

【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25年11月29日
【計算期間】	第4期中（自 平成25年3月1日 至 平成25年8月31日）
【ファンド名】	東京海上ストラテジック・トラストー東京海上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】	ミツビシ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 磯村 尚賢
【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25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	74,656,192.38	63.35
	ケイマン諸島	19,974,122.75	16.95
	米国	6,719,968.90	5.70
	小計	101,350,284.03	86.01
公債	日本	9,156,167.91	7.77
	小計	9,156,167.91	7.77
変動利付債	ケイマン諸島	2,856,932.10	2.42
	小計	2,856,932.10	2.42
小計		113,363,384.04	96.20
現金・その他の資産 (負債控除後)		4,476,162.78	3.80
合計（純資産総額）		117,839,546.82 (約11,519百万円)	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25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＝97.75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】**①【純資産の推移】**

平成25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24年10月末日	35,936,219.89	3,512,765	108.12	10,569
11月末日	26,659,963.96	2,606,011	108.47	10,603
12月末日	26,430,178.25	2,583,550	108.04	10,561
平成25年1月末日	25,450,962.72	2,487,832	106.93	10,452
2月末日	25,085,438.74	2,452,102	107.21	10,480
3月末日	25,285,460.81	2,471,654	107.86	10,543
4月末日	25,273,764.79	2,470,511	109.42	10,696
5月末日	18,770,647.87	1,834,831	108.04	10,561
6月末日	17,156,509.50	1,677,049	104.29	10,194
7月末日	16,598,990.07	1,622,551	105.23	10,286
8月末日	16,510,539.52	1,613,905	104.77	10,241
9月末日	17,210,349.02	1,682,312	105.57	10,319

<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24年10月末日	131,137,492.76	12,818,690	86.19	8,425
11月末日	123,474,892.54	12,069,671	82.61	8,075
12月末日	123,583,313.90	12,080,269	83.71	8,183
平成25年1月末日	124,054,529.26	12,126,330	85.02	8,311
2月末日	131,285,688.45	12,833,176	85.00	8,309
3月末日	130,759,585.10	12,781,749	83.21	8,134
4月末日	132,963,147.31	12,997,148	83.75	8,187
5月末日	119,234,228.56	11,655,146	77.13	7,539
6月末日	106,740,961.14	10,433,929	71.33	6,973
7月末日	98,297,516.54	9,608,582	69.10	6,755
8月末日	90,797,926.38	8,875,497	66.04	6,455
9月末日	95,160,061.82	9,301,896	69.91	6,834

＜中国元ヘッジクラス＞

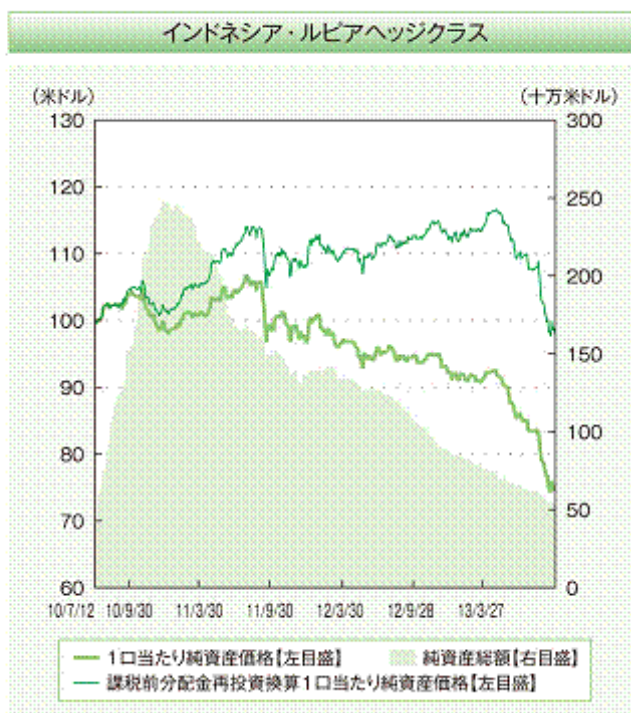
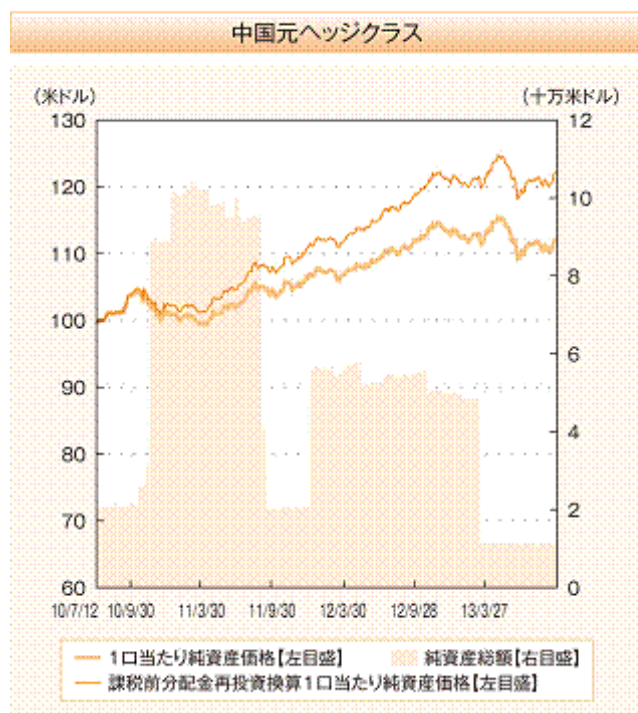
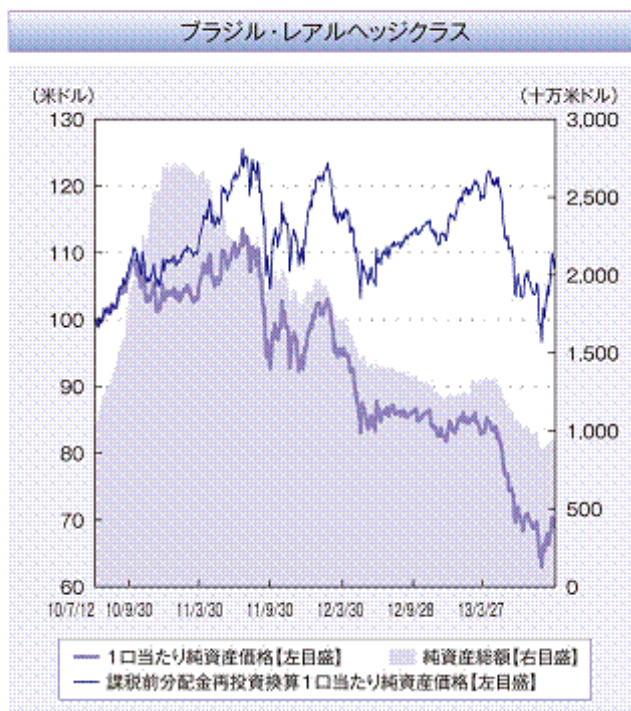
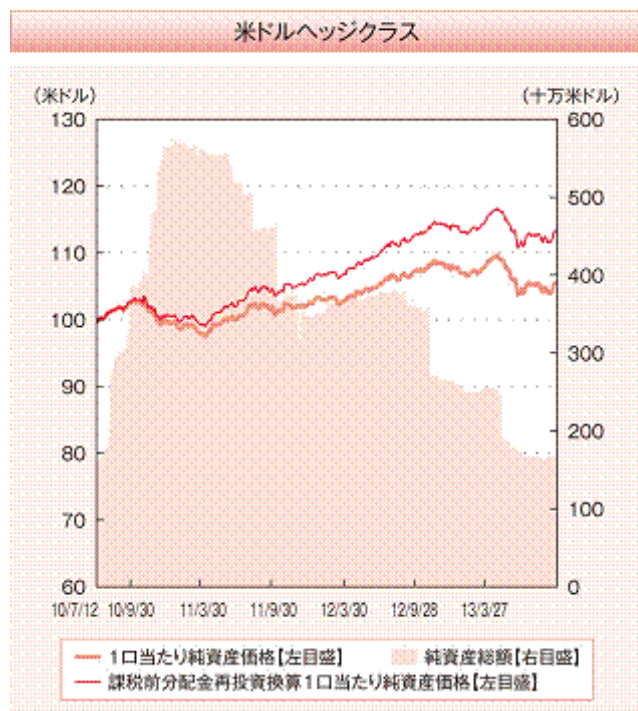
	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
平成24年10月末日	499,642.17	48,840	113.56	11,100
11月末日	504,271.85	49,293	114.61	11,203
12月末日	497,160.75	48,597	112.99	11,045
平成25年１月末日	483,959.30	47,307	112.55	11,002
２月末日	484,739.77	47,383	112.73	11,019
３月末日	112,114.11	10,959	112.11	10,959
４月末日	115,018.93	11,243	115.02	11,243
５月末日	114,384.38	11,181	114.38	11,181
６月末日	110,043.25	10,757	110.04	10,756
７月末日	111,465.93	10,896	111.47	10,896
８月末日	111,203.95	10,870	111.20	10,870
９月末日	112,209.33	10,968	112.21	10,969

＜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24年10月末日	10,285,693.23	1,005,427	94.59	9,246
11月末日	9,074,988.76	887,080	95.06	9,292
12月末日	8,722,795.83	852,653	92.06	8,999
平成25年１月末日	8,449,380.59	825,927	91.35	8,929
２月末日	8,093,659.12	791,155	91.98	8,991
３月末日	7,593,267.18	742,242	91.32	8,927
４月末日	7,402,485.37	723,593	92.52	9,044
５月末日	7,138,865.75	697,824	90.53	8,849
６月末日	6,565,100.83	641,739	85.91	8,398
７月末日	6,191,889.88	605,257	83.40	8,152
８月末日	5,779,430.32	564,939	78.69	7,692
９月末日	5,356,926.65	523,640	74.57	7,289

<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～2013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。

②【分配の推移】

平成25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24年10月1日～平成25年9月末日	2.40	235

<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24年10月1日～平成25年9月末日	13.80	1,349

<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24年10月1日～平成25年9月末日	3.00	293

<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24年10月1日～平成25年9月末日	9.00	880

<参考情報>

分配の推移（2013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1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	1.20
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	2.40
第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	2.40
2013年5月	0.20
2013年6月	0.20
2013年7月	0.20
2013年8月	0.20
2013年9月	0.20
直近1年間累計	2.40
設定来累計	7.40

ブラジル・レアルヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	5.70
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	13.00
第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	13.80
2013年5月	1.15
2013年6月	1.15
2013年7月	1.15
2013年8月	1.15
2013年9月	1.15
直近1年間累計	13.80
設定来累計	40.55

中国元ヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	1.50
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	3.00
第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	3.00
2013年5月	0.25
2013年6月	0.25
2013年7月	0.25
2013年8月	0.25
2013年9月	0.25
直近1年間累計	3.00
設定来累計	9.25

インドネシア・ルピアヘッジクラス	
第1会計年度 (2010年7月12日～2011年2月28日)	3.60
第2会計年度 (2011年3月1日～2012年2月29日)	8.40
第3会計年度 (2012年3月1日～2013年2月28日)	9.00
2013年5月	0.75
2013年6月	0.75
2013年7月	0.75
2013年8月	0.75
2013年9月	0.75
直近1年間累計	9.00
設定来累計	26.25

③【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24年10月1日～平成25年9月末日	0.61%

（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24年10月1日～平成25年9月末日	－2.99%

（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24年10月1日～平成25年9月末日	2.73%

（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24年10月1日～平成25年9月末日	－11.84%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

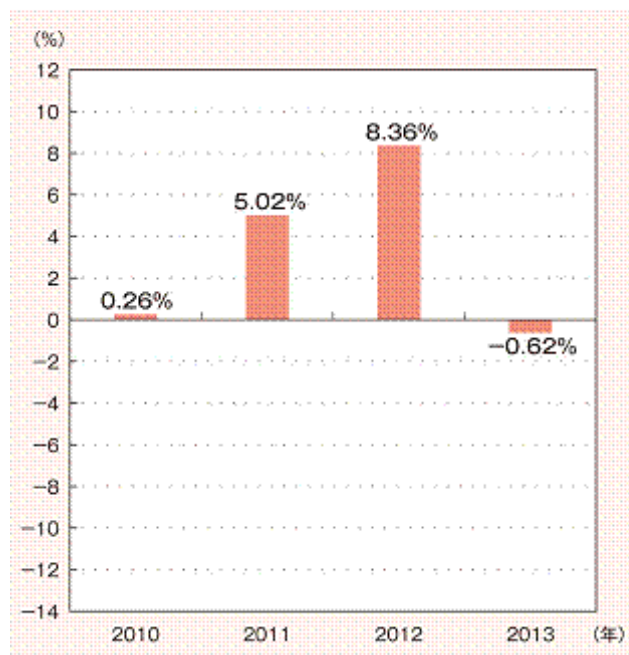
a＝上記期間末の1口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b＝上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

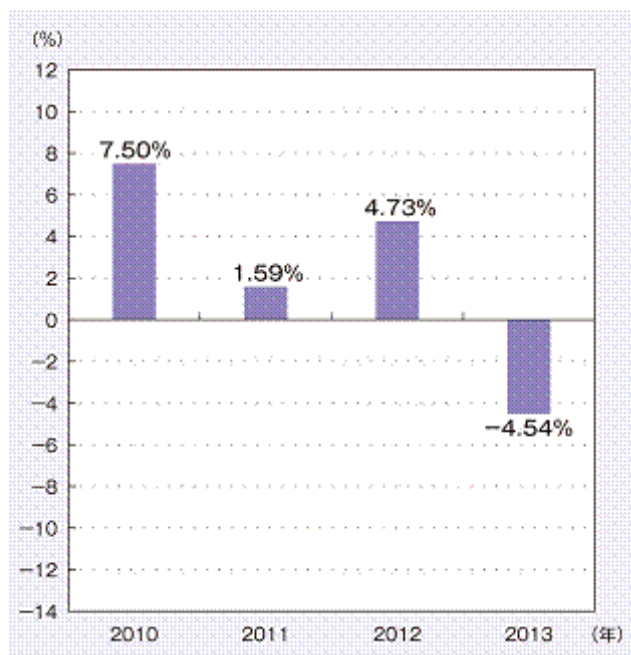
<参考情報>

年間収益率の推移

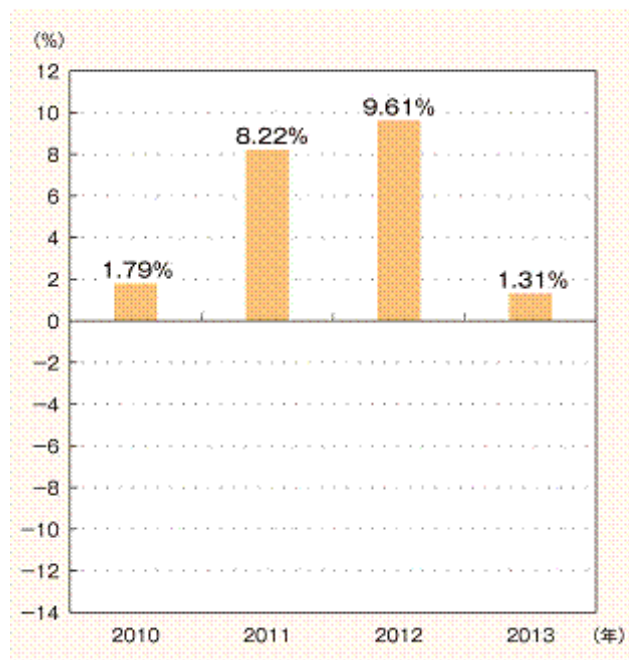
米ドルヘッジクラス



ブラジル・リアルヘッジクラス



中国元ヘッジクラス



インドネシア・ルピアヘッジクラス



(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、2013年については2013年 9 月末日における 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。2013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25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25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
74,729 (74,729)	250,774 (250,774)	163,020 (163,020)

＜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
487,680 (487,680)	689,855 (689,855)	1,361,249 (1,361,249)

＜中国元ヘッジクラス＞

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	3,915 (3,915)	1,000 (1,000)

＜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
8,138 (8,138)	48,679 (48,679)	71,838 (71,838)

（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、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. 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25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＝97.75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。
- d. サブ・ファンドの評価日は、取引日の翌営業日であり、取引日とは、(1) 次の暦日が営業日であるすべての営業日、および(2) 営業日である金曜日で、次の月曜日も営業日である場合をいう。営業日とは、ロンドン、ルクセンブルグ、ニューヨークおよび東京において銀行が営業している日かつニューヨーク証券取引所が取引を行っている日である。平成25年8月におけるサブ・ファンドの最終評価日は、平成25年8月29日であった。そのため、第4期の中間財務書類は平成25年8月29日付で作成されている。

（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・トラストー

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

2013年8月29日現在

米ドル

千円

		米ドル	千円
資産			
現金		2,252,780.29	220,209
銀行預金－基準通貨		899,289.09	87,906
銀行預金－外国通貨		1,353,491.20	132,304
有価証券（取得原価）		110,208,661.16	10,772,897
債券（取得原価）		110,208,661.16	10,772,897
未実現評価損益		(340,121.29)	(33,247)
未実現時価評価損益		3,491,218.14	341,267
未実現通貨運用損益		(3,834,680.53)	(374,840)
未実現通貨繰延損益		3,341.10	327
未収収益		1,611,201.07	157,495
債券に係る未収利息		1,611,201.07	157,495
資本証券		434,831.20	42,505
受益証券販売未収金		434,831.20	42,505
資産合計：		114,167,352.43	11,159,859
負債			
資本証券		632,248.26	61,802
受益証券買戻未払金		632,248.26	61,802
未払費用		336,004.00	32,844
未払監査費用		36,023.14	3,521
未払保管報酬		29,944.14	2,927
未払報告書作成費用		18,506.20	1,809
未払投資顧問報酬		139,739.40	13,660
未払受託報酬		1,995.95	195
未払代行協会員報酬		9,981.36	976
未払販売報酬		99,813.81	9,757
負債合計：		968,252.26	94,647

2013年8月29日現在

	米ドル	千円
資本		
ファンド受益証券	169,995,325.47	16,617,043
発行済ファンド受益証券（額面価額）	160,688,500.00	15,707,301
ブラジル・リアル	137,484,900.00	13,439,149
インドネシア・ルピア	7,344,600.00	717,935
中国元	100,000.00	9,775
米ドル	15,759,000.00	1,540,442
受益証券額面超過額	9,306,825.47	909,742
ブラジル・リアル	10,048,696.55	982,260
インドネシア・ルピア	617,990.32	60,409
中国元	(48,569.05)	(4,748)
米ドル	(1,311,292.35)	(128,179)
分配金支払額	(78,560,013.35)	(7,679,241)
分配金支払額	(78,560,013.35)	(7,679,241)
ブラジル・リアル	(72,331,009.05)	(7,070,356)
インドネシア・ルピア	(3,543,639.45)	(346,391)
中国元	(44,245.25)	(4,325)
米ドル	(2,641,119.60)	(258,169)
利益剰余金	40,695,103.17	3,977,946
利益剰余金	40,695,103.17	3,977,946
ブラジル・リアル	52,166,581.54	5,099,283
インドネシア・ルピア	2,573,604.89	251,570
中国元	101,668.03	9,938
米ドル	4,486,821.78	438,587
当期純損失	(18,931,315.12)	(1,850,536)
資本合計：	113,199,100.17	11,065,212
負債および資本合計	114,167,352.43	11,159,859
純資産額合計	113,199,100.17	11,065,212
発行済受益証券総数	1,606,885.00000口	
受益証券1口当たり純資産額合計	70.45	6,886円

損益計算書

東京海上ストラテジック・トラストー

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

2013年3月1日から
2013年8月29日までの期間

米ドル

千円

収益

実現損益

(12,387,559.30)

(1,210,884)

為替取引に係る実現利益

12,097,877.38

1,182,568

ブラジル・リアル

5,011,795.42

489,903

インドネシア・ルピア

48,921.39

4,782

中国元

12,772.12

1,248

為替取引に係る実現損失

(26,071,223.18)

(2,548,462)

ブラジル・リアル

(19,736,262.61)

(1,929,220)

インドネシア・ルピア

(353,053.59)

(34,511)

中国元

(9,060.65)

(886)

市場に係る実現利益

2,398,038.01

234,408

市場に係る実現損失

(231,471.70)

(22,626)

通貨に係る実現利益

106,454.41

10,406

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

通貨に係る実現損失

(687,234.22)

(67,177)

ブラジル・リアル

(0.02)

(0)

インドネシア・ルピア

(0.02)

(0)

受取利息

3,022,641.93

295,463

債券に係る受取利息

3,022,641.93

295,463

2013年3月1日から
2013年8月29日までの期間

	米ドル	千円
未実現評価損益	(8,530,126.67)	(833,820)
未実現時価評価損益	(5,296,979.41)	(517,780)
未実現通貨運用損益	(3,245,902.71)	(317,287)
ブラジル・リアル	(2,427,842.52)	(237,322)
インドネシア・ルピア	(277,835.71)	(27,158)
中国元	(1,110.33)	(109)
未実現通貨繰延損益	12,755.45	1,247
収益合計：	(17,895,044.04)	(1,749,241)
費用		
費用一報酬	1,036,271.08	101,295
監査費用	13,881.04	1,357
保管報酬	107,299.52	10,489
報告書作成費用	2,970.93	290
投資顧問報酬	500,882.59	48,961
受託報酬	12,067.28	1,180
代行協会員報酬	35,771.08	3,497
販売報酬	357,711.47	34,966
副保管報酬	5,687.17	556
費用合計：	1,036,271.08	101,295
投資純損失	(18,931,315.12)	(1,850,536)

（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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (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											
899,289.09000	米ドル現金	08/29/2013	MUGC	899,289.09	899,289.09	1.000000000	899,289.09	899,289.09	0.00	0.00	0.00
	現金米ドル					1.000000000					
899,289.09000	基準通貨現金 小計			899,289.09	899,289.09		899,289.09	899,289.09	0.00	0.00	0.00
899,289.09000	現金合計			899,289.09	899,289.09		899,289.09	899,289.09	0.00	0.00	0.00
社債											
変動利率											
9,090,000.00000	MITSUMI SUMITOMO FRN 03152072	03/09/2012		9,300,250.00	9,300,250.00	111.528999300C 1.000000000	10,137,986.04	10,137,986.04	837,736.04	0.00	837,736.04
6,380,000.00	BJPN3013 USJ45174AF61 MUGF CAP FIN 5	07/13/2012		6,651,150.00	10,245,431.48	109.807998600C 1.549200002	7,005,750.31	10,853,308.39	549,346.80	58,530.11	607,876.91
6,700,000.00000	BCYM055G XS0282533115 NIPPON LIFE INS	10/24/2012		6,887,875.00	6,887,875.00	99.071998500C 1.000000000	6,637,823.90	6,637,823.90	-250,051.10	0.00	-250,051.10
5,800,000.00000	FRN 10182042 BJPN301S USJ54675AA13 SOMPO JAPAN INS	03/22/2013		5,783,800.00	5,783,800.00	98.081001200C 1.000000000	5,688,698.07	5,688,698.07	-95,101.93	0.00	-95,101.93
	FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73										
27,970,000.00000	変動利率 小計			28,623,075.00	32,217,356.48		29,470,258.32	33,317,816.40	1,041,929.81	58,530.11	1,100,459.92
ミディアム・ターム・ノート											
5,450,000.00	EAST JAPAN RAILWAY 4.75% 12082031	07/13/2010		5,421,961.00	8,380,794.78	108.355003300C 1.549200002	5,905,347.68	9,148,564.64	748,862.65	18,907.21	767,769.86
1,110,000.00000	BJPN2981 XS0276809927 MITSUBISHI CORP	07/09/2012		1,104,316.80	1,104,316.80	98.676002500C 1.000000000	1,095,303.63	1,095,303.63	-9,013.17	0.00	-9,013.17
	1.875 % 07132017 BJPN301D XS0804218856										
6,560,000.00000	ミディアム・ターム・ノート 小計			6,526,277.80	9,485,111.58		7,000,651.31	10,243,868.27	739,849.48	18,907.21	758,756.69

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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
私募債											
2,980,000.00000	NISSAN MOTOR ACC 1.95 % 09122017 BUSA953C US654742AC94	09/05/2012		2,988,401.47	2,988,401.47	98.602996800C 1.000000000	2,938,369.30	2,938,369.30	-50,032.17	0.00	-50,032.17
7,900,000.00000	RESONA BANK FRN 09152049 BJPN2976 US76117JAB44	03/23/2012		8,323,450.00	8,323,450.00	107.625000000C 1.000000000	8,502,375.00	8,502,375.00	178,925.00	0.00	178,925.00
10,880,000.00000	私募債 小計			11,311,851.47	11,311,851.47		11,440,744.30	11,440,744.30	128,892.83	0.00	128,892.83
公募債											
1,200,000.00000	BK TOKYO-MIT UFJ 3.2 % 02262023 BJPN3026 USJ0423YBF00	02/19/2013		1,197,552.00	1,197,552.00	95.040000900C 1.000000000	1,140,480.01	1,140,480.01	-57,071.99	0.00	-57,071.99
5,000,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL LIF 7.25 % 07252049 BJPN2998 USJ09748AB01	05/10/2011		5,014,750.00	5,014,750.00	111.714996300C 1.000000000	5,585,749.81	5,585,749.81	570,999.81	0.00	570,999.81
2,800,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL LIF 2.875 % 07182018 BJPN302L XS0951574085	07/10/2013		2,785,664.00	2,785,664.00	101.431999200C 1.000000000	2,840,095.98	2,840,095.98	54,431.98	0.00	54,431.98
8,803,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.2 % 07182022 BCYM055H XS0803109270	07/12/2012		8,816,372.89	8,816,372.89	97.779998700C 1.000000000	8,607,573.29	8,607,573.29	-208,799.60	0.00	-208,799.60
8,700,000.00000	NIPPON TEL & TEL 2.15 % 02262020 BJPN3025 XS0891657172	02/19/2013		8,692,692.00	8,692,692.00	96.333999600C 1.000000000	8,381,057.97	8,381,057.97	-311,634.03	0.00	-311,634.03
4,910,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.95 % 01122022 BJPN3007 USJ7771KPK71	01/05/2012		4,894,337.10	4,894,337.10	100.551002500C 1.000000000	4,937,054.22	4,937,054.22	42,717.12	0.00	42,717.12

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
種別・グループ別 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
社債											
公募債											
6,800,000.00000	SUMITOMO MITSUI BK 4% 11092020	10/29/2010		6,678,636.12	9,202,200.94	106.607002200C 1.322450000	7,249,276.15	9,586,805.24	754,642.91	-370,038.60	384,604.30
5,510,000.00000	BJPN2991 XS0555833580 TOYOTA MTR CRED 3.3 % 01122022	01/13/2012		5,696,992.70	5,696,992.70	98.418998700C 1.000000000	5,422,886.83	5,422,886.83	-274,105.87	0.00	-274,105.87
	BUSA8365 US89233P5T93										
43,723,000.00000	公募債 小計			43,776,996.81	46,300,561.63		44,164,174.26	46,501,703.35	571,180.33	-370,038.60	201,141.72
89,133,000.00000	社債合計			90,238,201.08	99,314,881.16		92,075,828.19	101,504,132.32	2,481,852.45	-292,601.28	2,189,251.16
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
49,999.99	BRITISH POUND	08/13/2013		49,999.99	77,399.98	1.000000000S 1.549200002	49,999.99	77,459.98	0.00	60.00	60.00
	GBP										
370,668.00		08/28/2013		370,668.00	577,241.28	1.000000000S 1.549200002	370,668.00	574,238.87	0.00	-3,002.41	-3,002.41
1,994.97		08/28/2013		1,994.97	3,106.77	1.000000000S 1.549200002	1,994.97	3,090.61	0.00	-16.16	-16.16
	GBP										
381,570.00		08/22/2013		381,570.00	597,939.27	1.000000000S 1.549200002	381,570.00	591,128.24	0.00	-6,811.03	-6,811.03
1,691.24		08/22/2013		1,691.24	2,650.26	1.000000000S 1.549200002	1,691.24	2,620.07	0.00	-30.19	-30.19
805,924.20000	合計			805,924.20	1,258,337.56		805,924.20	1,248,537.77	0.00	-9,799.79	-9,799.79
0.00000											
49,701.84000	EURO	08/13/2013		49,701.84	66,071.14	1.000000000S 1.322450000	49,701.84	65,728.20	0.00	-342.94	-342.94
	EUR										
2,808,352.00000	JAPANESE YEN	08/13/2013		2,808,352	29,082.50	1.000000000S 98.435000000	2,808,352	28,530.01	0.00	-552.49	-552.49
	JPY										

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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
3,663,978.04000	非グループ化の有価証券	小計		3,663,978.04	1,353,491.20		3,663,978.04	1,342,795.98	0.00	-10,695.22	-10,695.22
3,663,978.04000	外貨建現金勘定合計			3,663,978.04	1,353,491.20		3,663,978.04	1,342,795.98	0.00	-10,695.22	-10,695.22
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
-4,449,000.00000	BRL FORWARD 17 OCT FBR17OCT	08/21/2013	BRH	-4,449,000.00	-1,819,036.72	1.000000000F 2.383555000	-4,449,000.00	-1,866,539.69	0.00	-47,502.97	-47,502.97
124,264,065.87000		08/08/2013	BRH	124,264,065.87	53,703,300.00	1.000000000F 2.383555000	124,264,065.87	52,133,920.08	0.00	-1,569,379.92	-1,569,379.92
96,628,328.87000		08/08/2013	BRH	96,628,328.87	41,778,900.00	1.000000000F 2.383555000	96,628,328.87	40,539,584.31	0.00	-1,239,315.69	-1,239,315.69
216,443,394.74000 0.00000	合計			216,443,394.74	93,663,163.28		216,443,394.74	90,806,964.70	0.00	-2,856,198.58	-2,856,198.58
683,309.90	CNY FORWARD 17 OCT FCN17OCT	08/12/2013	CNH	683,309.90	110,500.00	1.000000000F 6.136915000	683,309.90	111,344.20	0.00	844.20	844.20
4,883,565.51000	EUR FORWARD 16 OCT FEU16OCT	08/01/2013		4,883,565.51	6,470,431.29	1.000000000F 1.322685992	4,883,565.51	6,459,423.69	0.00	-11,007.60	-11,007.60
3,435,904.75000		08/01/2013		3,435,904.75	4,546,904.55	1.000000000F 1.322685992	3,435,904.75	4,544,623.08	0.00	-2,281.47	-2,281.47
5,683,937.33000		08/01/2013		5,683,937.33	7,530,591.73	1.000000000F 1.322685992	5,683,937.33	7,518,064.28	0.00	-12,527.45	-12,527.45
1,138.28000		08/01/2013		1,138.28	1,506.34	1.000000000F 1.322685992	1,138.28	1,505.59	0.00	-0.75	-0.75
3,182,643.08000		08/01/2013		3,182,643.08	4,216,683.82	1.000000000F 1.322685992	3,182,643.08	4,209,637.42	0.00	-7,046.40	-7,046.40
8,742,289.48000	FEU16OCT	08/01/2013		8,742,289.48	11,582,807.95	1.000000000F	8,742,289.48	11,563,303.83	0.00	-19,504.12	-19,504.12

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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (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											
-149,806.90000		08/23/2013		-149,806.90	-200,000.00	1.322685992 1.000000000F	-149,806.90	-198,147.49	0.00	1,852.51	1,852.51
-3,491,972.72000		08/01/2013		-3,491,972.72	-4,615,154.95	1.322685992 1.000000000F	-3,491,972.72	-4,618,783.40	0.00	-3,628.45	-3,628.45
-620,504.40000		08/01/2013		-620,504.40	-820,073.60	1.322685992 1.000000000F	-620,504.40	-820,732.48	0.00	-658.88	-658.88
-28,970,644.11000		08/01/2013		-28,970,644.11	-38,383,554.03	1.322685992 1.000000000F	-28,970,644.11	-38,319,065.13	0.00	64,488.90	64,488.90
-7,303,449.70000 0.00000	合計			-7,303,449.70	-9,669,856.90	1.322685992	-7,303,449.70	-9,660,170.61	0.00	9,686.29	9,686.29
3,044,197.06	GBP FORWARD 16 OCT FGB160CT	08/01/2013		3,044,197.06	4,615,154.95	1.000000000F 1.548615947	3,044,197.06	4,714,292.11	0.00	99,137.16	99,137.16
81,844.44		08/01/2013		81,844.44	124,080.26	1.000000000F 1.548615947	81,844.44	126,745.60	0.00	2,665.34	2,665.34
6,408,598.99		08/01/2013		6,408,598.99	9,740,333.48	1.000000000F 1.548615947	6,408,598.99	9,924,458.59	0.00	184,125.11	184,125.11
721,203.72		08/01/2013		721,203.72	1,096,078.20	1.000000000F 1.548615947	721,203.72	1,116,867.58	0.00	20,789.38	20,789.38
1,936,964.84		08/01/2013		1,936,964.84	2,943,992.86	1.000000000F 1.548615947	1,936,964.84	2,999,614.64	0.00	55,621.78	55,621.78
540,927.81		08/01/2013		540,927.81	820,073.61	1.000000000F 1.548615947	540,927.81	837,689.43	0.00	17,615.82	17,615.82
1,608,244.92		08/14/2013		1,608,244.92	2,489,621.03	1.000000000F 1.548615947	1,608,244.92	2,490,553.73	0.00	932.70	932.70
-295,947.26		08/23/2013		-295,947.26	-460,000.00	1.000000000F 1.548615947	-295,947.26	-458,308.65	0.00	1,691.35	1,691.35

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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (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											
-5,030,459.06		08/01/2013		-5,030,459.06	-7,645,643.81	1.000000000F 1.548615947	-5,030,459.06	-7,790,249.12	0.00	-144,605.31	-144,605.31
-2,995,215.61		08/01/2013		-2,995,215.61	-4,546,904.55	1.000000000F 1.548615947	-2,995,215.61	-4,638,438.66	0.00	-91,534.11	-91,534.11
-9,084,647.87		08/01/2013		-9,084,647.87	-13,806,484.45	1.000000000F 1.548615947	-9,084,647.87	-14,068,630.56	0.00	-262,146.11	-262,146.11
-3,681,122.01		08/01/2013		-3,681,122.01	-5,594,882.13	1.000000000F 1.548615947	-3,681,122.01	-5,700,644.25	0.00	-105,762.12	-105,762.12
-6,932,804.44		08/01/2013		-6,932,804.44	-10,536,268.20	1.000000000F 1.548615947	-6,932,804.44	-10,736,251.51	0.00	-199,983.31	-199,983.31
-13,678,214.47000 0.00000	合計			-13,678,214.47	-20,760,848.75		-13,678,214.47	-21,182,301.07	0.00	-421,452.32	-421,452.32
37,316,404,800.00	IDR FORWARD 17 OCT FID17OCT	08/12/2013	IDH	37,316,404,800.00	3,541,800.00	1.000000000F 11,019.116666666	37,316,404,800.00	3,386,515.08	0.00	-155,284.92	-155,284.92
27,079,283,000.00		08/12/2013	IDH	27,079,283,000.00	2,567,000.00	1.000000000F 11,019.116666666	27,079,283,000.00	2,457,482.19	0.00	-109,517.81	-109,517.81
-458,920,000.00		08/16/2013	IDH	-458,920,000.00	-42,571.43	1.000000000F 11,019.116666666	-458,920,000.00	-41,647.62	0.00	923.81	923.81
63,936,767,800.00000 0.00000	合計			63,936,767,800.00	6,066,228.57		63,936,767,800.00	5,802,349.65	0.00	-263,878.92	-263,878.92
-12,272,205.00000	JPY FORWARD 16 OCT FJP16OCT	08/01/2013		-12,272,205	-124,080.26	1.000000000F 98.411360000	-12,272,205	-124,703.13	0.00	-622.87	-622.87
-148,783.00000		08/01/2013		-148,783	-1,506.34	1.000000000F 98.411360000	-148,783	-1,511.85	0.00	-5.51	-5.51

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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (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											
-16,853,494.00000		08/01/2013		-16,853,494	-170,827.45	1.000000000F 98.411360000	-16,853,494	-171,255.57	0.00	-428.12	-428.12
15,854,574.00000		08/01/2013		15,854,574	160,708.89	1.000000000F 98.411360000	15,854,574	161,105.12	0.00	396.23	396.23
10,937,182.00000		08/01/2013		10,937,182	110,861.81	1.000000000F 98.411360000	10,937,182	111,137.39	0.00	275.58	275.58
-2,482,726.00000	合計			-2,482,726.00	-24,843.35		-2,482,726.00	-25,228.04	0.00	-384.69	-384.69
0.00000											
64,130,430,114.47000	非グループ化の有価証券	小計		64,130,430,114.47	69,384,342.85		64,130,430,114.47	65,852,958.83	0.00	-3,531,384.02	-3,531,384.02
64,130,430,114.47000	先物（ポジション）	合計		64,130,430,114.47	69,384,342.85		64,130,430,114.47	65,852,958.83	0.00	-3,531,384.02	-3,531,384.02

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・トラストー
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 2013年8月29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) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	市場 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
国債											
公募債											
8,400,000.00000	JAPAN FIN ORG MUNI 4% 01132021	01/06/2011		8,330,280.00	8,330,280.00	107.740997300C 1.000000000	9,050,243.77	9,050,243.77	719,963.77	0.00	719,963.77
	BJPN2995 XS0568671555										
8,400,000.00000	公募債 小計			8,330,280.00	8,330,280.00		9,050,243.77	9,050,243.77	719,963.77	0.00	719,963.77
8,400,000.00000	国債合計			8,330,280.00	8,330,280.00		9,050,243.77	9,050,243.77	719,963.77	0.00	719,963.77
変動利付債											
変動金利											
2,600,000.00000	SMFG PREF CAP FRN 01252049	08/16/2010		2,563,500.00	2,563,500.00	109.726997300C 1.000000000	2,852,901.93	2,852,901.93	289,401.93	0.00	289,401.93
	BCYM0484 USG8227UAA46										
2,600,000.00000	変動金利 小計			2,563,500.00	2,563,500.00		2,852,901.93	2,852,901.93	289,401.93	0.00	289,401.93
2,600,000.00000	変動利付債合計			2,563,500.00	2,563,500.00		2,852,901.93	2,852,901.93	289,401.93	0.00	289,401.93
64,235,126,381.60000	ポートフォリオ合計			64,236,125,362.68	181,845,784.30		64,238,972,355.49	181,502,321.92	3,491,218.15	-3,834,680.52	-343,462.38

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。

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（平成25年9月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約36億円）

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へ要求した場合。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、(i) 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(ii) 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25年8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	51	8,900,574,651.51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25年9月30日現在における株式会社三菱東京U F J銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝97.75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】

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2013年６月30日現在

（単位：米ドル）

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	375,158,892.00	36,671,782
1.2	売買目的で保有される金融資産	45,751,398.00	4,472,199
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	45,751,398.00	4,472,199
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	3,233,910.00	316,115
1.4.1	持分証券	3,233,910.00	316,115
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	3,387,826,512.00	331,160,042
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	3,387,826,512.00	331,160,042
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
1.9	有形資産	1,871,142.00	182,904
1.9.1	有形固定資産	1,871,142.00	182,904
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	4,494,270.00	439,315
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	4,494,270.00	439,315
1.12	税金資産	0.00	0
1.12.1	現行税金資産	0.00	0
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	28,868,352.00	2,821,881
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	3,847,204,476.00	376,064,238

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2013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	45,652,356.00	4,462,518
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	45,652,356.00	4,462,518
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証書（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証書（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	3,653,841,677.00	357,163,024
2.4.1	金融機関からの預金	803,883,131.00	78,579,576
2.4.2	金融機関以外からの預金	2,849,958,546.00	278,583,448
2.4.3	債務証書（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
2.8	引当金	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	5,136,456.00	502,089
2.9.1	現行税金負債	2,896,745.00	283,157
2.9.2	繰延税金負債	2,239,711.00	218,932
2.10	その他の負債	11,141,984.00	1,089,129
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	3,715,772,473.00	363,216,759

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2013年６月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	3,628,281
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	3,628,281
3.1.2	未払込請求資本	0.00	0
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：	2,441,180.00	238,625
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	2,441,180.00	238,625
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）	77,841,959.00	7,609,051
3.6	＜自己株式＞		
3.7	当期利益	14,030,895.00	1,371,520
3.8	＜中間配当＞		
3.10	資本合計	131,432,003.00	12,847,478
3.11	負債および資本合計	3,847,204,476.00	376,064,238

(2) 【損益の状況】

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

損益計算書

2013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（＋／－）	34,822,289.00	3,403,879
5.2	利息収益	5,100,934.00	498,616
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	93,802.00	9,169
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）	1,581,208.00	154,563
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。）	3,425,924.00	334,884
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）（－）	924,813.00	90,400
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）	132,035.00	12,906
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	792,778.00	77,494
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（＋）	17.00	2
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	17.00	2
5.6	受取手数料（＋）	54,260,320.00	5,303,946
5.7	（支払手数料）（－）	24,839,340.00	2,428,045
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（＋／－）	2,306,423.00	225,453
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	2,306,423.00	225,453
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（＋／－）		
5.12	為替差額、純額（＋／－）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.14	その他の事業収益（＋）	102,759.00	10,045

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	1,184,011.00	115,737
5.16	一般管理費（－）	15,822,658.00	1,546,665
5.16.1	従業員費用（－）	7,577,208.00	740,672
5.16.2	一般管理費用（－）	8,245,450.00	805,993
5.17	減価償却（＋／－）	673,123.00	65,798
5.17.1	有形固定資産	149,209.00	14,585
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	523,914.00	51,213
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（＋／－）	18,326,508.00	1,791,416
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,295,613.00	419,896
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	14,030,895.00	1,371,520
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	14,030,895.00	1,371,520