

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年11月30日

【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)

【代表者の役職氏名】 エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス
(Fabrice Mas, Executive Director)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 大西 信治
同 中野 恵太

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 東京海上ストラテジック・トラスト - 東京海上Roggeグローバル・
ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
(Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】 米ドル建 米ドルヘッジクラス：
20億アメリカ合衆国ドル(約2,899億8,000万円)を上限とする。
豪ドル建 豪ドルヘッジクラス：
20億オーストラリアドル(約1,915億4,000万円)を上限とする。
(注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」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、2023年6月30
日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ド
ル=144.99円および1豪ドル=95.77円)による。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし。

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2023年8月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するとともに、その他一部情報の時点等を更新するため本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

２【訂正の内容】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 第15 ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第31 ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第11 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
	2 事業の内容及び営業の概況		(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
3 管理会社の経理状況		5 管理会社の経理の概況		追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

東京海上ストラテジック・トラスト（Tokio Marine Strategic Trust）（以下「トラスト」という。）のサブ・ファンドである東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund）（以下「ファンド」という。）の運用状況は以下のとおりである。

（１）投資状況

資産別および地域別の投資状況

（2023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	5,654,217,864	17.74
	英国	4,486,374,029	14.08
	フランス	3,414,606,301	10.72
	オランダ	3,119,830,893	9.79
	ドイツ	1,752,121,110	5.50
	スイス	1,644,081,400	5.16
	オーストラリア	1,360,784,197	4.27
	アイルランド	1,208,127,001	3.79
	日本	1,114,242,777	3.50
	デンマーク	1,084,379,017	3.40
	オーストリア	917,477,838	2.88
	スペイン	832,815,225	2.61
	フィンランド	809,741,533	2.54
	香港	531,637,506	1.67
	ベルギー	510,132,362	1.60
	韓国	404,223,221	1.27
	イタリア	392,229,575	1.23
	ペルー	358,780,729	1.13
	ルクセンブルグ	242,298,659	0.76
	ケイマン諸島	229,958,059	0.72
	チェコ共和国	169,058,394	0.53
	スウェーデン	154,495,746	0.48
	ノルウェー	124,529,748	0.39
	トーゴ	45,302,300	0.14
小計		30,561,445,484	95.91
現金・その他の資産 （負債控除後）		1,302,574,856	4.09
合計（純資産総額）		31,864,020,340	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、2023年9月29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＝149.58円お

よび１豪ドル＝96.06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

2023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
2022年10月末日	99,227,605.89	14,842,465	0.006577	0.9838
11月末日	102,492,252.10	15,330,791	0.006781	1.0143
12月末日	102,255,359.10	15,295,357	0.006732	1.0070
2023年１月末日	105,197,492.04	15,735,441	0.006951	1.0397
２月末日	102,983,760.21	15,404,311	0.006803	1.0176
３月末日	99,216,453.57	14,840,797	0.006719	1.0050
４月末日	99,051,939.71	14,816,189	0.006743	1.0086
５月末日	98,299,997.30	14,703,714	0.006687	1.0002
６月末日	97,862,087.78	14,638,211	0.006648	0.9944
７月末日	98,384,462.51	14,716,348	0.006712	1.0040
８月末日	99,442,937.68	14,874,675	0.006659	0.9961
９月末日	98,423,821.80	14,722,235	0.006583	0.9847

< 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス >

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2022年10月末日	17,078,146.31	1,640,527	0.005613	0.5392
11月末日	17,449,620.58	1,676,211	0.005789	0.5561
12月末日	17,456,129.19	1,676,836	0.005742	0.5516
2023年1月末日	17,985,903.58	1,727,726	0.005923	0.5690
2月末日	17,463,954.18	1,677,587	0.005788	0.5560
3月末日	17,264,555.24	1,658,433	0.005720	0.5495
4月末日	17,033,597.95	1,636,247	0.005740	0.5514
5月末日	16,695,940.13	1,603,812	0.005688	0.5464
6月末日	16,401,573.82	1,575,535	0.005656	0.5433
7月末日	15,552,250.11	1,493,949	0.005710	0.5485
8月末日	15,888,408.05	1,526,240	0.005663	0.5440
9月末日	15,390,978.01	1,478,457	0.005594	0.5374

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2013年9月末日～2023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

2023年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
2022年10月1日～2023年9月末日	0.000480	0.071798

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
2022年10月1日～2023年9月末日	0.000360	0.034582

<参考情報>

分配の推移（2023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
第11会計年度(2022年3月1日～2023年2月28日)		0.000500
2023年5月		0.000040
2023年6月		0.000040
2023年7月		0.000040
2023年8月		0.000040
2023年9月		0.000040
直近1年間累計		0.000480
設定来累計		0.006059

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
第11会計年度(2022年3月1日～2023年2月28日)		0.000380
2023年5月		0.000030
2023年6月		0.000030
2023年7月		0.000030
2023年8月		0.000030
2023年9月		0.000030
直近1年間累計		0.000360
設定来累計		0.007438

収益率の推移

2023年9月末日までの1年間の収益率は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
2022年10月1日～2023年9月末日	6.76%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
2022年10月1日～2023年9月末日	5.40%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<参考情報>

年間収益率の推移



（注1）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

ただし、2023年については2023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

（注2）2023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

2023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2023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
2022年10月１日～ 2023年９月末日	1,703,630,670 (1,703,630,670)	2,167,561,285 (2,167,561,285)	14,951,122,833 (14,951,122,833)

<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
2022年10月１日～ 2023年９月末日	271,948,246 (271,948,246)	588,970,663 (588,970,663)	2,751,530,972 (2,751,530,972)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

３ ファンドの経理状況

- a．ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第４項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第１条の３第７項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．ファンドの原文の中間財務書類は日本円で表示されている。

[次へ](#)

(１) 資産及び負債の状況

純資産計算書

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

報告期間：2023年 3 月 1 日から2023年 8 月31日

詳細	残高 (日本円)
資産	
投資 - ロング	
社債	30,944,380,310.25
設定払込未収金	
設定払込未収金	78,000,000.00
現金 - ロング	
現金および現金同等物	1,279,988,911.82
先渡為替取引未収金	
先渡為替取引未収金	67,697,389,645.87
未収金	
未収金	11,432,277.38
資産合計	100,011,191,145.32
負債	
AIFMD報酬未払金	
AIFMD報酬未払金	(78,121.73)
未払監査報酬	
未払監査報酬	(104,480.91)
未払代行協会員報酬	
未払代行協会員報酬	(911,330.77)
監査報酬未払金	
監査報酬未払金	(765,274.79)
販売会社報酬未払金	
販売会社報酬未払金	(10,808,533.08)
財務書類作成報酬未払金	
財務書類作成報酬未払金	(564,499.10)
先渡為替取引未払金	
先渡為替取引未払金	(68,083,214,255.38)
管理会社報酬未払金	
管理会社報酬未払金	(15,558,385.00)
管理報酬未払金	
管理報酬未払金	(28,039,571.42)
未払金	
未払金	(219,170.73)
副投資顧問報酬未払金	
副投資顧問報酬未払金	(3,111,686.00)
受託報酬未払金	

受託報酬未払金	(3,795,496.04)
負債合計	(68,147,170,804.95)
純資産額合計	31,864,020,340.37

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

2023年8月31日現在

クラス名称	通貨	期末資産	発行済受益証券口数	1口当たり 純資産価額
豪ドル建 豪ドルヘッジクラス	豪ドル	15,888,408.05	2,805,479,685	0.005663
豪ドルクラス	日本円	904,786,623	119,019.5849	7,602
資源国通貨バスケットクラス	日本円	25,715,031	5,246.7231	4,901
ブラジル・レアルクラス	日本円	1,579,559,603	543,273.8971	2,907
ユーロクラス	日本円	3,568,383	310.6369	11,487
日本円クラス	日本円	6,188,016,900	925,883.6327	6,683
メキシコ・ペソクラス	日本円	461,747,773	66,922.1142	6,900
トルコ・リラクラス	日本円	692,230,229	1,169,040.0334	592
米ドル建 米ドルヘッジクラス	米ドル	99,442,937.68	14,932,527,598	0.006659
米ドルクラス	日本円	6,032,782,317	392,590.1802	15,367

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：2023年3月1日から2023年8月31日

勘定科目	説明	期間累計 (日本円)
収益		633,325,554.91
未収利息 - ロングの増減		(31,011,267.58)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(31,011,267.58)
受取利息		15,694,589.38
	現金および現金同等物	15,679,371.65
	社債	15,217.73
利息収入		588,416,607.29
	現金および現金同等物	0.00
	社債	588,416,607.29
その他の収益		61,049.59
	現金および現金同等物	61,049.59
売却未収利息収入		60,164,576.23
	現金および現金同等物	0.00
	社債	60,164,576.23
費用		(1,203,021,860.08)
AIFMD費用		(228,290.49)
	現金および現金同等物	(228,290.49)
管理事務代行報酬費用		11,647,108.00
	現金および現金同等物	11,647,108.00
仲介手数料費用		(3,828,046.83)
	現金および現金同等物	(3,828,046.83)
監査報酬費用		(9,627,601.95)
	現金および現金同等物	(9,627,601.95)
銀行手数料		(82,004.75)
	現金および現金同等物	(82,004.75)
保管報酬		(6.00)
	現金および現金同等物	(6.00)
販売会社報酬		(45,400,755.30)
	現金および現金同等物	(45,400,755.30)
宣言された分配金		(996,368,745.20)
	現金および現金同等物	(996,368,745.20)
財務書類作成報酬		(101,443.63)
	現金および現金同等物	(101,443.63)
支払利息		(174,563.38)
	現金および現金同等物	(174,563.38)
利息に係る源泉徴収税費用		(4,962,349.47)

	現金および現金同等物	0.00
	社債	(4,962,349.47)
弁護士および専門家報酬(費用)		(170,442.00)
	現金および現金同等物	(170,442.00)
管理会社報酬		(18,550,092.00)
	現金および現金同等物	(18,550,092.00)
管理報酬		(98,180,363.96)
	現金および現金同等物	(98,180,363.96)
その他の報酬費用		(521,047.58)
	現金および現金同等物	(521,047.58)
立替報酬		682,749.71
	現金および現金同等物	682,749.71
購入未払利息費用		(29,591,756.66)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(29,591,756.66)
登録報酬費用		(1,345,252.11)
	現金および現金同等物	(1,345,252.11)
財務報告および会計		(19,618.74)
	現金および現金同等物	(19,618.74)
副保管報酬(費用)		(1,005,409.44)
	現金および現金同等物	(1,005,409.44)
副投資顧問報酬費用		(3,710,025.00)
	現金および現金同等物	(3,710,025.00)
受託報酬		(1,483,903.30)
	現金および現金同等物	(1,483,903.30)
新発銘柄以外への投資に係る実現および未 実現損益		1,512,433,025.95
未実現為替差損益の増減		1,587,488,955.90
	現金および現金同等物	(4,127,203.63)
	社債	1,759,820,402.34
	先渡為替取引	(168,204,242.81)
未実現価格損益の増減		(8,338,861.08)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(8,338,861.08)
長期為替差損益		153,211,350.67
	現金および現金同等物	0.00
	社債	153,211,350.67
長期価格損益		(172,078,607.66)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(172,078,607.66)
988条費用		(4,605,937,655.92)
	現金および現金同等物	(67,197,230.56)
	社債	(242,300,077.60)
	先渡為替取引	(4,296,440,347.76)

988条収益		4,554,850,840.24
	現金および現金同等物	153,202,257.11
	社債	770,893,237.55
	先渡為替取引	3,630,755,345.58
短期為替差損益		13,571,467.45
	現金および現金同等物	0.00
	社債	13,571,467.45
短期価格損益		(10,334,463.65)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(10,334,463.65)
純利益／損失		942,736,720.78

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

東京海上ストラテジック・トラスト－

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

投資ポジション評価明細表

報告期間：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
投資					29,846,555,182.39	1,994,879,214.42	382,934,825.26	31,841,434,396.81	100.00%
現金 - ロング					1,280,508,110.52	-519,198.70	0.00	1,279,988,911.82	4.02%
JP Morgan Collateral					33,747,600.00	1,192,800.00	0.00	34,940,400.00	0.11%
米ドル					33,747,600.00	1,192,800.00	0.00	34,940,400.00	0.11%
米ドル	USD	240,000.00000	1.0000	240,000.00	33,747,600.00	1,192,800.00	0.00	34,940,400.00	0.11%
MUFJ Global Custody S.A.					1,246,760,510.52	-1,711,998.70	0.00	1,245,048,511.82	3.91%
豪ドル					40,918,357.79	11,843.00	0.00	40,930,200.79	0.13%
豪ドル	AUD	434,097.09000	1.0000	434,097.09	40,918,357.79	11,843.00	0.00	40,930,200.79	0.13%
カナダドル					4,517.51	981.14	0.00	5,498.65	0.00%
カナダドル	CAD	51.10000	1.0000	51.10	4,517.51	981.14	0.00	5,498.65	0.00%
ユーロ					125,000,263.09	-691,455.14	0.00	124,308,807.95	0.39%
ユーロ	EUR	786,711.33000	1.0000	786,711.33	125,000,263.09	-691,455.14	0.00	124,308,807.95	0.39%
日本円					458,772,590.50	0.00	0.00	458,772,590.50	1.44%
日本円	JPY	458,772,590.50000	1.0000	458,772,590.50	458,772,590.50	0.00	0.00	458,772,590.50	1.44%
英ポンド					5,285,583.11	22,824.84	0.00	5,308,407.95	0.02%
英ポンド	GBP	28,775.29000	1.0000	28,775.29	5,285,583.11	22,824.84	0.00	5,308,407.95	0.02%
ロシア・ルーブル					0.09	-0.03	0.00	0.06	0.00%
ロシア・ルーブル	RUB	0.04000	1.0000	0.04	0.09	-0.03	0.00	0.06	0.00%
米ドル					616,779,198.43	-1,056,192.51	0.00	615,723,005.92	1.93%
米ドル	USD	4,229,302.51000	1.0000	4,229,302.51	616,779,198.43	-1,056,192.51	0.00	615,723,005.92	1.93%
投資 - ロング					28,566,047,071.87	1,995,398,413.12	382,934,825.26	30,561,445,484.99	95.98%
					28,566,047,071.87	1,995,398,413.12	382,934,825.26	30,561,445,484.99	95.98%
ユーロ					13,972,211,889.94	901,957,623.05	156,940,841.75	14,874,169,512.99	46.71%
AGEAS FLT 07/02/49	BE0002644251	700,000.00000	86.3020	713,125.00	88,603,732.82	6,852,743.20	599,123.90	95,456,476.02	0.30%
AGEAS FLT PERP	BE6317598850	1,400,000.00000	73.3224	1,392,370.00	172,214,560.99	-10,014,428.49	1,943,941.75	162,200,132.50	0.51%
AIA GROUP LTD FLT 09/09/33 SR:GMTN	XS2356311139	1,300,000.00000	80.4074	1,304,647.50	170,273,198.24	-5,105,296.13	1,768,022.84	165,167,902.11	0.52%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	XS1989708836	2,250,000.00000	87.5310	2,298,401.00	283,695,075.01	27,498,668.32	3,999,645.84	311,193,743.33	0.98%
ASSICURAZIONI GENERALI FLT 06/08/48 SR:EMTN	XS1428773763	2,550,000.00000	100.3216	3,031,645.00	378,289,811.01	25,933,409.81	4,678,800.44	404,223,220.82	1.27%
AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31 SR:EMTN	XS2294372169	4,500,000.00000	88.4962	4,500,450.00	569,080,990.98	60,169,815.25	1,546,646.29	629,250,806.23	1.98%
BANK OF IRELAND GROUP FLT 10/14/29 SR:EMTN	XS2065555562	3,600,000.00000	96.3279	3,685,123.15	443,282,715.98	104,667,541.61	11,918,335.84	547,950,257.59	1.72%
BANQUE FED CRED MUTUEL 1.125% 11/19/31 SR:EMTN	FR0014006KD4	1,800,000.00000	74.3458	1,787,184.00	233,816,478.49	-22,362,618.96	2,507,175.26	211,453,859.53	0.66%
BANQUE OUEST AFRICAINE D 2.750% 01/22/33 SR:REGS	XS2288824969	400,000.00000	71.6760	396,264.00	49,925,955.00	-4,623,655.27	1,057,156.52	45,302,299.73	0.14%
BAWAG GROUP AG FLT 03/26/29 SR:EMTN	XS1968814332	4,000,000.00000	93.8699	3,995,520.00	504,988,433.98	88,309,383.93	6,521,179.30	593,297,817.91	1.86%
BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34 SR:EMTN	BE6331190973	2,000,000.00000	79.8920	1,994,640.00	259,281,358.69	-6,805,605.01	1,597,375.93	252,475,753.68	0.79%
BNP PARIBAS FLT 08/31/33 SR:EMTN	FR00140057U9	2,300,000.00000	79.7438	2,297,355.00	295,992,596.61	-6,184,184.17	8,688.43	289,808,412.44	0.91%
CAIXABANK SA FLT 06/18/31 SR:EMTN	XS2310118976	2,900,000.00000	89.0193	2,762,261.00	370,654,537.34	37,259,334.66	1,173,747.51	407,913,872.00	1.28%
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 1.650% 06/12/29	XS2010331440	3,350,000.00000	81.8991	3,138,113.00	404,299,247.01	29,221,993.88	1,932,943.60	433,521,240.89	1.36%
CHUBB INA HOLDINGS INC 2.500% 03/15/38	XS1785813251	1,350,000.00000	80.4872	1,349,986.50	176,023,539.34	-4,332,822.81	2,477,012.00	171,690,716.53	0.54%
COMMERZBANK AG FLT 10/05/33 SR:EMTN	DE000CZ43Z49	3,900,000.00000	99.7890	3,881,787.00	611,619,211.95	3,322,001.50	6,609,825.68	614,941,213.45	1.93%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT 11/30/32 SR:GMTN	XS2524143554	1,300,000.00000	95.3761	1,297,933.00	177,460,473.49	18,455,241.10	5,997,101.31	195,915,714.59	0.62%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT PERP	XS2202900424	1,200,000.00000	88.2250	1,200,000.00	145,657,442.00	21,628,486.09	1,450,590.03	167,285,928.09	0.53%
CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	FR0013312154	2,000,000.00000	87.5961	2,007,829.00	272,543,704.01	4,278,717.56	4,886,426.78	276,822,421.57	0.87%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	FR0013533999	1,400,000.00000	86.8975	1,400,000.00	174,581,833.00	17,648,454.25	1,683,157.46	192,230,287.25	0.60%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP SR:EMTN	FR001400F067	1,400,000.00000	99.0049	1,402,850.00	199,915,509.79	19,098,093.58	3,050,722.89	219,013,603.37	0.69%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31 SR: EMTN	XS229913581 9	3,000,000.00000	89.4713	3,000,285.00	380,237,162.01	43,885,330.66	1,411,734.94	424,122,492.67	1.33%
DANSKE BANK A/S FLT 06/21/29 SR: EMTN	XS196769773 8	2,250,000.00000	97.5796	2,309,239.50	279,812,949.99	67,106,020.30	1,748,479.06	346,918,970.29	1.09%
DE VOLKSBANK NV FLT 10/22/30 SR: EMTN	XS220290263 6	3,800,000.00000	91.9122	3,890,234.00	479,510,695.97	72,367,524.33	9,039,510.76	551,878,220.30	1.73%
DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	DE000DL19VU 0	2,100,000.00000	74.9261	1,896,154.00	258,168,803.91	-9,547,101.85	2,450,031.67	248,621,702.06	0.78%
DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 01/15/32	XS223211542 3	1,000,000.00000	72.1723	990,170.00	124,200,604.00	-10,160,663.36	991,354.80	114,039,940.64	0.36%
ELM BV (HELVETIA SCHWEIZ) FLT 09/29/47	XS158789345 1	950,000.00000	91.1837	973,098.09	115,872,576.99	21,003,395.51	4,677,576.68	136,875,972.50	0.43%
GROUPE ACM FLT 04/21/42	FR001400614 4	2,900,000.00000	74.3349	2,540,966.00	351,430,526.24	-10,805,039.97	3,080,539.48	340,625,486.27	1.07%
HANNOVER RE FLT 10/09/39	XS206335092 5	1,700,000.00000	79.6567	1,682,354.00	198,098,356.99	15,874,109.35	2,707,340.18	213,972,466.34	0.67%
HSBC HOLDINGS PLC FLT 06/15/27	XS248658959 6	1,500,000.00000	96.2455	1,457,940.00	205,538,777.47	22,578,433.83	1,524,945.72	228,117,211.30	0.72%
ING GROEP NV FLT 05/26/31 SR: EMTN	XS217662117 0	1,200,000.00000	92.1287	1,198,056.00	141,564,503.00	33,123,417.37	1,078,876.34	174,687,920.37	0.55%
ING GROEP NV FLT 06/09/32 SR: EMTN	XS235075644 6	500,000.00000	85.3875	497,620.00	66,582,328.00	878,381.03	158,658.28	67,460,709.03	0.21%
JYSKE BANK A/S FLT 01/28/31 SR: EMTN	XS210939121 4	2,250,000.00000	88.1340	2,224,035.00	272,639,082.98	40,698,470.52	2,629,904.12	313,337,553.50	0.98%
LA BANQUE POSTALE FLT 08/02/32 SR: EMTN	FR0014001R3 4	3,000,000.00000	82.4997	2,983,050.00	379,425,930.02	11,648,988.17	291,413.18	391,074,918.19	1.23%
LANDBK HESSEN-THUERINGEN FLT 09/15/32 SR: EMTN	XS248977299 1	1,700,000.00000	93.3378	1,697,892.00	243,859,823.39	6,862,566.14	11,624,176.19	250,722,389.53	0.79%
LB BADEN-WUERTTEMBERG 3.625% 06/16/25 SR: EMTN	XS124673224 9	1,980,000.00000	97.4065	1,972,495.80	275,882,567.00	28,864,500.94	2,385,993.95	304,747,067.94	0.96%
MAPFRE SA 2.875% 04/13/30	ES022424410 5	700,000.00000	86.0416	693,420.00	93,697,233.36	1,471,176.51	1,225,068.61	95,168,409.87	0.30%
MAPFRE SA FLT 03/31/47	ES022424408 9	600,000.00000	94.6679	600,000.00	71,996,318.00	17,754,890.96	1,745,241.11	89,751,208.96	0.28%
MUTUELLE ASSURANCE FLT 06/21/52	FR0014003XZ 7	1,900,000.00000	69.9205	1,697,655.00	231,308,526.56	-21,392,940.70	1,255,019.41	209,915,585.86	0.66%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32 SR: EMTN	XS238295033 0	4,150,000.00000	82.0768	4,056,896.50	542,594,981.89	-4,381,022.88	6,595,818.57	538,213,959.01	1.69%
NN GROUP NV FLT PERP	XS102895029 0	3,300,000.00000	96.9376	3,460,611.63	461,773,159.02	43,693,559.62	3,077,323.14	505,466,718.64	1.59%
NORDEA BANK ABP FLT 08/18/31 SR: EMTN	XS234345907 4	2,900,000.00000	88.5936	2,893,736.00	382,614,869.02	23,348,359.30	109,549.77	405,963,228.32	1.27%
PHOENIX GRP HLD PLC 4.375% 01/24/29 SR: EMTN	XS188100511 7	2,870,000.00000	91.4225	3,120,805.50	380,970,967.00	33,621,576.44	11,958,487.87	414,592,543.44	1.30%
RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	XS234824104 8	1,400,000.00000	76.4227	1,396,108.00	186,801,417.00	-17,743,022.84	507,706.51	169,058,394.16	0.53%
SAMPO OYJ FLT 09/03/52 SR: EMTN	XS222664527 8	1,550,000.00000	77.8650	1,548,891.00	194,383,740.01	-3,679,392.12	6,089,364.41	190,704,347.89	0.60%
SOCIETE GENERALE FLT 06/30/31 SR: EMTN	FR0014002QE 8	3,100,000.00000	88.3274	2,977,196.00	394,254,254.07	38,402,747.29	948,549.89	432,657,001.36	1.36%
SWEDBANK AB FLT 08/23/32 SR: GMTN	XS252287965 4	1,050,000.00000	93.1195	1,021,079.00	148,002,965.90	6,492,779.76	147,892.19	154,495,745.66	0.49%
TALANX AG FLT 12/01/42	XS241124169 3	1,000,000.00000	75.3849	991,310.00	128,134,747.98	-9,018,476.59	2,075,784.40	119,116,271.39	0.37%
UNIQA INSURANCE GROUP AG FLT 12/09/41	XS241839214 3	600,000.00000	74.4474	599,148.00	76,560,701.96	-5,979,758.80	1,640,930.30	70,580,943.16	0.22%
VOLKSBANK WIEN AG 0.875% 03/23/26 SR: EMTN	AT000B12208 0	1,800,000.00000	89.1638	1,790,208.00	232,917,327.00	20,681,750.03	1,101,541.81	253,599,077.03	0.80%
WESTPAC BANKING CORP FLT 05/13/31	XS234220659 1	1,850,000.00000	88.6315	1,850,000.00	243,337,069.00	15,750,350.11	679,092.43	259,087,419.11	0.81%
ZUERCHER KANTONALBANK FLT 06/08/29	CH126684714 9	3,000,000.00000	99.4616	3,000,224.00	447,838,518.48	23,641,440.09	4,575,316.38	471,479,958.57	1.48%
英ボンド					3,996,167,827.60	129,128,230.67	69,899,037.02	4,125,296,058.27	12.96%
AVIVA PLC FLT 06/03/55	XS218134840 5	2,000,000.00000	75.7925	2,042,380.00	285,230,621.00	-5,589,681.60	3,629,075.41	279,640,939.40	0.88%
AXA SA FLT PERP SR: eMTN	XS113454156 1	2,850,000.00000	96.3145	3,070,707.75	518,437,744.79	-12,052,571.16	14,178,243.44	506,385,173.63	1.59%
BANCO SANTANDER SA FLT 10/04/32 SR: EMTN	XS239351859 7	1,600,000.00000	81.3043	1,452,048.00	236,594,823.10	3,386,910.41	6,040,770.01	239,981,733.51	0.75%
BARCLAYS PLC FLT PERP	XS259180384 1	900,000.00000	90.2944	900,000.00	147,317,310.00	2,598,629.70	3,255,184.49	149,915,939.70	0.47%
BNP PARIBAS FLT 05/24/31 SR: EMTN	FR0014003N1 0	1,000,000.00000	85.8999	997,690.00	153,807,644.00	4,658,736.63	1,008,076.50	158,466,380.63	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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
CREDIT AGRICOLE SA FLT 12/09/31	FR0014003W84	1,200,000.00000	84.0901	1,202,088.00	186,641,191.99	-488,021.06	952,124.22	186,153,170.93	0.58%
HSBC HOLDINGS PLC 6.000% 03/29/40 SR: EMTN	XS0498768315	800,000.00000	88.0744	1,017,096.00	141,259,280.00	-11,277,010.97	3,774,238.43	129,982,269.03	0.41%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31	XS2351166421	2,700,000.00000	84.7938	2,437,730.00	398,802,492.67	23,547,306.93	2,107,086.54	422,349,799.60	1.33%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	XS2080995405	1,300,000.00000	91.1082	1,365,000.00	190,305,323.00	28,191,661.74	2,222,454.48	218,496,984.74	0.69%
M&G PLC FLT 10/20/51	XS1888920276	1,250,000.00000	89.0618	1,373,600.00	188,771,192.00	16,603,184.49	4,748,985.40	205,374,376.49	0.64%
NATIONAL AUSTRALIA BANK FLT 09/15/31 SR: GMTN	XS2386287416	1,200,000.00000	84.0317	1,200,000.00	182,332,560.00	3,691,395.16	1,737,481.98	186,023,955.16	0.58%
NATWEST GROUP PLC FLT 11/28/31 SR: EMTN	XS2346516250	500,000.00000	84.3088	500,000.00	76,971,853.00	793,722.58	506,512.42	77,765,575.58	0.24%
NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32 SR: EMTN	XS2385122630	1,450,000.00000	79.6559	1,304,394.00	213,803,235.06	-729,278.14	997,617.71	213,073,956.92	0.67%
RL FINANCE BONDS NO3 6.125% 11/13/28	XS1319738537	400,000.00000	94.9808	499,000.00	76,129,201.00	-6,041,728.91	3,615,768.80	70,087,472.09	0.22%
RL FINANCE BONDS NO6 FLT PERP	XS2625140301	1,700,000.00000	96.7699	1,700,000.00	291,245,445.00	12,237,028.96	8,542,321.47	303,482,473.96	0.95%
RL FINANCE NO 4 PLC FLT 10/07/49	XS2061962465	1,200,000.00000	73.9451	1,175,712.00	156,582,293.00	7,112,526.21	9,727,550.21	163,694,819.21	0.51%
UBS GROUP AG FLT 06/09/28 SR: EMTN	CH0550413337	2,800,000.00000	85.8956	2,795,455.00	382,293,771.99	61,389,779.31	2,667,370.43	443,683,551.30	1.39%
VIRGIN MONEY UK PLC FLT 08/19/31 SR: EMTN	XS2343851510	1,100,000.00000	84.1379	1,100,242.00	169,641,846.00	1,095,640.39	188,175.08	170,737,486.39	0.54%
米ドル					10,597,667,354.33	964,312,559.40	156,094,946.49	11,561,979,913.73	36.31%
ABN AMRO BANK NV FLT 03/13/37 SR: 144A	US00084DAV29	3,000,000.00000	76.5708	3,000,000.00	340,365,000.00	-5,938,420.84	6,774,943.56	334,426,579.16	1.05%
AEGON NV FLT PERP SR: CMS	NL0000116168	2,000,000.00000	75.9040	1,715,000.00	186,437,645.00	34,572,031.80	1,465,484.82	221,009,676.80	0.69%
AIA GROUP LTD FLT PERP SR: GMTN	XS2328261263	1,800,000.00000	87.1990	1,806,300.00	199,243,925.00	29,263,670.47	2,830,172.40	228,507,595.47	0.72%
ARGENTUM (SWISS RE LTD) FLT PERP	XS1640851983	1,800,000.00000	87.6233	1,807,920.00	192,480,207.01	37,139,253.13	643,369.23	229,619,460.14	0.72%
AVIATION CAPITAL GROUP 3.500% 11/01/27 SR: 144A	US05369AAA97	1,372,000.00000	89.5042	1,469,658.96	152,550,606.00	26,227,367.82	2,330,330.57	178,777,973.82	0.56%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 4.250% 04/15/26 SR:144A	US05401AAL5 2	700,000.00000	94.3073	699,825.00	73,198,199.00	22,909,847.94	1,636,213.64	96,108,046.94	0.30%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 4.375% 05/01/26 SR:144A	US05401AAG 67	655,000.00000	94.2852	707,275.55	74,560,989.00	15,347,608.97	1,390,640.05	89,908,597.97	0.28%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 5.500% 01/15/26 SR:144A	US05401AAK7 9	570,000.00000	97.4317	643,661.10	67,854,754.00	12,997,416.04	583,189.25	80,852,170.04	0.25%
BANCO DE CREDITO DEL PER FLT 07/01/30 SR:REGS	US05971V2C8 1	2,650,000.00000	92.9965	2,547,400.00	306,319,106.01	52,461,623.48	2,009,376.30	358,780,729.49	1.13%
BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38	US59023VAA8 9	2,950,000.00000	116.9562	4,374,083.00	496,152,227.99	6,146,246.91	9,892,854.60	502,298,474.90	1.58%
BANK OF AMERICA CORP FLT 02/04/33 SR:MTN	US06051GKK4 9	1,000,000.00000	82.1460	1,001,302.40	114,929,489.47	4,662,706.39	324,508.96	119,592,195.86	0.38%
BANK OF NOVA SCOTIA FLT 10/27/81 SR:2	US0641598N9 1	2,200,000.00000	71.7975	2,200,000.00	246,202,000.00	-16,243,941.17	1,096,538.13	229,958,058.83	0.72%
CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	US172967EW 71	1,030,000.00000	124.3610	1,581,977.00	169,137,062.01	17,345,414.14	1,556,799.04	186,482,476.15	0.59%
COMMONWEALTH BANK AUST 3.784% 03/14/32 SR:REGS	USQ2704MAH 18	2,350,000.00000	83.7186	2,149,876.00	270,103,592.46	16,318,425.01	6,005,505.81	286,422,017.47	0.90%
DAI-ICHI LIFE INSURANCE FLT PERP SR:144A	US23380YAC1 2	4,760,000.00000	98.3221	4,887,530.17	549,013,560.09	132,343,659.49	12,075,256.66	681,357,219.58	2.14%
DEUTSCHE BANK NY FLT 01/14/32	US251526CF4 7	1,700,000.00000	77.2336	1,762,713.00	197,265,211.83	-6,116,200.68	1,204,906.35	191,149,011.15	0.60%
DNB BANK ASA FLT PERP SR:-	XS207528099 5	900,000.00000	95.0417	900,810.00	98,323,412.40	26,206,335.14	5,127,776.67	124,529,747.54	0.39%
FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33	US316773DF4 7	2,600,000.00000	88.3210	2,600,000.00	332,007,000.00	2,306,532.41	5,745,759.52	334,313,532.41	1.05%
GLOBAL ATLANTIC FIN CO 3.125% 06/15/31 SR:144A	US37959GAB3 2	2,200,000.00000	73.9335	1,973,133.00	239,670,757.86	-2,871,304.66	2,113,004.52	236,799,453.20	0.74%
GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	US38143VAA7 0	5,150,000.00000	100.0957	6,447,248.16	718,749,936.98	31,730,261.72	2,114,330.95	750,480,198.70	2.36%
HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32 SR:REGS	USY306AXAD2 6	3,000,000.00000	89.8054	3,000,000.00	341,805,000.00	50,424,574.77	1,106,846.36	392,229,574.77	1.23%
HARTFORD FINL SVCS GRP FLT 02/12/47 SR:ICON	US416515BC7 6	1,090,000.00000	85.8125	1,043,675.00	117,643,047.25	18,530,792.41	580,841.14	136,173,839.66	0.43%
HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39 SR:BKNT	US4042Q1AD 94	2,500,000.00000	107.7747	3,080,345.00	353,538,974.10	38,720,445.60	3,255,442.36	392,259,419.70	1.23%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
HSBC HOLDINGS PLC FLT PERP	US404280DT3 3	1,900,000.00000	99.9598	1,911,789.16	260,806,176.59	15,694,153.25	10,695,644.66	276,500,329.84	0.87%
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 09/30/30 SR:EMTN	XS223597386 9	1,300,000.00000	72.8953	1,295,567.00	136,649,924.00	1,312,085.26	2,877,679.62	137,962,009.26	0.43%
HUNTINGTON BANCSHARES FLT 05/17/33	US446150BA1 8	1,750,000.00000	92.6719	1,750,000.00	228,208,750.00	7,895,001.99	3,696,993.58	236,103,751.99	0.74%
ING GROEP NV FLT 03/28/33	US456837BC6 5	840,000.00000	89.9248	843,131.70	100,459,142.06	9,511,167.91	2,209,927.89	109,970,309.97	0.35%
JACKSON FINANCIAL INC 3.125% 11/23/31	US46817MAL 19	2,500,000.00000	78.0288	2,492,325.00	285,483,367.13	-1,487,977.91	3,096,208.77	283,995,389.22	0.89%
JPMORGAN CHASE & CO FLT 05/13/31	US46647PBP0 9	3,400,000.00000	84.6527	3,400,000.00	360,570,014.99	58,451,736.21	4,389,562.45	419,021,751.20	1.32%
LIBERTY MUTUAL GROUP INC FLT 12/15/51 SR:144A	US53079EBM 57	2,016,000.00000	80.7500	1,847,365.00	226,817,222.32	10,183,510.89	2,555,890.27	237,000,733.21	0.74%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	US53944YAV5 6	1,500,000.00000	90.8226	1,465,250.00	203,526,423.75	-5,190,387.79	3,105,813.33	198,336,035.96	0.62%
METLIFE INC 6.400% 12/15/36	US59156RAP3 8	2,700,000.00000	99.4000	3,010,530.00	355,553,168.20	35,167,854.80	5,310,940.80	390,721,023.00	1.23%
MITSUMI SUMITOMO INSURANC FLT PERP SR:REGS	USJ4517MAA 74	3,100,000.00000	95.9168	3,100,000.00	343,774,503.99	89,111,053.44	10,859,731.09	432,885,557.43	1.36%
NASDAQ INC 3.250% 04/28/50	US63111XAB7 3	900,000.00000	66.3641	882,882.00	95,011,345.00	-8,056,826.82	1,454,940.09	86,954,518.18	0.27%
PRUDENTIAL FINANCIAL INC FLT 03/15/44	US744320AN2 5	1,100,000.00000	98.5000	1,050,500.00	140,199,730.00	17,541,617.51	3,839,885.26	157,741,347.51	0.50%
SANTANDER UK GROUP HLDGS 5.625% 09/15/45 SR:REGS	XS129135271 1	1,500,000.00000	76.1094	1,794,255.00	194,703,578.01	-28,497,794.86	5,664,166.41	166,205,783.15	0.52%
STANDARD CHARTERED PLC 4.300% 02/19/27 SR:144A	US853254BF6 4	2,400,000.00000	94.3916	2,385,984.00	239,684,024.87	90,124,140.96	500,812.40	329,808,165.83	1.04%
STANDARD CHARTERED PLC 5.300% 01/09/43 SR:REGS	XS087526739 4	1,150,000.00000	85.4555	1,284,964.00	139,193,730.00	3,878,135.14	1,281,714.16	143,071,865.14	0.45%
SWISS RE FINANCE LUX FLT PERP	XS204942234 3	1,800,000.00000	92.4617	1,806,282.00	191,312,364.01	50,986,294.69	11,044,442.06	242,298,658.70	0.76%
SYNOVUS BANK GA FLT 10/29/30 SR:*	US87164DSE1 2	1,750,000.00000	82.0888	1,750,000.00	183,408,741.01	25,732,074.99	3,453,599.72	209,140,816.00	0.66%
UBS GROUP AG FLT 08/11/28 SR:144A	US225401AV0 1	4,900,000.00000	102.1800	4,941,438.02	698,890,320.42	30,027,569.28	2,553,059.44	728,917,889.70	2.29%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 04/19/51 SR:EMTN	XS228317756 1	1,800,000.00000	78.3026	1,800,000.00	187,559,999.99	17,634,312.39	2,882,583.00	205,194,312.38	0.64%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 05/02/52 SR:EMTN	XS241697819 0	1,637,000.00000	78.9323	1,631,106.80	188,303,124.53	-189,508.22	2,757,260.60	188,113,616.31	0.59%
債権投資					67,289,273,708.09	497,548,215.16	0.00	67,786,821,923.25	100.00%
設定払込未収金					78,000,000.00	0.00	0.00	78,000,000.00	0.12%
設定払込未収金					78,000,000.00	0.00	0.00	78,000,000.00	0.12%
日本円					78,000,000.00	0.00	0.00	78,000,000.00	0.12%
日本円	JPY	78,000,000.00000	1.0000	78,000,000.00	78,000,000.00	0.00	0.00	78,000,000.00	0.12%
先渡為替取引未収金					67,211,273,708.09	486,115,937.78	0.00	67,697,389,645.87	99.87%
先渡為替取引未収金					67,211,273,708.09	486,115,937.78	0.00	67,697,389,645.87	99.87%
豪ドル					2,604,903,748.39	7,631,064.43	0.00	2,612,534,812.82	3.85%
AUD.FWD	AUD.FWD	27,743,759.21000	1.0000	27,743,759.21	2,604,903,748.39	7,631,064.43	0.00	2,612,534,812.82	3.85%
ブラジル・リアル					1,607,037,103.99	-24,545,165.09	0.00	1,582,491,938.90	2.33%
BRL.FWD	BRL.FWD	53,985,597.12000	1.0000	53,985,597.12	1,607,037,103.99	-24,545,165.09	0.00	1,582,491,938.90	2.33%
ユーロ					11,806,702,501.72	-16,080,202.35	0.00	11,790,622,299.37	17.39%
EUR.FWD	EUR.FWD	74,721,094.54000	1.0000	74,721,094.54	11,806,702,501.72	-16,080,202.35	0.00	11,790,622,299.37	17.39%
日本円					8,354,730,464.00	0.00	0.00	8,354,730,464.00	12.33%
JPY.FWD	JPY.FWD	8,354,730,464.00000	1.0000	8,354,730,464.00	8,354,730,464.00	0.00	0.00	8,354,730,464.00	12.33%
メキシコ・ペソ					546,074,674.80	13,839,059.58	0.00	559,913,734.38	0.83%
MXN.FWD	MXN.FWD	64,960,125.76000	1.0000	64,960,125.76	546,074,674.80	13,839,059.58	0.00	559,913,734.38	0.83%
新トルコ・リラ					675,795,383.85	12,197,841.32	0.00	687,993,225.17	1.01%
TRY.FWD	TRY.FWD	127,115,801.40000	1.0000	127,115,801.40	675,795,383.85	12,197,841.32	0.00	687,993,225.17	1.01%
英ポンド					4,166,058,748.82	-7,888,514.75	0.00	4,158,170,234.07	6.13%
GBP.FWD	GBP.FWD	22,582,957.04000	1.0000	22,582,957.04	4,166,058,748.82	-7,888,514.75	0.00	4,158,170,234.07	6.13%
南アフリカ・ランド					8,536,319.04	-78,067.65	0.00	8,458,251.39	0.01%
ZAR.FWD	ZAR.FWD	1,102,984.94000	1.0000	1,102,984.94	8,536,319.04	-78,067.65	0.00	8,458,251.39	0.01%
米ドル					37,441,434,763.48	501,039,922.29	0.00	37,942,474,685.77	55.97%
USD.FWD	USD.FWD	262,802,838.25000	1.0000	262,802,838.25	37,441,434,763.48	501,039,922.29	0.00	37,942,474,685.77	55.97%

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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
未収金					0.00	11,432,277.38	0.00	11,432,277.38	0.02%
未収金					0.00	11,432,277.38	0.00	11,432,277.38	0.02%
豪ドル					0.00	11,069,554.46	0.00	11,069,554.46	0.02%
豪ドル	AUD	0.00000	NA	0.00	0.00	11,069,554.46	0.00	11,069,554.46	0.02%
米ドル					0.00	362,722.92	0.00	362,722.92	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	362,722.92	0.00	362,722.92	0.00%
債務投資					-67,275,011,086.93	-872,159,718.02	0.00	-68,147,170,804.95	100.00%
AIFMD報酬未払金					-78,121.73	0.00	0.00	-78,121.73	0.00%
AIFMD報酬未払金					-78,121.73	0.00	0.00	-78,121.73	0.00%
ユーロ					-78,121.73	0.00	0.00	-78,121.73	0.00%
ユーロ	EUR	-497.46000	1.0000	-497.46	-78,121.73	0.00	0.00	-78,121.73	0.00%
未払監査報酬					-104,480.91	0.00	0.00	-104,480.91	0.00%
未払監査報酬					-104,480.91	0.00	0.00	-104,480.91	0.00%
米ドル					-104,480.91	0.00	0.00	-104,480.91	0.00%
米ドル	USD	-753.48000	1.0000	-753.48	-104,480.91	0.00	0.00	-104,480.91	0.00%
代行協会員報酬未払金					-911,330.77	0.00	0.00	-911,330.77	0.00%
代行協会員報酬未払金					-911,330.77	0.00	0.00	-911,330.77	0.00%
豪ドル					2,078,328.18	0.00	0.00	2,078,328.18	0.00%
豪ドル	AUD	25,824.34000	1.0000	25,824.34	2,078,328.18	0.00	0.00	2,078,328.18	0.00%
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					517,659.05	0.00	0.00	517,659.05	0.00%
米ドル	USD	3,616.20000	1.0000	3,616.20	517,659.05	0.00	0.00	517,659.05	0.00%
監査報酬未払金					-765,274.79	0.00	0.00	-765,274.79	0.00%
監査報酬未払金					-765,274.79	0.00	0.00	-765,274.79	0.00%
ユーロ					-765,274.79	0.00	0.00	-765,274.79	0.00%
ユーロ	EUR	-4,965.78000	1.0000	-4,965.78	-765,274.79	0.00	0.00	-765,274.79	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：2023年３月１日から2023年８月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
販売会社報酬未払金					-10,808,533.08	0.00	0.00	-10,808,533.08	0.02%
販売会社報酬未払金					-10,808,533.08	0.00	0.00	-10,808,533.08	0.02%
豪ドル					24,644,057.48	0.00	0.00	24,644,057.48	-0.04%
豪ドル	AUD	306,215.22000	1.0000	306,215.22	24,644,057.48	0.00	0.00	24,644,057.48	-0.04%
日本円					-41,591,783.00	0.00	0.00	-41,591,783.00	0.06%
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	0.06%
米ドル					6,139,192.44	0.00	0.00	6,139,192.44	-0.01%
米ドル	USD	42,886.43000	1.0000	42,886.43	6,139,192.44	0.00	0.00	6,139,192.44	-0.01%
財務書類作成報酬未払金					-564,499.10	0.00	0.00	-564,499.10	0.00%
財務書類作成報酬未払金					-564,499.10	0.00	0.00	-564,499.10	0.00%
ユーロ					-564,499.10	0.00	0.00	-564,499.10	0.00%
ユーロ	EUR	-3,861.87000	1.0000	-3,861.87	-564,499.10	0.00	0.00	-564,499.10	0.00%
先渡為替取引未払金					-67,211,273,708.09	-871,940,547.29	0.00	-68,083,214,255.38	99.91%
先渡為替取引未払金					-67,211,273,708.09	-871,940,547.29	0.00	-68,083,214,255.38	99.91%
豪ドル					-274,935,134.00	1,563,685.18	0.00	-273,371,448.82	0.40%
AUD.FWD	AUD.FWD	-2,910,595.51000	1.0000	-2,910,595.51	-274,935,134.00	1,563,685.18	0.00	-273,371,448.82	0.40%
ユーロ					-26,359,911,448.36	-451,122,958.49	0.00	-26,811,034,406.85	39.34%
EUR.FWD	EUR.FWD	-170,666,916.24000	1.0000	-170,666,916.24	-26,359,911,448.36	-451,122,958.49	0.00	-26,811,034,406.85	39.34%
日本円					-2,604,544,717.00	0.00	0.00	-2,604,544,717.00	3.82%
JPY.FWD	JPY.FWD	-2,604,544,717.00000	1.0000	-2,604,544,717.00	-2,604,544,717.00	0.00	0.00	-2,604,544,717.00	3.82%
メキシコ・ペソ					-94,828,443.29	-4,716,371.98	0.00	-99,544,815.27	0.15%
MXN.FWD	MXN.FWD	-11,549,000.00000	1.0000	-11,549,000.00	-94,828,443.29	-4,716,371.98	0.00	-99,544,815.27	0.15%
英ポンド					-8,107,215,020.83	-147,149,572.76	0.00	-8,254,364,593.59	12.11%
GBP.FWD	GBP.FWD	-45,165,914.08000	1.0000	-45,165,914.08	-8,107,215,020.83	-147,149,572.76	0.00	-8,254,364,593.59	12.11%
米ドル					-29,769,838,944.61	-270,515,329.24	0.00	-30,040,354,273.85	44.08%
USD.FWD	USD.FWD	-206,727,925.81000	1.0000	-206,727,925.81	-29,769,838,944.61	-270,515,329.24	0.00	-30,040,354,273.85	44.08%

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：2023年3月1日から2023年8月31日

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
管理会社報酬未払金					-15,558,385.00	0.00	0.00	-15,558,385.00	0.02%
管理会社報酬未払金					-15,558,385.00	0.00	0.00	-15,558,385.00	0.02%
日本円					-15,558,385.00	0.00	0.00	-15,558,385.00	0.02%
日本円	JPY	-15,558,385.00000	1.0000	-15,558,385.00	-15,558,385.00	0.00	0.00	-15,558,385.00	0.02%
管理報酬未払金					-28,039,571.42	0.00	0.00	-28,039,571.42	0.04%
管理報酬未払金					-28,039,571.42	0.00	0.00	-28,039,571.42	0.04%
豪ドル					37,788,412.20	0.00	0.00	37,788,412.20	-0.06%
豪ドル	AUD	469,549.74000	1.0000	469,549.74	37,788,412.20	0.00	0.00	37,788,412.20	-0.06%
日本円					-73,966,914.50	0.00	0.00	-73,966,914.50	0.11%
日本円	JPY	-73,966,914.50000	1.0000	-73,966,914.50	-73,966,914.50	0.00	0.00	-73,966,914.50	0.11%
米ドル					8,138,930.88	0.00	0.00	8,138,930.88	-0.01%
米ドル	USD	57,618.71000	1.0000	57,618.71	8,138,930.88	0.00	0.00	8,138,930.88	-0.01%
未払金					0.00	-219,170.73	0.00	-219,170.73	0.00%
未払金					0.00	-219,170.73	0.00	-219,170.73	0.00%
ユーロ					0.00	-65,571.63	0.00	-65,571.63	0.00%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	-65,571.63	0.00	-65,571.63	0.00%
米ドル					0.00	-153,599.10	0.00	-153,599.10	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-153,599.10	0.00	-153,599.10	0.00%
副投資顧問報酬未払金					-3,111,686.00	0.00	0.00	-3,111,686.00	0.00%
副投資顧問報酬未払金					-3,111,686.00	0.00	0.00	-3,111,686.00	0.00%
日本円					-3,111,686.00	0.00	0.00	-3,111,686.00	0.00%
日本円	JPY	-3,111,686.00000	1.0000	-3,111,686.00	-3,111,686.00	0.00	0.00	-3,111,686.00	0.00%
受託報酬未払金					-3,795,496.04	0.00	0.00	-3,795,496.04	0.01%
受託報酬未払金					-3,795,496.04	0.00	0.00	-3,795,496.04	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					-2,879,888.04	0.00	0.00	-2,879,888.04	0.00%
米ドル	USD	-20,800.72000	1.0000	-20,800.72	-2,879,888.04	0.00	0.00	-2,879,888.04	0.00%
報告金額合計:					29,860,817,803.55	1,620,267,711.56	382,934,825.26	31,481,085,515.11	100.00%

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（2023年9月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約280億円）
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、2023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	26	3,122,842,143.30米ドル

（３）その他

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

[次へ](#)

5 管理会社の経理の概況

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2023年9月29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＝149.58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)

2023年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	4,692,187,089.76	701,857,345
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,682,344,966.68	401,225,160
040	その他の要求払預金	2,009,842,123.08	300,632,185
050	売買目的で保有される金融資産	55,652,935.19	8,324,566
060	デリバティブ	55,652,935.19	8,324,566
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
096	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
097	持分証券		
098	債務証券		
099	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産		
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
141	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産	2,704.52	405
142	持分証券	2,704.52	405
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	2,084,320,576.16	311,772,672
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	2,084,320,576.16	311,772,672
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	1,356,117.68	202,848
280	有形固定資産	1,356,117.68	202,848
290	投資不動産		
300	無形資産	2,368,995.89	354,354
310	営業権		
320	その他の無形資産	2,368,995.89	354,354
330	税金資産		
340	現行税金資産		
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	28,778,853.14	4,304,741
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	6,864,667,272.34	1,026,816,931

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)

2023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	50,108,762.49	7,495,269
020	デリバティブ	50,108,762.49	7,495,269
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債		
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	6,176,819,707.18	923,928,692
120	預金	6,175,693,377.14	923,760,215
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	1,126,330.04	168,476
150	デリバティブ・ヘッジ会計		
160	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
170	引当金		
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金		
240	税金負債	19,008,809.78	2,843,338
250	現行税金負債	19,001,809.78	2,842,291
260	繰延税金負債	7,000.00	1,047
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	17,711,719.53	2,649,319
290	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
300	負債合計	6,263,648,998.98	936,916,617

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)

2023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	27,989,105
020	払込資本	187,117,965.90	27,989,105
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	0.00	0
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	1,725,327.17	258,074
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	364,038,890.34	54,452,937
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	364,038,890.34	54,452,937
240	(-) 自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	48,136,090.02	7,200,196

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	601,018,273.43	89,900,313
310	資本および負債合計	6,864,667,272.41	1,026,816,931

(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

2023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	144,350,729.25	21,591,982
020	売買目的で保有される金融資産	29,086,681.50	4,350,786
025	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
030	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産		
041	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
051	償却後原価における金融資産	106,031,144.89	15,860,139
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	9,063,434.51	1,355,709
085	負債に係る利息収益	169,468.35	25,349
090	(支払利息)	100,333,415.87	15,007,872
100	(売買目的で保有される金融負債)	2,773,313.48	414,832
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	97,252,445.98	14,547,021
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	15,076.36	2,255
145	(資産に係る支払利息)	292,580.05	43,764
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当		
170	売買目的で保有される金融資産		
175	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
191	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	59,684,590.73	8,927,621
210	(支払手数料)	17,373,438.51	2,598,719
220	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負 債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
231	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
241	償却後原価における金融資産		
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (-)損失、純額	7,413,064.51	1,108,846
287	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保 有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額		
290	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した 金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
310	為替差額〔利益または(-)損失〕、純額		
320	子会社、合併会社および関連会社への投資の認識除外に係る利 益または(-)損失、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
340	その他の事業収益	3,489,801.02	522,004

米ドル

千円

350	（その他の事業費用）	2,059,751.73	308,098
355	事業収益合計、純額	95,171,579.40	14,235,765
360	（管理費用）	26,482,543.32	3,961,259
370	（従業員費用）	12,419,637.57	1,857,729
380	（その他の管理費用）	14,062,905.75	2,103,529
385	（破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金）	2,844,673.04	425,506
390	（減価償却）	1,192,662.99	178,399
400	（有形固定資産）	643,283.10	96,222
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	549,379.89	82,176
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）	482,472.51	72,168
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）	482,472.51	72,168
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	64,169,227.54	9,598,433
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	16,033,137.52	2,398,237
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	48,136,090.02	7,200,196
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	48,136,090.02	7,200,196
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	48,136,090.02	7,200,196

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第１ ファンドの状況

１ ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

() 資本金の額 (2023年 6 月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約271億円)

発行済株式総数 5,051,655株 (一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

() 会社の沿革

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

() 資本金の額 (2023年 9 月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約280億円)

発行済株式総数 5,051,655株 (一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2023年 9 月29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 = 149.58円) による。

() 会社の沿革

(後略)

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

（Ａ）日本

2023年7月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（Ａ）日本

2023年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

５ 運用状況

（２）投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄

（ 2023年 6 月末日現在 ）

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格 (円)		時価 (円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/ 2 /15	5,150,000	99.95	718,749,937	144.46	743,963,719	2.45
2	UBS Group AG	スイス	社債	6.442 (2027年 8 月 以降変動金利)	2028/ 8 /11	4,900,000	100.49	698,890,320	145.25	711,720,114	2.35
3	Dai - ichi Life Insurance Co Ltd	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金利)	永久債	4,760,000	97.55	549,013,560	140.99	671,098,386	2.21
4	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	オーストラリア	社債	0.669 (2026年 5 月 以降変動金利)	2031/ 5 / 5	4,500,000	86.40	569,080,991	136.25	613,106,453	2.02
5	Commerzbank AG	ドイツ	社債	6.750 (2023年 8 月 以降変動金利)	2033/10/ 5	3,900,000	99.34	611,619,212	156.64	610,904,699	2.01
6	Bawag Group AG	オーストリア	社債	2.375 (2024年 3 月 以降変動金利)	2029/ 3 /26	4,000,000	91.30	504,988,434	143.97	575,882,419	1.90
7	de Volksbank NV	オランダ	社債	1.750 (2025年10月 以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	90.65	479,510,696	142.94	543,189,936	1.79
8	Bank of Ireland Group PLC	アイルランド	社債	2.375 (2024年10月 以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	95.34	443,282,716	150.34	541,240,538	1.78
9	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年 3 月 以降変動金利)	永久債	2,850,000	96.92	518,437,745	178.09	507,566,023	1.67
10	Bank of America Corp	米国	社債	7.750	2038/ 5 /14	2,950,000	118.91	496,152,228	171.87	507,013,284	1.67
11	NN Group NV	オランダ	社債	4.500 (2026年 1 月 以降変動金利)	永久債	3,300,000	96.45	461,773,159	152.08	501,880,373	1.65
12	Zuercher Kantonalbank	スイス	社債	4.156 (2023年 6 月 以降変動金利)	2029/ 6 / 8	3,000,000	98.89	447,838,519	155.93	467,794,691	1.54
13	Natwest Group Plc	英国	社債	1.043 (2027年 6 月 以降変動金利)	2032/ 9 /14	3,550,000	81.57	463,380,567	128.62	456,605,558	1.51
14	Mitsui Sumitomo Insurance	日本	社債	4.950 (2029年 3 月 以降変動金利)	永久債	3,100,000	95.50	343,774,504	138.03	427,898,690	1.41
15	Capital One Financial Corp	米国	社債	1.650	2029/ 6 /12	3,350,000	80.56	404,299,247	127.03	425,566,751	1.40
16	Credit Suisse Group AG	スイス	社債	2.250 (2027年 6 月 以降変動金利)	2028/ 6 / 9	2,800,000	82.42	382,293,772	151.46	424,076,745	1.40
17	Societe Generale SA	フランス	社債	1.125 (2026年 6 月 以降変動金利)	2031/ 6 /30	3,100,000	86.61	394,254,254	136.58	423,392,974	1.40

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
18	JP Morgan Chase & Co	米国	社債	2.956 (2030年5月以降変動金利)	2031/ 5 / 13	3,400,000	85.73	360,570,015	123.91	421,290,855	1.39
19	Danske Bnak A/S	デンマーク	社債	1.000 (2026年2月以降変動金利)	2031/ 5 / 15	3,000,000	87.63	380,237,162	138.18	414,539,802	1.37
20	Phoenix Group Holdings PLC	英国	社債	4.375	2029/ 1 / 24	2,870,000	90.67	380,970,967	142.98	410,361,004	1.35
21	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	イタリア	社債	5.000 (2028年6月以降変動金利)	2048/ 6 / 8	2,550,000	99.61	378,289,811	157.07	400,527,389	1.32
22	CaixaBank SA	スペイン	社債	1.250 (2026年3月以降変動金利)	2031/ 6 / 18	2,900,000	87.26	370,654,537	137.59	399,021,405	1.32
23	NORDEA BANK ABP	フィンランド	社債	0.625 (2026年5月以降変動金利)	2031/ 8 / 18	2,900,000	87.24	382,614,869	137.56	398,928,620	1.32
24	HANWHA LIFE INSURANCE	韓国	社債	3.379 (2027年2月以降変動金利)	2032/ 2 / 4	3,000,000	89.51	341,805,000	129.37	388,098,589	1.28
25	LA BANQUE POSTALE	フランス	社債	0.750 (2027年5月以降変動金利)	2032/ 8 / 2	3,000,000	80.62	379,425,930	127.13	381,399,934	1.26
26	Banco de Crédito de Peru S.A.	ペルー	社債	3.125 (2025年7月以降変動金利)	2030/ 7 / 1	2,650,000	91.47	306,319,106	132.20	350,342,506	1.16
27	Danske Bank A/S	デンマーク	社債	2.500 (2024年6月以降変動金利)	2029/ 6 / 21	2,250,000	96.46	279,812,950	152.10	342,219,938	1.13
28	FIFTH THIRD BANCORP	米国	社債	4.337 (2032年4月以降変動金利)	2033/ 4 / 25	2,600,000	88.04	332,007,000	127.24	330,833,920	1.09
29	ABN AMRO Bank NV	オランダ	社債	3.324 (2031年12月以降変動金利)	2037/ 3 / 13	3,000,000	75.96	340,365,000	109.79	329,376,548	1.09
30	Standard Chartered PLC	英国	社債	4.300	2027/ 2 / 19	2,400,000	94.36	239,684,025	136.38	327,318,008	1.08

投資不動産物件

該当事項なし。(2023年6月末日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2023年6月末日現在)

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

（ 2023年 9 月末日現在 ）

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格 (円)		時価 (円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/ 2 / 15	5,150,000	139.56	718,749,937	145.73	750,494,722	2.36
2	UBS Group AG	スイス	社債	6.442 (2027年 8 月 以降変動金利)	2028/ 8 / 11	4,900,000	142.63	698,890,320	148.76	728,935,427	2.29
3	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金利)	永久債	4,760,000	115.34	549,013,560	143.16	681,440,163	2.14
4	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	オーストラリア	社債	0.669 (2026年 5 月 以降変動金利)	2031/ 5 / 5	4,500,000	126.46	569,080,991	139.84	629,260,594	1.97
5	Commerzbank AG	ドイツ	社債	6.750 (2023年 8 月 以降変動金利)	2033/10/ 5	3,900,000	156.83	611,619,212	157.69	614,983,045	1.93
6	Bawag Group AG	オーストリア	社債	2.375 (2024年 3 月 以降変動金利)	2029/ 3 / 26	4,000,000	126.25	504,988,434	148.33	593,339,088	1.86
7	de Volksbank NV	オランダ	社債	1.750 (2025年10月 以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	126.19	479,510,696	145.25	551,935,428	1.73
8	Bank of Ireland Group PLC	アイルランド	社債	2.375 (2024年10月 以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	123.13	443,282,716	152.23	548,025,685	1.72
9	Natwest Group Plc	英国	社債	1.043 (2027年 6 月 以降変動金利)	2032/ 9 / 14	4,150,000	130.75	542,594,982	129.70	538,255,702	1.69
10	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年 3 月 以降変動金利)	永久債	2,850,000	181.91	518,437,745	177.71	506,462,030	1.59
11	NN Group NV	オランダ	社債	4.500 (2026年 1 月 以降変動金利)	永久債	3,300,000	139.93	461,773,159	153.18	505,486,194	1.59
12	Bank of America Corp	米国	社債	7.750	2038/ 5 / 14	2,950,000	168.19	496,152,228	170.29	502,366,427	1.58
13	Zuercher Kantonalbank	スイス	社債	4.156 (2023年 6 月 以降変動金利)	2029/ 6 / 8	3,000,000	149.28	447,838,518	157.17	471,508,915	1.48
14	UBS GROUP AG	スイス	社債	2.250 (2027年 6 月 以降変動金利)	2028/ 6 / 9	2,800,000	136.53	382,293,772	158.46	443,698,010	1.39
15	CAPITAL ONE FINANCIAL CO	米国	社債	1.650	2029/ 6 / 12	3,350,000	120.69	404,299,247	129.41	433,533,474	1.36
16	Mitsui Sumitomo Insurance	日本	社債	4.950 (2029年 3 月 以降変動金利)	永久債	3,100,000	110.90	343,774,504	139.66	432,960,151	1.36
17	Societe Generale SA	フランス	社債	1.125 (2026年 6 月 以降変動金利)	2031/ 6 / 30	3,100,000	127.18	394,254,254	139.57	432,663,004	1.36
18	Danske Bank A/S	デンマーク	社債	1.000 (2026年 5 月 以降変動金利)	2031/ 5 / 15	3,000,000	126.75	380,237,162	141.38	424,131,427	1.33

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
19	LLOYDS BANKING GROUP PLC	英国	社債	1.985 (2026年12月 以降変動金利)	2031/12/15	2,700,000	147.70	398,802,493	156.43	422,361,222	1.33
20	JP Morgan Chase & Co	米国	社債	2.956 (2030年5月 以降変動金利)	2031/ 5 /13	3,400,000	106.05	360,570,015	123.25	419,051,902	1.32
21	Phoenix Group Holdings PLC	英国	社債	4.375	2029/ 1 /24	2,870,000	132.74	380,970,967	144.48	414,668,225	1.30
22	CaixaBank SA	スベ イン	社債	1.250 (2026年3月 以降変動金利)	2031/ 6 /18	2,900,000	127.81	370,654,537	140.66	407,921,300	1.28
23	NORDEA BANK ABP	フィン ランド	社債	0.625 (2026年6月 以降変動金利)	2031/ 8 /18	2,900,000	131.94	382,614,869	139.99	405,963,921	1.27
24	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	イタリ ア	社債	5.000 (2028年6月 以降変動金利)	2048/ 6 / 8	2,550,000	148.35	378,289,811	158.53	404,252,832	1.27
25	HSBC BANK USA NA	米国	社債	7.000	2039/ 1 /15	2,500,000	141.42	353,538,974	156.91	392,281,781	1.23
26	HANWHA LIFE INSURANCE	韓国	社債	3.379 (2027年2月 以降変動金利)	2032/ 2 / 4	3,000,000	113.94	341,805,000	130.75	392,237,178	1.23
27	LA BANQUE POSTALE	フラン ス	社債	0.750 (2027年5月 以降変動金利)	2032/ 8 / 2	3,000,000	126.48	379,425,930	130.36	391,076,762	1.23
28	METLIFE INC	米国	社債	6.400	2066/12/15	2,700,000	131.69	355,553,168	144.73	390,757,503	1.23
29	Banco de Crédito de Peru S.A.	ペルー	社債	3.125 (2025年7月 以降変動金利)	2030/ 7 / 1	2,650,000	115.59	306,319,106	135.39	358,794,531	1.13
30	Danske Bank A/S	デン マーク	社債	2.500 (2024年6月 以降変動金利)	2029/ 6 /21	2,250,000	124.36	279,812,950	154.19	346,930,036	1.09

投資不動産物件

該当事項なし。(2023年9月末日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2023年9月末日現在)