

【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4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】 エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス
(Fabrice Mas, Executive Director)
- 【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通
り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 大西 信治
同 中野 恵太
- 【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グローバル・
ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
(Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global
Hybrid Securities Fund)
- 【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】
米ドル建 米ドルヘッジクラス：
20億アメリカ合衆国ドル(約2,733億6,000万円)を上限とする。
豪ドル建 豪ドルヘッジクラス：
20億オーストラリアドル(約1,878億円)を上限とする。
(注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびオーストラリア
ドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2022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=136.68円および1豪ドル=93.90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、2022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とともに、その他一部情報の時点等を更新するため、また、2022年11月30日付でファンドの設立地における英文目論見書が改訂されましたので、当該変更を反映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グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド(Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund)(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

(2022年9月末日現在)

資産の種類	地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
社債	米国	6,088,228,302	19.67
	英国	3,620,185,586	11.70
	フランス	3,169,984,019	10.24
	オランダ	2,408,071,016	7.78
	スイス	1,719,383,930	5.56
	日本	1,624,262,205	5.25
	オーストラリア	1,404,061,608	4.54
	アイルランド	1,328,293,988	4.29
	ドイツ	1,077,607,654	3.48
	スペイン	997,873,670	3.22
	デンマーク	941,245,050	3.04
	オーストリア	825,554,334	2.67
	フィンランド	604,676,806	1.95
	韓国	589,676,983	1.91
	ベルギー	434,291,787	1.40
	イスラエル	402,007,339	1.30
	香港	363,334,697	1.17
	イタリア	342,913,664	1.11
	ノルウェー	276,736,436	0.89
	シンガポール	238,384,949	0.77
	ケイマン諸島	232,120,105	0.75
	ペルー	190,588,455	0.62
	チェコ共和国	153,727,935	0.50
	中国	123,230,007	0.40
スウェーデン	85,864,516	0.28	
国際機関	42,576,858	0.14	
	小計	29,284,881,899	94.62
	現金・その他の資産 (負債控除後)	1,663,667,113	5.38
	合計(純資産総額)	30,948,549,013	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」という。)およびオーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2022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=144.81円および1豪ドル=94.17円)による。以下、米ドルおよび豪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、米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券は米ドル建、豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券は豪ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨または豪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

2022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。

<米ドル建 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
2021年10月末日	150,734,252.47	21,827,827	0.008667	1.2551
11月末日	149,790,504.59	21,691,163	0.008588	1.2436
12月末日	149,978,854.19	21,718,438	0.008560	1.2396
2022年1月末日	141,872,359.50	20,544,536	0.008308	1.2031
2月末日	135,614,110.57	19,638,279	0.007999	1.1583
3月末日	129,292,122.95	18,722,792	0.007818	1.1321
4月末日	122,681,374.53	17,765,490	0.007506	1.0869
5月末日	119,315,192.83	17,278,033	0.007393	1.0706
6月末日	113,393,857.75	16,420,565	0.007061	1.0225
7月末日	115,557,748.90	16,733,918	0.007256	1.0507
8月末日	109,079,586.67	15,795,815	0.007011	1.0153
9月末日	101,986,348.73	14,768,643	0.006616	0.9581

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2021年10月末日	28,062,848.58	2,642,678	0.007402	0.6970
11月末日	27,901,617.27	2,627,495	0.007333	0.6905
12月末日	26,957,030.87	2,538,544	0.007310	0.6884
2022年1月末日	25,869,034.26	2,436,087	0.007105	0.6691
2月末日	24,941,057.98	2,348,699	0.006844	0.6445
3月末日	23,736,491.59	2,235,265	0.006694	0.6304
4月末日	22,002,028.83	2,071,931	0.006413	0.6039
5月末日	21,149,093.47	1,991,610	0.006332	0.5963
6月末日	19,967,673.11	1,880,356	0.006043	0.5691
7月末日	20,252,707.63	1,907,197	0.006213	0.5851
8月末日	18,323,287.40	1,725,504	0.006001	0.5651
9月末日	17,334,189.22	1,632,361	0.005649	0.5320

<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 (2012年12月13日~2022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、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。

(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

2022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。

<米ドル建 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
2021年10月1日～2022年9月末日	0.000550	0.079646

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
2021年10月1日～2022年9月末日	0.000440	0.041435

<参考情報>

分配の推移(2022年9月末日現在)

米ドル建 米ドルヘッジクラス		
(単位:米ドル、1口当たり課税前)		
第6会計年度(2017年3月1日～2018年2月28日)		0.000540
第7会計年度(2018年3月1日～2019年2月28日)		0.000540
第8会計年度(2019年3月1日～2020年2月29日)		0.000630
第9会計年度(2020年3月1日～2021年2月28日)		0.000720
第10会計年度(2021年3月1日～2022年2月28日)		0.000644
2022年5月		0.000040
2022年6月		0.000040
2022年7月		0.000040
2022年8月		0.000040
2022年9月		0.000040
直近1年間累計		0.000550
設定来累計		0.005579

豪ドル建 豪ドルヘッジクラス		
(単位:豪ドル、1口当たり課税前)		
第6会計年度(2017年3月1日～2018年2月28日)		0.000720
第7会計年度(2018年3月1日～2019年2月28日)		0.000720
第8会計年度(2019年3月1日～2020年2月29日)		0.000672
第9会計年度(2020年3月1日～2021年2月28日)		0.000622
第10会計年度(2021年3月1日～2022年2月28日)		0.000534
2022年5月		0.000030
2022年6月		0.000030
2022年7月		0.000030
2022年8月		0.000030
2022年9月		0.000030
直近1年間累計		0.000440
設定来累計		0.007078

収益率の推移

2022年9月末日までの1年間の収益率は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率(注)
2021年10月1日～2022年9月末日	-18.48%

(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

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率(注)
2021年10月1日～2022年9月末日	-18.87%

(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、2022年については2022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、2012年の場合は当初発行価格(米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券は1口当たり0.01米ドル、豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券は1口当たり0.01豪ドル))

(注2) 2012年は12月13日(運用開始日)から12月末日までの収益率である。2022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

2022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2022年9月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	販売口数	買戻口数	発行済口数
2021年10月1日～ 2022年9月末日	855,439,441 (855,439,441)	3,076,070,648 (3,076,070,648)	15,415,053,448 (15,415,053,448)

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	販売口数	買戻口数	発行済口数
2021年10月1日～ 2022年9月末日	179,946,804 (179,946,804)	1,054,042,137 (1,054,042,137)	3,068,553,389 (3,068,553,389)

(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。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日本円で表示されている。

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

純資産計算書

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

詳細	残高 (日本円)
資産	
投資 - ロング	
社債	30,991,248,807.96
現金 - ロング	
現金および現金同等物	398,640,547.12
先渡為替取引未収金	
先渡為替取引未収金	33,420,351,273.12
その他の資産	
その他の資産	6.00
未収金	
未収金	11,787,019.10
資産合計	64,822,027,653.30
負債	
未払監査報酬	
未払監査報酬	(173,314.09)
未払代行協会員報酬	
未払代行協会員報酬	(1,136,159.98)
監査報酬未払金	
監査報酬未払金	(460,866.86)
現金 - ショート	
現金および現金同等物	(29,111,250.00)
販売会社報酬未払金	
販売会社報酬未払金	(13,474,777.52)
先渡為替取引未払金	
先渡為替取引未払金	(32,969,693,719.66)
管理会社報酬未払金	
管理会社報酬未払金	(39,288,026.00)
管理報酬未払金	
管理報酬未払金	(87,722,258.63)
未払金	
未払金	(1,106,406.15)
未払報告費用	
未払報告費用	(313,624.36)
副投資顧問報酬未払金	
副投資顧問報酬未払金	(3,428,011.00)
受託報酬未払金	

受託報酬未払金	(4,127,161.74)
負債合計	<u>(33,150,035,575.99)</u>
純資産額合計	<u>31,671,992,077.31</u>

1口当たり純資産価額(現地通貨)

東京海上ストラテジック・トラスト-

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2022年8月31日現在

クラス名称	通貨	期末資産	発行済受益証券	1口当たり 純資産価額
豪ドル建 豪ドルヘッジクラス	豪ドル	18,323,287.40	3,053,278,630	0.006001
豪ドルクラス	日本円	1,060,937,581	136,062.7899	7,797
資源国通貨バスケットクラス	日本円	27,355,184	5,477.3156	4,994
ブラジル・リアルクラス	日本円	1,101,385,456	418,781.5106	2,630
ユーロクラス	日本円	5,070,250	487.5160	10,400
日本円クラス	日本円	6,103,292,690	865,245.7257	7,054
メキシコ・ペソクラス	日本円	512,738,028	94,357.4200	5,434
ロシア・ルーブルクラス	日本円	359,740,841	65,556.8823	5,487
トルコ・リラクラス	日本円	919,570,066	1,371,405.9211	671
米ドル建 米ドルヘッジクラス	米ドル	109,079,586.67	15,558,392,031	0.007011
米ドルクラス	日本円	4,719,276,988	309,965.2069	15,225

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グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

勘定科目	説明	期間累計 (日本円)
収益		616,538,458.41
未収利息 - ロングの増減		(54,925,798.86)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(54,925,798.86)
受取利息		1,150,426.69
	現金および現金同等物	1,148,934.54
	社債	1,492.15
利息収入		594,930,341.18
	現金および現金同等物	0.00
	社債	594,930,341.18
その他の収益		27,976.46
	現金および現金同等物	27,976.46
売却未収利息収入		75,355,512.94
	社債	75,355,512.94
費用		(1,361,161,907.47)
仲介手数料費用		(4,426,804.03)
	現金および現金同等物	(4,426,804.03)
監査報酬費用		(1,143,433.93)
	現金および現金同等物	(1,143,433.93)
販売会社報酬		(52,501,948.87)
	現金および現金同等物	(52,501,948.87)
宣言された分配金		(1,155,691,463.49)
	現金および現金同等物	(1,155,691,463.49)
支払利息		(2,009,348.11)
	現金および現金同等物	(255,701.21)
	社債	(1,753,646.90)
利息に係る源泉徴収税費用		(4,761,170.41)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(4,761,170.41)
弁護士および専門家報酬(費用)		(402,973.55)
	現金および現金同等物	(402,973.55)
管理会社報酬		(20,636,657.00)
	現金および現金同等物	(20,636,657.00)
管理報酬		(110,272,233.55)
	現金および現金同等物	(110,272,233.55)
専門家報酬		(2,036,100.00)
	現金および現金同等物	(2,036,100.00)

財務報告および会計		(108,917.71)
	現金および現金同等物	(108,917.71)
副保管報酬(費用)		(1,388,367.56)
	現金および現金同等物	(1,388,367.56)
副投資顧問報酬費用		(4,127,335.00)
	現金および現金同等物	(4,127,335.00)
受託報酬		(1,655,154.26)
	現金および現金同等物	(1,655,154.26)
新発銘柄以外への投資に係る実現および未 実現損益		1,305,753,225.57
未実現為替差損益の増減		4,030,315,419.18
	現金および現金同等物	6,174,976.12
	社債	3,648,328,330.19
	先渡為替取引	375,812,112.87
未実現価格損益の増減		(3,538,350,162.71)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(3,538,350,162.71)
長期為替差損益		56,658,269.94
	現金および現金同等物	0.00
	社債	56,658,269.94
長期価格損益		(52,947,692.46)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(52,947,692.46)
988条費用		(8,588,845,840.35)
	現金および現金同等物	(134,938,940.74)
	社債	(305,877,941.18)
	先渡為替取引	(8,148,028,958.43)
988条収益		9,397,544,875.46
	現金および現金同等物	181,528,960.47
	社債	646,822,155.07
	先渡為替取引	8,569,193,759.92
短期為替差損益		45,239,000.00
	社債	45,239,000.00
短期価格損益		(43,860,643.49)
	現金および現金同等物	(53,662.00)
	社債	(43,806,981.49)
純利益 / 損失		561,129,776.51

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
投資					30,366,240,257.04	639,295,192.38	355,242,655.66	31,005,535,449.42	100.00%
現金 - ロング					399,857,879.00	-1,217,331.88	0.00	398,640,547.12	1.29%
現金および現金同等物					399,857,879.00	-1,217,331.88	0.00	398,640,547.12	1.29%
豪ドル					10,292,414.24	80,800.94	0.00	10,373,215.18	0.03%
豪ドル	AUD	109,152.25000	1.0000	109,152.25	10,292,414.24	80,800.94	0.00	10,373,215.18	0.03%
カナダドル					4,403.00	889.65	0.00	5,292.65	0.00%
カナダドル	CAD	50.00000	1.0000	50.00	4,403.00	889.65	0.00	5,292.65	0.00%
ユーロ					55,437,721.91	234,802.14	0.00	55,672,524.05	0.18%
ユーロ	EUR	399,388.67000	1.0000	399,388.67	55,437,721.91	234,802.14	0.00	55,672,524.05	0.18%
日本円					9,688,707.00	0.00	0.00	9,688,707.00	0.03%
日本円	JPY	9,688,707.00000	1.0000	9,688,707.00	9,688,707.00	0.00	0.00	9,688,707.00	0.03%
英ポンド					114,173,682.30	-3,946,500.05	0.00	110,227,182.25	0.36%
英ポンド	GBP	683,350.37000	1.0000	683,350.37	114,173,682.30	-3,946,500.05	0.00	110,227,182.25	0.36%
ロシア・ルーブル					0.09	0.00	0.00	0.09	0.00%
ロシア・ルーブル	RUB	0.04000	1.0000	0.04	0.09	0.00	0.00	0.09	0.00%
米ドル					210,260,950.46	2,412,675.44	0.00	212,673,625.90	0.69%
米ドル	USD	1,534,165.02000	1.0000	1,534,165.02	210,260,950.46	2,412,675.44	0.00	212,673,625.90	0.69%
現金 - ショート					-29,176,350.00	65,100.00	0.00	-29,111,250.00	-0.09%
現金および現金同等物					-29,176,350.00	65,100.00	0.00	-29,111,250.00	-0.09%
米ドル					-29,176,350.00	65,100.00	0.00	-29,111,250.00	-0.09%
米ドル	USD	-210,000.00000	1.0000	-210,000.00	-29,176,350.00	65,100.00	0.00	-29,111,250.00	-0.09%
投資 - ロング					29,995,558,728.04	640,447,424.26	355,242,655.66	30,636,006,152.30	98.81%
社債					29,995,558,728.04	640,447,424.26	355,242,655.66	30,636,006,152.30	98.81%
ユーロ					12,994,667,379.05	-601,657,673.26	121,473,198.36	12,393,009,705.79	39.97%
AGEAS FLT 07/02/49	BE000264425 1	700,000.00000	89.7001	713,125.00	88,603,732.82	-1,077,903.36	529,984.96	87,525,829.46	0.28%
AGEAS FLT PERP	BE631759885 0	1,400,000.00000	79.4538	1,392,370.00	172,214,560.99	-17,158,809.71	1,719,610.71	155,055,751.28	0.50%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
AIA GROUP LTD FLT 09/09/33 SR:GMTN	XS2356311139	1,300,000.00000	80.9317	1,304,647.50	170,273,198.24	-23,614,752.18	1,559,719.66	146,658,446.06	0.47%
AIB GROUP PLC FLT 05/30/31 SR:EMTN	XS2230399441	1,550,000.00000	91.4109	1,549,256.00	190,410,453.99	7,093,158.75	1,599,741.12	197,503,612.74	0.64%
ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	XS1989708836	2,250,000.00000	89.3517	2,298,401.00	283,695,075.01	-3,454,732.01	3,538,086.39	280,240,343.00	0.90%
ASSICURAZIONI GENERALI FLT 06/08/48 SR:EMTN	XS1428773763	2,550,000.00000	99.0383	3,031,645.00	378,289,811.01	-26,252,527.61	4,138,866.49	352,037,283.40	1.14%
AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31 SR:EMTN	XS2294372169	4,500,000.00000	87.2333	4,500,450.00	569,080,990.98	-21,888,992.78	1,368,163.18	547,191,998.20	1.76%
BANCO SANTANDER SA 3.125% 01/19/27 SR:EMTN	XS1548444816	3,000,000.00000	96.5946	2,967,900.00	364,610,749.99	39,331,619.88	8,055,752.25	403,942,369.87	1.30%
BANK OF IRELAND GROUP FLT 10/14/29 SR:EMTN	XS2065555562	3,600,000.00000	93.4818	3,685,123.15	443,282,715.98	25,827,284.76	10,514,153.01	469,110,000.74	1.51%
BANQUE FED CRED MUTUEL 1.125% 11/19/31 SR:EMTN	FR0014006KD4	1,800,000.00000	76.0343	1,787,184.00	233,816,478.49	-43,039,020.89	2,211,787.34	190,777,457.60	0.62%
BANQUE OUEST AFRICAINE D 2.750% 01/22/33 SR:REGS	XS2288824969	400,000.00000	79.0625	396,264.00	49,925,955.00	-5,842,491.81	932,605.49	44,083,463.19	0.14%
BAWAG GROUP AG FLT 03/26/29 SR:EMTN	XS1968814332	4,000,000.00000	96.0384	3,995,520.00	504,988,433.98	30,500,035.50	5,768,634.68	535,488,469.48	1.73%
BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34 SR:EMTN	BE6331190973	2,000,000.00000	79.5676	1,994,640.00	259,281,358.69	-37,455,964.67	1,413,038.62	221,825,394.02	0.72%
BNP PARIBAS FLT 08/31/33 SR:EMTN	FR00140057U9	2,300,000.00000	78.9366	2,297,355.00	295,992,596.61	-42,916,263.38	7,685.78	253,076,333.23	0.82%
BPCE SA FLT 01/13/42 SR:NC5	FR0014005V34	1,200,000.00000	86.4950	1,196,124.00	154,129,966.97	-9,447,078.97	1,587,949.88	144,682,888.00	0.47%
CAIXABANK SA FLT 06/18/31 SR:EMTN	XS2310118976	1,800,000.00000	85.9347	1,792,314.00	231,711,423.99	-16,092,814.31	644,460.18	215,618,609.68	0.70%
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 1.650% 06/12/29	XS2010331440	2,100,000.00000	82.7155	2,092,713.00	254,547,631.00	-12,416,002.68	1,071,866.17	242,131,628.32	0.78%
CHUBB INA HOLDINGS INC 2.500% 03/15/38	XS1785813251	1,350,000.00000	84.1095	1,349,986.50	176,023,539.34	-17,744,362.02	2,191,164.61	158,279,177.32	0.51%
CNP ASSURANCES FLT 07/27/50	FR0013463775	2,300,000.00000	83.5688	2,285,210.00	274,710,912.99	-6,783,614.44	632,430.26	267,927,298.55	0.86%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT 11/30/32 SR:GMTN	XS2524143554	1,300,000.00000	98.4674	1,297,933.00	177,460,473.49	974,898.24	38,476.66	178,435,371.73	0.58%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
COOPERATIVE RABOBANK UA FLT PERP	XS2202900424	1,200,000.00000	89.5419	1,200,000.00	145,657,442.00	4,122,110.47	1,279,685.84	149,779,552.47	0.48%
CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	FR0013312154	2,000,000.00000	89.6378	2,007,829.00	272,543,704.01	-22,643,758.20	4,310,722.54	249,899,945.81	0.81%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	FR0013533999	1,400,000.00000	87.1818	1,400,000.00	174,581,833.00	-4,444,806.26	1,484,852.86	170,137,026.74	0.55%
DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31 SR:EMTN	XS2299135819	3,000,000.00000	86.5742	3,000,285.00	380,237,162.01	-18,198,531.94	1,248,820.62	362,038,630.07	1.17%
DANSKE BANK A/S FLT 06/21/29 SR:EMTN	XS1967697738	2,250,000.00000	96.9552	2,309,239.50	279,812,949.99	24,274,834.84	1,546,704.43	304,087,784.83	0.98%
DE VOLKSBANK NV FLT 10/22/30 SR:EMTN	XS2202902636	3,800,000.00000	91.1432	3,890,234.00	479,510,695.97	3,273,335.72	7,974,502.53	482,784,031.69	1.56%
DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	DE000DL19VU0	1,300,000.00000	73.7235	1,297,946.00	164,493,469.01	-30,897,102.94	1,337,994.81	133,596,366.07	0.43%
DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 01/15/32	XS2232115423	1,000,000.00000	74.6326	990,170.00	124,200,604.00	-20,166,962.40	874,556.33	104,033,641.60	0.34%
ELM BV (HELVETIA SCHWEIZ) FLT 09/29/47	XS1587893451	950,000.00000	94.2506	973,098.09	115,872,576.99	8,938,394.66	4,126,478.53	124,810,971.65	0.40%
GROUPE ACM FLT 04/21/42	FR0014006144	1,500,000.00000	77.1551	1,496,520.00	197,209,085.99	-35,884,352.60	1,409,506.02	161,324,733.39	0.52%
HANNOVER RE FLT 10/09/39	XS2063350925	1,700,000.00000	79.8576	1,682,354.00	198,098,356.99	-8,859,534.23	2,388,369.43	189,238,822.76	0.61%
ING GROEP NV FLT 05/26/31 SR:EMTN	XS2176621170	1,200,000.00000	91.8475	1,198,056.00	141,564,503.00	12,071,734.28	954,373.92	153,636,237.28	0.50%
ING GROEP NV FLT 06/09/32 SR:EMTN	XS2350756446	500,000.00000	83.9529	497,620.00	66,582,328.00	-8,069,507.46	140,349.11	58,512,820.54	0.19%
JYSKE BANK A/S FLT 01/28/31 SR:EMTN	XS2109391214	2,250,000.00000	89.4264	2,224,035.00	272,639,082.98	7,835,389.56	2,320,056.65	280,474,472.54	0.90%
LA BANQUE POSTALE FLT 08/02/32 SR:EMTN	FR0014001R34	3,000,000.00000	81.9938	2,983,050.00	379,425,930.02	-36,541,589.10	257,784.07	342,884,340.92	1.11%
LANDBK HESSEN-THUER INGEN FLT 09/15/32 SR:EMTN	XS2489772991	1,700,000.00000	96.5382	1,697,892.00	243,859,823.39	-15,092,964.31	2,278,811.20	228,766,859.08	0.74%
LB BADEN-WUERTEMBERG 3.625% 06/16/25 SR:EMTN	XS1246732249	1,980,000.00000	98.1746	1,972,495.80	275,882,567.00	-4,919,900.72	2,110,650.05	270,962,666.28	0.87%
MAPFRE SA 2.875% 04/13/30	ES0224244105	700,000.00000	87.6117	693,420.00	93,697,233.36	-8,209,201.54	1,083,695.60	85,488,031.82	0.28%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
MAPFRE SA FLT 03/31/47	ES0224244089	600,000.00000	97.0246	600,000.00	71,996,318.00	9,151,801.76	1,543,840.16	81,148,119.76	0.26%
MUTUELLE ASSURANCE FLT 06/21/52	FR0014003XZ7	1,200,000.00000	73.9351	1,200,123.00	160,037,987.99	-36,364,382.24	701,172.68	123,673,605.75	0.40%
NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32 SR: EMTN	XS2382950330	3,550,000.00000	81.5540	3,558,092.50	463,380,567.10	-59,810,693.78	4,977,458.31	403,569,873.32	1.30%
NN GROUP NV FLT PERP	XS1028950290	3,300,000.00000	98.7971	3,460,611.63	461,773,159.02	-7,305,068.32	2,722,199.80	454,468,090.70	1.47%
NORDEA BANK ABP FLT 08/18/31 SR: EMTN	XS2343459074	2,900,000.00000	87.3229	2,893,736.00	382,614,869.02	-29,617,580.91	96,907.72	352,997,288.11	1.14%
PHOENIX GRP HLD PLC 4.375% 01/24/29 SR: EMTN	XS1881005117	2,870,000.00000	95.0972	3,120,805.50	380,970,967.00	-523,531.55	10,549,574.45	380,447,435.45	1.23%
RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	XS2348241048	1,400,000.00000	77.2270	1,396,108.00	186,801,417.00	-36,091,273.43	449,117.14	150,710,143.57	0.49%
SAMPO OYJ FLT 09/03/52 SR: EMTN	XS2226645278	1,550,000.00000	79.5989	1,548,891.00	194,383,740.01	-22,401,388.56	5,371,933.63	171,982,351.45	0.55%
SOCIETE GENERALE FLT 06/30/31 SR: EMTN	FR0014002QE8	2,200,000.00000	85.8741	2,186,690.00	281,015,732.01	-17,667,685.61	595,481.21	263,348,046.40	0.85%
SWEDBANK AB FLT 08/23/32 SR: GMTN	XS2522879654	650,000.00000	96.4862	647,959.00	88,638,976.91	-1,216,338.30	80,987.16	87,422,638.61	0.28%
TALANX AG FLT 12/01/42	XS2411241693	1,000,000.00000	78.3504	991,310.00	128,134,747.98	-18,918,759.00	1,831,221.67	109,215,988.98	0.35%
UNICAJA BANCO SA FLT 06/30/25 SR: emtn	ES0380907057	800,000.00000	100.5249	799,640.00	113,206,194.28	-1,105,369.53	866,154.48	112,100,824.75	0.36%
UNIQA INSURANCE GROUP AG FLT 12/09/41	XS2418392143	600,000.00000	75.1257	599,148.00	76,560,701.96	-13,728,113.24	1,447,600.78	62,832,588.72	0.20%
VOLKSBANK WIEN AG 0.875% 03/23/26 SR: EMTN	AT000B122080	1,800,000.00000	89.1815	1,790,208.00	232,917,327.00	-9,152,252.23	974,423.79	223,765,074.77	0.72%
WESTPAC BANKING CORP FLT 05/13/31	XS2342206591	1,850,000.00000	87.6540	1,850,000.00	243,337,069.00	-17,295,278.86	600,725.11	226,041,790.14	0.73%
ZUERCHER KANTONALBANK FLT 04/13/28	CH1170565753	1,850,000.00000	95.0976	1,850,000.00	249,978,197.50	-4,741,013.60	2,012,308.29	245,237,183.90	0.79%
英債券					3,206,888,586.84	-302,007,134.74	48,057,741.40	2,904,881,452.10	9.37%
AVIVA PLC FLT 06/03/55	XS2181348405	2,000,000.00000	77.8893	2,042,380.00	285,230,621.00	-33,953,397.91	3,173,194.43	251,277,223.09	0.81%
AXA SA FLT PERP SR: eMTN	XS1134541561	2,850,000.00000	98.9762	3,070,707.75	518,437,744.79	-63,427,917.36	12,431,150.94	455,009,827.43	1.47%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
BANCO SANTANDER SA FLT 10/04/32 SR: EMTN	XS239351859 7	900,000.00000	81.2002	895,842.00	135,117,430.09	-17,236,183.55	2,971,088.02	117,881,246.54	0.38%
BNP PARIBAS FLT 05/24/31 SR: EMTN	FR0014003N1 0	1,000,000.00000	85.9250	997,690.00	153,807,644.00	-15,207,219.69	883,857.81	138,600,424.31	0.45%
CLOSE BROTHERS GROUP PLC FLT 09/11/31	XS235148056 6	810,000.00000	84.7659	808,721.10	125,739,124.00	-14,987,100.31	1,235,553.96	110,752,023.69	0.36%
CREDIT AGRICOLE SA FLT 12/09/31	FR0014003W 84	1,200,000.00000	84.3322	1,202,088.00	186,641,191.99	-23,403,629.06	832,519.29	163,237,562.93	0.53%
CREDIT SUISSE GROUP AG FLT 06/09/28 SR: EMTN	CH055041333 7	2,800,000.00000	81.3036	2,795,455.00	382,293,771.99	-15,085,198.95	2,338,687.76	367,208,573.04	1.18%
HSBC HOLDINGS PLC 6.000% 03/29/40 SR: EMTN	XS049876831 5	800,000.00000	92.9617	1,017,096.00	141,259,280.00	-21,298,516.17	3,309,163.63	119,960,763.83	0.39%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31	XS235116642 1	750,000.00000	84.2515	750,777.00	116,253,092.00	-14,327,280.74	511,776.76	101,925,811.26	0.33%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	XS208099540 5	1,300,000.00000	91.2500	1,365,000.00	190,305,323.00	1,041,606.31	1,943,271.87	191,346,929.31	0.62%
M&G PLC FLT 10/20/51	XS188892027 6	1,250,000.00000	92.8431	1,373,600.00	188,771,192.00	-1,571,672.10	4,152,422.39	187,199,519.90	0.60%
NATIONAL AUSTRALIA BANK FLT 09/15/31 SR: GMTN	XS238628741 6	1,200,000.00000	83.8413	1,200,000.00	182,332,560.00	-20,045,361.82	1,519,221.16	162,287,198.18	0.52%
NATWEST GROUP PLC FLT 11/28/31 SR: EMTN	XS234651625 0	500,000.00000	84.3290	500,000.00	76,971,853.00	-8,958,774.58	442,884.82	68,013,078.42	0.22%
NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32 SR: EMTN	XS238512263 0	800,000.00000	80.9776	797,784.00	121,374,418.98	-16,878,326.07	481,267.82	104,496,092.91	0.34%
RL FINANCE BONDS NO3 6.125% 11/13/28	XS131973853 7	400,000.00000	98.4422	499,000.00	76,129,201.00	-12,612,731.06	3,161,559.38	63,516,469.94	0.20%
RL FINANCE NO 4 PLC FLT 10/07/49	XS206196246 5	1,200,000.00000	78.7065	1,175,712.00	156,582,293.00	-4,234,147.11	8,505,584.65	152,348,145.89	0.49%
VIRGIN MONEY UK PLC FLT 08/19/31 SR: EMTN	XS234385151 0	1,100,000.00000	84.4371	1,100,242.00	169,641,846.00	-19,821,284.57	164,536.71	149,820,561.43	0.48%
米ドル					13,794,002,762.15	1,544,112,232.26	185,711,715.90	15,338,114,994.41	49.47%
ABN AMRO BANK NV FLT 03/13/37 SR: 144A	US00084DAV2 9	3,000,000.00000	77.5183	3,000,000.00	340,365,000.00	-17,985,603.52	6,451,053.00	322,379,396.48	1.04%
AEGON NV FLT PERP SR: CMS	NL000011616 8	2,000,000.00000	80.5834	1,715,000.00	186,437,645.00	36,979,831.50	1,098,572.32	223,417,476.50	0.72%
AIA GROUP LTD FLT PERP SR: GMTN	XS232826126 3	1,800,000.00000	88.5523	1,806,300.00	199,243,925.00	21,716,151.67	2,694,870.00	220,960,076.67	0.71%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
ARGENTUM (SWISS RE LTD) FLT PERP	XS164085198 3	1,800,000.00000	91.5870	1,807,920.00	192,480,207.01	36,052,229.79	612,611.60	228,532,436.80	0.74%
AVIATION CAPITAL GROUP 3.500% 11/01/27 SR:144A	US05369AAA9 7	1,372,000.00000	85.5301	1,469,658.96	152,550,606.00	10,122,123.28	2,218,924.17	162,672,729.28	0.52%
AVIATION CAPITAL GROUP 4.875% 10/01/25 SR:144A	US05367AAH 68	1,828,000.00000	95.3035	2,046,720.20	211,978,801.99	29,526,486.69	5,147,319.53	241,505,288.68	0.78%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 2.125% 02/21/26 SR:144A	US05401AAM 36	3,250,000.00000	86.3060	3,203,427.50	332,732,012.99	56,103,263.06	265,938.59	388,835,276.05	1.25%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 4.250% 04/15/26 SR:144A	US05401AAL5 2	700,000.00000	92.2307	699,825.00	73,198,199.00	16,300,195.62	1,557,990.97	89,498,394.62	0.29%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 4.375% 05/01/26 SR:144A	US05401AAG 67	655,000.00000	92.5194	707,275.55	74,560,989.00	9,446,057.66	1,324,157.55	84,007,046.66	0.27%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 5.500% 01/15/26 SR:144A	US05401AAK7 9	570,000.00000	96.5595	643,661.10	67,854,754.00	8,442,926.67	555,308.65	76,297,680.67	0.25%
BANCO DE CREDITO DEL PER FLT 07/01/30 SR:REGS	US05971V2C8 1	1,500,000.00000	92.0000	1,494,000.00	164,810,617.01	26,491,882.99	1,083,007.81	191,302,500.00	0.62%
BANCO SANTANDER MEXICO 5.375% 04/17/25 SR:REGS	USP1507SAH0 6	3,850,000.00000	100.6873	4,350,500.00	463,175,991.64	74,198,634.90	10,677,831.29	537,374,626.54	1.73%
BANK HAPOLIM FLT 01/21/32	IL0066204707	3,300,000.00000	86.8100	3,300,000.00	375,226,500.00	21,896,696.25	1,713,416.39	397,123,196.25	1.28%
BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38	US59023VAA8 9	2,950,000.00000	123.4260	4,374,083.00	496,152,227.99	8,590,644.68	9,419,905.69	504,742,872.67	1.63%
BANK OF AMERICA CORP FLT 02/04/33	US06051GKK4 9	2,250,000.00000	84.0796	2,252,930.40	258,591,351.31	3,658,019.42	695,239.03	262,249,370.73	0.85%
BANK OF NOVA SCOTIA FLT 10/27/81 SR:2	US0641598N9 1	2,200,000.00000	75.4500	2,200,000.00	246,202,000.00	-16,098,362.50	1,044,115.80	230,103,637.50	0.74%
BPCE SA 4.750% 07/19/27 SR:144A	US05578AE46 5	3,600,000.00000	98.8887	3,590,964.00	493,560,046.98	-55,790.01	2,765,568.75	493,504,256.97	1.59%
CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	US172967EW 71	1,030,000.00000	130.5153	1,581,977.00	169,137,062.01	17,217,563.79	1,482,372.96	186,354,625.80	0.60%
COMMONWEALTH BANK AUST 3.784% 03/14/32 SR:REGS	USQ2704MAH 18	1,000,000.00000	85.9184	1,000,000.00	115,635,000.00	3,469,395.86	2,433,361.64	119,104,395.86	0.38%
COOPERATIVE RABOBANK UA FLT 04/06/33 SR:144A	US74977RDP6 4	400,000.00000	88.9296	400,000.00	48,806,000.00	505,463.20	839,312.76	49,311,463.20	0.16%
COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.650% 04/05/27 SR:144A	US21871XAC3 9	650,000.00000	94.0874	649,090.00	78,783,298.75	5,995,284.75	1,333,822.80	84,778,583.50	0.27%
DAI-ICHI LIFE INSURANCE FLT PERP SR:144A	US23380YAC1 2	4,760,000.00000	99.8547	4,887,530.17	549,013,560.09	109,882,472.36	11,497,973.38	658,896,032.45	2.13%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
DBS GROUP HOLDINGS LTD FLT PERP SR:GMTN	XS2122408854	1,800,000.00000	94.9346	1,800,000.00	201,762,010.01	35,123,575.59	91,492.50	236,885,585.60	0.76%
DEUTSCHE BANK NY FLT 01/14/32	US251526CF47	1,700,000.00000	73.8008	1,762,713.00	197,265,211.83	-23,344,307.27	1,147,303.24	173,920,904.56	0.56%
DNB BANK ASA FLT PERP SR:-	XS2075280995	2,000,000.00000	94.6977	2,001,800.00	218,496,472.00	44,052,928.97	10,850,294.27	262,549,400.97	0.85%
FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33	US316773DF47	2,600,000.00000	95.2994	2,600,000.00	332,007,000.00	11,475,754.32	5,471,071.29	343,482,754.32	1.11%
GLOBAL ATLANTIC FIN CO 3.125% 06/15/31 SR:144A	US37959GAB32	1,300,000.00000	78.1054	1,303,641.00	143,461,410.00	-2,705,752.07	1,188,901.91	140,755,657.93	0.45%
GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	US38143VAA70	5,150,000.00000	104.2424	6,447,248.16	718,749,936.98	25,456,102.07	2,013,250.87	744,206,039.05	2.40%
HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32 SR:REGS	USY306AXAD26	3,000,000.00000	88.8189	3,000,000.00	341,805,000.00	27,570,392.44	1,053,931.22	369,375,392.44	1.19%
HARTFORD FINL SVCS GRP FLT 02/12/47 SR:ICON	US416515BC76	1,090,000.00000	82.3900	1,043,675.00	117,643,047.25	6,849,272.63	358,917.43	124,492,319.88	0.40%
HSBC BANK PLC FLT PERP SR:2M	XS0015190423	2,300,000.00000	76.2361	1,805,500.00	197,620,996.00	45,448,215.57	2,386,852.95	243,069,211.57	0.78%
HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39 SR:BKNT	US4042Q1AD94	2,000,000.00000	116.1422	2,540,880.00	275,456,810.00	46,547,356.32	2,479,847.22	322,004,166.32	1.04%
HSBC HOLDINGS PLC 6.800% 06/01/38	US404280AJ87	3,050,000.00000	106.9870	3,937,580.50	430,633,498.01	21,714,309.24	7,187,706.25	452,347,807.25	1.46%
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 09/30/30 SR:EMTN	XS2235973869	1,300,000.00000	72.5611	1,295,567.00	136,649,924.00	-5,885,733.64	2,740,106.03	130,764,190.36	0.42%
HUNTINGTON BANCSHARES FLT 05/17/33	US446150BA18	1,750,000.00000	98.2181	1,750,000.00	228,208,750.00	10,062,246.92	3,520,250.95	238,270,996.92	0.77%
ING GROEP NV FLT 03/28/33	US456837BC65	840,000.00000	92.2508	843,131.70	100,459,142.06	6,962,290.91	2,104,277.60	107,421,432.97	0.35%
JACKSON FINANCIAL INC 3.125% 11/23/31 SR:144A	US46817MAK36	2,500,000.00000	79.9455	2,492,325.00	285,483,367.13	-8,422,313.00	2,948,187.93	277,061,054.13	0.89%
JPMORGAN CHASE & CO FLT 05/13/31	US46647PBPO9	3,400,000.00000	85.7757	3,400,000.00	360,570,014.99	43,712,114.51	4,179,710.10	404,282,129.50	1.30%
LIBERTY MUTUAL GROUP INC FLT 12/15/51 SR:144A	US53079EBM57	1,106,000.00000	83.3508	1,106,000.00	122,179,820.00	5,613,001.71	1,335,155.14	127,792,821.71	0.41%
MACQUARIE GROUP LTD FLT 06/21/28 SR:REGS	US55608KBC80	2,800,000.00000	94.7923	2,800,000.00	330,918,000.00	37,018,351.27	3,092,908.58	367,936,351.27	1.19%

東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
METLIFE INC 6.400% 12/15/36	US59156RAP38	2,000,000.00000	102.6710	2,305,000.00	253,434,756.00	31,220,591.50	3,745,955.56	284,655,347.50	0.92%
mitsui sumitomo insuranc flt perp sr:regs	USJ4517MAA74	3,100,000.00000	99.2600	3,100,000.00	343,774,503.99	82,782,938.51	10,340,558.59	426,557,442.50	1.38%
MORGAN STANLEY FLT 04/22/42	US61772BAC72	1,345,000.00000	77.8590	1,345,000.00	145,300,349.23	-131,849.99	2,149,325.12	145,168,499.24	0.47%
NASDAQ INC 3.250% 04/28/50	US63111XAB73	900,000.00000	73.7063	882,882.00	95,011,345.00	-3,053,534.94	1,385,383.59	91,957,810.06	0.30%
PRINCIPAL FINANCIAL GRP FLT 05/15/55	US74251VAL62	1,850,000.00000	93.3333	1,813,000.00	188,914,599.99	50,444,558.82	720,466.67	239,359,158.81	0.77%
PRUDENTIAL FINANCIAL INC FLT 06/15/43	US744320AM42	4,150,000.00000	99.6000	4,245,496.10	390,045,442.01	182,947,132.99	6,831,613.28	572,992,575.00	1.85%
SANTANDER UK GROUP HLDGS 5.625% 09/15/45 SR:REGS	XS1291352711	1,500,000.00000	88.8616	1,794,255.00	194,703,578.01	-9,926,967.72	5,393,378.91	184,776,610.29	0.60%
SHINHAN FINANCIAL GROUP FLT PERP SR:REGS	USY7749XAY77	1,750,000.00000	88.7310	1,750,000.00	191,100,002.99	24,155,857.32	2,111,744.90	215,255,860.31	0.69%
SOMPO JAPAN INSURANCE FLT 03/28/73 SR:REGS	USJ7620TAB73	1,290,000.00000	99.8865	1,302,286.41	125,730,568.00	52,892,714.21	4,047,061.57	178,623,282.21	0.58%
STANDARD CHARTERED PLC 4.300% 02/19/27 SR:144A	US853254BF64	4,700,000.00000	97.6699	4,672,552.00	469,381,215.37	166,974,874.50	933,870.42	636,356,089.87	2.05%
STANDARD CHARTERED PLC 5.300% 01/09/43 SR:REGS	XS0875267394	1,150,000.00000	87.6273	1,284,964.00	139,193,730.00	500,680.09	1,220,439.10	139,694,410.09	0.45%
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.202% 09/17/29	US86562MBS89	2,730,000.00000	88.2316	2,730,000.00	292,888,034.99	41,021,260.20	5,520,353.40	333,909,295.19	1.08%
SWISS RE FINANCE LUX FLT PERP	XS2049422343	1,800,000.00000	93.5083	1,806,282.00	191,312,364.01	42,014,321.38	10,516,439.06	233,326,685.39	0.75%
SYNOVUS BANK GA FLT 10/29/30 SR:*	US87164DSE12	1,750,000.00000	95.1775	1,750,000.00	183,408,741.01	47,485,925.40	3,288,493.06	230,894,666.41	0.74%
UBS GROUP AG FLT PERP	CH0558521263	1,700,000.00000	92.0487	1,720,400.00	184,074,201.00	32,849,972.37	1,073,573.61	216,924,173.37	0.70%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 04/19/51 SR:EMTN	XS2283177561	1,800,000.00000	81.3105	1,800,000.00	187,559,999.99	15,330,000.18	2,744,775.00	202,890,000.17	0.65%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 05/02/52 SR:EMTN	XS2416978190	1,637,000.00000	81.6129	1,631,106.80	188,303,124.53	-3,099,617.16	2,625,443.90	185,203,507.37	0.60%

[次へ](#)

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジ

ション評価

明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年

8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収 利息	帳簿上の時価	投資比率
債権投資					32,660,336,294.75	771,802,003.47	0.00	33,432,138,298.22	100.00%
先渡為替取引 未収金					32,660,336,288.75	760,014,984.37	0.00	33,420,351,273.12	99.96%
先渡為替取引					32,660,336,288.75	760,014,984.37	0.00	33,420,351,273.12	99.96%
豪ドル					3,194,129,098.37	66,338,142.88	0.00	3,260,467,241.25	9.75%
AUD.FWD	AUD.FWD	34,336,292.29000	1.0000	34,336,292.29	3,194,129,098.37	66,338,142.88	0.00	3,260,467,241.25	9.75%
ブラジル・ リアル					1,122,185,019.50	57,525,156.25	0.00	1,179,710,175.75	3.53%
BRL.FWD	BRL.FWD	44,258,188.88000	1.0000	44,258,188.88	1,122,185,019.50	57,525,156.25	0.00	1,179,710,175.75	3.53%
ユーロ					1,008,569,041.31	5,970,005.85	0.00	1,014,539,047.16	3.03%
EUR.FWD	EUR.FWD	7,280,380.77000	1.0000	7,280,380.77	1,008,569,041.31	5,970,005.85	0.00	1,014,539,047.16	3.03%
日本円					6,912,371,317.00	0.00	0.00	6,912,371,317.00	20.68%
JPY.FWD	JPY.FWD	6,912,371,317.00000	1.0000	6,912,371,317.00	6,912,371,317.00	0.00	0.00	6,912,371,317.00	20.68%
メキシコ・ ペソ					498,808,439.42	28,789,687.10	0.00	527,598,126.52	1.58%
MXN.FWD	MXN.FWD	76,791,296.64000	1.0000	76,791,296.64	498,808,439.42	28,789,687.10	0.00	527,598,126.52	1.58%
新トルコ・ リラ					955,811,585.43	9,600,240.21	0.00	965,411,825.64	2.89%
TRY.FWD	TRY.FWD	127,775,831.62000	1.0000	127,775,831.62	955,811,585.43	9,600,240.21	0.00	965,411,825.64	2.89%
英債券					163,519,129.29	-539,901.32	0.00	162,979,227.97	0.49%
GBP.FWD	GBP.FWD	1,011,768.73000	1.0000	1,011,768.73	163,519,129.29	-539,901.32	0.00	162,979,227.97	0.49%
ロシア・ ルーブル					364,878,144.39	8,370,546.03	0.00	373,248,690.42	1.12%
RUB.FWD	RUB.FWD	166,508,280.00000	1.0000	166,508,280.00	364,878,144.39	8,370,546.03	0.00	373,248,690.42	1.12%
南アフリ カ・ランド					9,105,684.52	171,544.01	0.00	9,277,228.53	0.03%
ZAR.FWD	ZAR.FWD	1,142,911.29000	1.0000	1,142,911.29	9,105,684.52	171,544.01	0.00	9,277,228.53	0.03%
米ドル					18,430,958,829.52	583,789,563.36	0.00	19,014,748,392.88	56.88%
USD.FWD	USD.FWD	137,406,312.71000	1.0000	137,406,312.71	18,430,958,829.52	583,789,563.36	0.00	19,014,748,392.88	56.88%
その他の資産					6.00	0.00	0.00	6.00	0.00%
現金および 現金同等物					6.00	0.00	0.00	6.00	0.00%
日本円					6.00	0.00	0.00	6.00	0.00%
日本円	JPY	6.00000	1.0000	6.00	6.00	0.00	0.00	6.00	0.00%

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジ

ション評価

明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年8

月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利 息	帳簿上の時価	投資比率
未収金					0.00	11,787,019.10	0.00	11,787,019.10	0.04%
現金および現 金同等物					0.00	11,787,019.10	0.00	11,787,019.10	0.04%
豪ドル					0.00	11,645,430.14	0.00	11,645,430.14	0.03%
豪ドル	AUD	0.00000	NA	0.00	0.00	11,645,430.14	0.00	11,645,430.14	0.03%
米ドル					0.00	141,588.96	0.00	141,588.96	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	141,588.96	0.00	141,588.96	0.00%
債務投資					-	-310,463,837.06	0.00	-	100.00%
					32,810,460,488.93			33,120,924,325.99	
未払監査報酬					-173,314.09	0.00	0.00	-173,314.09	0.00%
現金および現 金同等物					-173,314.09	0.00	0.00	-173,314.09	0.00%
米ドル					-173,314.09	0.00	0.00	-173,314.09	0.00%
米ドル	USD	-1,411.74000	1.0000	-1,411.74	-173,314.09	0.00	0.00	-173,314.09	0.00%
未払代行協会員 報酬					-1,136,159.98	0.00	0.00	-1,136,159.98	0.00%
現金および現 金同等物					-1,136,159.98	0.00	0.00	-1,136,159.98	0.00%
豪ドル					2,050,000.01	0.00	0.00	2,050,000.01	-0.01%
豪ドル	AUD	25,508.07000	1.0000	25,508.07	2,050,000.01	0.00	0.00	2,050,000.01	-0.01%
日本円					-3,507,318.00	0.00	0.00	-3,507,318.00	0.01%
日本円	JPY	-3,507,318.00000	1.0000	-3,507,318.00	-3,507,318.00	0.00	0.00	-3,507,318.00	0.01%
米ドル					321,158.01	0.00	0.00	321,158.01	0.00%
米ドル	USD	2,349.02000	1.0000	2,349.02	321,158.01	0.00	0.00	321,158.01	0.00%
監査報酬未払金					-460,866.86	0.00	0.00	-460,866.86	0.00%
現金および現 金同等物					-460,866.86	0.00	0.00	-460,866.86	0.00%
ユーロ					-1,227,870.42	0.00	0.00	-1,227,870.42	0.00%
ユーロ	EUR	-9,030.00000	1.0000	-9,030.00	-1,227,870.42	0.00	0.00	-1,227,870.42	0.00%
日本円					421,140.00	0.00	0.00	421,140.00	0.00%
日本円	JPY	421,140.00000	1.0000	421,140.00	421,140.00	0.00	0.00	421,140.00	0.00%

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジ

ション評価

明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年

8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
米ドル					345,863.56	0.00	0.00	345,863.56	0.00%
米ドル	USD	3,101.22000	1.0000	3,101.22	345,863.56	0.00	0.00	345,863.56	0.00%
販売会社報酬 未払金					-13,474,777.52	0.00	0.00	-13,474,777.52	0.04%
現金および現金 同等物					-13,474,777.52	0.00	0.00	-13,474,777.52	0.04%
豪ドル					24,308,150.34	0.00	0.00	24,308,150.34	-0.07%
豪ドル	AUD	302,464.94000	1.0000	302,464.94	24,308,150.34	0.00	0.00	24,308,150.34	-0.07%
日本円					-41,591,783.00	0.00	0.00	-41,591,783.00	0.13%
日本円	JPY	-41,591,783.00000	1.0000	-41,591,783.00	-41,591,783.00	0.00	0.00	-41,591,783.00	0.13%
米ドル					3,808,855.14	0.00	0.00	3,808,855.14	-0.01%
米ドル	USD	27,858.80000	1.0000	27,858.80	3,808,855.14	0.00	0.00	3,808,855.14	-0.01%
先渡為替取引 未払金					-	309,357,430.91	0.00	-	-99.54%
					32,660,336,288.75			32,969,693,719.66	
先渡為替取引					-	309,357,430.91	0.00	-	-99.54%
					32,660,336,288.75			32,969,693,719.66	
豪ドル					-380,965,524.97	-3,585,456.81	0.00	-384,550,981.78	1.16%
AUD.FWD	AUD.FWD	-4,051,000.00000	1.0000	-4,051,000.00	-380,965,524.97	-3,585,456.81	0.00	-384,550,981.78	1.16%
ブラジル・ リアル					-37,114,622.66	-1,055,601.08	0.00	-38,170,223.74	0.12%
BRL.FWD	BRL.FWD	-1,432,000.00000	1.0000	-1,432,000.00	-37,114,622.66	-1,055,601.08	0.00	-38,170,223.74	0.12%
ユーロ					-	108,778,499.63	0.00	-	-41.62%
					13,894,105,561.31			13,785,327,061.68	
EUR.FWD	EUR.FWD	-98,924,236.14000	1.0000	-98,924,236.14	13,894,105,561.31	108,778,499.63	0.00	13,785,327,061.68	41.62%
日本円					-790,231,288.00	0.00	0.00	-790,231,288.00	2.39%
JPY.FWD	JPY.FWD	790,231,288.00000	1.0000	790,231,288.00	-790,231,288.00	0.00	0.00	-790,231,288.00	2.39%
新トルコ・ リラ					-28,967,018.82	-559,921.97	0.00	-29,526,940.79	0.09%
TRY.FWD	TRY.FWD	-3,908,000.00000	1.0000	-3,908,000.00	-28,967,018.82	-559,921.97	0.00	-29,526,940.79	0.09%
英ポンド					-3,381,852,171.76	39,756,567.25	0.00	-3,342,095,604.51	10.09%
GBP.FWD	GBP.FWD	-20,747,599.97000	1.0000	-20,747,599.97	-3,381,852,171.76	39,756,567.25	0.00	-3,342,095,604.51	10.09%

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジ

ション評価

明細表

報告期間：2022年3月1日から2022年

8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利 息	帳簿上の時価	投資比 率
米ドル					-	452,691,517.93	0.00	-	44.08%
					14,147,100,101.23			14,599,791,619.16	
USD.FWD	USD.FWD	105,426,151.79000	1.0000	105,426,151.79	14,147,100,101.23	452,691,517.93	0.00	14,599,791,619.16	44.08%
管理会社報酬 未払金					-39,288,026.00	0.00	0.00	-39,288,026.00	0.12%
現金および現 金同等物					-39,288,026.00	0.00	0.00	-39,288,026.00	0.12%
日本円					-39,288,026.00	0.00	0.00	-39,288,026.00	0.12%
日本円	JPY	-39,288,026.00000	1.0000	-39,288,026.00	-39,288,026.00	0.00	0.00	-39,288,026.00	0.12%
管理報酬未払 金					-87,722,258.63	0.00	0.00	-87,722,258.63	0.26%
現金および現 金同等物					-87,722,258.63	0.00	0.00	-87,722,258.63	0.26%
豪ドル					33,292,390.86	0.00	0.00	33,292,390.86	-0.10%
豪ドル	AUD	421,890.56000	1.0000	421,890.56	33,292,390.86	0.00	0.00	33,292,390.86	-0.10%
日本円					-93,669,484.00	0.00	0.00	-93,669,484.00	0.28%
日本円	JPY	-93,669,484.00000	1.0000	-93,669,484.00	-93,669,484.00	0.00	0.00	-93,669,484.00	0.28%
米ドル					-27,345,165.49	0.00	0.00	-27,345,165.49	0.08%
米ドル	USD	-201,323.60000	1.0000	-201,323.60	-27,345,165.49	0.00	0.00	-27,345,165.49	0.08%
未払金					0.00	-1,106,406.15	0.00	-1,106,406.15	0.00%
現金および現 金同等物					0.00	-1,106,406.15	0.00	-1,106,406.15	0.00%
豪ドル					0.00	-33,160.33	0.00	-33,160.33	0.00%
豪ドル	AUD	0.00000	NA	0.00	0.00	-33,160.33	0.00	-33,160.33	0.00%
ユーロ					0.00	-39,092.74	0.00	-39,092.74	0.00%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	-39,092.74	0.00	-39,092.74	0.00%
米ドル					0.00	-1,034,153.08	0.00	-1,034,153.08	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-1,034,153.08	0.00	-1,034,153.08	0.00%

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジ

ション評

報告期間：2022年3月1日から2022年8月31日

価明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
未払報告費用					-313,624.36	0.00	0.00	-313,624.36	0.00%
現金および現金同等物					-313,624.36	0.00	0.00	-313,624.36	0.00%
ユーロ					-197,638.36	0.00	0.00	-197,638.36	0.00%
ユーロ	EUR	-1,476.90000	1.0000	-1,476.90	-197,638.36	0.00	0.00	-197,638.36	0.00%
日本円					-115,986.00	0.00	0.00	-115,986.00	0.00%
日本円	JPY	-115,986.00000	1.0000	-115,986.00	-115,986.00	0.00	0.00	-115,986.00	0.00%
副投資顧問報酬未払金					-3,428,011.00	0.00	0.00	-3,428,011.00	0.01%
現金および現金同等物					-3,428,011.00	0.00	0.00	-3,428,011.00	0.01%
日本円					-3,428,011.00	0.00	0.00	-3,428,011.00	0.01%
日本円	JPY	3,428,011.00000	1.0000	3,428,011.00	-3,428,011.00	0.00	0.00	-3,428,011.00	0.01%
受託報酬未払金					-4,127,161.74	0.00	0.00	-4,127,161.74	0.01%
現金および現金同等物					-4,127,161.74	0.00	0.00	-4,127,161.74	0.01%
日本円					-915,608.00	0.00	0.00	-915,608.00	0.00%
日本円	JPY	-915,608.00000	1.0000	-915,608.00	-915,608.00	0.00	0.00	-915,608.00	0.00%
米ドル					-3,211,553.74	0.00	0.00	-3,211,553.74	0.01%
米ドル	USD	-26,402.16000	1.0000	-26,402.16	-3,211,553.74	0.00	0.00	-3,211,553.74	0.01%
報告金額合計:					30,216,116,062.86	1,100,633,358.79	355,242,655.66	31,316,749,421.65	100.00%

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額(2022年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約271億円)

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、2022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	27	3,395,461,120.47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。

[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、2022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=144.81円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2022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	7,307,751,556.09	1,058,235,503
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	5,003,476,980.83	724,553,502
040	その他の要求払預金	2,304,274,575.26	333,682,001
050	売買目的で保有される金融資産	107,099,072.14	15,509,017
060	デリバティブ	107,099,072.14	15,509,017
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		
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		
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	2,591.61	375
142	持分証券	2,591.61	375
143	債務証券		
144	ローンおよび貸付金		
181	償却後原価における金融資産	2,040,386,764.92	295,468,407
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	2,040,386,764.92	295,468,407
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	2,494,125.49	361,174
280	有形固定資産	2,494,125.49	361,174
290	投資不動産		
300	無形資産	2,577,775.88	373,288
310	営業権		
320	その他の無形資産	2,577,775.88	373,288
330	税金資産	13,799,588.21	1,998,318
340	現行税金資産	13,799,588.21	1,998,318
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	41,012,071.07	5,938,958
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	9,515,123,545.39	1,377,885,041

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)

2022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	58,421,702.88	8,460,047
020	デリバティブ	58,421,702.88	8,460,047
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		
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	8,885,414,337.89	1,286,696,850
120	預金	8,883,247,381.29	1,286,383,053
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	2,166,956.60	313,797
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		
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金		
240	税金負債	15,689,662.84	2,272,020
250	現行税金負債	14,990,027.56	2,170,706
260	繰延税金負債	699,635.28	101,314
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	36,068,672.82	5,223,105
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	8,995,594,376.44	1,302,652,022

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)

2022年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	資本	187,117,965.90	27,096,553
020	払込資本	187,117,965.90	27,096,553
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		
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		
095	損益に再分類されることがない項目		
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-)損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
124	子会社、合弁会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
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	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		
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、合弁会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	794,885.79	115,107
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	302,480,181.34	43,802,155
220	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準備金または累積損失		
230	その他	302,480,181.34	43,802,155
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	29,136,135.93	4,219,204

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〕		
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	519,529,168.96	75,233,019
310	資本および負債合計	9,515,123,545.40	1,377,885,041

(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

2022年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

		米ドル	千円
010	利息収益	38,134,683.26	5,522,283
020	売買目的で保有される金融資産	29,158,916.27	4,222,503
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	5,162,052.74	747,517
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	388,092.13	56,200
085	負債に係る利息収益	3,425,622.12	496,064
090	(支払利息)	19,073,028.47	2,761,965
100	(売買目的で保有される金融負債)	136,344.47	19,744
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)	1,453,880.25	210,536
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	43,945.63	6,364
145	(資産に係る支払利息)	17,438,858.12	2,525,321
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当		
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、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	69,068,200.25	10,001,766
210	(支払手数料)	25,936,416.67	3,755,852
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		
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	8,728,801.26	1,264,018
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		
320	子会社、合併会社および関連会社への投資の認識除外に係る利 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	3,652,536.23	528,924

米ドル

千円

		米ドル	千円
350	(その他の事業費用)	1,470,368.69	212,924
355	事業収益合計、純額	73,104,407.17	10,586,249
360	(管理費用)	30,884,563.95	4,472,394
370	(従業員費用)	11,745,977.85	1,700,935
380	(その他の管理費用)	19,138,586.10	2,771,459
385	(破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金)	2,148,302.61	311,096
390	(減価償却)	1,340,688.86	194,145
400	(有形固定資産)	703,348.13	101,852
410	(投資不動産)		
420	(その他の無形資産)	637,340.73	92,293
425	修正利益または(-)損失、純額		
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)		
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)	467,321.09	67,673
481	(その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産)		
491	(償却後原価における金融資産)	467,321.09	67,673
510	(子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または(-)減損の戻入)		
520	(非金融資産に係る減損または(-)減損の戻入)		
530	(有形固定資産)		
540	(投資不動産)		
550	(営業権)		
560	(その他の無形資産)		
570	(その他)		
580	損益認識されるマイナスの営業権		
590	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または(-)損失の持分		
600	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される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	38,263,530.66	5,540,942
620	(継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入)	9,127,394.73	1,321,738
630	継続事業からの税引後利益または(-)損失	29,136,135.93	4,219,204
640	非継続事業からの税引後利益または(-)損失		
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	29,136,135.93	4,219,204
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	29,136,135.93	4,219,204

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社とファンドの関係法人の名称、ファンドの運営上の役割および契約等の概要

<訂正前>

名称	ファンド運営上の役割	契約等の概要
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.)	管理会社 保管会社 管理事務代行会社	2010年5月21日付で信託証書(2015年7月9日付改訂信託証書により改訂済。)および2011年9月27日付補遺信託証書(2012年11月6日付変更証書により改訂済。)(以下「信託証書」と総称する。)をそれぞれ受託会社と締結。信託証書は、ファンド資産の管理、ファンドの受益証券の発行、買戻しおよびファンドの終了等について規定している。2010年5月21日付で保管契約および管理事務代行契約(注1)を受託会社と締結。同契約は、ファンドの資産保管業務および管理事務代行業務について規定している。

(中略)

東京海上アセットマネジメント株式会社	投資顧問会社	2014年7月21日付で効力発生の投資顧問契約(注3)を副管理会社と締結。同契約は、投資顧問業務について規定している。
--------------------	--------	---

(後略)

<訂正後>

名称	ファンド運営上の役割	契約等の概要
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.)	管理会社 保管会社 管理事務代行会社	2010年5月21日付で信託証書(2015年7月9日付改訂信託証書により改訂済。)および2011年9月27日付補遺信託証書(2012年11月6日付変更証書により改訂済。)(以下「信託証書」と総称する。)をそれぞれ受託会社と締結。信託証書は、ファンド資産の管理、ファンドの受益証券の発行、買戻しおよびファンドの終了等について規定している。 2010年5月21日付で保管契約(2015年1月22日付で改訂再録済(2011年9月27日付で遡及的に効力発生。))および管理事務代行契約(2015年1月21日付で改訂再録済。)(注1)を受託会社と締結。同契約は、ファンドの資産保管業務および管理事務代行業務について規定している。

(中略)

東京海上アセットマネジメント株式会社	投資顧問会社	2014年7月21日付で効力発生の投資顧問契約(注3)を副管理会社と2014年11月21日付で締結。同契約は、投資顧問業務について規定している。
--------------------	--------	--

(後略)

管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

- () 資本金の額(2022年6月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約256億円)

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(2022年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約271億円)

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、2022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=144.81円)による。

- () 会社の沿革

(後略)

(6) 監督官庁の概要

<訂正前>

トラストは、ミューチュアル・ファンドとしてミューチュアル・ファンド法に基づき規制されている。CIMAは、ミューチュアル・ファンド法の遵守を確保するための監督および執行権限を有する。ミューチュアル・ファンド法に基づく規則により、法定の事項および監査済財務書類を毎年CIMAに提出しなければならない。規制された投資信託として、CIMAは、いつでも受託会社に、トラストの財務書類の監査を行い、これをCIMAが定める期限内に提出するよう指示することができる。かかる指示に従わない場合、受託会社に相当額の罰金が科されることがあるほか、CIMAは裁判所にトラストの解散を請求することができる。

規制された投資信託が、履行期の到来した義務を履行できないかもしくは履行できなくなる可能性がある場合、投資者や債権者の利益を害する方法で業務を遂行もしくは遂行を企図し、または任意解散を行おうとしている場合、トラストのような免許投資信託の場合、規制された投資信託がミューチュアル・ファンド法に反して、免許の条件を遵守せずに業務を行っているか、行おうとしている場合、規制された投資信託の指示および運営が適正かつ正当な方法で行われていない場合、または、規制された投資信託のマネジャーの地位にある者が、その任務にあたる適正かつ正当な者ではない場合、CIMAは、一定の措置を取ることができる。CIMAの権限には、受託会社の交替を要求すること、トラストの適切な業務遂行について受託会社に助言を与える者を任命すること、またはトラストの業務監督者を任命すること等が含まれる。CIMAは、その他の権限(その他措置の承認を裁判所に申請する権限を含む。)を行使することができる。

トラストの受託会社は、ケイマン諸島の会社として登録されており、かつ信託会社として免許を受けている。受託会社は、CIMAの監督下にある。受託会社はまた、ミューチュアル・ファンド法に基づく投資信託管理会社として免許を受けている。

<訂正後>

トラストは、ミューチュアル・ファンドとしてミューチュアル・ファンド法に基づき規制されている。CIMAは、ミューチュアル・ファンド法の遵守を確保するための監督および執行権限を有する。ミューチュアル・ファンド法に基づく規則により、法定の事項および監査済財務書類を毎年CIMAに提出しなければならない。規制された投資信託として、CIMAは、いつでもトラストおよびファンドに、その財務書類の監査を行い、これをCIMAが定める期限内に提出するよう指示することができる。かかる指示に従わない場合、受託会社に相当額の罰金が科されることがあるほか、CIMAは裁判所にトラストの解散を請求することができる。

ただし、CIMAは一定の状況下においてトラストおよびファンドの活動を調査する権限を有しているものの、トラストおよび各ファンドは、その投資活動またはポートフォリオの組成に関して、CIMAまたはケイマン諸島のその他の政府当局による監督に服することはない。CIMAまたはケイマン諸島のその他の政府当局は、英文目論見書もしくはその付属書の条項またはファンドへの投資の利点についての意見表明または承認をしていない。ケイマン諸島には投資者に利用可能な投資補償スキームは存在しない。

規制された投資信託が、履行期の到来した義務を履行できないかもしくは履行できなくなる可能性がある場合、投資者や債権者の利益を害する方法で業務を遂行もしくは遂行を企図し、または任意解散を行おうとしている場合、免許投資信託の場合、その投資信託の免許の条件を遵守せずに業務を行っているか、行おうとしている場合、規制された投資信託の指示および運営が適正かつ正当な方法で行われていない場合、または、規制された投資信託のマネジャーの地位にある者が、その任務にあたる適正かつ正当な者ではない場合、CIMAは、一定の措置を取ることができる。CIMAの権限には、受託会社の交替を要求すること、トラストの適切な業務遂行について受託会社に助言を与える者を任命すること、またはトラストの業務監督者を任命することが含まれる。CIMAは、その他の権限(その他措置の承認を裁判所に申請する権限を含む。)を行使することができる。

トラストの受託会社は、ケイマン諸島の会社として登録されており、かつ信託会社として免許を受けている。受託会社は、CIMAの監督下にある。受託会社はまた、ミューチュアル・ファンド法に基づく投資信託管理会社として免許を受けている。

4 手数料等及び税金

(4) その他の手数料等

< 訂正前 >

(前略)

- (a) 信託証書に記載された一切の初期費用、ならびにあらゆる投資対象の登録および運用、もしくは投資対象の保有、または投資対象の権原書類の保管に関連して生じた一切の費用(手数料および費用、輸送、移動その他における紛失に対する権原書類の保険、ならびに文書を安全に保管するために受託会社の代理人によって負担された費用を含む。)
- (b) 受託会社による収益または元本の回収、または租税の決定において生じた一切の費用(税金の払戻しまたは減税を受けるにあたり生じた専門家報酬その他の費用を含む。)
- (c) 収益もしくは元本の分配に関して、または信託財産の保有またはその取引に関して、または(サブ・ファンドからの収益または利益以外の)関連するサブ・ファンドに関して受託会社もしくは管理会社に課される(またはそれらから回収できる)その他のものに関して、支払われる一切の税金(信託証書に基づき受益者に対して行われたまたは行われる一切の分配に対して支払われる租税は除くが、何らかの者に対する補償(かかる補償が租税に関連する場合)のための支払金を含む。)
- (d) 監査人の報酬および費用
- (e) 法務、監査、評価および会計費用、仲介手数料、コンピューター・ソフトウェア・サービスおよび管理費(管理事務代行会社の報酬ならびに受託会社および管理事務代行会社が関連するサブ・ファンドを運営するにあたり負担した立替費用を含む。)
- (f) 信託証書に基づき授権された受託会社の支出
- (g) 関連するサブ・ファンドのための投資対象の保有または取引について発生した一切の公租公課
- (h) 補遺信託証書の作成および受益者集会の開催に係る、およびこれに付帯する報酬および費用
- (i) 信託証書または関連するサブ・ファンドの設立もしくは終了に起因する、またはこれに関連する印紙税その他の租税
- (j) 登録事務代行会社および関連するサブ・ファンドに関して適式に任命された登録事務代行会社の委託先の報酬および費用
- (k) 信託証書に記載される販売・買戻契約に基づき、管理会社により支払われる報酬および費用
- (l) 代行協会員報酬
- (m) サブ・ファンドの終了に関連して生じた受託会社の(管理会社の同意するところによるか、または同意がなくかつ別異に放棄されない場合、その現在の商業レートによる)報酬および費用
- (n) 信託証書に詳述される(またはあるサブ・ファンドに関する合意事項を参照することにより記載される)その他の報酬および費用

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

- (a) 本書に記載された一切の初期費用、ならびにあらゆる投資対象の登録および運用、もしくは投資対象の保有、または投資対象の権原書類の保管に関連して生じた一切の費用(手数料および費用、輸送、移動その他における紛失に対する権原書類の保険、ならびに文書を安全に保管するために受託会社の代理人によって負担された費用を含む。)
- (b) 受託会社による収益または元本の回収、または租税の決定において生じた一切の費用(税金の払戻しまたは減税を受けるにあたり生じた専門家報酬その他の費用を含む。)
- (c) 収益もしくは元本の分配に関して、または信託財産の保有またはその取引に関して、または(サブ・ファンドからの収益または利益以外の)関連するサブ・ファンドに関して受託会社もしくは管理会社に課される(またはそれらから回収できる)その他のものに関して、支払われる一切の税金(信託証書に基づき受益者に対して行われたまたは行われる一切の分配に対して支払われる

租税は除くが、何らかの者に対する補償(かかる補償が租税に関連する場合)のための支払金を含む。)

- (d) 監査人の報酬および費用
- (e) 法務、監査、評価および会計費用、仲介手数料、コンピューター・ソフトウェア・サービスおよび管理費(管理事務代行会社の報酬ならびに受託会社および管理事務代行会社に関連するサブ・ファンドを運営するにあたり負担した立替費用を含む。)
- (f) 英文目論見書に基づき授権された受託会社の支出
- (g) 関連するサブ・ファンドのための投資対象の保有または取引について発生した一切の公租公課
- (h) 補遺信託証書の作成および受益者集会の開催に係る、およびこれに付帯する報酬および費用
- (i) トラストまたは関連するサブ・ファンドの設立もしくは終了に起因する、またはこれに関連する印紙税その他の租税
- (j) 登録事務代行会社および関連するサブ・ファンドに関して適式に任命された登録事務代行会社の委託先の報酬および費用
- (k) 本書に記載される販売・買戻契約に基づき、管理会社により支払われる報酬および費用
- (l) 代行協会員報酬
- (m) サブ・ファンドの終了に関連して生じた受託会社の(管理会社の同意するところによるか、または同意がなくかつ別異に放棄されない場合、その現在の商業レートによる)報酬および費用
- (n) 本書に詳述される(またはあるサブ・ファンドに関する合意事項を参照することにより記載される)その他の報酬および費用

(後略)

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(前略)

(A) 日本

2022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

2022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

(2022年6月末日現在)

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	106.18	718,749,937	147.50	759,641,030	2.35
2	THE DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金利)	永久債	4,760,000	99.28	549,013,560	136.09	647,795,394	2.00
3	STANDARD CHARTERED PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	4,700,000	96.21	469,381,215	132.84	624,361,374	1.93
4	BAWAG GROUP AG	オース トリア	社債	2.375 (2024年3月 以降変動金利)	2029/3/26	4,000,000	96.91	504,988,434	138.53	554,132,283	1.71
5	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	オース トラリア	社債	0.669 (2026年5月 以降変動金利)	2031/5/5	4,500,000	86.37	569,080,991	122.82	552,670,202	1.71
6	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年6月 以降変動金利)	2043/6/15	4,150,000	97.54	390,045,442	132.85	551,343,947	1.70
7	BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FINANCIERO SANTAND	メキシ コ	社債	5.375	2025/4/17	3,850,000	100.58	463,175,992	138.14	531,828,125	1.64
8	DE VOLKSBANK NV	オラン ダ	社債	1.750 (2025年10月 以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	91.40	479,510,696	131.53	499,826,388	1.54
9	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	123.40	496,152,228	169.01	498,593,205	1.54
10	BANK OF IRELAND GROUP PLC	アイル ランド	社債	2.375 (2024年10月 以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	93.75	443,282,716	135.56	488,009,206	1.51
11	AXA SA	フラン ス	社債	5.453 (2026年3月 以降変動金利)	永久債	2,850,000	99.40	518,437,745	166.94	475,779,639	1.47
12	NN GROUP NV	オラン ダ	社債	4.500 (2026年1月 以降変動金利)	永久債	3,300,000	96.22	461,773,159	142.81	471,259,922	1.46
13	HSBC HOLDINGS PLC	英国	社債	6.800	2038/6/1	3,050,000	107.84	430,633,498	147.28	449,192,461	1.39
14	MITSUMI SUMITOMO INSURANCE CO LTD	日本	社債	4.950 (2029年3月 以降変動金利)	永久債	3,100,000	97.78	343,774,504	134.98	418,439,343	1.29
15	BANCO SANTANDER SA	スペイ ン	社債	3.125	2027/1/19	3,000,000	95.88	364,610,750	138.16	414,493,911	1.28
16	NATWEST GROUP PLC	英国	社債	1.043 (2027年9月 以降変動金利)	2032/9/14	3,550,000	81.31	463,380,567	116.66	414,125,737	1.28

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
17	CREDIT SUISSE GROUP AG	スイス	社債	2.250 (2027年6月 以降変動金利)	2028/6/9	2,800,000	87.22	382,293,772	144.14	403,578,970	1.25
18	JPMORGAN CHASE & CO	米国	社債	2.956 (2030年5月 以降変動金利)	2031/5/13	3,400,000	86.39	360,570,015	117.89	400,841,385	1.24
19	BANK HAPOALIM	イスラ エル	社債	3.255	2032/1/21	3,300,000	84.78	375,226,500	118.24	390,202,022	1.20
20	TORONTO - DOMINION BANK	カナダ	社債	3.200 (2032年3月 以降変動金利)	2032/3/10	3,150,000	89.25	361,212,314	122.59	386,170,111	1.19
21	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	英国	社債	4.375	2029/1/24	2,870,000	92.34	380,970,967	133.85	384,137,067	1.19
22	AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	アイル ランド	社債	2.125 (2028年1月 以降変動金利)	2026/2/21	3,250,000	85.94	332,732,013	117.80	382,851,439	1.18
23	HANWHA LIFE INSURANCE	韓国	社債	3.379	2032/2/4	3,000,000	91.77	341,805,000	126.55	379,651,315	1.17
24	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.217 (2041年4月 以降変動金利)	2042/4/22	3,500,000	78.54	378,104,998	107.54	376,398,159	1.16
25	DANSKE BANK A/S	デン マーク	社債	1.000	2031/5/15	3,000,000	87.04	380,237,162	123.80	371,410,774	1.15
26	NORDEA BANK ABP	フィン ランド	社債	0.625	2031/8/18	2,900,000	87.67	382,614,869	125.29	363,336,400	1.12
27	MACQUARIE GROUP LTD	オース トラリ ア	社債	4.098	2028/6/21	2,800,000	95.06	330,918,000	129.30	362,043,882	1.12
28	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	イタリ ア	社債	5.000 (2028年6月 以降変動金利)	2048/6/8	2,550,000	97.79	378,289,811	139.33	355,294,519	1.10
29	LA BANQUE POSTALE	フラン ス	社債	0.750	2032/8/2	3,000,000	80.70	379,425,930	115.59	346,769,878	1.07
30	FIFTH THIRD BANCORP	米国	社債	4.337	2033/4/25	2,600,000	95.21	332,007,000	130.43	339,126,282	1.05

投資不動産物件

該当事項なし。(2022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。(2022年6月末日現在)

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

(2022年9月末日現在)

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	142.03	731,478,820	2.36
2	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金利)	永久債	4,760,000	115.34	549,013,560	143.79	684,432,001	2.21
3	STANDARD CHARTERED PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	4,700,000	99.87	469,381,215	133.98	629,715,959	2.03
4	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年6月 以降変動金利)	2043/6/15	4,150,000	93.99	390,045,442	144.61	600,128,601	1.94
5	BAIWAG GROUP AG	オース トラリア	社債	2.375 (2024年3月 以降変動金利)	2029/3/26	4,000,000	126.25	504,988,434	135.30	541,202,846	1.75
6	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	オース トラリア	社債	0.669 (2025年6月 以降変動金利)	2031/5/5	4,500,000	126.46	569,080,991	119.60	538,197,990	1.74
7	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	165.72	488,881,704	1.58
8	DE VOLKSBANK NV	オラン ダ	社債	1.750 (2025年10月 以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	126.19	479,510,696	128.09	486,750,406	1.57
9	BANK OF IRELAND GROUP PLC	アイル ランド	社債	2.375 (2024年10月 以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	123.13	443,282,716	133.13	479,269,680	1.55
10	NN GROUP NV	オラン ダ	社債	4.500 (2026年1月 以降変動金利)	永久債	3,300,000	139.93	461,773,159	133.10	439,216,049	1.42
11	AXA SA	フラン ス	社債	5.453 (2026年3月 以降変動金利)	永久債	2,850,000	181.91	518,437,745	153.67	437,962,416	1.42
12	HSBC HOLDINGS PLC	英国	社債	6.800	2038/6/1	3,050,000	141.19	430,633,498	142.52	434,701,200	1.40
13	mitsui sumitomo insurance co ltd	日本	社債	4.950 (2029年3月 以降変動金利)	永久債	3,100,000	110.90	343,774,504	136.35	422,678,740	1.37
14	BANK HAPoALIM	イスラ エル	社債	3.255 (2027年1月 以降変動金利)	2032/1/21	3,300,000	113.71	375,226,500	121.82	402,007,339	1.30
15	BANCO SANTANDER SA	スペイ ン	社債	3.125	2027/1/19	3,000,000	121.54	364,610,750	133.34	400,030,681	1.29
16	AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	アイル ランド	社債	2.125 (2026年1月 以降変動金利)	2026/2/21	3,250,000	102.38	332,732,013	122.36	397,666,516	1.28
17	JPMORGAN CHASE & CO	米国	社債	2.956 (2030年5月 以降変動金利)	2031/5/13	3,400,000	106.05	360,570,015	116.47	395,984,057	1.28
18	NATWEST GROUP PLC	英国	社債	1.043 (2027年6月 以降変動金利)	2032/9/14	3,550,000	130.53	463,380,567	109.66	389,283,724	1.26
19	MACQUARIE GROUP LTD	オース トラリア	社債	4.098 (2027年6月 以降変動金利)	2028/6/21	2,800,000	118.19	330,918,000	134.49	376,563,800	1.22

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
20	BPCE SA	フランス	社債	4.750	2027/7/19	2,700,000	137.10	370,170,035	139.31	376,130,236	1.22
21	HANWHA LIFE INSURANCE	韓国	社債	3.379 (2027年2月以降変動金利)	2032/2/4	3,000,000	113.94	341,805,000	124.23	372,681,617	1.20
22	DANSKE BANK A/S	デンマーク	社債	1.000 (2026年2月以降変動金利)	2031/5/15	3,000,000	126.75	380,237,162	119.11	357,342,196	1.15
23	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	英国	社債	4.375	2029/1/24	2,870,000	132.74	380,970,967	122.09	350,391,137	1.13
24	CREDIT SUISSE GROUP AG	スイス	社債	2.250 (2028年6月以降変動金利)	2028/6/9	2,800,000	136.53	382,293,772	124.35	348,170,092	1.12
25	NORDEA BANK ABP	フィンランド	社債	0.625 (2026年5月以降変動金利)	2031/8/18	2,900,000	131.94	382,614,869	119.94	347,833,951	1.12
26	FIFTH THIRD BANCORP	米国	社債	4.337 (2032年4月以降変動金利)	2033/4/25	2,600,000	127.70	332,007,000	132.56	344,659,084	1.11
27	ASSICURAZIONI GENERALI	イタリア	社債	5.000 (2028年6月以降変動金利)	2048/6/8	2,550,000	148.35	378,289,811	134.48	342,913,664	1.11
28	LA BANQUE POSTALE	フランス	社債	0.750 (2027年5月以降変動金利)	2032/8/2	3,000,000	126.48	379,425,930	110.57	331,696,111	1.07
29	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP	日本	社債	3.202	2029/9/17	2,730,000	107.28	292,888,035	121.39	331,388,712	1.07
30	HSBC BANK USA NA	米国	社債	7.000	2039/1/15	2,000,000	137.73	275,456,810	155.43	310,853,256	1.00

投資不動産物件

該当事項なし。(2022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。(2022年9月末日現在)

第2 管理及び運営

1 申込(販売)手続等

(1) 海外における販売

<訂正前>

(前略)

制裁

受託会社およびファンドは、法令により、制裁制度の適用を受ける法人、個人、組織および/または投資対象との間の取引を制限される。

したがって、受託会社は、投資者に自身が、また、自身が知り得る限りまたは信じる限りにおいて、自身の実質的な所有者、管理者または授権された者(以下「関係者」という。)(もしもれば)が、()米国財務省外国資産管理局(以下「OFAC」という。)によって維持されるか、または欧州連合(以下「EU」という。)および/もしくは英国(以下「UK」という。)の規則(後者が命令によりケイマン諸島に適用される場合を含む。)またはケイマン諸島法制に基づく、制裁の対象となる法主体または個人のリストに記載されていないこと、()国際連合、OFAC、EU、UKおよび/またはケイマン諸島により課される制裁が適用される国または領域に事業の拠点を置いておらず、また居住していないこと、ならびに()その他国際連合、OFAC、EU、UKにより課される制裁(後者が命令によりケイマン諸島に適用される場合を含む。)またはケイマン諸島により課される制裁の対象(以下総称して「制裁対象」という。)でないことを継続的に表明および保証するよう要求することができる。

投資者または関係者が制裁対象であるか、または制裁対象となった場合、受託会社は、投資者または該当する場合その関係者が制裁対象でなくなるまで、または投資者との追加の取引および/もしくはファンドにおける投資者の持分の追加の取引を続けるための認可が適用法に基づき取得されるまで、直ちに、かつ、投資者に通知を行うことなくかかる追加の取引を停止することを要求される場合がある(以下「制裁対象者事由」という。)。受託会社およびファンドは、制裁対象者事由に起因して投資者が被った一切の債務、費用、経費、損害および/または損失(直接的、間接的または派生的な損失、利益の喪失、収入の喪失、評判の喪失ならびにすべての利息、違約金および法的費用および一切のその他の専門家費用および経費を含むがこれらに限られない。)につき、一切の責任を負わないものとする。

さらに、ファンドのために行われた投資がその後制裁の対象となった場合、受託会社は制裁が解除されるか、またはかかる取引を続けるための認可が適用法に基づき取得されるまで、直ちに、かつ、投資者に通知を行うことなく、かかる投資に関する更なる取引を停止する場合がある。

<訂正後>

(前略)

制裁

受託会社およびファンドは、法令により、制裁制度の適用を受ける法人、個人、組織および/または投資対象との間の取引を制限される。

したがって、受託会社は、投資者に自身が、また、自身が知り得る限りまたは信じる限りにおいて、自身の実質的な所有者、管理者または授権された者(以下「関係者」という。)(もしもれば)が、()米国財務省外国資産管理局(以下「OFAC」という。)によって維持されるか、または欧州連合(以下「EU」という。)および/もしくは英国(以下「UK」という。)の規則(後者が命令によりケイマン諸島に適用される場合を含む。)またはケイマン諸島法制に基づく、制裁の対象となる法主体または個人のリストに記載されていないこと、()国際連合、OFAC、EU、UKおよび/またはケイマン諸島により課される制裁が適用される国または領域に事業の拠点を置いておらず、また居住していないこと、ならびに()その他国際連合、OFAC、EU、UKにより課される制裁(後者が命令によりケイマン諸島に適用される場合を含む。)またはケイマン諸島により課

される制裁の対象(以下総称して「制裁対象」という。)でないことを継続的に表明および保証するよう要求することができる。

投資者または関係者が制裁対象であるか、または制裁対象となった場合、受託会社は、投資者または該当する場合その関係者が制裁対象でなくなるまで、または投資者との追加の取引および/もしくはファンドにおける投資者の持分の追加の取引を続けるための認可が適用法に基づき取得されるまで、直ちに、かつ、投資者に通知を行うことなくかかる追加の取引を停止することを要求される場合がある(以下「制裁対象者事由」という。)。受託会社およびファンドは、制裁対象者事由に起因して投資者が被った一切の債務、費用、経費、損害および/または損失(直接的、間接的または派生的な損失、利益の喪失、収入の喪失、評判の喪失ならびにすべての利息、違約金および法的費用および一切のその他の専門家費用および経費を含むがこれらに限られない。)につき、一切の責任を負わないものとする。

さらに、ファンドのために行われた投資がその後制裁の対象となった場合、受託会社は制裁が解除されるか、またはかかる取引を続けるための認可が適用法に基づき取得されるまで、直ちに、かつ、投資者に通知を行うことなく、かかる投資に関する更なる取引を停止する場合がある。

情報請求

受託会社、管理会社、またはケイマン諸島に住所を有するその取締役もしくは代理人は、適用法に基づき規制当局もしくは規制機関または政府当局もしくは政府機関が行う情報請求に従い、情報の提供を強制されることがある。具体的には、CIMAが、自らもしくは公認の外国の規制当局のために、金融庁法(改正済)に基づいて請求する場合、または、ケイマン諸島税務情報局が、ケイマン諸島税務情報局法(改正済)または関連する規則、合意、協定および覚書に基づいて請求する場合がある。これらの法律に基づく秘密情報の開示は、いかなる秘密保持義務の違反ともみなされず、一定の状況において、受託会社、管理会社、その取締役または代理人は、かかる請求を受けたことの開示を禁止される場合がある。

郵便物の取扱い

トラストまたはファンドの登記上の事務所において受領された、トラストまたはファンド宛の郵便物は、処理のため、管理事務代行会社が提供する転送先所在地に未開封のまま転送される。受託会社、管理会社、その取締役、役員、顧問またはサービス提供者(ケイマン諸島における登記上の事務所サービスを提供する機関を含む。)はいずれも、何らかの経緯で生じた転送先所在地への郵便物の配達遅延に対していかなる責任も負わない。特に受託会社および管理会社は、自身個人宛の郵便物(トラストまたはファンド宛の郵便物ではないもの)のみを、受領、開封または直接処理する。

3 受益証券の譲渡

(1) 受益証券の譲渡

<訂正前>

以下に記載される規定、本書に規定される規定および管理会社が決定するその他の条件に基づき、受益者は、通常もしくは一般的な形式(または管理事務代行会社が随時承認するあらゆる形式)により自らが保有する受益証券を譲渡することができる。各譲渡証書は、譲渡人またはその代理人および譲受人またはその代理人の署名が付される必要がある。

譲渡に関して、管理会社または管理事務代行会社は、それぞれの絶対的裁量により、譲受人に対して、必要または望ましいとみなすあらゆる情報(管理会社または管理事務代行会社が、関連または適用ある法域の法律規定または政府等の要求もしくは規制または当該時に効力を有する管理会社もしくは管理事務代行会社の方針の遵守を促すために要求されることがある情報または文書を含む。)を必要または望ましいとみなすいずれかの形態で提供するよう要求することができる。

受託会社および管理会社は、受託会社または管理会社が譲受人の氏名をトラストの受益者名簿に記入するまで、信託証書の規定に従って行われたい譲渡の確認、合意または登録を行わず、また引き続き譲渡人を、すべての点において譲渡の対象となる受益証券に対する権利を有する受益者として取り扱う。

管理会社またはその受託者としての管理事務代行会社のいずれも、当該譲渡契約または販売契約における表明に依拠して同意することにつき責任を負わず、それぞれ全面的に保護される。

<訂正後>

以下に記載される規定、本書に規定される規定および管理会社または副管理会社が決定するその他の条件に基づき、受益者は、通常もしくは一般的な形式(または管理事務代行会社が随時承認するあらゆる形式)により自らが保有する受益証券を譲渡することができる。各譲渡証書は、譲渡人またはその代理人および譲受人またはその代理人の署名が付される必要がある。

譲渡に関して、管理会社、副管理会社または管理事務代行会社は、それぞれの絶対的裁量により、譲受人に対して、必要または望ましいとみなすあらゆる情報(管理会社または管理事務代行会社が、関連または適用ある法域の法律規定または政府等の要求もしくは規制または当該時に効力を有する管理会社、副管理会社もしくは管理事務代行会社の方針の遵守を促すために要求されることがある情報または文書を含む。)を必要または望ましいとみなすいずれかの形態で提供するように要求することができる。

受託会社、管理会社または副管理会社は、受託会社、管理会社または副管理会社が譲受人の氏名をトラストの受益者名簿に記入するまで、信託証書の規定に従って行われたい譲渡の確認、合意または登録を行わず、また引き続き譲渡人を、すべての点において譲渡の対象となる受益証券に対する権利を有する受益者として取り扱う。

管理会社、副管理会社またはその受託者としての管理事務代行会社のいずれも、当該譲渡契約または販売契約における表明に依拠して同意することにつき責任を負わず、それぞれ全面的に保護される。

4 資産管理等の概要

(5) その他

ファンドの解散

<訂正前>

ファンドは、以下の場合、2026年9月10日(当該日が営業日でない場合、前営業日)、または、管理会社はその絶対的裁量により随時定めるそれ以降の日より前に終了することがある。

- () ファンドの決議により可決された場合
 - () トラストのケイマン諸島における規制ミューチュアル・ファンドとしての当局による免許または他の許可が廃止または改正された場合
- (後略)

<訂正後>

ファンドは、以下の場合、2026年9月10日(当該日が営業日でない場合、前営業日)、または、管理会社はその絶対的裁量により随時定めるそれ以降の日より前に終了することがある。

- () ファンドの決議により可決された場合
 - () トラストのケイマン諸島における規制ミューチュアル・ファンドとしてのCIMAによる免許または他の許可が廃止または改正された場合
- (後略)

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

4 利害関係人との取引制限

<訂正前>

管理会社は、利害関係人との取引に関して特別の制限に服していない。

<訂正後>

利益相反

投資者は、以下の潜在的利益相反に注意する必要がある。

受託会社、管理会社、副管理会社、投資顧問会社、保管会社および管理事務代行会社ならびにこれらの取締役、役員、従業員、代理人および関連会社(以下「利害関係者」という。)はそれぞれ、ファンドとの利益相反が時折生じうる他の金融、投資またはその他の専門的な活動に参与することがある。当該活動には、他ファンドの受託者、管理事務代行者、保管者、投資運用者または販売者としての行為および他ファンドまたは他社の取締役、役員、顧問または代理人としての役務が含まれる。管理会社、副管理会社および/または投資顧問会社は、ファンドと類似または重複する投資目的を掲げる他の投資ファンドに対する投資運用および投資助言サービスの提供に関与することがある。管理会社および副管理会社は、ファンドに対して提供されるサービスと類似するサービスを第三者に提供することがある。いかなる利害関係者も、当該活動から得られる利益について説明する責任を負わない。利益相反が生じた場合、受託会社、管理会社、副管理会社、投資顧問会社、保管会社または管理事務代行会社は、(必要に応じて)自身の利益相反方針のもとで定められた原則に従って、これを公正かつ誠実に解決することができるよう努力を払う。

受託会社またはその他のサービス提供者は、ファンドに関して銀行、ブローカーとして行為するかまたは管理事務、専門的もしくはその他のサービスを提供する場合、かかる資格において、これに関連して信託財産からファンドにより支払を受けることが合意されている報酬または費用を受領し保持する権利を有するものとする。

受託会社、管理会社、副管理会社または投資顧問会社は、権限もしくは裁量権の行使の方法もしくは結果または取引において何らかの別のまたは相反する利害関係(個人的な利害関係であるかもしくはその他の何らかの資格における利害関係であるか、または受託会社の場合、別の信託の唯一の受託者もしくは受託者の一人としての資格における利害関係であるかを問わない。)を有する可能性があることにかかわらず、信託証書または一般的な法令により授権される取引を締結および実行するための権限または裁量権を行使することができ、その結果としてかかる資格において得た利益について説明する責任を負わないが、受託会社の場合、受託会社は、単なる形式上の当事者にすぎない場合を除き、別のまたは相反する利害関係を有する可能性がある案件において活動することを差し控えることができる。

受託会社ならびにその役員および従業員は、何らかの形でファンドと関係のある会社、団体または企業の役員、従業員、代理人または顧問として得た合理的な報酬またはその他の合理的な利益について説明する責任を負わない。これは、自らの立場または役職が、受託会社としての地位またはファンドに帰属もしくは関連するいずれかの持分、株式、資産、権利もしくは権限を理由または手段として獲得または維持された可能性があるか否かを問わない。

適用ある法令または規則に規定されるところに従い、管理会社、副管理会社および/または投資顧問会社は、ファンドの勘定で、いずれかの利害関係者もしくは投資ファンドから、または当該利害関係者により助言もしくは管理される勘定から有価証券を取得し、またはこれらに対して当該有価証券を処分することができる。利害関係者(受託会社を除く。)は、自らが適当と考える受益証券を保有および取引することができる。利害関係者は、ファンドの勘定で類似する投資対象が保有されている可能性があるにかかわらず、自らの勘定で投資対象を購入、保有および取引することができる。

利害関係者は、受益者またはファンドによってもしくはファンドの勘定で有価証券が保有される事業体との間で金融取引その他の取引を契約し、もしくは締結することができ、または、当該契約もしくは取引について利害関係を有することができる。さらに、利害関係者は、ファンドの投資対象の販売または購入(当該利害関係者が当該ファンドの勘定で実行し、当該ファンドの利益となるもしくは利益とならないもの)に関して交渉できる手数料および利益を受領することができる。

第2 その他の関係法人の概況

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(4) 東京海上アセットマネジメント株式会社(「投資顧問会社」)

(口) 事業の内容

<訂正前>

投資顧問会社は、1985年12月9日に日本法の下で投資顧問会社として設立され、現在の資本金は20億円である。投資顧問会社は、金融庁に投資運用業の登録を行っており、金融商品取引法の下で規制を受けている。投資顧問会社は、2022年6月末日現在、8兆3,516億円の資産の運用を行っている。

<訂正後>

投資顧問会社は、1985年に設立された日本の法人であり、東京海上ホールディングス株式会社の子会社である。投資顧問会社は、金融商品取引法に従い投資運用業を行う事業者として登録されており、日本国内外の機関投資家および個人投資家に対して投資運用および投資信託サービスを提供している。投資顧問会社は、2022年6月末日現在、8兆3,516億円の資産の運用を行っている。