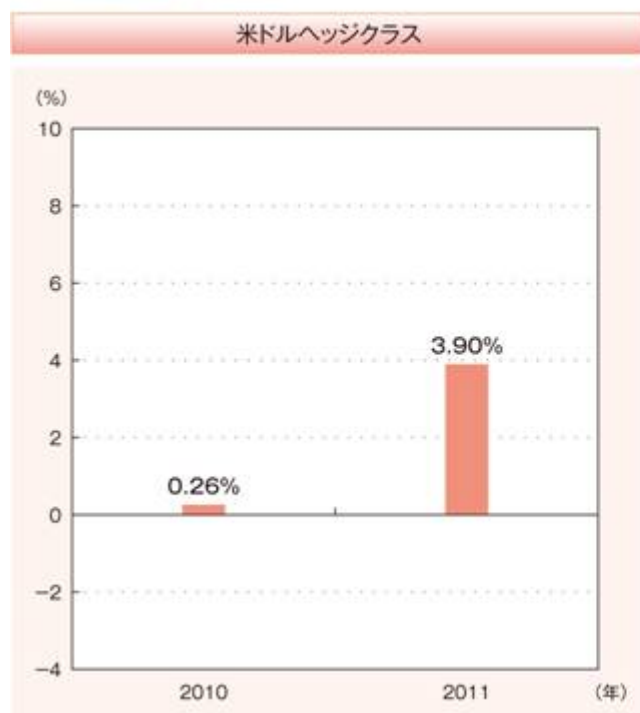
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

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。2011年は1月1日から9月末日までの収益率である。

(注3) ファンドおよび各クラスに、ベンチマークはない。

2【販売及び買戻しの実績】

平成23年9月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに平成23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
308,676 (308,676)	231,691 (231,691)	452,791 (452,791)

<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
1,794,588 (1,794,588)	1,512,189 (1,512,189)	2,034,712 (2,034,712)

<中国元ヘッジクラス>

販売口数	買戻口数	発行済口数
8,800 (8,800)	8,910 (8,910)	1,932 (1,932)

<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
134,731 (134,731)	130,198 (130,198)	150,947 (150,947)

（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。

3【ファンドの経理状況】

- a．サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の平成23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＝76.65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。

（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

2011年 8 月31日現在

米ドル

千円

資産	米ドル	千円
現金	4,840,372.23	371,015
銀行預金 - 基準通貨	3,987,478.12	305,640
銀行預金 - 外国通貨	852,894.11	65,374
有価証券（取得原価）	264,148,845.60	20,247,009
債券（取得原価）	264,148,845.60	20,247,009
未実現評価損益	13,779,150.30	1,056,172
未実現時価評価損益	3,412,829.96	261,593
未実現通貨運用損益	10,310,569.93	790,305
未実現通貨繰延損益	55,750.41	4,273
未収収益	5,353,472.06	410,344
債券に係る未収利息	5,353,472.06	410,344
資本証券	2,991,340.88	229,286
受益証券販売未収金	2,991,340.88	229,286
前払費用	225,425.26	17,279
設立費用	225,425.26	17,279
資産合計：	291,338,606.33	22,331,104
負債		
資本証券	4,134,406.43	316,902
受益証券買戻未払金	4,134,406.43	316,902
未払費用	716,581.43	54,926
未払監査費用	30,916.73	2,370
未払保管報酬	72,513.05	5,558
未払報告書作成費用	4,041.76	310
未払投資運用報酬	338,394.36	25,938
未払受託報酬	4,834.26	371
未払代行協会員報酬	24,171.03	1,853
未払販売報酬	241,710.24	18,527
負債合計：	4,850,987.86	371,828

2011年8月31日現在

	米ドル	千円
資本		
ファンド受益証券	265,635,966.05	20,360,997
発行済ファンド受益証券（額面価額）	263,329,500.00	20,184,206
ブラジル・リアル	202,618,400.00	15,530,700
インドネシア・ルピア	15,064,100.00	1,154,663
中国元	907,200.00	69,537
米ドル	44,739,800.00	3,429,306
受益証券額面超過額	2,306,466.05	176,791
ブラジル・リアル	1,754,735.17	134,500
インドネシア・ルピア	167,354.91	12,828
中国元	17,099.80	1,311
米ドル	367,276.17	28,152
分配金支払額	(28,669,060.70)	(2,197,484)
分配金支払額	(28,669,060.70)	(2,197,484)
ブラジル・リアル	(25,981,976.90)	(1,991,519)
インドネシア・ルピア	(1,471,141.20)	(112,763)
中国元	(23,311.00)	(1,787)
米ドル	(1,192,631.60)	(91,415)
当期純利益	49,520,713.12	3,795,763
資本合計：	286,487,618.47	21,959,276
負債および資本合計	291,338,606.33	22,331,104
純資産額合計	286,487,618.47	21,959,276
発行済受益証券総数	2,633,295.0000口	
受益証券1口当たり純資産額合計	108.79	8,339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

2011年3月1日から
2011年8月31日までの期間

米ドル

千円

収益

実現損益

13,303,508.20

1,019,714

為替取引に係る実現利益

41,745,151.41

3,199,766

ブラジル・レアル

32,970,276.73

2,527,172

インドネシア・ルピア

1,551,013.75

118,885

中国元

25,820.60

1,979

為替取引に係る実現損失

(27,458,269.30)

(2,104,676)

ブラジル・レアル

(14,056,954.90)

(1,077,466)

インドネシア

(302,260.30)

(23,168)

中国元

(12,881.62)

(987)

市場に係る実現利益

573,104.27

43,928

市場に係る実現損失

(2,408,194.76)

(184,588)

通貨に係る実現利益

1,245,788.01

95,490

ブラジル・レアル

0.04

0

インドネシア・ルピア

0.03

0

通貨に係る実現損失

(394,071.43)

(30,206)

ブラジル・レアル

(0.03)

(0)

インドネシア・ルピア

(0.02)

(0)

中国元

0.00

0

その他の利益

0.00

0

受取利息

6,745,127.13

517,014

現金に係る受取利息

252.93

19

債券に係る受取利息

6,744,874.20

516,995

2011年3月1日から
2011年8月31日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	13,202,198.73	1,011,949
未実現時価評価損益	8,783,529.27	673,258
未実現通貨運用損益	4,445,005.43	340,710
ブラジル・レアル	140,451.65	10,766
インドネシア・ルピア	(338,914.43)	(25,978)
中国元	5,105.83	391
未実現通貨繰延損益	(26,335.97)	(2,019)
収益合計：	33,250,834.06	2,548,676
費用		
費用 - 報酬	2,363,718.36	181,179
監査費用	16,634.96	1,275
保管報酬	236,751.22	18,147
報告書作成費用	1,521.01	117
弁護士費用	15,973.28	1,224
投資運用報酬	1,104,839.14	84,686
受託報酬	15,783.49	1,210
設立費用償却	75,969.92	5,823
印刷費	16,458.62	1,262
経費	999.86	77
代行協会員報酬	78,917.08	6,049
販売報酬	789,170.84	60,490
副保管会社報酬	10,668.94	818
その他の費用	30.00	2
源泉徴収税費用	(24.35)	(2)
源泉徴収税	(24.35)	(2)
費用合計：	2,363,694.01	181,177
投資純利益	30,887,140.05	2,367,499

（２）【投資有価証券明細表等】

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
現金											
基準通貨現金											
3,987,478.1200	米ドル現金	8/31/2011		3,987,478.12	3,987,478.12	1.000000000	3,987,478.12	3,987,478.12	0.00	0.00	0.00
	米ドル現金					1.000000000					
3,987,478.1200	基準通貨現金 小計			3,987,478.12	3,987,478.12		3,987,478.12	3,987,478.12	0.00	0.00	0.00
3,987,478.1200	現金合計			3,987,478.12							
		3,987,478.12		3,987,478.12	3,987,478.12		0.00	0.00	0.00		
社債											
メディアム・ターム・ノート											
4,500,000.00	EAST JAPAN RAILWAY 4.75% 12082031 BJPN2981 XS0276809927 Local Currency: GBP	7/13/2010		4,382,167.00	6,802,439.48	100.885002100 ^C 1.628250002	4,539,825.09	7,391,970.22	256,706.79	332,823.95	589,530.74
14,000,000.00000	JTI UK FINANCE 4.5% 04022014 BGBR1748 XS0269190533 Local Currency: EUR	9/9/2010		15,161,937.00	19,897,188.27	106.733001700 ^C 1.439800001	14,942,620.24	21,514,384.63	- 315,772.27	1,932,968.64	1,617,196.36
20,500,000.0000	mitsubishi corp 2.75% 09162015 BJPN2986 XS0540225496	9/8/2010		20,659,074.00	20,659,074.00	103.616996700 ^C 1.000000000	21,241,484.32	21,241,484.32	582,410.32	0.00	582,410.32
6,000,000.0000	TOYOTA MOTOR CREDIT 3.2% 06172015 BUSA5999 US89233P4B94	7/14/2010		6,245,673.15	6,245,673.15	106.373001000 ^C 1.000000000	6,382,380.06	6,382,380.06	136,706.91	0.00	136,706.91
5,400,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT 4% 12072017 BUSA6707 XS0595707570 Local Currency: GBP	2/18/2011		5,391,306.00	8,738,498.34	104.276000900 ^C 1.628250002	5,630,904.05	9,168,519.53	390,125.52	39,895.67	430,021.19
50,400,000.0000	メディアム・ターム・ノート 小計			51,840,157.15	62,342,873.24		52,737,213.76	65,698,738.76	1,050,177.27	2,305,688.26	3,355,865.52

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
私募債											
3,500,000.0000	AMERICAN HONDA FIN 3.50% 03162015 BUSA6131 US02666QF407	8/11/2010		3,717,858.45	3,717,858.45	106.424003600 ^C 1.000000000	3,724,840.13	3,724,840.13	6,981.68	0.00	6,981.68
10,500,000.0000	AMERICAN HONDA FIN 2.50% 09212015 BUSA6297 US02666QG645	9/14/2010		10,562,030.20	10,562,030.20	102.183080000 ^C 1.000000000	10,729,223.40	10,729,223.40	167,193.20	0.00	167,193.20
1,200,000.0000	NISSAN MOTOR ACCEPT 4.5% 01302015 BUSA5704 US654742AB12	8/11/2010		1,276,340.00	1,276,340.00	107.201877000 ^C 1.000000000	1,286,422.52	1,286,422.52	10,082.52	0.00	10,082.52
15,200,000.0000	私募債 小計			15,556,228.65	15,556,228.65		15,740,486.05	15,740,486.05	184,257.40	0.00	184,257.40
公募債											
3,300,000.0000	AMERICAN HONDA FIN 3.50% 03162015 BUSA6135 US02666RAL50	8/16/2010		3,490,470.00	3,490,470.00	106.748776000 ^C 1.000000000	3,522,709.61	3,522,709.61	32,239.61	0.00	32,239.61
3,200,000.0000	AMERICAN HONDA FIN 2.50% 09212015 BUSA6368 US02666RAM34	10/19/2010		3,271,297.50	3,271,297.50	102.861000000 ^C 1.000000000	3,291,552.00	3,291,552.00	20,254.50	0.00	20,254.50
5,000,000.0000	DAI-ICHI MUTUAL LIF 7.25 % 07252049 BJPN2998 USJ09748AB01	5/10/2011		5,014,750.00	5,014,750.00	102.222999500 ^C 1.000000000	5,111,149.98	5,111,149.98	96,399.97	0.00	96,399.97
21,500,000.0000	DEVELOP BK OF JAPAN 5.125% 02012017 BJPN2979 XS0285449368	7/13/2010		24,755,347.01	24,755,347.01	118.205001800 ^C 1.000000000	25,414,075.39	25,414,075.39	658,728.38	0.00	658,728.38
5,000,000.0000	JAPAN BANK FOR INTL 5.25% 03232016 BJPN2654 XS0247673295	7/12/2010		5,768,690.96	5,768,690.96	117.311996400 ^C 1.000000000	5,865,599.82	5,865,599.82	96,908.86	0.00	96,908.86

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
公募債											
4,200,000.0000	JAPAN FIN CORP MUNI 5% 05162017 BJPN2980 XS0301003959	7/13/2010		4,818,040.41	4,818,040.41	117.943000700 ^C 1.000000000	4,953,606.03	4,953,606.03	135,565.62	0.00	135,565.62
18,900,000.0000	NISSAN MOTOR ACC 4.5% 01302015 BUSA6015 USU65478AD87	7/14/2010		19,882,318.00	19,882,318.00	107.139999300 ^C 1.000000000	20,249,459.87	20,249,459.87	367,141.87	0.00	367,141.87
1,400,000.0000	SUMITOMO MITSUI 3.15% 07222015 BJPN2983 USJ7771KMX20	11/17/2010		1,457,260.00	1,457,260.00	104.226997300 ^C 1.000000000	1,459,177.96	1,459,177.96	1,917.96	0.00	1,917.96
15,200,000.00000	SUMITOMO MITSUI BK 4% 11092020 BJPN2991 XS0555833580 Local Currency: EUR	10/29/2010		14,928,716.00	20,569,625.61	97.572998000 ^C 1.439800001	14,831,095.70	21,353,811.60	- 140,553.71	924,739.70	784,185.99
77,700,000.0000	公募債 小計			83,386,889.88	89,027,799.49		84,698,426.36	91,221,142.26	1,268,603.06	924,739.70	2,193,342.76
143,300,000.0000	社債合計			150,783,275.68	166,926,901.38		153,176,126.17	172,660,367.07	2,503,037.73	3,230,427.96	5,733,465.68
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
279,447.69	BRITISH POUND GBP Local Currency: GBP	8/10/2011		279,447.69	453,208.26	1.000000000 ^S 1.628250002	279,447.69	455,010.70	0.00	1,802.44	1,802.44
271,607.83000	EURO EUR Local Currency: EUR	8/10/2011		271,607.83	386,253.96	1.000000000 ^S 1.439800001	271,607.83	391,060.95	0.00	4,806.99	4,806.99
1,040,002.0000	JAPANESE YEN JPY Local Currency: JPY	9/8/2010		1,040,002	13,431.89	1.000000000 ^S 76.470000000	1,040,002	13,600.13	0.00	168.24	168.24
1,591,057.5200	非グループ化の有価証券 小計			1,591,057.52	852,894.11		1,591,057.52	859,671.78	0.00	6,777.67	6,777.67
1,591,057.5200	外貨建現金勘定合計			1,591,057.52	852,894.11		1,591,057.52	859,671.78	0.00	6,777.67	6,777.67

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
先物 (ポジション)											
非グループ化の有価証券											
- 2,839,000.00	BRL FORWARD 16 SEP FBR16SEP Local Currency: BRL	8/30/2011		- 2,839,000.00	- 1,782,955.47	1.000000000 F 1.592440000	- 2,839,000.00	- 1,782,798.72	0.00	156.75	156.75
358,783,972.80	BRL FORWARD 16 SEP FBR16SEP Local Currency: BRL	MultiLot		358,783,972.80	222,818,000.00	1.000000000 F 1.592440000	358,783,972.80	225,304,546.98	0.00	2,486,546.98	2,486,546.98
6,088,692.30	CNY FORWARD 16 SEP FCN16SEP Local Currency: CNY	MultiLot		6,088,692.30	948,000.00	1.000000000 F 6.371160000	6,088,692.30	955,664.64	0.00	7,664.64	7,664.64
12,165,313.00000	EUR FORWARD 12 OCT FEU12OCT Local Currency: EUR	MultiLot		12,165,313.00	17,604,581.40	1.000000000 F 1.439078848	12,165,313.00	17,506,844.62	0.00	- 97,736.78	- 97,736.78
- 55,497,565.91000	EUR FORWARD 12 OCT FEU12OCT Local Currency: EUR	MultiLot		- 55,497,565.91	- 80,103,414.45	1.000000000 F 1.439078848	- 55,497,565.91	- 79,865,373.24	0.00	238,041.21	238,041.21
- 49,289,448.50	GBP FORWARD 12 OCT FGB12OCT Local Currency: GBP	MultiLot		- 49,289,448.50	- 80,712,475.83	1.000000000 F 1.627476345	- 49,289,448.50	- 80,217,411.47	0.00	495,064.36	495,064.36
2,565,291.57	GBP FORWARD 12 OCT FGB12OCT Local Currency: GBP	7/26/2011		2,565,291.57	4,177,064.26	1.000000000 F 1.627476345	2,565,291.57	4,174,951.35	0.00	- 2,112.91	- 2,112.91
144,539,447,800.00	IDR FORWARD 16 SEP FID16SEP Local Currency: IDR	MultiLot		144,539,447,800.00	16,941,000.00	1.000000000 F 8,551.133333333	144,539,447,800.00	16,902,958.03	0.00	- 38,041.97	- 38,041.97
- 8,978,243,000.00	IDR FORWARD 16 SEP FID16SEP Local Currency: IDR	MultiLot		- 8,978,243,000.00	- 1,045,984.97	1.000000000 F 8,551.133333333	- 8,978,243,000.00	- 1,049,947.73	0.00	- 3,962.76	- 3,962.76

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格
先物（ポジション）						
非グループ化の有価証券						
15,992,935.0000	JPY FORWARD 12 OCT FJP12OCT Local Currency: JPY	7/26/2011		15,992,935	204,750.20	1.000000000 ^F 76.441440000
- 16,981,370.0000	JPY FORWARD 12 OCT FJP12OCT Local Currency: JPY	7/26/2011		- 16,981,370	- 217,408.85	1.000000000 ^F 76.441440000
135,832,193,620.2600	非グループ化の有価証券 小計			135,832,193,620.26	98,831,156.29	
135,832,193,620.2600	先物（ポジション）合計			135,832,193,620.26	98,831,156.29	
国債						
ソブリン債						
17,300,000.0000	JAPAN FIN ORG MUNI 4% 01132021 BJPN2995 XS0568671555	1/6/2011		17,156,410.00	17,156,410.00	110.433998100 ^C 1.000000000
2,600,000.0000	US TREASURY N/B 4.25% 08152014 BUSA2950 US912828CT50	8/19/2011		2,899,821.21	2,899,821.21	111.511718700 ^C 1.000000000
2,600,000.0000	US TREASURY N/B 3.25% 07312016 BUSA6257 US912828LD08	8/19/2011		2,894,133.71	2,894,133.71	111.152343700 ^C 1.000000000
22,500,000.0000	ソブリン債 小計			22,950,364.92	22,950,364.92	
22,500,000.0000	国債合計			22,950,364.92	22,950,364.92	
変動利付債						
変動金利						
6,500,000.00	BANK TOKYO CURACAO FRN 01202017 BANT0063 XS0261579436 Local Currency: GBP	7/16/2010		6,692,638.00	10,475,311.38	98.532384000 ^C 1.628250002

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

		未実現損益				
口数 / 金額	種類	価額 （表示通貨） （米ドル）	価額 （基準通貨） （米ドル）	市場 （米ドル）	通貨 （米ドル）	合計 （米ドル）
先物（ポジション）						
非グループ化の有価証券						
15,992,935.0000	JPY FORWARD 12 OCT FJP12OCT Local Currency: JPY	15,992,935	209,218.13	0.00	4,467.93	4,467.93
- 16,981,370.0000	JPY FORWARD 12 OCT FJP12OCT Local Currency: JPY	- 16,981,370	- 222,148.75	0.00	- 4,739.90	- 4,739.90
135,832,193,620.2600	非グループ化の有価証券 小計	135,832,193,620.26	101,916,503.84	0.00	3,085,347.55	3,085,347.55
135,832,193,620.2600	先物（ポジション）合計	135,832,193,620.26	101,916,503.84	0.00	3,085,347.55	3,085,347.55
国債						
ソブリン債						
17,300,000.0000	JAPAN FIN ORG MUNI 4% 01132021 BJPN2995 XS0568671555	19,105,081.67	19,105,081.67	1,948,671.67	0.00	1,948,671.67
2,600,000.0000	US TREASURY N/B 4.25% 08152014 BUSA2950 US912828CT50	2,899,304.69	2,899,304.69	- 516.52	0.00	- 516.52
2,600,000.0000	US TREASURY N/B 3.25% 07312016 BUSA6257 US912828LD08	2,889,960.94	2,889,960.94	- 4,172.77	0.00	- 4,172.77
22,500,000.0000	ソブリン債 小計	24,894,347.30	24,894,347.30	1,943,982.38	0.00	1,943,982.38
22,500,000.0000	国債合計	24,894,347.30	24,894,347.30	1,943,982.38	0.00	1,943,982.38
変動利付債						
変動金利						
6,500,000.00	BANK TOKYO CURACAO FRN 01202017 BANT0063 XS0261579436 Local Currency: GBP	6,404,604.96	10,428,298.04	- 468,989.80	421,976.46	- 47,013.34

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (米ドル)	取得原価 (基準通貨) (米ドル)	基準価格
変動利付債						
変動金利						
14,050,000.00000	MUFG CAPITAL FIN 2	7/19/2010		12,638,692.50	16,653,681.36	92.078002900 ^C
	FRN 07252049					1.439800001
	BCYM0460		XS0247684490			
	Local Currency: EUR					
16,100,000.00	NORINCHUKIN FIN	7/12/2010		16,417,777.83	25,551,307.45	99.129452000 ^C
	FRN 09282016					1.628250002
	BCYM0481		XS0269183165			
	Local Currency: GBP					
2,600,000.0000	SMFG PREF CAP	8/16/2010		2,563,500.00	2,563,500.00	100.393997100 ^C
	FRN 01252049					1.000000000
	BCYM0484		USG8227UAA46			
12,100,000.00	STB FINANCE	7/16/2010		12,202,900.00	19,027,779.11	99.349260000 ^C
	FRN 10202049					1.628250002
	BCYM0381		XS0268400156			
	Local Currency: GBP					
51,350,000.0000	変動金利 小計			50,515,508.33	74,271,579.30	
51,350,000.0000	変動利付債合計			50,515,508.33	74,271,579.30	
136,054,922,155.9000	ポートフォリオ合計			136,062,021,304.83	367,820,374.12	

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
種別・グループ別 2011年 8 月31日現在

		未実現損益				
口数 / 金額	種類	価額 (表示通貨) (米ドル)	価額 (基準通貨) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
変動利付債						
変動金利						
14,050,000.00000	MUFG CAPITAL FIN 2 FRN 07252049 BCYM0460 Local Currency: EUR	12,936,959.41	18,626,634.17	429,444.69	1,543,508.11	1,972,952.81
16,100,000.00	NORINCHUKIN FIN FRN 09282016 BCYM0481 Local Currency: GBP	15,959,841.77	25,986,612.40	- 745,634.39	1,180,939.34	435,304.95
2,600,000.0000	SMFG PREF CAP FRN 01252049 BCYM0484	2,610,243.92	2,610,243.92	46,743.92	0.00	46,743.92
12,100,000.00	STB FINANCE FRN 10202049 BCYM0381 Local Currency: GBP	12,021,260.46	19,573,617.37	- 295,754.58	841,592.84	545,838.26
51,350,000.0000	変動金利 小計	49,932,910.52	77,225,405.90	- 1,034,190.16	3,988,016.75	2,953,826.60
51,350,000.0000	変動利付債合計	49,932,910.52	77,225,405.90	- 1,034,190.16	3,988,016.75	2,953,826.60
136,054,922,155.9000	ポートフォリオ合計	136,065,775,539.89	381,543,774.01	3,412,829.95	10,310,569.93	13,723,399.88

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（平成23年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約28億円）

発行済株式総数 1,002,080株

（２）【事業の内容及び営業の状況】

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命を解除することができる。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の4分の3以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の4分の3を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合、管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不履行、誠実に行為しないこと、過失、詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視の場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、()ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは()かかる者の行為に関係し、もしくはこれらから生じ、もしくはこれらに基づき、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が現実に一時的に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、かかる行為が故意の不履行、誠実に行為しないこと、過失、詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、平成23年９月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

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	25	7,264,292,104米ドル

（３）【その他】

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

5【管理会社の経理の概況】

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．管理会社の原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、円貨換算が併記されている。日本円への換算には、平成23年9月30日現在における株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝76.65円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2011年6月30日現在

（単位：米ドル）

資産		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	30,727,952.00	2,355,298
1.2	売買目的で保有される金融資産	1,748,169.00	133,997
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	1,748,169.00	133,997
1.2.2	持分証券		
1.2.3	債務証券		
1.2.4	ローンおよび貸付金		
1.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0.00	0
1.3.1	持分証券		
1.3.2	債務証券		
1.3.3	ローンおよび貸付金		
1.4	売却可能金融資産	2,104,952.00	161,345
1.4.1	持分証券	2,104,952.00	161,345
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	1,086,205,285.00	83,257,635
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	1,086,205,285.00	83,257,635
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
1.9	有形資産	386,163.00	29,599
1.9.1	有形固定資産	386,163.00	29,599
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	1,165,631.00	89,346
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	1,165,631.00	89,346
1.12	税金資産	1,703,114.00	130,544
1.12.1	現行税金資産	1,703,114.00	130,544
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	24,816,525.00	1,902,187
1.14	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
1.15	資産合計	1,148,857,791.00	88,059,950

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2011年6月30日現在

（単位：米ドル）

負債

米ドル

千円

		米ドル	千円
2.1	中央銀行預金		
2.2	売買目的で保有される金融負債	239,784.00	18,379
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	239,784.00	18,379
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証券（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証券（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	1,022,637,911.00	78,385,196
2.4.1	金融機関からの預金	752,787,973.00	57,701,198
2.4.2	金融機関以外からの預金	269,849,938.00	20,683,998
2.4.3	債務証券（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
2.8	引当金	0.00	0
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務		
2.8.3	年金およびその他の退職後給付金債務		
2.8.4	ローン契約および保証		
2.8.5	有償契約		
2.8.99	その他の引当金	0.00	0
2.9	税金負債	13,469,496.00	1,032,437
2.9.1	現行税金負債	11,023,417.00	844,945
2.9.2	繰延税金負債	2,446,079.00	187,492
2.10	その他の負債	10,757,985.00	824,600
2.11	要求払株式資本（例えば、共同株式）		
2.12	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
2.13	負債合計	1,047,105,176.00	80,260,612

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2011年6月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	2,845,092
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	2,845,092
3.1.2	未払込請求資本		
3.2	株式発行差金		
3.3	その他のエクイティ	0.00	0
3.3.1	複合金融商品のエクイティ部分		
3.3.99	その他のエクイティ商品		
3.4	再評価準備金およびその他の評価差額：	1,186,131.00	90,917
3.4.1	有形資産		
3.4.2	無形資産		
3.4.3	外国事業純投資のヘッジ（有効部分）		
3.4.4	外貨換算		
3.4.5	キャッシュ・フロー・ヘッジ（有効部分）		
3.4.6	売却可能金融資産	1,186,131.00	90,917
3.4.7	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	50,184,867.00	3,846,670
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	13,263,648.00	1,016,659
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	101,752,615.00	7,799,338
3.11	負債および資本合計	1,148,857,791.00	88,059,950

（２）【損益の状況】

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

損益計算書

2011年６月30日に終了した期間

（単位：米ドル）

		米ドル	千円
5.1	金融および運用収益および費用（＋／－）	30,896,321.00	2,368,203
5.2	利息収益	5,889,587.00	451,437
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	127,622.00	9,782
5.2.2	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）	2,665,530.00	204,313
5.2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.2.4	売却可能金融資産		
5.2.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）	3,096,435.00	237,342
5.2.6	満期保有目的投資有価証券		
5.2.7	デリバティブ－ヘッジ会計、金利リスク		
5.2.99	その他の資産		
5.3	（支払利息）（－）	2,146,641.00	164,540
5.3.1	中央銀行からの預金	0.00	0
5.3.2	売買目的で保有される金融負債（区別して計上される場合）	17,188.00	1,317
5.3.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債		
5.3.4	償却後原価で測定される金融負債	2,129,453.00	163,223
5.3.5	デリバティブ－ヘッジ会計、金利リスク		
5.3.99	その他の負債		
5.4	要求払株式資本に係る費用（－）		
5.5	受取配当（＋）	348,254.00	26,694
5.5.1	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）		
5.5.2	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.5.3	売却可能金融資産	348,254.00	26,694
5.6	受取手数料（＋）	44,460,362.00	3,407,887
5.7	（支払手数料）（－）	18,861,846.00	1,445,760
5.8	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負債に係る実現利益（損失）、純額（＋／－）	0.00	0
5.8.1	売却可能金融資産		
5.8.2	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）		
5.8.3	満期保有目的投資有価証券		
5.8.4	償却後原価で測定される金融負債		
5.8.99	その他		
5.9	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）	1,093,544.00	83,820
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	1,093,544.00	83,820
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）		

米ドル

千円

5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（＋／－）		
5.12	為替差額、純額（＋／－）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.14	その他の事業収益（＋）	634,960.00	48,670
5.15	その他の事業費用（－）	521,899.00	40,004
5.16	一般管理費（－）	13,719,082.00	1,051,568
5.16.1	従業員費用（－）	6,627,339.00	507,986
5.16.2	一般管理費用（－）	7,091,743.00	543,582
5.17	減価償却（＋／－）	576,073.00	44,156
5.17.1	有形固定資産	152,968.00	11,725
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	423,105.00	32,431
5.18	引当金（＋／－）	0.00	0
5.19	減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1.1	取得原価で測定される金融資産（値付けされていないエクイティ）		
5.19.1.2	売却可能金融資産		
5.19.1.3	償却後原価で測定されるローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）		
5.19.1.4	償却後原価で測定される満期保有目的投資証券		
5.19.2	非金融資産に係る減損、純額（＋／－）	0.00	0
5.19.2.1	有形固定資産		
5.19.2.2	投資不動産		
5.19.2.3	営業権		
5.19.2.4	その他の無形資産		
5.19.2.99	その他		
5.20	直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）		
5.22	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される除却グループからの損益（＋／－）		
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	16,601,166.00	1,272,479
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	3,337,518.00	255,821
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	13,263,648.00	1,016,659
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	13,263,648.00	1,016,659