

## 【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】 2024年11月29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  
同 大西 信治

【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 金光 由以

【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3,221億4,000万円)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2,140億円)を上限とする。  
(注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびオーストラリア  
ドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2024年6月28  
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=161.07円および1豪ドル=107.00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、2024年8月30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ため、また、ファンドの受託会社の名称変更を反映するとともにその他一部情報の基準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1 5 ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 1 ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第1 1 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
	2 事業の内容及び営業の概況		(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
3 管理会社の経理状況		5 管理会社の経理の概況		追加

\* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

## 1 ファンドの運用状況

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

### (1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(2024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	7,426,528,485	24.22
	英国	4,242,240,550	13.84
	フランス	3,945,395,421	12.87
	オランダ	2,516,796,075	8.21
	ドイツ	1,465,808,222	4.78
	オーストラリア	1,344,061,165	4.38
	スペイン	1,192,374,662	3.89
	スイス	1,182,756,646	3.86
	日本	964,813,764	3.15
	フィンランド	774,830,315	2.53
	アイルランド	748,661,331	2.44
	オーストリア	619,777,573	2.02
	香港	434,368,736	1.42
	イタリア	424,851,941	1.39
	韓国	414,274,207	1.35
	ベルギー	393,894,449	1.28
	ペルー	370,997,876	1.21
	チェコ共和国	367,403,018	1.20
	デンマーク	308,273,681	1.01
	カナダ	282,958,009	0.92
ルクセンブルグ	239,558,046	0.78	
スウェーデン	168,657,961	0.55	
	小計	29,829,282,133	97.29
	現金・その他の資産 (負債控除後)	832,377,477	2.71
	合計(純資産総額)	30,661,659,610	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、2024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=142.73円および1豪ドル=98.73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

2024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。

## &lt;米ドル建 米ドルヘッジクラス&gt;

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2023年10月末日	97,271,714.84	13,883,592	0.006522	0.9309
11月末日	93,845,158.20	13,394,519	0.006710	0.9577
12月末日	96,641,366.28	13,793,622	0.006903	0.9853
2024年1月末日	96,328,365.50	13,748,948	0.006906	0.9857
2月末日	95,342,308.04	13,608,208	0.006829	0.9747
3月末日	96,326,125.06	13,748,628	0.006897	0.9844
4月末日	94,451,087.48	13,481,004	0.006781	0.9679
5月末日	97,004,968.16	13,845,519	0.006835	0.9756
6月末日	97,164,316.95	13,868,263	0.006824	0.9740
7月末日	98,433,713.54	14,049,444	0.006919	0.9875
8月末日	98,382,133.53	14,042,082	0.006943	0.9910
9月末日	99,225,153.70	14,162,406	0.007006	1.0000

## &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
2023年10月末日	14,898,231.66	1,470,902	0.005538	0.5468
11月末日	14,670,747.25	1,448,443	0.005699	0.5627
12月末日	14,786,777.57	1,459,899	0.005855	0.5781
2024年1月末日	14,582,050.15	1,439,686	0.005861	0.5787
2月末日	14,078,440.60	1,389,964	0.005791	0.5717
3月末日	13,998,911.63	1,382,113	0.005847	0.5773
4月末日	13,555,711.47	1,338,355	0.005745	0.5672
5月末日	13,794,332.41	1,361,914	0.005791	0.5717
6月末日	13,589,183.68	1,341,660	0.005781	0.5708
7月末日	13,658,272.25	1,348,481	0.005861	0.5787
8月末日	13,509,329.46	1,333,776	0.005880	0.5805
9月末日	13,641,938.01	1,346,869	0.005923	0.5848

## &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(2014年9月末日~2024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

2024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
2023年10月1日～2024年9月末日	0.000480	0.068510

## &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
2023年10月1日～2024年9月末日	0.000360	0.035543

## &lt;参考情報&gt;

## 分配の推移(2024年9月末日現在)

米ドル建 米ドルヘッジクラス		豪ドル建 豪ドルヘッジクラス	
(単位:米ドル、1口当たり課税前)		(単位:豪ドル、1口当たり課税前)	
第8会計年度(2019年3月1日～2020年2月29日)	0.000630	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)	0.000720	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)	0.000644	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)	0.000500	第11会計年度(2022年3月1日～2023年2月28日)	0.000380
第12会計年度(2023年3月1日～2024年2月29日)	0.000480	第12会計年度(2023年3月1日～2024年2月29日)	0.000360
2024年5月	0.000040	2024年5月	0.000030
2024年6月	0.000040	2024年6月	0.000030
2024年7月	0.000040	2024年7月	0.000030
2024年8月	0.000040	2024年8月	0.000030
2024年9月	0.000040	2024年9月	0.000030
直近1年間累計	0.000480	直近1年間累計	0.000360
設定来累計	0.006539	設定来累計	0.007798

## 収益率の推移

2024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)
2023年10月1日～2024年9月末日	13.72%

(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)
2023年10月1日～2024年9月末日	12.32%

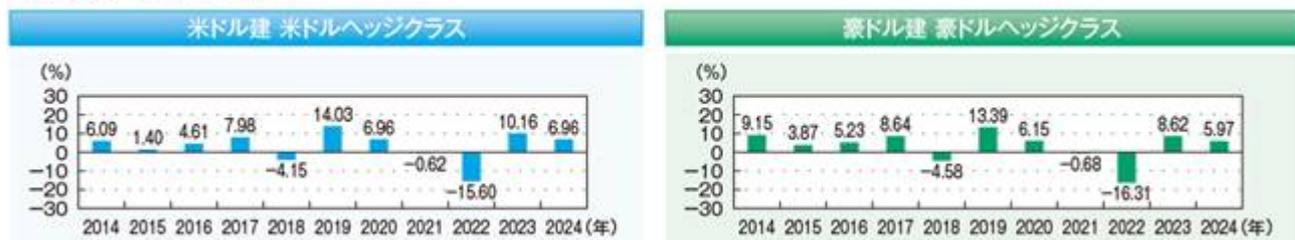
(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

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、2024年については2024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) 2024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

2024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2024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
2023年10月1日～ 2024年9月末日	1,730,974,564 (1,730,974,564)	2,518,327,949 (2,518,327,949)	14,163,769,448 (14,163,769,448)

### <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
2023年10月1日～ 2024年9月末日	117,606,803 (117,606,803)	565,852,649 (565,852,649)	2,303,285,126 (2,303,285,126)

(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、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5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

2024年8月31日現在

詳細	残高 (日本円)
<b>資産</b>	
投資 - ロング	
社債	30,510,926,016
優先株式	30,888,718
投資 - ロング合計	30,541,814,733
現金 - ロング	
現金および現金同等物	711,893,436
先渡為替取引未収金	
先渡為替取引未収金	29,025,398,378
未収金	
未収金	(3,217)
前払登録報酬	
前払登録報酬	239,177
資産合計	60,279,342,507
<b>負債</b>	
AIFMD報酬未払金	
AIFMD報酬未払金	(208,575)
未払監査報酬	
未払監査報酬	(1,747,210)
未払代行協会員報酬	
未払代行協会員報酬	(1,397,445)
監査報酬未払金	
監査報酬未払金	(7,888,633)
設定払込未払金	
設定払込未払金	(17,000,000)
現金 - ショート	
現金および現金同等物	(53,873,850)
販売会社報酬未払金	
販売会社報酬未払金	(16,815,181)
FATCA報酬未払金	
FATCA報酬未払金	(152,389)
財務書類作成報酬未払金	
財務書類作成報酬未払金	(617,775)
先渡為替取引未払金	

先渡為替取引未払金	(29,232,959,451)
MLRO報酬未払金	
MLRO報酬未払金	(262,070)
管理会社報酬未払金	
管理会社報酬未払金	(16,360,246)
管理報酬未払金	
管理報酬未払金	(36,876,950)
未払金	
未払金	1,968,978
副投資顧問報酬未払金	
副投資顧問報酬未払金	(3,433,014)
受託報酬未払金	
受託報酬未払金	(2,172,522)
負債合計	<u>(29,389,796,333)</u>
純資産額合計	<u>30,889,546,174</u>

## 1口当たり純資産価額(現地通貨)

## 東京海上ストラテジック・トラスト-

## 東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2024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	13,509,329.46	2,297,511,892	0.005880
豪ドルクラス	日本円	862,232,928	99,905.2977	8,631
資源国通貨バスケットクラス	日本円	33,721,760	6,530.5723	5,164
ブラジル・リアルクラス	日本円	1,119,710,066	409,742.6463	2,733
ユーロクラス	日本円	14,377,863	1,133.9553	12,679
日本円クラス	日本円	5,057,534,366	730,698.8656	6,922
メキシコ・ペソクラス	日本円	611,042,478	92,747.5799	6,588
トルコ・リラクラス	日本円	704,673,618	1,203,691.6297	585
米ドル建 米ドルヘッジクラス	米ドル	98,382,133.53	14,169,859,682	0.006943
米ドルクラス	日本円	6,826,570,281	420,401.9451	16,238

## 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：2024年3月1日から2024年8月31日

勘定科目	説明	期間累計 (日本円)
収益		651,811,841.38
未収利息 - ロングの増減		(29,645,949.57)
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	(29,645,949.57)
受取利息		11,898,404.17
	現金および現金同等物	11,872,346.16
	社債	26,058.01
利息収入		634,385,378.75
	現金および現金同等物	0.00
	社債	634,385,378.75
売却未収利息収入		35,174,008.03
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	35,174,008.03
費用		(1,231,084,297.94)
AIFMD費用		(250,338.10)
	現金および現金同等物	(250,338.10)
仲介手数料費用		(4,055,783.02)
	現金および現金同等物	(4,055,783.02)
監査報酬費用		(3,748,941.09)
	現金および現金同等物	(3,748,941.09)
銀行手数料		(74,121.27)
	現金および現金同等物	(74,121.27)
販売会社報酬		(48,342,620.75)
	現金および現金同等物	(48,342,620.75)
宣言された分配金		(1,020,084,692.24)
	現金および現金同等物	(1,020,084,692.24)
FATCA費用		(87,093.11)
	現金および現金同等物	(87,093.11)
財務書類作成報酬		(234,660.35)
	現金および現金同等物	(234,660.35)
支払利息		(27,844.18)
	現金および現金同等物	(27,844.18)
利息に係る源泉徴収税費用		(6,510,755.30)
	現金および現金同等物	(0.00)

	社債	(6,510,755.30)
弁護士および専門家報酬(費用)		(439,140.00)
	現金および現金同等物	(439,140.00)
MLRO報酬未払金		(225,060.96)
	現金および現金同等物	(225,060.96)
管理会社報酬		(19,776,470.00)
	現金および現金同等物	(19,776,470.00)
管理報酬		(107,168,330.17)
	現金および現金同等物	(107,168,330.17)
立替報酬		(520,268.15)
	現金および現金同等物	(520,268.15)
専門家報酬		(1,193,757.00)
	現金および現金同等物	(1,193,757.00)
購入未払利息費用		(11,384,707.77)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(11,384,707.77)
登録報酬費用		(379,404.24)
	現金および現金同等物	(379,404.24)
規制報告報酬		(6,066.60)
	現金および現金同等物	(6,066.60)
副保管報酬(費用)		(784,602.58)
	現金および現金同等物	(784,602.58)
副投資顧問報酬費用		(4,116,254.00)
	現金および現金同等物	(4,116,254.00)
受託報酬		(1,673,387.06)
	現金および現金同等物	(1,673,387.06)
新発銘柄以外への投資に係る実現および未 実現損益		314,181,900.74
未実現為替差損益の増減		(1,179,455,849.12)
	現金および現金同等物	(17,492,841.55)
	社債	(1,086,378,227.40)
	先渡為替取引	(75,318,316.84)
	優先株式	(266,463.33)
未実現価格損益の増減		1,258,699,159.83
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	1,258,623,832.54
	優先株式	75,327.29
長期価格損益		21,847,504.71
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	21,847,504.71
988条費用		(4,093,859,692.63)

	現金および現金同等物	(57,460,375.76)
	社債	(160,691,591.71)
	先渡為替取引	(3,875,707,725.16)
988条収益		4,266,249,692.74
	現金および現金同等物	65,866,516.66
	社債	729,839,145.61
	先渡為替取引	3,470,544,030.47
短期為替差損益		29,690.90
	社債	29,690.90
短期価格損益		40,671,394.31
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	40,671,394.31
純利益 / 損失		(265,090,555.82)

[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：2024年3月1日から2024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					27,276,034,425.98	3,543,391,773.71	380,408,119.86	30,819,426,199.69	100.00%
現金 - ロング					730,362,189.65	-18,468,753.53	0.00	711,893,436.12	2.31%
現金および現金同等物					730,362,189.65	-18,468,753.53	0.00	711,893,436.12	2.31%
豪ドル					51,568,656.34	308,401.54	0.00	51,877,057.88	0.17%
豪ドル	AUD	525,108.68000	1.0000	525,108.68	51,568,656.34	308,401.54	0.00	51,877,057.88	0.17%
カナダドル					4,875.87	993.70	0.00	5,869.57	0.00%
カナダドル	CAD	54.33000	1.0000	54.33	4,875.87	993.70	0.00	5,869.57	0.00%
ユーロ					145,688,274.70	-8,015,275.59	0.00	137,672,999.11	0.45%
ユーロ	EUR	854,209.04000	1.0000	854,209.04	145,688,274.70	-8,015,275.59	0.00	137,672,999.11	0.45%
日本円					81,947,326.00	0.00	0.00	81,947,326.00	0.27%
日本円	JPY	81,947,326.00000	1.0000	81,947,326.00	81,947,326.00	0.00	0.00	81,947,326.00	0.27%
英ポンド					182,976,655.70	-7,787,929.05	0.00	175,188,726.65	0.57%
英ポンド	GBP	915,486.23000	1.0000	915,486.23	182,976,655.70	-7,787,929.05	0.00	175,188,726.65	0.57%
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					268,176,400.95	-2,974,944.10	0.00	265,201,456.85	0.86%
米ドル	USD	1,821,376.03000	1.0000	1,821,376.03	268,176,400.95	-2,974,944.10	0.00	265,201,456.85	0.86%
現金 - ショート					-56,029,650.00	2,155,800.00	0.00	-53,873,850.00	-0.17%
現金および現金同等物					-56,029,650.00	2,155,800.00	0.00	-53,873,850.00	-0.17%
米ドル					-56,029,650.00	2,155,800.00	0.00	-53,873,850.00	-0.17%
米ドル	USD	-370,000.00000	1.0000	-370,000.00	-56,029,650.00	2,155,800.00	0.00	-53,873,850.00	-0.17%
投資 - ロング					26,601,701,886.33	3,559,704,727.24	380,408,119.86	30,161,406,613.57	97.86%
社債					26,570,622,032.79	3,559,895,863.28	380,408,119.86	30,130,517,896.07	97.76%
ユーロ					10,384,141,485.25	1,409,181,413.62	156,051,290.35	11,793,322,898.87	38.27%
AGEAS FLT 07/02/49	BE000264425 1	700,000.00000	95.5516	713,125.00	88,603,732.82	19,196,681.99	602,732.20	107,800,414.81	0.35%
AIA GROUP LTD FLT 09/09/33 SR:GMTN	XS235631113 9	1,300,000.00000	88.2759	1,304,647.50	170,273,198.24	14,683,480.44	1,798,447.50	184,956,678.68	0.60%

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：2024年3月1日から2024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
AROUNDTOWN FINANCE SARL FLT PERP	XS2799494120	625,000.00000	83.5244	313,476.56	50,488,801.61	33,646,460.15	2,693,873.50	84,135,261.76	0.27%
ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	XS1989708836	2,250,000.00000	95.6742	2,298,401.00	283,695,075.01	63,250,918.68	4,057,265.34	346,945,993.69	1.13%
AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31 SR:EMTN	XS2294372169	3,500,000.00000	95.0219	3,500,350.00	442,618,548.54	93,395,849.95	1,220,022.71	536,014,398.49	1.74%
AXA SA FLT PERP SR:EMTN	XS2737652474	650,000.00000	104.3814	655,232.50	104,227,556.00	5,122,990.09	834,811.01	109,350,546.09	0.35%
BANQUE FED CRED MUTUEL 1.125% 11/19/31 SR:EMTN	FR0014006KD4	1,800,000.00000	82.0834	1,787,184.00	233,816,478.49	4,312,727.58	2,550,319.46	238,129,206.07	0.77%
BAWAG GROUP AG FLT 02/24/34	XS2707629056	3,100,000.00000	107.8686	3,100,640.14	506,051,669.29	32,889,682.27	17,415,293.41	538,941,351.56	1.75%
BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34 SR:EMTN	BE6331190973	2,000,000.00000	88.2172	1,994,640.00	259,281,358.69	25,078,131.74	1,622,740.55	284,359,490.43	0.92%
BNP PARIBAS FLT 08/31/33 SR:EMTN	FR00140057U9	2,300,000.00000	88.4875	2,297,355.00	295,992,596.61	32,022,759.02	3,243,549.27	328,015,355.63	1.06%
CAIXABANK SA FLT 06/18/31 SR:EMTN	XS2310118976	2,900,000.00000	95.5285	2,762,261.00	370,654,537.34	75,839,353.48	1,184,490.21	446,493,890.82	1.45%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.500% 03/15/38	XS1785813251	2,481,000.00000	88.0863	2,353,025.16	341,022,145.11	11,202,422.42	4,628,552.81	352,224,567.53	1.14%
COMMERZBANK AG FLT 10/05/33 SR:EMTN	DE000CZ43Z49	3,000,000.00000	108.4435	2,985,990.00	470,476,316.88	53,859,434.67	29,515,935.05	524,335,751.55	1.70%
COOPERATIVE RABOBANK UA FLT 11/30/32 SR:GMTN	XS2524143554	1,300,000.00000	100.2330	1,297,933.00	177,460,473.49	32,548,947.80	6,100,301.19	210,009,421.29	0.68%
COOPERATIVE RABOBANK UA FLT PERP	XS2202900424	800,000.00000	97.0490	800,000.00	97,104,961.33	28,026,253.77	970,984.10	125,131,215.10	0.41%
CPI PROPERTY GROUP SA 1.750% 01/14/30 SR:EMTN	XS2432162654	700,000.00000	78.1628	513,200.00	86,352,340.65	1,830,242.03	1,240,701.90	88,182,582.68	0.29%
CPI PROPERTY GROUP SA 7.000% 05/07/29 SR:EMTN	XS2815976126	350,000.00000	100.2951	332,647.00	55,972,032.47	603,991.07	1,254,919.36	56,576,023.54	0.18%
CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	FR0013312154	2,000,000.00000	94.4752	2,007,829.00	272,543,704.01	31,987,777.93	4,970,513.85	304,531,481.94	0.99%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	FR0013533999	2,000,000.00000	94.7286	1,917,390.00	285,386,530.71	19,961,858.25	2,417,552.25	305,348,388.96	0.99%
DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31 SR:EMTN	XS2299135819	2,000,000.00000	95.9081	2,000,190.00	253,491,441.34	55,659,048.16	953,774.04	309,150,489.50	1.00%

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：2024年3月1日から2024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
DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	DE000DL19VU0	2,100,000.00000	85.1945	1,896,154.00	258,168,803.91	30,178,247.17	2,492,192.53	288,347,051.08	0.94%
DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 01/15/32	XS2232115423	1,000,000.00000	81.5781	990,170.00	124,200,604.00	7,278,942.14	1,008,414.33	131,479,546.14	0.43%
ELM BV (HELVETIA SCHWEIZ) FLT 09/29/47	XS1587893451	950,000.00000	97.7979	973,098.09	115,872,576.99	33,867,379.53	4,758,108.48	149,739,956.52	0.49%
GENERALI FLT 06/08/48 SR:EMTN	XS1428773763	2,550,000.00000	103.3754	3,031,645.00	378,289,811.01	46,566,421.46	4,729,129.61	424,856,232.47	1.38%
GROUPE ACM FLT 04/21/42	FR0014006144	2,900,000.00000	82.8009	2,540,966.00	351,430,526.24	35,575,537.97	3,127,054.17	387,006,064.21	1.26%
HANNOVER RE FLT 10/09/39	XS2063350925	1,700,000.00000	87.6616	1,682,354.00	198,098,356.99	42,085,035.17	2,753,928.88	240,183,392.16	0.78%
ING GROEP NV FLT 05/26/31 SR:EMTN	XS2176621170	1,200,000.00000	97.0962	1,198,056.00	141,564,503.00	46,223,587.08	1,092,203.74	187,788,090.08	0.61%
ING GROEP NV FLT 06/09/32 SR:EMTN	XS2350756446	500,000.00000	92.4207	497,620.00	66,582,328.00	7,894,938.24	160,342.22	74,477,266.24	0.24%
LA BANQUE POSTALE FLT 08/02/32 SR:EMTN	FR0014001R34	3,000,000.00000	91.0153	2,983,050.00	379,425,930.02	60,642,653.28	288,119.24	440,068,583.30	1.43%
LANDBK HESSEN-THUERINGEN FLT 09/15/32 SR:EMTN	XS2489772991	1,700,000.00000	97.9883	1,697,892.00	243,859,823.39	24,617,617.17	11,824,208.42	268,477,440.56	0.87%
MAPFRE SA 2.875% 04/13/30	ES0224244105	700,000.00000	94.4710	693,420.00	93,697,233.36	12,884,046.91	1,244,101.09	106,581,280.27	0.35%
MAPFRE SA FLT 03/31/47	ES0224244089	600,000.00000	100.0093	600,000.00	71,996,318.00	24,714,736.28	1,773,423.60	96,711,054.28	0.31%
MUTUELLE ASSURANCE FLT 06/21/52	FR0014003XZ7	1,900,000.00000	81.5984	1,697,655.00	231,308,526.56	18,564,621.31	1,265,792.83	249,873,147.87	0.81%
NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32 SR:EMTN	XS2382950330	4,150,000.00000	91.8726	4,056,896.50	542,594,981.89	71,900,394.34	6,709,321.34	614,495,376.23	1.99%
NN GROUP NV FLT PERP	XS1028950290	2,800,000.00000	100.0850	2,936,276.53	391,807,528.87	59,852,476.09	2,614,930.49	451,660,004.96	1.47%
PHOENIX GRP HLD PLC 4.375% 01/24/29 SR:EMTN	XS1881005117	1,870,000.00000	100.3105	2,033,416.82	248,228,469.79	54,095,521.01	7,925,850.38	302,323,990.80	0.98%
RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	XS2348241048	2,500,000.00000	91.1558	2,381,565.00	348,907,861.68	18,381,987.30	916,241.27	367,289,848.98	1.19%
SAMPO OYJ FLT 09/03/52 SR:EMTN	XS2226645278	1,550,000.00000	88.1415	1,548,891.00	194,383,740.01	25,805,781.06	6,194,151.97	220,189,521.07	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：2024年3月1日から2024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
SOCIETE GENERALE FLT 06/30/31 SR: EMTN	FR0014002QE 8	4,200,000.00000	94.4632	3,997,996.00	562,174,578.07	77,260,371.93	1,293,556.04	639,434,950.00	2.07%
SWEDBANK AB FLT 08/23/32 SR: GMTN	XS252287965 4	1,050,000.00000	99.5563	1,021,079.00	148,002,965.90	20,474,841.77	134,455.65	168,477,807.67	0.55%
TALANX AG FLT 12/01/42	XS241124169 3	1,000,000.00000	84.9428	991,310.00	128,134,747.98	8,767,625.73	2,111,505.11	136,902,373.71	0.44%
UNIQA INSURANCE GROUP AG FLT 12/09/41	XS241839214 3	600,000.00000	85.9929	599,148.00	76,560,701.96	6,596,219.92	1,669,167.90	83,156,921.88	0.27%
WESTPAC BANKING CORP FLT 05/13/31	XS234220659 1	1,850,000.00000	94.9711	1,850,000.00	243,337,069.00	39,833,419.27	688,311.35	283,170,488.27	0.92%
英債券					3,828,902,210.24	559,196,330.07	64,630,126.18	4,388,098,540.31	14.24%
AVIVA PLC FLT 06/03/55	XS218134840 5	2,000,000.00000	82.5393	2,042,380.00	285,230,621.00	30,666,252.15	3,722,658.93	315,896,873.15	1.02%
AXA SA FLT PERP SR: eMTN	XS113454156 1	2,850,000.00000	99.4500	3,070,707.75	518,437,744.79	23,942,546.19	14,666,089.74	542,380,290.98	1.76%
BANCO SANTANDER SA FLT 10/04/32 SR: EMTN	XS239351859 7	1,600,000.00000	90.0993	1,452,048.00	236,594,823.10	39,269,597.27	6,249,047.68	275,864,420.37	0.90%
BNP PARIBAS FLT 05/24/31 SR: EMTN	FR0014003N1 0	1,000,000.00000	94.2795	997,690.00	153,807,644.00	26,606,927.11	1,038,070.06	180,414,571.11	0.59%
CREDIT AGRICOLE SA FLT 12/09/31	FR0014003W 84	1,200,000.00000	92.1701	1,202,088.00	186,641,191.99	25,012,285.68	975,892.95	211,653,477.67	0.69%
HSBC HOLDINGS PLC 6.000% 03/29/40 SR: EMTN	XS049876831 5	800,000.00000	98.8196	1,017,096.00	141,259,280.00	10,022,760.72	3,900,626.89	151,282,040.72	0.49%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31	XS235116642 1	4,350,000.00000	92.8828	3,866,811.50	663,857,453.91	109,319,491.09	3,476,271.98	773,176,945.00	2.51%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	XS208099540 5	850,000.00000	99.2162	892,500.00	124,430,403.50	36,951,929.20	1,484,525.38	161,382,332.70	0.52%
M&G PLC FLT 10/20/51	XS188892027 6	1,250,000.00000	95.8999	1,373,600.00	188,771,192.00	40,622,999.21	4,889,421.02	229,394,191.21	0.74%
NATIONAL AUSTRALIA BANK FLT 09/15/31 SR: GMTN	XS238628741 6	1,200,000.00000	92.6412	1,200,000.00	182,332,560.00	30,402,882.68	1,791,710.55	212,735,442.68	0.69%
NATWEST GROUP PLC FLT 11/28/31 SR: EMTN	XS234651625 0	500,000.00000	93.0586	500,000.00	76,971,853.00	12,067,286.03	519,938.80	89,039,139.03	0.29%
NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32 SR: EMTN	XS238512263 0	3,200,000.00000	89.1357	2,738,344.00	479,761,167.95	66,066,762.73	2,256,600.56	545,827,930.68	1.77%
RL FINANCE BONDS NO3 6.125% 11/13/28	XS131973853 7	400,000.00000	101.8763	499,000.00	76,129,201.00	1,851,533.96	3,740,435.67	77,980,734.96	0.25%

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：2024年3月1日から2024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
RL FINANCE BONDS NO6 FLT PERP	XS262514030 1	1,100,000.00000	110.6970	1,100,000.00	188,452,935.00	44,561,526.85	5,675,711.52	233,014,461.85	0.76%
RL FINANCE NO 4 PLC FLT 10/07/49	XS206196246 5	1,200,000.00000	82.3252	1,175,712.00	156,582,293.00	32,464,116.29	10,062,943.13	189,046,409.29	0.61%
VIRGIN MONEY UK PLC FLT 08/19/31 SR:EMTN	XS234385151 0	1,100,000.00000	94.5423	1,100,242.00	169,641,846.00	29,367,432.91	180,181.32	199,009,278.91	0.65%
米ドル					12,357,578,337.30	1,591,518,119.59	159,726,703.33	13,949,096,456.89	45.26%
ABN AMRO BANK NV FLT 03/13/37 SR:144A	US00084DAV2 9	3,000,000.00000	85.6099	3,000,000.00	340,365,000.00	33,591,841.00	6,735,541.69	373,956,841.00	1.21%
AEGON LTD FLT PERP SR:CMS	NL000011616 8	2,000,000.00000	77.5000	1,715,000.00	186,437,645.00	39,250,105.00	1,505,897.87	225,687,750.00	0.73%
AIA GROUP LTD FLT PERP SR:GMTN	XS232826126 3	1,800,000.00000	96.1650	1,806,300.00	199,243,925.00	52,793,935.64	2,810,904.53	252,037,860.64	0.82%
AVIATION CAPITAL GROUP 3.500% 11/01/27 SR:144A	US05369AAA9 7	1,372,000.00000	95.8995	1,469,658.96	152,550,606.00	39,027,782.22	2,330,650.70	191,578,388.22	0.62%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 6.375% 05/04/28 SR:144A	US05401AAS0 6	2,100,000.00000	103.9288	2,110,473.00	310,603,918.96	7,179,723.02	6,281,035.68	317,783,641.98	1.03%
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG FLT 11/15/34	US05946KAN1 9	1,600,000.00000	113.2980	1,600,000.00	240,800,000.00	23,148,014.75	5,407,433.19	263,948,014.75	0.86%
BANCO DE CREDITO DEL PER FLT 07/01/30 SR:REGS	US05971V2C8 1	2,650,000.00000	97.3675	2,547,400.00	306,319,106.01	69,376,557.18	1,976,158.14	375,695,663.19	1.22%
BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38	US59023VAA8 9	2,950,000.00000	123.9904	4,374,083.00	496,152,227.99	36,429,412.63	9,894,213.65	532,581,640.62	1.73%
BANK OF AMERICA CORP FLT 02/04/33 SR:MTN	US06051GKK4 9	4,750,000.00000	88.0697	4,032,125.35	569,291,968.51	39,818,718.04	1,541,629.34	609,110,686.55	1.98%
BANK OF NOVA SCOTIA FLT 10/27/81 SR:2	US0641598N9 1	2,200,000.00000	87.3747	2,200,000.00	246,202,000.00	33,686,346.36	1,096,688.77	279,888,346.36	0.91%
CAPITAL ONE FINANCIAL CO FLT 02/01/34	US14040HCY9 9	3,200,000.00000	102.1522	3,049,728.00	444,177,634.56	31,786,007.06	2,258,624.76	475,963,641.62	1.54%
CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	US172967EW 71	2,230,000.00000	129.9893	3,098,418.00	401,564,551.31	20,509,730.46	3,371,008.53	422,074,281.77	1.37%
COMMONWEALTH BANK AUST 3.784% 03/14/32 SR:REGS	USQ2704MAH 18	2,350,000.00000	91.3302	2,149,876.00	270,103,592.46	42,402,654.54	5,970,364.77	312,506,247.00	1.01%
DAI-ICHI LIFE INSURANCE FLT PERP SR:144A	US23380YAC1 2	3,660,000.00000	99.8102	3,758,058.91	422,140,678.56	109,762,150.10	9,210,535.49	531,902,828.66	1.73%
DEUTSCHE BANK NY FLT 01/14/32	US251526CF4 7	1,700,000.00000	87.9873	1,762,713.00	197,265,211.83	20,528,357.79	1,205,071.87	217,793,569.62	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：2024年3月1日から2024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
FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33	US316773DF47	6,200,000.00000	94.3504	5,853,572.00	805,536,058.11	46,213,392.21	13,703,308.81	851,749,450.32	2.76%
GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	US38143VAA70	5,150,000.00000	108.5240	6,447,248.16	718,749,936.98	95,033,995.35	2,114,621.41	813,783,932.33	2.64%
HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32 SR:REGS	USY306AXAD26	3,000,000.00000	95.6475	3,000,000.00	341,805,000.00	75,997,539.76	1,065,998.47	417,802,539.76	1.36%
HARTFORD FINL SVCS GRP FLT 02/12/47 SR:ICON	US416515BC76	1,090,000.00000	90.2813	1,043,675.00	117,643,047.25	25,641,828.81	529,363.03	143,284,876.06	0.46%
HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39 SR:BKNT	US4042Q1AD94	2,500,000.00000	116.5520	3,080,345.00	353,538,974.10	70,725,020.50	3,255,889.59	424,263,994.60	1.38%
HSBC HOLDINGS PLC FLT PERP	US404280DT33	1,900,000.00000	107.1535	1,911,789.16	260,806,176.59	35,633,556.05	10,697,114.00	296,439,732.64	0.96%
HUNTINGTON BANCSHARES FLT 05/17/33	US446150BA18	1,750,000.00000	98.1492	1,750,000.00	228,208,750.00	21,883,897.73	3,697,501.46	250,092,647.73	0.81%
ING GROEP NV FLT 03/28/33	US456837BC65	1,740,000.00000	96.0647	1,669,394.70	230,595,564.56	12,786,997.60	4,578,336.64	243,382,562.16	0.79%
JACKSON FINANCIAL INC 3.125% 11/23/31	US46817MAL19	2,500,000.00000	86.4142	2,492,325.00	285,483,367.13	29,075,231.85	3,096,634.11	314,558,598.98	1.02%
JPMORGAN CHASE & CO FLT 05/13/31	US46647PBPO9	3,400,000.00000	90.9243	3,400,000.00	360,570,014.99	89,557,047.36	4,390,165.48	450,127,062.35	1.46%
LIBERTY MUTUAL GROUP INC FLT 12/15/51 SR:144A	US53079EBM57	2,016,000.00000	93.8303	1,847,365.00	226,817,222.32	48,611,882.09	2,556,241.37	275,429,104.41	0.89%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	US53944YAV56	1,500,000.00000	105.8828	1,465,250.00	203,526,423.75	27,729,443.45	3,106,240.00	231,255,867.20	0.75%
METLIFE INC 6.400% 12/15/36	US59156RAP38	2,700,000.00000	105.3756	3,010,530.00	355,553,168.20	58,713,734.16	5,311,670.40	414,266,902.36	1.34%
MITSUJI SUMITOMO INSURANC FLT PERP SR:REGS	USJ4517MAA74	3,100,000.00000	98.7144	3,100,000.00	343,774,503.99	101,798,157.72	10,799,158.84	445,572,661.71	1.45%
NASDAQ INC 3.250% 04/28/50	US63111XAB73	900,000.00000	70.9339	882,882.00	95,011,345.00	-2,056,344.21	1,455,139.97	92,955,000.79	0.30%
NEW YORK LIFE INSURANCE 6.750% 11/15/39 SR:144A	US64952GAF54	1,500,000.00000	116.1076	1,722,315.00	254,635,661.18	-1,047,932.87	4,340,849.06	253,587,728.31	0.82%
SANTANDER UK GROUP HLDGS 5.625% 09/15/45 SR:REGS	XS1291352711	1,500,000.00000	85.9445	1,794,255.00	194,703,578.01	-6,994,300.49	5,630,818.36	187,709,277.52	0.61%
STANDARD CHARTERED PLC 4.300% 02/19/27 SR:144A	US853254BF64	2,400,000.00000	98.6710	2,385,984.00	239,684,024.87	105,123,793.00	459,141.10	344,807,817.87	1.12%

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：2024年3月1日から2024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
STANDARD CHARTERED PLC 5.300% 01/09/43 SR:REGS	XS087526739 4	1,150,000.00000	95.4916	1,284,964.00	139,193,730.00	20,702,846.30	1,257,238.51	159,896,576.30	0.52%
STATE STREET CORP FLT PERP SR:I	US857477CH4 8	750,000.00000	102.3250	753,750.00	111,245,962.50	496,774.69	1,544,626.37	111,742,737.19	0.36%
SYNOVUS BANK GA FLT 10/29/30 SR:*	US87164DSE1 2	1,750,000.00000	89.2000	1,750,000.00	183,408,741.01	43,880,663.99	3,454,074.17	227,289,405.00	0.74%
UBS GROUP AG FLT 08/12/33 SR:144A	US225401AZ1 5	6,912,000.00000	108.4976	7,167,556.80	1,063,787,248.55	28,156,106.17	3,289,489.52	1,091,943,354.72	3.54%
UBS GROUP AG FLT PERP SR:144A	US902613BE7 4	550,000.00000	115.6300	558,050.00	84,218,647.50	8,381,036.32	2,201,719.49	92,599,683.82	0.30%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 04/19/51 SR:EMTN	XS228317756 1	1,800,000.00000	85.7229	1,800,000.00	187,559,999.99	37,110,396.23	2,861,138.25	224,670,396.22	0.73%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 05/02/52 SR:EMTN	XS241697819 0	1,637,000.00000	87.0025	1,631,106.80	188,303,124.53	19,072,020.03	2,734,465.94	207,375,144.56	0.67%
優先株式					31,079,853.54	-191,136.04	0.00	30,888,717.50	0.10%
米ドル					31,079,853.54	-191,136.04	0.00	30,888,717.50	0.10%
CITIGROUP CAPITAL XIII FLT 10/30/40	US173080201 4	7,150.00000	29.6700	211,623.16	31,079,853.54	-191,136.04	0.00	30,888,717.50	0.10%
債権投資					30,438,780,320.82	-1,413,145,983.06	0.00	29,025,634,337.76	100.00%
先渡為替取引未収金					30,438,541,143.85	-1,413,142,766.27	0.00	29,025,398,377.58	100.00%
先渡為替取引未収金					30,438,541,143.85	-1,413,142,766.27	0.00	29,025,398,377.58	100.00%
豪ドル					2,186,193,392.12	68,699,597.64	0.00	2,254,892,989.76	7.77%
AUD.FWD	AUD.FWD	22,856,626.50000	1.0000	22,856,626.50	2,186,193,392.12	68,699,597.64	0.00	2,254,892,989.76	7.77%
ブラジル・リアル					1,162,986,609.04	4,721,089.55	0.00	1,167,707,698.59	4.02%
BRL.FWD	BRL.FWD	45,557,181.36000	1.0000	45,557,181.36	1,162,986,609.04	4,721,089.55	0.00	1,167,707,698.59	4.02%
ユーロ					633,493,839.97	-44,913,764.21	0.00	588,580,075.76	2.03%
EUR.FWD	EUR.FWD	3,658,550.02000	1.0000	3,658,550.02	633,493,839.97	-44,913,764.21	0.00	588,580,075.76	2.03%

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：2024年3月1日から2024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
日本円					5,639,876,871.00	0.00	0.00	5,639,876,871.00	19.43%
JPY.FWD	JPY.FWD	5,639,876,871.00000	1.0000	5,639,876,871.00	5,639,876,871.00	0.00	0.00	5,639,876,871.00	19.43%
メキシコ・ペソ					650,182,592.65	-26,787,329.65	0.00	623,395,263.00	2.15%
MXN.FWD	MXN.FWD	84,408,250.50000	1.0000	84,408,250.50	650,182,592.65	-26,787,329.65	0.00	623,395,263.00	2.15%
新トルコ・リラ					745,329,335.90	-36,191,145.51	0.00	709,138,190.39	2.44%
TRY.FWD	TRY.FWD	168,862,883.60000	1.0000	168,862,883.60	745,329,335.90	-36,191,145.51	0.00	709,138,190.39	2.44%
英ポンド					184,692,887.50	-12,897,473.16	0.00	171,795,414.34	0.59%
GBP.FWD	GBP.FWD	900,000.00000	1.0000	900,000.00	184,692,887.50	-12,897,473.16	0.00	171,795,414.34	0.59%
南アフリカ・ランド					10,960,940.32	183,143.46	0.00	11,144,083.78	0.04%
ZAR.FWD	ZAR.FWD	1,362,550.41000	1.0000	1,362,550.41	10,960,940.32	183,143.46	0.00	11,144,083.78	0.04%
米ドル					19,224,824,675.35	-1,365,956,884.39	0.00	17,858,867,790.96	61.53%
USD.FWD	USD.FWD	122,982,670.98000	1.0000	122,982,670.98	19,224,824,675.35	-1,365,956,884.39	0.00	17,858,867,790.96	61.53%
未収金					0.00	-3,216.79	0.00	-3,216.79	0.00%
現金および現金同等物					0.00	-3,216.79	0.00	-3,216.79	0.00%
米ドル					0.00	-3,216.79	0.00	-3,216.79	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-3,216.79	0.00	-3,216.79	0.00%
前払登録報酬					239,176.97	0.00	0.00	239,176.97	0.00%
現金および現金同等物					239,176.97	0.00	0.00	239,176.97	0.00%
米ドル					239,176.97	0.00	0.00	239,176.97	0.00%
米ドル	USD	1,620.55000	1.0000	1,620.55	239,176.97	0.00	0.00	239,176.97	0.00%
債務投資					-	1,207,550,671.45	0.00	-	100.00%
					30,543,473,154.37			29,335,922,482.92	
AIFMD報酬未払金					-208,575.21	0.00	0.00	-208,575.21	0.00%
現金および現金同等物					-208,575.21	0.00	0.00	-208,575.21	0.00%
ユーロ					-208,575.21	0.00	0.00	-208,575.21	0.00%
ユーロ	EUR	-1,247.76000	1.0000	-1,247.76	-208,575.21	0.00	0.00	-208,575.21	0.00%
未払監査報酬					-1,747,209.89	0.00	0.00	-1,747,209.89	0.01%
現金および現金同等物					-1,747,209.89	0.00	0.00	-1,747,209.89	0.01%
米ドル					-1,747,209.89	0.00	0.00	-1,747,209.89	0.01%
米ドル	USD	-11,498.34000	1.0000	-11,498.34	-1,747,209.89	0.00	0.00	-1,747,209.89	0.01%

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：2024年3月1日から2024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
代行協会員報酬未払金					-1,397,444.66	0.00	0.00	-1,397,444.66	0.00%
現金および現金同等物					-1,397,444.66	0.00	0.00	-1,397,444.66	0.00%
豪ドル					-119,176.61	0.00	0.00	-119,176.61	0.00%
豪ドル	AUD	-1,175.28000	1.0000	-1,175.28	-119,176.61	0.00	0.00	-119,176.61	0.00%
米ドル					-1,278,268.05	0.00	0.00	-1,278,268.05	0.00%
米ドル	USD	-8,403.83000	1.0000	-8,403.83	-1,278,268.05	0.00	0.00	-1,278,268.05	0.00%
監査報酬未払金					-7,888,633.11	0.00	0.00	-7,888,633.11	0.03%
現金および現金同等物					-7,888,633.11	0.00	0.00	-7,888,633.11	0.03%
ユーロ					-7,888,633.11	0.00	0.00	-7,888,633.11	0.03%
ユーロ	EUR	-48,482.01000	1.0000	-48,482.01	-7,888,633.11	0.00	0.00	-7,888,633.11	0.03%
設定払込未払金					-17,000,000.00	0.00	0.00	-17,000,000.00	0.06%
現金および現金同等物					-17,000,000.00	0.00	0.00	-17,000,000.00	0.06%
日本円					-17,000,000.00	0.00	0.00	-17,000,000.00	0.06%
日本円	JPY	-17,000,000.00000	1.0000	-17,000,000.00	-17,000,000.00	0.00	0.00	-17,000,000.00	0.06%
販売会社報酬未払金					-16,815,181.34	0.00	0.00	-16,815,181.34	0.06%
現金および現金同等物					-16,815,181.34	0.00	0.00	-16,815,181.34	0.06%
豪ドル					-1,413,536.86	0.00	0.00	-1,413,536.86	0.00%
豪ドル	AUD	-13,939.75000	1.0000	-13,939.75	-1,413,536.86	0.00	0.00	-1,413,536.86	0.00%
米ドル					-15,401,644.48	0.00	0.00	-15,401,644.48	0.05%
米ドル	USD	-101,169.79000	1.0000	-101,169.79	-15,401,644.48	0.00	0.00	-15,401,644.48	0.05%
FATCA報酬未払金					-152,388.58	0.00	0.00	-152,388.58	0.00%
現金および現金同等物					-152,388.58	0.00	0.00	-152,388.58	0.00%
米ドル					-152,388.58	0.00	0.00	-152,388.58	0.00%
米ドル	USD	-998.73000	1.0000	-998.73	-152,388.58	0.00	0.00	-152,388.58	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：2024年3月1日から2024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
財務書類作成報酬未払金					-617,775.02	0.00	0.00	-617,775.02	0.00%
現金および現金同等物					-617,775.02	0.00	0.00	-617,775.02	0.00%
ユーロ					-617,775.02	0.00	0.00	-617,775.02	0.00%
ユーロ	EUR	-3,884.97000	1.0000	-3,884.97	-617,775.02	0.00	0.00	-617,775.02	0.00%
先渡為替取引未払金					-	1,205,581,692.96	0.00	-	99.65%
					30,438,541,143.85			29,232,959,450.89	
先渡為替取引未払金					-	1,205,581,692.96	0.00	-	99.65%
					30,438,541,143.85			29,232,959,450.89	
豪ドル					-123,377,198.66	4,146,920.95	0.00	-119,230,277.71	0.41%
AUD.FWD	AUD.FWD	-1,209,543.15000	1.0000	-1,209,543.15	-123,377,198.66	4,146,920.95	0.00	-119,230,277.71	0.41%
ブラジル・リアル					-34,346,646.81	1,230,499.11	0.00	-33,116,147.70	0.11%
BRL.FWD	BRL.FWD	-1,292,000.00000	1.0000	-1,292,000.00	-34,346,646.81	1,230,499.11	0.00	-33,116,147.70	0.11%
ユーロ					-	721,010,463.55	0.00	-	42.89%
					13,301,986,538.71			12,580,976,075.16	
EUR.FWD	EUR.FWD	-78,203,254.23000	1.0000	-78,203,254.23	-13,301,986,538.71	721,010,463.55	0.00	-12,580,976,075.16	42.89%
日本円					-733,839,492.00	0.00	0.00	-733,839,492.00	2.50%
JPY.FWD	JPY.FWD	-733,839,492.00000	1.0000	-733,839,492.00	-733,839,492.00	0.00	0.00	-733,839,492.00	2.50%
メキシコ・ペソ					-20,219,909.24	973,354.01	0.00	-19,246,555.23	0.07%
MXN.FWD	MXN.FWD	-2,606,000.00000	1.0000	-2,606,000.00	-20,219,909.24	973,354.01	0.00	-19,246,555.23	0.07%
新トルコ・リラ					-19,850,570.75	117,161.69	0.00	-19,733,409.06	0.07%
TRY.FWD	TRY.FWD	-4,699,000.00000	1.0000	-4,699,000.00	-19,850,570.75	117,161.69	0.00	-19,733,409.06	0.07%
英ポンド					-4,991,204,319.18	207,046,892.11	0.00	-4,784,157,427.07	16.31%
GBP.FWD	GBP.FWD	-25,063,193.34000	1.0000	-25,063,193.34	-4,991,204,319.18	207,046,892.11	0.00	-4,784,157,427.07	16.31%
米ドル					-	271,056,401.54	0.00	-	37.30%
					11,213,716,468.50			10,942,660,066.96	
USD.FWD	USD.FWD	-75,290,938.15000	1.0000	-75,290,938.15	-11,213,716,468.50	271,056,401.54	0.00	-10,942,660,066.96	37.30%

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：2024年3月1日から2024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
MLRO報酬未払金					-262,070.39	0.00	0.00	-262,070.39	0.00%
現金および現金同等物					-262,070.39	0.00	0.00	-262,070.39	0.00%
米ドル					-262,070.39	0.00	0.00	-262,070.39	0.00%
米ドル	USD	-1,783.74000	1.0000	-1,783.74	-262,070.39	0.00	0.00	-262,070.39	0.00%
管理会社報酬未払金					-16,360,246.00	0.00	0.00	-16,360,246.00	0.06%
現金および現金同等物					-16,360,246.00	0.00	0.00	-16,360,246.00	0.06%
日本円					-16,360,246.00	0.00	0.00	-16,360,246.00	0.06%
日本円	JPY	-16,360,246.00000	1.0000	-16,360,246.00	-16,360,246.00	0.00	0.00	-16,360,246.00	0.06%
管理報酬未払金					-36,876,949.82	0.00	0.00	-36,876,949.82	0.13%
現金および現金同等物					-36,876,949.82	0.00	0.00	-36,876,949.82	0.13%
豪ドル					-1,899,803.21	0.00	0.00	-1,899,803.21	0.01%
豪ドル	AUD	-18,735.12000	1.0000	-18,735.12	-1,899,803.21	0.00	0.00	-1,899,803.21	0.01%
日本円					-14,277,124.00	0.00	0.00	-14,277,124.00	0.05%
日本円	JPY	-14,277,124.00000	1.0000	-14,277,124.00	-14,277,124.00	0.00	0.00	-14,277,124.00	0.05%
米ドル					-20,700,022.61	0.00	0.00	-20,700,022.61	0.07%
米ドル	USD	-135,973.59000	1.0000	-135,973.59	-20,700,022.61	0.00	0.00	-20,700,022.61	0.07%
未払金					0.00	1,968,978.49	0.00	1,968,978.49	-0.01%
現金および現金同等物					0.00	1,968,978.49	0.00	1,968,978.49	-0.01%
豪ドル					0.00	88,359.09	0.00	88,359.09	0.00%
豪ドル	AUD	0.00000	NA	0.00	0.00	88,359.09	0.00	88,359.09	0.00%
ユーロ					0.00	73,886.23	0.00	73,886.23	0.00%
ユーロ	AUD	0.00000	NA	0.00	0.00	73,886.23	0.00	73,886.23	0.00%
米ドル					0.00	1,806,733.17	0.00	1,806,733.17	-0.01%
米ドル	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	1,806,733.17	0.00	1,806,733.17	-0.01%

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：2024年3月1日から2024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
副投資顧問報酬未払金					-3,433,014.00	0.00	0.00	-3,433,014.00	0.01%
現金および現金同等物					-3,433,014.00	0.00	0.00	-3,433,014.00	0.01%
日本円					-3,433,014.00	0.00	0.00	-3,433,014.00	0.01%
日本円	JPY	-3,433,014.00000	1.0000	-3,433,014.00	-3,433,014.00	0.00	0.00	-3,433,014.00	0.01%
受託報酬未払金					-2,172,522.50	0.00	0.00	-2,172,522.50	0.01%
現金および現金同等物					-2,172,522.50	0.00	0.00	-2,172,522.50	0.01%
米ドル					-2,172,522.50	0.00	0.00	-2,172,522.50	0.01%
米ドル	USD	-14,251.81000	1.0000	-14,251.81	-2,172,522.50	0.00	0.00	-2,172,522.50	0.01%
報告金額合計:					27,171,341,592.43	3,337,796,462.10	380,408,119.86	30,509,138,054.53	100.00%

[次へ](#)

## 4 管理会社の概況

### (1) 資本金の額(2024年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約267億円)  
発行済株式総数 5,051,655株

### (2) 事業の内容及び営業の状況

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

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

信託証書の規定に基づき、管理会社は、信託証書に基づく義務の履行に関する故意の不適切な行為もしくは重過失、詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視の場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

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

管理会社は、2024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	20	3,218,987,246.00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「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5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、2024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=142.73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。

[次へ](#)

## (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)

2024年6月30日現在

(単位:米ドル)

## 資産

		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	4,478,297,929.37	639,187,463
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,851,039,967.06	406,928,934
040	その他の要求払預金	1,627,257,962.31	232,258,529
050	売買目的で保有される金融資産	42,284,567.44	6,035,276
060	デリバティブ	42,284,567.44	6,035,276
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	2,656.80	379
142	持分証券	2,656.80	379
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	2,148,527,982.75	306,659,399
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	2,148,527,982.75	306,659,399
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	444,289.56	63,413
280	有形固定資産	444,289.56	63,413
290	投資不動産		
300	無形資産	2,701,880.07	385,639
310	営業権		
320	その他の無形資産	2,701,880.07	385,639
330	税金資産	153,721.56	21,941
340	現行税金資産	14,721.56	2,101
350	繰延税金資産	139,000.00	19,839
360	その他の資産	25,100,198.81	3,582,551
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	6,697,513,226.36	955,936,063

## 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)

2024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	34,588,124.08	4,936,763
020	デリバティブ	34,588,124.08	4,936,763
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	5,898,065,702.33	841,830,918
120	預金	5,897,996,468.51	841,821,036
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	69,233.82	9,882
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	36,008,463.59	5,139,488
250	現行税金負債	36,008,463.59	5,139,488
260	繰延税金負債		
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	23,782,497.92	3,394,476
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	5,992,444,787.92	855,301,645

## 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)

2024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	26,707,347
020	払込資本	187,117,965.90	26,707,347
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、合弁会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
320	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動		
330	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性		
340	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕		
350	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕		
360	信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動		
128	損益に再分類されることがある項目		
130	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ準備金〔有効部分〕		
155	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動		
165	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
180	子会社、合弁会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	645,381.57	92,115
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	463,212,940.12	66,114,383
220	持分法を用いて計上される子会社、合弁会社および関連会社への投資の準備金または累積損失		
230	その他	463,212,940.12	66,114,383
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	54,092,150.85	7,720,573

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	705,068,438.44	100,634,418
310	資本および負債合計	6,697,513,226.36	955,936,063

## (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

2024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	162,081,876.28	23,133,946
020	売買目的で保有される金融資産	18,337,025.24	2,617,244
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	134,203,758.00	19,154,902
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	9,357,344.72	1,335,574
085	負債に係る利息収益	183,748.32	26,226
090	(支払利息)	104,491,741.72	14,914,106
100	(売買目的で保有される金融負債)	1,933,620.73	275,986
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)	102,396,749.51	14,615,088
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	18,361.33	2,621
145	(資産に係る支払利息)	143,010.15	20,412
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	59,886,669.57	8,547,624
210	(支払手数料)	17,141,913.35	2,446,665
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	1,006,164.82	143,610
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	3,323,301.92	474,335

米ドル

千円

		米ドル	千円
350	(その他の事業費用)	3,109,692.45	443,846
355	事業収益合計、純額	101,554,665.07	14,494,897
360	(管理費用)	28,044,490.20	4,002,790
370	(従業員費用)	12,952,665.99	1,848,734
380	(その他の管理費用)	15,091,824.21	2,154,056
385	(破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金)	2,679.38	382
390	(減価償却)	1,110,206.72	158,460
400	(有形固定資産)	541,318.33	77,262
410	(投資不動産)		
420	(その他の無形資産)	568,888.39	81,197
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)	16,994.62	2,426
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)	16,994.62	2,426
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	72,380,294.15	10,330,839
620	(継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入)	18,288,143.30	2,610,267
630	継続事業からの税引後利益または(-)損失	54,092,150.85	7,720,573
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	54,092,150.85	7,720,573
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	54,092,150.85	7,720,573

## ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

## 包括利益計算書

2024年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

		米ドル	千円
0010	当期利益または(-)損失	54,092,150.85	7,720,573
0020	その他の包括利益		
0030	損益に再分類されることがない項目		
0040	有形固定資産		
0050	無形固定資産		
0060	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		
0070	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
0080	持分法を用いて計上される事業体のその他の認識済収益 および費用の持分		
0081	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		
0083	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 ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
0084	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)		
0085	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)		
0086	信用リスクの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		
0090	再分類されることがない項目に関する法人税等		
0100	損益に再分類されることがある項目		
0110	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
0120	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
0130	損益に振替		
0140	その他の再分類		
0150	外貨換算		
0160	持分に帰属する為替差益または(-)差損		
0170	損益に振替		
0180	その他の再分類		
0190	キャッシュ・フロー・ヘッジ〔有効部分〕		
0200	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
0210	損益に振替		
0220	ヘッジ項目の当初帳簿価への振替		
0230	その他の再分類		
0231	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
0232	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
0233	損益に振替		
0234	その他の再分類		
0241	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		
0251	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
0261	損益に振替		
0270	その他の再分類		
0280	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
0290	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
0300	損益に振替		
0310	その他の再分類		

米ドル

千円

		米ドル	千円
0320	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		
0330	損益に再分類される可能性のある項目に関する法人税等		
0340	当期包括利益合計	54,092,150.85	7,720,573
0350	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
0360	親会社株主に帰属する金額	54,092,150.85	7,720,573

[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

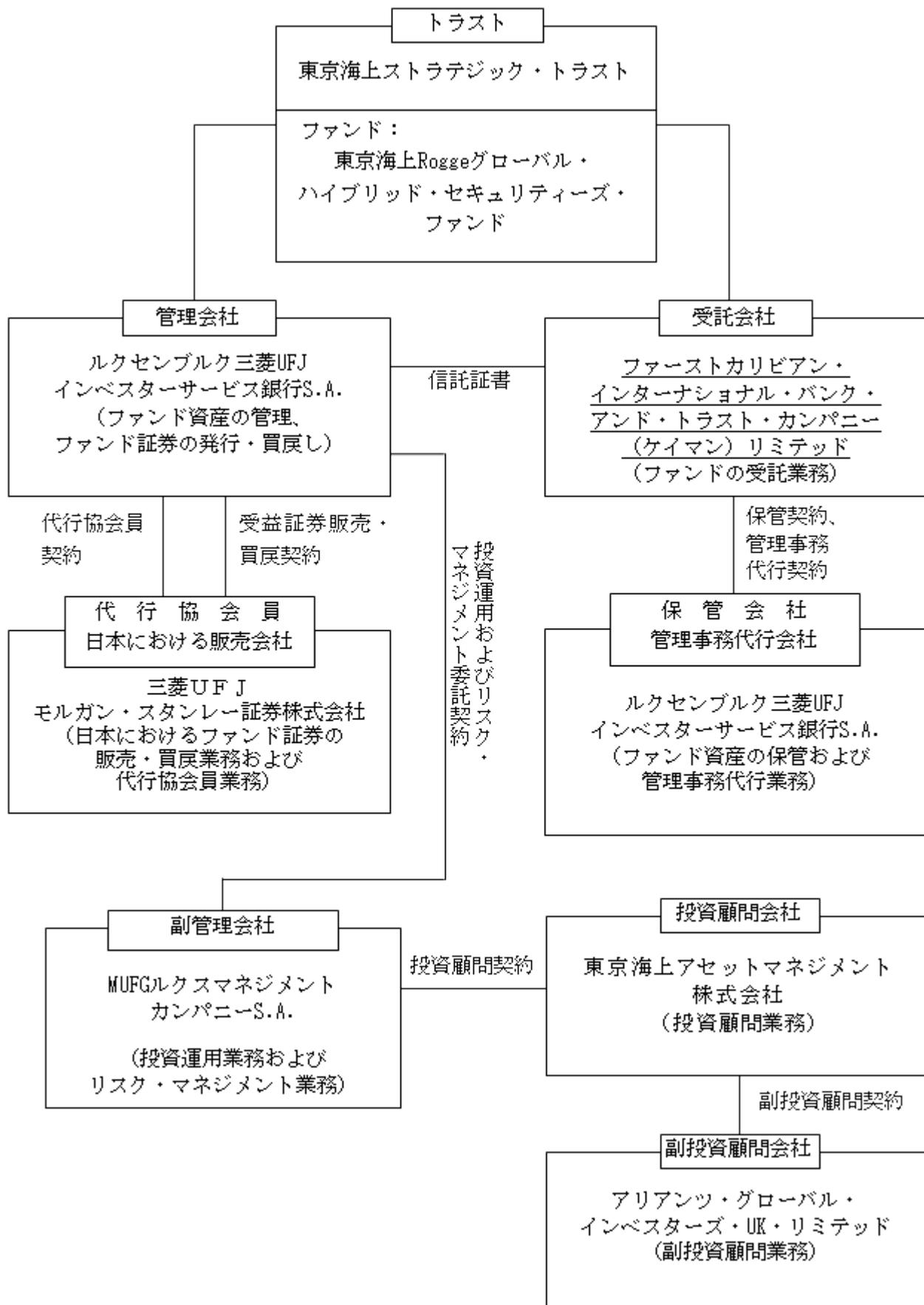
### 第1 ファンドの状況

#### 1 ファンドの性格

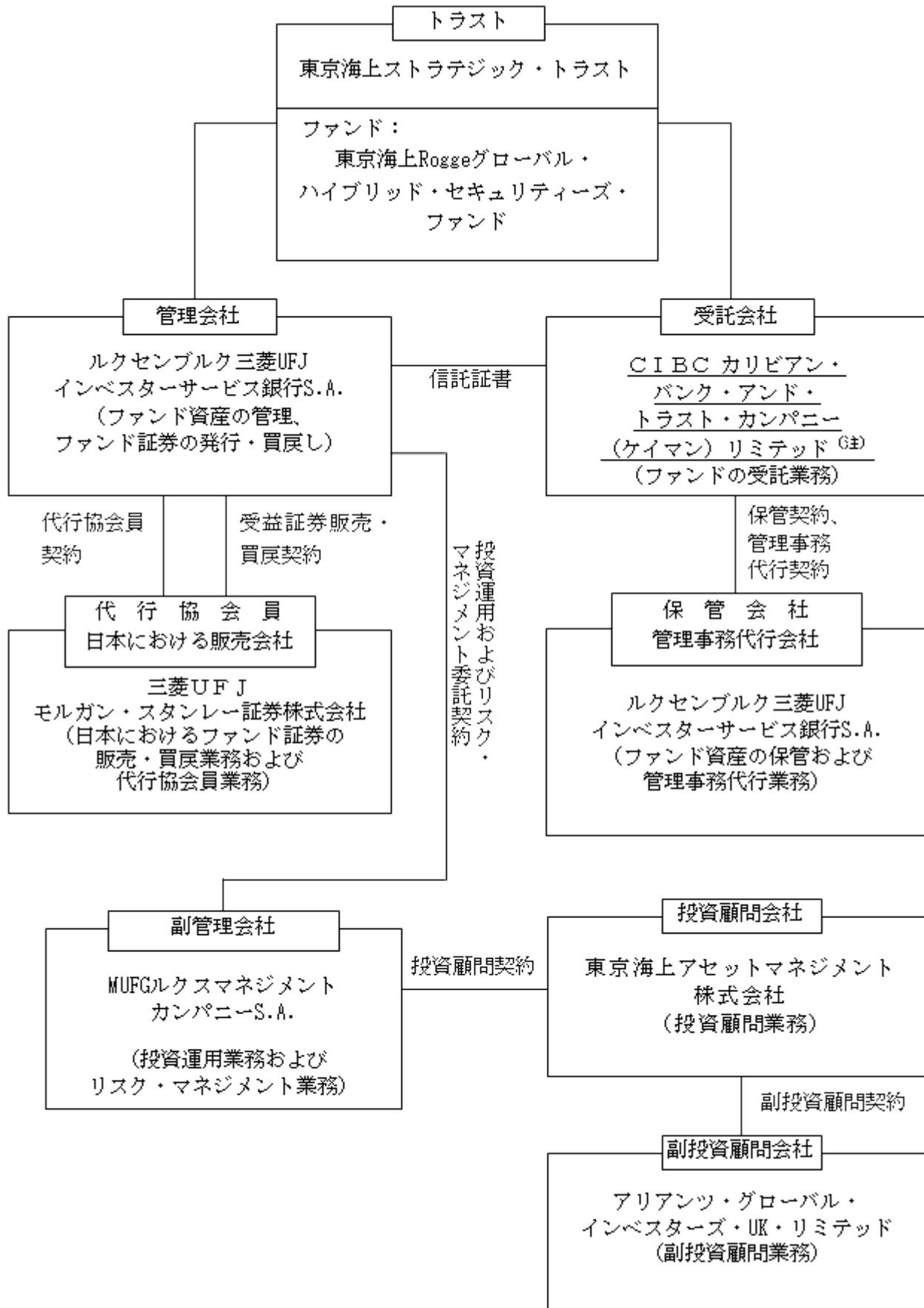
##### (3) ファンドの仕組み

## ファンドの仕組み

&lt;訂正前&gt;



&lt;訂正後&gt;



(注) 2024年8月13日付で、ファンドの受託会社であるファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッドは、その商号をCIBC カリビアン・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッドに変更した。以下同じ。

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

## &lt;訂正前&gt;

名称	ファンド運営上の役割	契約等の概要
(中略)		
ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド (FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited)	受託会社	信託証書を管理会社と締結。信託証書は、ファンドの資産の運用、管理、ファンドの受益証券の発行、買戻しおよびファンドの終了等について規定している。

(後略)

## &lt;訂正後&gt;

名称	ファンド運営上の役割	契約等の概要
(中略)		
CIBC カリビアン・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド (CIBC Caribbean Bank and Trust Company (Cayman) Limited)	受託会社	信託証書を管理会社と締結。信託証書は、ファンドの資産の運用、管理、ファンドの受益証券の発行、買戻しおよびファンドの終了等について規定している。

(後略)

## 管理会社の概況

## &lt;訂正前&gt;

(前略)

## ( ) 資本金の額(2024年6月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約301億円)

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)

## &lt;訂正後&gt;

(前略)

## ( ) 資本金の額(2024年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約267億円)

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、2024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=142.73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

2024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

2024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

&lt; 訂正前 &gt;

## 投資有価証券の主要銘柄

(2024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	UBS GROUP AG FLT 08/12/33	スイス	社債	6.537 (2032年8月 以降変動金利)	2033/8/12	6,912,000	153.90	1,063,787,249	169.13	1,169,017,704	3.49
2	FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33	米国	社債	4.337 (2032年4月 以降変動金利)	2033/4/25	6,200,000	129.93	805,536,058	146.68	909,413,893	2.72
3	GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	166.16	855,746,199	2.56
4	LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31	英国	社債	1.985 (2026年12月 以降変動金利)	2031/12/15	4,350,000	152.61	663,857,454	185.95	808,892,633	2.42
5	SOCIETE GENERALE FLT 06/30/31	フランス	社債	1.125 (2026年6月 以降変動金利)	2031/6/30	4,200,000	133.85	562,174,578	160.87	675,665,912	2.02
6	BANK OF AMERICA CORP FLT 02/04/33	米国	社債	2.972 (2032年2月 以降変動金利)	2033/2/4	4,750,000	119.85	569,291,969	136.15	646,693,424	1.93
7	NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32	英国	社債	1.043 (2027年9月 以降変動金利)	2032/9/14	4,150,000	130.75	542,594,982	155.16	643,927,075	1.92
8	DAI-ICHI LIFE INSURANCE FLT PERP	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金利)	永久債	3,660,000	115.34	422,140,679	160.24	586,484,337	1.75
9	AXA SA FLT PERP	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	201.15	573,290,634	1.71
10	NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32	フィン ランド	社債	1.625 (2027年12月 以降変動金利)	2032/12/9	3,200,000	149.93	479,761,168	177.72	568,697,565	1.70
11	AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31	オース トラリア	社債	0.669 (2026年5月 以降変動金利)	2031/5/5	3,500,000	126.46	442,618,549	160.87	563,030,067	1.68
12	BAWAG GROUP AG FLT 02/24/34	オース トラリア	社債	6.750 (2029年2月 以降変動金利)	2034/2/24	3,100,000	163.24	506,051,669	180.96	560,988,601	1.68
13	BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	190.41	561,703,563	1.68
14	COMMERZBANK AG FLT 10/05/33	ドイツ	社債	6.750 (2028年10月 以降変動金利)	2033/10/5	3,000,000	156.83	470,476,317	185.11	555,324,978	1.66
15	CAPITAL ONE FINANCIAL CO FLT 02/01/34	米国	社債	5.817 (2033年2月 以降変動金利)	2034/2/1	3,200,000	138.81	444,177,635	159.06	508,990,175	1.52
16	NN GROUP NV FLT PERP	オラン ダ	社債	4.500 (2026年1月 以降変動金利)	永久債	2,800,000	139.93	391,807,529	171.59	480,460,733	1.44

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
17	MITSUI SUMITOMO INSURANC FLT PERP	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	155.58	482,290,407	1.44
18	JPMORGAN CHASE & CO FLT 05/13/31	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	140.86	478,930,299	1.43
19	CAIXABANK SA FLT 06/18/31	ス페인	社債	1.250 (2026年6月 以降変動金利)	2031/6/18	2,900,000	127.81	370,654,537	162.49	471,207,197	1.41
20	LA BANQUE POSTALE FLT 08/02/32	フランス	社債	0.750 (2027年8月 以降変動金利)	2032/8/2	3,000,000	126.48	379,425,930	153.65	460,936,288	1.38
21	HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32	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	150.90	452,693,097	1.35
22	HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39	米国	社債	7.000	2039/1/15	2,500,000	141.42	353,538,974	180.57	451,421,418	1.35
23	ASSICURAZIONI GENERALI FLT 06/08/48	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	176.11	449,074,720	1.34
24	CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	米国	社債	8.125	2039/7/15	2,230,000	180.07	401,564,551	201.30	448,907,670	1.34
25	METLIFE INC 6.400% 12/15/36	米国	社債	6.400	2036/12/15	2,700,000	131.69	355,553,168	162.48	438,685,850	1.31
26	BANCO DE CREDITO DEL PER FLT 07/01/30	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	154.85	410,362,809	1.23
27	GROUPE ACM FLT 04/21/42	フランス	社債	1.850 (2032年4月 以降変動金利)	2042/4/21	2,900,000	121.18	351,430,526	138.99	403,062,577	1.20
28	ABN AMRO BANK NV FLT 03/13/37	オランダ	社債	3.324 (2032年3月 以降変動金利)	2037/3/13	3,000,000	113.46	340,365,000	131.48	394,451,482	1.18
29	RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	チェコ	社債	1.000 (2027年6月 以降変動金利)	2028/6/9	2,500,000	139.56	348,907,862	155.20	388,010,714	1.16
30	STANDARD CHARTERED PLC 4.300% 02/19/27	英国	社債	4.300	2027/2/19	2,400,000	99.87	239,684,025	155.87	374,091,731	1.12

## 投資不動産物件

該当事項なし。(2024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。(2024年6月末日現在)

&lt; 訂正後 &gt;

## 投資有価証券の主要銘柄

(2024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	UBS GROUP AG	スイス	社債	6.537 (2032年8月 以降変動金利)	2033/8/12	6,912,000	153.90	1,063,787,249	157.69	1,089,936,667	3.55
2	FIFTH THIRD BANCORP	米国	社債	4.337 (2032年4月 以降変動金利)	2033/4/25	6,200,000	129.93	805,536,058	137.57	852,937,859	2.78
3	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	154.74	796,906,210	2.60
4	LLOYDS BANKING GROUP PLC	英国	社債	1.985 (2026年12月 以降変動金利)	2031/12/15	4,350,000	152.61	663,857,454	179.24	779,691,042	2.54
5	SOCIETE GENERALE	フラン ス	社債	1.125 (2026年6月 以降変動金利)	2031/6/30	4,200,000	133.85	562,174,578	152.05	638,599,998	2.08
6	NATWEST GROUP PLC	英国	社債	1.043 (2027年9月 以降変動金利)	2032/9/14	4,150,000	130.75	542,594,982	148.53	616,409,850	2.01
7	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	2.972 (2032年2月 以降変動金利)	2033/2/4	4,750,000	119.85	569,291,969	128.24	609,152,068	1.99
8	NORDEA BANK ABP	フィン ランド	社債	1.625 (2027年12月 以降変動金利)	2032/12/9	3,200,000	149.93	479,761,168	172.32	551,408,136	1.80
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	181.91	518,437,745	191.67	546,248,177	1.78
10	BAWAG GROUP AG	オース トリア	社債	6.750 (2029年2月 以降変動金利)	2034/2/24	3,100,000	163.24	506,051,669	173.13	536,700,976	1.75
11	AUST & NZ BANKING GROUP	オース トラリ ア	社債	0.669 (2026年5月 以降変動金利)	2031/5/5	3,500,000	126.46	442,618,549	152.80	534,813,133	1.74
12	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	180.77	533,281,091	1.74
13	COMMERZBANK AG	ドイツ	社債	6.750 (2028年10月 以降変動金利)	2033/10/5	3,000,000	156.83	470,476,317	174.68	524,043,808	1.71
14	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金利)	永久債	3,660,000	115.34	422,140,679	142.93	523,137,786	1.71
15	CAPITAL ONE FINANCIAL CO	米国	社債	5.817 (2033年2月 以降変動金利)	2034/2/1	3,200,000	138.81	444,177,635	148.88	476,421,566	1.55
16	NN GROUP NV	オラン ダ	社債	4.500 (2026年1月 以降変動金利)	永久債	2,800,000	139.93	391,807,529	160.10	448,276,764	1.46
17	JPMORGAN CHASE & CO	米国	社債	2.956 (2030年5月 以降変動金利)	2031/5/13	3,400,000	106.05	360,570,015	131.63	447,533,877	1.46
18	CAIXABANK SA	スเปน ン	社債	1.250 (2026年6月 以降変動金利)	2031/6/18	2,900,000	127.81	370,654,537	153.98	446,528,836	1.46

	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	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	142.48	441,675,978	1.44
20	LA BANQUE POSTALE	フラン ス	社債	0.750 (2027年8月 以降変動金利)	2032/8/2	3,000,000	126.48	379,425,930	147.08	441,240,656	1.44
21	GENERALI	イタリ ア	社債	5.000 (2028年6月 以降変動金利)	2048/6/8	2,550,000	148.35	378,289,811	166.61	424,851,941	1.39
22	CITIGROUP INC	米国	社債	8.125	2039/7/15	2,230,000	180.07	401,564,551	189.95	423,581,762	1.38
23	HSBC BANK USA NA	米国	社債	7.000	2039/1/15	2,500,000	141.42	353,538,974	169.43	423,565,685	1.38
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	113.94	341,805,000	138.09	414,274,207	1.35
25	METLIFE INC	米国	社債	6.400	2036/12/15	2,700,000	131.69	355,553,168	151.35	408,656,340	1.33
26	GROUPE ACM	フラン ス	社債	1.850 (2032年4月 以降変動金利)	2042/4/21	2,900,000	121.18	351,430,526	133.59	387,407,253	1.26
27	ABN AMRO BANK NV	オラン ダ	社債	3.324 (2032年3月以 降変動金利)	2037/3/13	3,000,000	113.46	340,365,000	125.16	375,488,454	1.22
28	BANCO DE CREDITO DEL PER	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	140.00	370,997,876	1.21
29	RAIFFEISENBANK AS	チェコ 共和国	社債	1.000 (2027年6月 以降変動金利)	2028/6/9	2,500,000	139.56	348,907,862	146.96	367,403,018	1.20
30	CHUBB INA HOLDINGS LLC	米国	社債	2.500	2038/3/15	2,481,000	137.45	341,022,145	144.12	357,559,468	1.17

## 投資不動産物件

該当事項なし。(2024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。(2024年9月末日現在)

## 第三部 特別情報

### 第2 その他の関係法人の概況

#### 1 名称、資本金の額及び事業の内容

<訂正前>

(1) ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド(FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman)Limited) (「受託会社」)

(イ) 資本金の額

2024年6月末日現在、39,960,510米ドル(約64億3,644万円)

(ロ) 事業の内容

受託会社は、ケイマン諸島の法律に基づき設立され、また存続する会社である。受託会社は、世界有数の規模の銀行の一つであるカナダ帝国商業銀行が91.67%の株式を保有している子会社であるCIBCファースト・カリビアン・インターナショナル銀行の子会社である。受託会社は、1965年に設立され、ケイマン諸島で最大級の総合銀行信託会社に数えられており、銀行、信託および投資業務の全範囲を提供している。その顧客には、ケイマン諸島および世界中の個人、法人およびその他の機関が含まれる。受託会社は、適法に設立され有効に存続しており、ケイマン諸島の銀行および信託会社法(改正済)の条項に基づき事業を営む免許を付与されている。受託会社はまた、ミューチュアル・ファンド法の条項に基づく免許ミューチュアル・ファンド管理事務代行会社でもある。

(後略)

<訂正後>

(1) CIBC カリビアン・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド(CIBC Caribbean Bank and Trust Company (Cayman) Limited) (「受託会社」)

(イ) 資本金の額

2024年6月末日現在、39,960,510米ドル(約64億3,644万円)

(ロ) 事業の内容

受託会社は、ケイマン諸島の法律に基づき設立され、また存続する会社である。受託会社は、世界有数の規模の銀行の一つであるカナダ帝国商業銀行が91.67%の株式を保有している子会社であるCIBCカリビアン銀行の子会社である。受託会社は、1965年に設立され、ケイマン諸島で最大級の総合銀行信託会社に数えられており、銀行、信託および投資業務の全範囲を提供している。その顧客には、ケイマン諸島および世界中の個人、法人およびその他の機関が含まれる。受託会社は、適法に設立され有効に存続しており、ケイマン諸島の銀行および信託会社法(改正済)の条項に基づき事業を営む免許を付与されている。受託会社はまた、ミューチュアル・ファンド法の条項に基づく免許ミューチュアル・ファンド管理事務代行会社でもある。

(後略)

## 2 関係業務の概要

### <訂正前>

- (1) ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド(FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman)Limited) (「受託会社」)

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドの受託業務および保管業務を行う。

(後略)

### <訂正後>

- (1) CIBC カリビアン・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド(CIBC Caribbean Bank and Trust Company (Cayman) Limited) (「受託会社」)

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドの受託業務および保管業務を行う。

(後略)