

## 【表紙】

|               |                                                                                                                                                    |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 【提出書類】        | 半期報告書                                                                                                                                              |
| 【提出先】         | 関東財務局長                                                                                                                                             |
| 【提出日】         | 令和4年11月30日                                                                                                                                         |
| 【計算期間】        | 第11期中(自 令和4年3月1日 至 令和4年8月31日)                                                                                                                      |
| 【ファンド名】       | 東京海上ストラテジック・トラスト - 東京海上Roggeグローバル・<br>ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド<br>(Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global<br>Hybrid Securities Fund) |
| 【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.<br>(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)<br>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<br>(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<br>り 287 - 289番<br>(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of<br>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<br>森・濱田松本法律事務所                                                                                                      |
| 【事務連絡者氏名】     | 弁護士 三浦 健<br>同 大西 信治<br>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<br>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<br>（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 |

## &lt;豪ドル建 豪ドルヘッジクラス&gt;

|            | 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 |

## &lt;参考情報&gt;

## 純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移(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。

## &lt;米ドル建 米ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 1口当たり分配金 |          |
|----------------------|----------|----------|
|                      | 米ドル      | 円        |
| 2021年10月1日～2022年9月末日 | 0.000550 | 0.079646 |

## &lt;豪ドル建 豪ドルヘッジクラス&gt;

| 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 |

## &lt;参考情報&gt;

## 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。

## &lt;米ドル建 米ドルヘッジクラス&gt;

| 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

## &lt;豪ドル建 豪ドルヘッジクラス&gt;

| 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

## &lt;参考情報&gt;

## 年間収益率の推移



(注1) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

ただし、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～<br>2022年９月末日 | 855,439,441<br>(855,439,441) | 3,076,070,648<br>(3,076,070,648) | 15,415,053,448<br>(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～<br>2022年９月末日 | 179,946,804<br>(179,946,804) | 1,054,042,137<br>(1,054,042,137) | 3,068,553,389<br>(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。

### 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。

( 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<br>(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    | (33,150,035,575.99) |
| 純資産額合計  | 31,671,992,077.31   |

## 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<br>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<br>(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<br>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     |

## ( 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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>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 | BE0002644251 | 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     | BE6317598850 | 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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価   | 帳簿上の<br>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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価   | 帳簿上の<br>未実現損益  | 未収利息         | 帳簿上の時価         | 投資比率  |
|---------------------------------------------------|--------------|-----------------|--------------|----------------|----------------|----------------|--------------|----------------|-------|
| COOPERATIEVE 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<br>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<br>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<br>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<br>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%<br>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<br>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<br>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<br>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-THUERINGEN FLT<br>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-WUERTTEMBERG 3.625%<br>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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価     | 帳簿上の<br>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<br>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<br>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%<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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% |
| 英ボンド                                            |              |                 |              |                | 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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>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<br>SR: EMTN      | XS239351859<br>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<br>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<br>09/11/31         | XS235148056<br>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<br>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<br>06/09/28 SR: EMTN  | CH055041333<br>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<br>SR: EMTN    | XS049876831<br>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<br>12/15/31         | XS235116642<br>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<br>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<br>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<br>09/15/31 SR: GMTN | XS238628741<br>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<br>SR: EMTN       | XS234651625<br>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<br>SR: EMTN         | XS238512263<br>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%<br>11/13/28          | XS131973853<br>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<br>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<br>SR: EMTN     | XS234385151<br>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<br>SR: 144A        | US00084DAV2<br>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<br>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<br>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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価   | 帳簿上の<br>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                    | XS1640851983 | 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%<br>11/01/27 SR:144A   | US05369AAA97 | 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%<br>10/01/25 SR:144A   | US05367AAH68 | 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%<br>02/21/26 SR:144A | US05401AAM36 | 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%<br>04/15/26 SR:144A | US05401AAL52 | 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%<br>05/01/26 SR:144A | US05401AAG67 | 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%<br>01/15/26 SR:144A | US05401AAK79 | 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<br>07/01/30 SR:REGS    | US05971V2C81 | 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%<br>04/17/25 SR:REGS   | USP1507SAH06 | 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%<br>05/14/38             | US59023VAA89 | 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                   | US06051GKK49 | 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<br>SR:2            | US0641598N91 | 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                     | US05578AE465 | 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                       | US172967EW71 | 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%<br>03/14/32 SR:REGS   | USQ2704MAH18 | 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<br>04/06/33 SR:144A     | US74977RDP64 | 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%<br>04/05/27 SR:144A | US21871XAC39 | 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<br>SR:144A         | US23380YAC12 | 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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価   | 帳簿上の<br>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<br>SR:GMTN        | XS212240885<br>4 | 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                     | US251526CF4<br>7 | 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:-                        | XS207528099<br>5 | 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                  | US316773DF4<br>7 | 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%<br>06/15/31 SR:144A | US37959GAB3<br>2 | 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%<br>02/15/34        | US38143VAA7<br>0 | 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<br>SR:REGS     | USY306AXAD2<br>6 | 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<br>02/12/47 SR:ICON    | US416515BC7<br>6 | 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                      | XS001519042<br>3 | 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<br>SR:BKNT       | US4042Q1AD<br>94 | 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                 | US404280AJ8<br>7 | 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%<br>09/30/30 SR:EMTN   | XS223597386<br>9 | 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<br>05/17/33             | US446150BA1<br>8 | 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                         | US456837BC6<br>5 | 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%<br>11/23/31 SR:144A  | US46817MAK<br>36 | 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                  | US46647PBP0<br>9 | 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<br>12/15/51 SR:144A  | US53079EBM<br>57 | 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<br>SR:REGS       | US55608KBC8<br>0 | 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<br>(現地通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価   | 帳簿上の<br>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                         | US59156RAP3<br>8 | 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<br>sr:regs        | USJ4517MAA<br>74 | 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                         | US61772BAC7<br>2 | 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                          | US63111XAB7<br>3 | 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<br>05/15/55             | US74251VAL6<br>2 | 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<br>06/15/43            | US744320AM<br>42 | 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%<br>09/15/45 SR:REGS | XS129135271<br>1 | 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<br>SR:REGS         | USY7749XAY7<br>7 | 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<br>SR:REGS       | USJ7620TAB7<br>3 | 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%<br>02/19/27 SR:144A   | US853254BF6<br>4 | 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%<br>01/09/43 SR:REGS   | XS087526739<br>4 | 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%<br>09/17/29         | US86562MBS<br>89 | 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                       | XS204942234<br>3 | 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:*                   | US87164DSE1<br>2 | 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                               | CH055852126<br>3 | 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<br>04/19/51 SR:EMTN      | XS228317756<br>1 | 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<br>05/02/52 SR:EMTN      | XS241697819<br>0 | 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<br>(現地<br>通貨) | 取得原価<br>(現地通貨)   | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>未実現損益  | 未収<br>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<br>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・<br>レアル   |         |                     |                  |                  | 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・<br>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・<br>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・<br>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<br>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<br>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<br>(現地<br>通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>未実現損益   | 未収利<br>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<br>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<br>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<br>報酬   |      |                  |                  |                | -1,136,159.98     | 0.00            | 0.00     | -1,136,159.98     | 0.00%   |
| 現金および現<br>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<br>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<br>(現地<br>通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>未実現損益  | 未収利<br>息 | 帳簿上の時価            | 投資比<br>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<br>未払金  |         |                   |                  |                | -13,474,777.52    | 0.00           | 0.00     | -13,474,777.52    | 0.04%    |
| 現金および現<br>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<br>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・<br>レアル   |         |                   |                  |                | -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・<br>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<br>(現地<br>通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>未実現損益  | 未収利<br>息 | 帳簿上の時価            | 投資比<br>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<br>未払金  |         |                   |                  |                | -39,288,026.00    | 0.00           | 0.00     | -39,288,026.00    | 0.12%    |
| 現金および現<br>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<br>金    |         |                   |                  |                | -87,722,258.63    | 0.00           | 0.00     | -87,722,258.63    | 0.26%    |
| 現金および現<br>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<br>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<br>(現地<br>通貨) | 取得原価<br>(現地通貨) | 帳簿上の<br>取得原価      | 帳簿上の<br>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% |

## 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係し、もしくはこれらから生じ、もしくはこれらに基づき、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が現実に一時的に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、かかる行為が信託証書に基づく義務の履行に関する故意の不適切な行為もしくは重過失または詐欺を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、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。

## 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<br>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<br>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<br>ヘッジ項目の公正価値変動    |                  |               |
| 260 | 子会社、合併会社および関連会社への投資                      |                  |               |
| 270 | 有形資産                                     | 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<br>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<br>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         |
|-----|-----------------------------------------------|----------------|------------|
| 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、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分          |                |            |
| 320 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動             |                |            |
| 330 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性 |                |            |
| 340 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕      |                |            |
| 350 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕      |                |            |
| 360 | 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、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分          |                |            |
| 190 | 利益剰余金                                         | 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、合併会社および関連会社への投資の準備金または累積損失    |                |            |
| 230 | その他                                           | 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<br>売買目的保有以外の金融資産                  |               |            |
| 030 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして<br>指定した金融資産                      |               |            |
| 041 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産                                |               |            |
| 051 | 償却後原価における金融資産                                             | 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<br>指定した金融負債)                    |               |            |
| 120 | (償却後原価で測定される金融負債)                                         | 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<br>売買目的保有以外の金融資産                  |               |            |
| 191 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産                                |               |            |
| 192 | 持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および<br>関連会社への投資                  |               |            |
| 200 | 受取手数料                                                     | 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<br>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<br>(-)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<br>有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額  |               |            |
| 290 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した<br>金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額 |               |            |
| 300 | ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額                                     |               |            |
| 310 | 為替差額[利益または(-)損失]、純額                                       |               |            |
| 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<br>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

|     |                                                       |               |            |
|-----|-------------------------------------------------------|---------------|------------|
| 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  |