

## 【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】 2025年11月28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外国法共同事業

【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外国法共同事業

【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2,896億2,000万円)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1,890億円)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、2025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=144.81円および1豪ドル=94.50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、2025年8月29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) 投資状況	更新
		(3) 運用実績	1 ファンドの運用状況 (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	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	(1) 資本金の額	更新
	2	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	3 管理会社の経理状況	5	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

(2025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	7,204,665,358	26.45
	フランス	3,909,875,725	14.35
	英国	3,868,681,931	14.20
	ドイツ	1,416,384,768	5.20
	スペイン	1,243,799,140	4.57
	オランダ	1,226,127,906	4.50
	スイス	946,042,279	3.47
	オーストラリア	929,027,658	3.41
	イタリア	856,505,989	3.14
	フィンランド	845,238,118	3.10
	オーストリア	830,154,357	3.05
	香港	474,279,898	1.74
	日本	466,027,697	1.71
	アイルランド	461,393,420	1.69
	ベルギー	444,703,797	1.63
	チェコ共和国	417,447,996	1.53
	デンマーク	344,484,026	1.26
	韓国	290,265,091	1.07
	ルクセンブルグ	284,740,439	1.05
カナダ	272,944,033	1.00	
	小計	26,732,789,626	98.14
	現金・その他の資産 (負債控除後)	507,755,990	1.86
	合計(純資産総額)	27,240,545,616	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、2025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=148.88円お

よび1豪ドル=97.89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

2025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
2024年10月末日	97,673,368.02	14,541,611	0.006904	1.0279
11月末日	98,102,556.39	14,605,509	0.006943	1.0337
12月末日	98,583,507.33	14,677,113	0.006866	1.0222
2025年1月末日	98,833,057.29	14,714,266	0.006868	1.0225
2月末日	98,179,757.83	14,617,002	0.006901	1.0274
3月末日	97,042,124.46	14,447,631	0.006830	1.0169
4月末日	97,464,414.13	14,510,502	0.006798	1.0121
5月末日	97,132,106.97	14,461,028	0.006807	1.0134
6月末日	97,667,412.61	14,540,724	0.006851	1.0200
7月末日	95,847,347.94	14,269,753	0.006853	1.0203
8月末日	95,487,365.10	14,216,159	0.006849	1.0197
9月末日	92,131,122.77	13,716,482	0.006872	1.0231

## &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
2024年10月末日	13,303,992.29	1,302,328	0.005842	0.5719
11月末日	13,182,176.99	1,290,403	0.005878	0.5754
12月末日	12,968,156.18	1,269,453	0.005808	0.5685
2025年1月末日	12,936,743.52	1,266,378	0.005816	0.5693
2月末日	12,912,919.77	1,264,046	0.005843	0.5720
3月末日	12,693,764.75	1,242,593	0.005784	0.5662
4月末日	12,718,591.55	1,245,023	0.005756	0.5635
5月末日	12,719,648.07	1,245,126	0.005771	0.5649
6月末日	12,787,691.06	1,251,787	0.005810	0.5687
7月末日	11,729,531.19	1,148,204	0.005813	0.5690
8月末日	11,728,903.86	1,148,142	0.005811	0.5688
9月末日	11,756,448.31	1,150,839	0.005832	0.5709

## &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(2015年9月末日~2025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

2025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
2024年10月1日～2025年9月末日	0.000480	0.071462

## &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
2024年10月1日～2025年9月末日	0.000360	0.035240

## &lt;参考情報&gt;

## 分配の推移(2025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
第12会計年度(2023年3月1日～2024年2月29日)	0.000480
第13会計年度(2024年3月1日～2025年2月28日)	0.000480
2025年5月	0.000040
2025年6月	0.000040
2025年7月	0.000040
2025年8月	0.000040
2025年9月	0.000040
直近1年間累計	0.000480
設定来累計	0.007019

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
第12会計年度(2023年3月1日～2024年2月29日)	0.000360
第13会計年度(2024年3月1日～2025年2月28日)	0.000360
2025年5月	0.000030
2025年6月	0.000030
2025年7月	0.000030
2025年8月	0.000030
2025年9月	0.000030
直近1年間累計	0.000360
設定来累計	0.008158

## 収益率の推移

2025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)
2024年10月1日～2025年9月末日	4.94%

(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)
2024年10月1日～2025年9月末日	4.54%

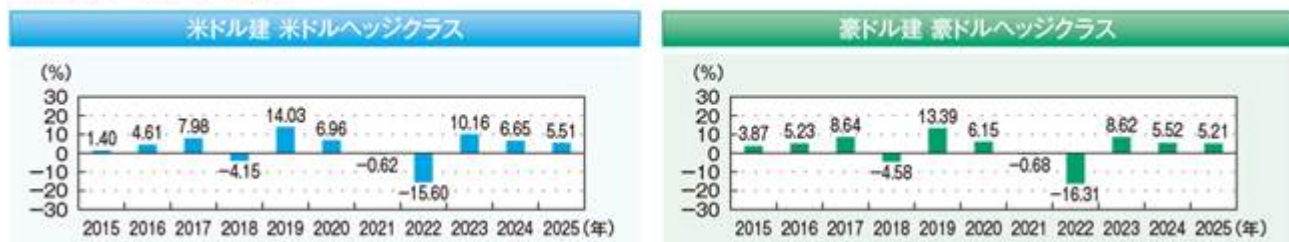
(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

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、2025年については2025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) 2025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

2025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2025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
2024年10月1日～ 2025年9月末日	1,157,153,749 (1,157,153,749)	1,914,430,746 (1,914,430,746)	13,406,492,451 (13,406,492,451)

### <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
2024年10月1日～ 2025年9月末日	44,610,740 (44,610,740)	332,100,993 (332,100,993)	2,015,794,873 (2,015,794,873)

(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

2025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	27,088,185,407.33
優先株式	147,627,751.01
投資 - ロング合計	27,235,813,158.34
設定払込未収金	
設定払込未収金	100,000,000.00
現金 - ロング	
現金および現金同等物	697,820,461.12
先渡為替取引未収金	
先渡為替取引未収金	28,476,586,006.14
未収金	
未収金	(7,005.05)
前払登録報酬	
前払登録報酬	290,825.12
資産合計	56,510,503,445.67
<b>負債</b>	
AIFMD報酬未払金	
AIFMD報酬未払金	(207,211.64)
未払監査報酬	
未払監査報酬	(2,883,758.31)
未払代行協会員報酬	
未払代行協会員報酬	(1,263,819.85)
監査報酬未払金	
監査報酬未払金	(6,028,861.96)
設定払込未払金	
設定払込未払金	(12,000,000.00)
現金 - ショート	
現金および現金同等物	(20,555,500.00)
販売会社報酬未払金	
販売会社報酬未払金	(14,940,483.88)
FATCA報酬未払金	
FATCA報酬未払金	(36,069.04)
財務書類作成報酬未払金	
財務書類作成報酬未払金	(160,121.23)
先渡為替取引未払金	

(28,743,397,682.72)

先渡為替取引未払金	
MLRO報酬未払金	
MLRO報酬未払金	(73,322.01)
管理会社報酬未払金	
管理会社報酬未払金	(14,435,495.00)
管理報酬未払金	
管理報酬未払金	(30,769,201.40)
未払金	
未払金	(172,714.13)
副投資顧問報酬未払金	
副投資顧問報酬未払金	(2,892,361.00)
受託報酬未払金	
受託報酬未払金	(452,904.26)
負債合計	<u>(28,850,269,506.43)</u>
純資産額合計	<u>27,660,233,939.24</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

2025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	11,728,903.86	2,018,282,107	0.005811
豪ドルクラス	日本円	771,064,817	88,873.3451	8,676
資源国通貨バスケットクラス	日本円	34,334,537	6,492.9500	5,288
ブラジル・リアルクラス	日本円	830,108,771	279,617.0585	2,969
ユーロクラス	日本円	61,605,056	4,449.3953	13,846
日本円クラス	日本円	4,234,797,021	612,823.1504	6,910
メキシコ・ペソクラス	日本円	360,748,878	49,023.8469	7,359
トルコ・リラクラス	日本円	298,678,552	490,254.8852	609
米ドル建 米ドルヘッジクラス	米ドル	95,487,365.10	13,941,432,466	0.006849
米ドルクラス	日本円	5,921,726,752	361,735.5299	16,370

## 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：2025年3月1日から2025年8月31日

勘定科目	説明	期間累計 (日本円)
収益		599,867,473.57
未収利息 - ロングの増減		(9,062,141.21)
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	(9,062,141.21)
受取配当金		6,153,449.08
	現金および現金同等物	(0.00)
	優先株式	6,153,449.08
受取利息		13,177,375.44
	現金および現金同等物	12,022,129.77
	社債	1,155,245.67
利息収入		506,060,011.59
	現金および現金同等物	0.00
	社債	506,060,011.59
売却未収利息収入		83,538,778.67
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	83,538,778.67
費用		(1,088,826,469.97)
AIFMD費用		(248,462.02)
	現金および現金同等物	(248,462.02)
仲介手数料費用		(3,807,774.96)
	現金および現金同等物	(3,807,774.96)
監査報酬費用		(6,483,089.29)
	現金および現金同等物	(6,483,089.29)
銀行手数料		(78,912.22)
	現金および現金同等物	(78,912.22)
販売会社報酬		(45,160,201.70)
	現金および現金同等物	(45,160,201.70)
分配金に係る源泉徴収税費用		0.00
	現金および現金同等物	0.00
宣言された分配金		(889,197,485.92)
	現金および現金同等物	(889,197,485.92)
FATCA費用		(109,344.76)
	現金および現金同等物	(109,344.76)
財務書類作成報酬		(221,214.11)
	現金および現金同等物	(221,214.11)
支払利息		(149,021.45)
	現金および現金同等物	(149,021.45)

利息に係る源泉徴収税費用		(10,090,420.38)
	現金および現金同等物	0.00
	社債	(10,090,420.38)
MLRO報酬未払金		(218,689.63)
	現金および現金同等物	(218,689.63)
管理会社報酬		(17,487,652.00)
	現金および現金同等物	(17,487,652.00)
管理報酬		(93,723,396.96)
	現金および現金同等物	(93,723,396.96)
購入未払利息費用		(15,777,567.62)
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	(15,777,567.62)
登録報酬費用		(426,143.62)
	現金および現金同等物	(426,143.62)
規制報告報酬		0.00
	現金および現金同等物	0.00
副保管報酬(費用)		(742,805.69)
	現金および現金同等物	(742,805.69)
副投資顧問報酬費用		(3,502,790.00)
	現金および現金同等物	(3,502,790.00)
受託報酬		(1,401,497.64)
	現金および現金同等物	(1,401,497.64)
新発銘柄以外への投資に係る実現および未実現損益		(17,389,534.52)
未実現為替差損益の増減		(358,404,067.25)
	現金および現金同等物	3,880,850.72
	社債	221,365,598.92
	先渡為替取引	(583,447,955.91)
	優先株式	(202,560.98)
未実現価格損益の増減		463,485,662.60
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	463,971,968.18
	優先株式	(486,305.58)
長期為替差損益		16,657,732.60
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	19,585,057.03
	優先株式	(2,927,324.43)
長期価格損益		41,123,535.34
	現金および現金同等物	42,219,800.03
	社債	(1,096,264.69)
988条費用		(3,610,263,159.76)
	現金および現金同等物	(54,511,699.74)
	社債	(224,276,982.93)
	先渡為替取引	(3,331,474,477.09)

988条収益		3,428,544,384.31
	現金および現金同等物	84,403,143.35
	社債	707,510,290.14
	先渡為替取引	2,636,630,950.82
短期為替差損益		(34,410.00)
	社債	(34,410.00)
短期価格損益		1,500,787.64
	現金および現金同等物	(0.00)
	社債	1,500,787.64
純利益 / 損失		(506,348,530.92)

[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

2025年8月31日現在

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					23,414,022,416.90	4,128,798,538.44	370,257,164.12	27,542,820,955.34	100.00%
現金 - ロング					698,417,167.01	-596,705.89	0.00	697,820,461.12	2.53%
現金および 現金同等物 豪ドル					698,417,167.01	-596,705.89	0.00	697,820,461.12	2.53%
豪ドル	AUD	134,892.22000	1.0000	134,892.22	12,955,957.33	6,775.28	0.00	12,962,732.61	0.05%
カナダドル					4,932.04	933.69	0.00	5,865.73	0.00%
カナダドル	CAD	54.85000	1.0000	54.85	4,932.04	933.69	0.00	5,865.73	0.00%
ユーロ					64,037,069.55	-35,705.28	0.00	64,001,364.27	0.23%
ユーロ	EUR	372,407.00000	1.0000	372,407.00	64,037,069.55	-35,705.28	0.00	64,001,364.27	0.23%
日本円					44,775,629.00	0.00	0.00	44,775,629.00	0.16%
日本円	JPY	44,775,629.00000	1.0000	44,775,629.00	44,775,629.00	0.00	0.00	44,775,629.00	0.16%
英ポンド					42,391,676.47	467,253.61	0.00	42,858,930.08	0.16%
英ポンド	GBP	216,057.79000	1.0000	216,057.79	42,391,676.47	467,253.61	0.00	42,858,930.08	0.16%
米ドル					534,251,902.62	-1,035,963.19	0.00	533,215,939.43	1.94%
米ドル	USD	3,631,642.70000	1.0000	3,631,642.70	534,251,902.62	-1,035,963.19	0.00	533,215,939.43	1.94%
現金 - ショート					-20,713,700.00	158,200.00	0.00	-20,555,500.00	-0.07%
現金および 現金同等物 米ドル					-20,713,700.00	158,200.00	0.00	-20,555,500.00	-0.07%
米ドル	USD	-140,000.00000	1.0000	-140,000.00	-20,713,700.00	158,200.00	0.00	-20,555,500.00	-0.07%
投資 - ロング					22,736,318,949.89	4,129,237,044.33	370,257,164.12	26,865,555,994.22	97.54%
社債					22,581,511,627.72	4,136,416,615.49	370,257,164.12	26,717,928,243.21	97.01%
ユーロ					9,623,125,157.16	2,279,484,272.48	166,994,041.13	11,902,609,429.64	43.21%
AGEAS FLT 07/02/49	BE0002644251	700,000.00000	99.1035	713,125.00	88,603,732.82	30,618,835.25	631,992.53	119,222,568.07	0.43%
AIA GROUP LTD FLT 09/09/33 SR: GMTN AROUNDTO WN	XS2356311139	1,300,000.00000	93.1476	1,304,647.50	170,273,198.24	37,833,582.62	1,912,198.22	208,106,780.86	0.76%
FINANCE SARL FLT PERP	XS2799494120	625,000.00000	104.1368	313,476.56	50,488,801.61	61,366,249.72	2,851,558.77	111,855,051.33	0.41%

## 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

2025年8月31日現在

## ン評価明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49 AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31 SR: EMTN	XS198970883 6	2,250,000.00000	99.6280	2,298,401.00	283,695,075.01	101,548,392.78	4,290,580.68	385,243,467.79	1.40%
AXA SA FLT PERP SR: EMTN	XS273765247 4	650,000.00000	106.4022	655,232.50	104,227,556.00	14,632,366.26	870,822.49	118,859,922.26	0.43%
BANCO SANTANDER SA FLT PERP	XS281732374 9	400,000.00000	107.2195	410,400.00	66,358,540.44	7,347,826.16	130,762.02	73,706,366.60	0.27%
BANQUE FED CRED MUTUEL 4.750% 11/10/31 SR: EMTN	FR001400LW N3	1,500,000.00000	106.7347	1,599,803.00	259,713,218.87	15,435,951.32	9,829,490.81	275,149,170.19	1.00%
BAWAG GROUP AG FLT 02/24/34 BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34 SR: EMTN	XS270762905 6	3,100,000.00000	109.6939	3,100,640.14	506,051,669.29	78,355,490.02	18,424,071.26	584,407,159.31	2.12%
BNP PARIBAS FLT 08/31/33 SR: EMTN	FR00140057U 9	2,300,000.00000	93.1890	2,297,355.00	295,992,596.61	72,359,967.18	3,449,179.56	368,352,563.79	1.34%
BNP PARIBAS FLT PERP	FR001400F2H 9	400,000.00000	109.9685	420,800.00	68,040,140.88	7,556,010.93	1,108,159.60	75,596,151.81	0.27%
CAIXABANK SA FLT 02/23/33 SR: EMTN	XS255897888 3	500,000.00000	106.8790	536,695.00	87,330,956.73	4,509,463.72	2,766,218.00	91,840,420.45	0.33%
CAIXABANK SA FLT 06/18/31 SR: EMTN	XS231011897 6	2,900,000.00000	98.9668	2,762,261.00	370,654,537.34	122,586,231.15	1,245,975.22	493,240,768.49	1.79%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.500% 03/15/38 COMMERZBANK AG FLT 10/05/33 SR: EMTN	XS178581325 1	2,481,000.00000	87.6517	2,353,025.16	341,022,145.11	32,708,365.63	4,906,305.50	373,730,510.74	1.36%
COOPERATIVE RABOBANK UA FLT 11/30/32 SR: GMTN	DE000C243Z4 9	3,500,000.00000	108.7326	3,531,415.00	559,227,818.34	94,804,325.86	36,597,064.09	654,032,144.20	2.37%
CPI PROPERTY GROUP SA 1.750% 01/14/30 SR: EMTN	XS252414355 4	1,300,000.00000	101.7284	1,297,933.00	177,460,473.49	49,817,253.21	6,475,245.48	227,277,726.70	0.83%
CPI PROPERTY GROUP SA 7.000% 05/07/29 SR: EMTN	XS243216265 4	700,000.00000	86.7838	513,200.00	86,352,340.65	18,049,450.22	1,315,071.81	104,401,790.87	0.38%
CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48 CREDIT AGRICOLE SA FLT 03/18/35 SR: EMTN	FR001597612 6	350,000.00000	107.0423	332,647.00	55,972,032.47	8,414,458.44	1,326,607.52	64,386,490.91	0.23%
	FR001331215 4	2,000,000.00000	98.3594	2,007,829.00	272,543,704.01	65,534,432.48	5,265,231.11	338,078,136.49	1.23%
	FR001400YAD 3	700,000.00000	101.4298	707,413.00	115,341,107.59	6,680,011.89	2,243,285.08	122,021,119.48	0.44%

## 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

2025年8月31日現在

## ン評価明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	FR001353399 9	2,000,000.00000	99.1805	1,917,390.00	285,386,530.71	55,513,937.27	2,540,519.18	340,900,467.98	1.24%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP SR: EMTN	FR001400N2U 2	200,000.00000	105.0136	202,100.00	32,678,023.94	3,416,977.43	412,834.37	36,095,001.37	0.13%
DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31 SR: EMTN	XS229913581 9	2,000,000.00000	99.0547	2,000,190.00	253,491,441.34	86,976,630.28	1,007,609.62	340,468,071.62	1.24%
DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	DE000DL19VU 0	2,100,000.00000	89.4710	1,896,154.00	258,168,803.91	64,734,902.94	2,637,559.44	322,903,706.85	1.17%
DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 01/15/32 ELM BV	XS223211542 3	1,000,000.00000	85.7309	990,170.00	124,200,604.00	23,135,277.44	1,068,819.55	147,335,881.44	0.53%
(HELVETIA SCHWEIZ) FLT 09/29/47 ERSTE GROUP BANK AG FLT 11/26/35 SR: EMTN	XS158789345 1	950,000.00000	100.2815	973,098.09	115,872,576.99	47,852,700.85	5,057,282.10	163,725,277.84	0.59%
GENERALI FLT 06/08/48 SR: EMTN	AT0000A3NRE 3	1,500,000.00000	99.1855	1,496,865.00	258,124,939.00	-2,436,750.17	102,408.92	255,688,188.83	0.93%
GROUPE ACM FLT 04/21/42	XS142877376 3	2,550,000.00000	105.4411	3,031,645.00	378,289,811.01	83,794,711.41	4,982,723.74	462,084,522.42	1.68%
HANNOVER RE FLT 10/09/39	FR001400614 4	2,900,000.00000	87.8341	2,540,966.00	351,430,526.24	86,326,118.76	3,309,173.62	437,756,645.00	1.59%
ING GROEP NV FLT 05/26/31 SR: EMTN	XS206335092 5	1,700,000.00000	91.9335	1,682,354.00	198,098,356.99	70,494,168.54	2,926,599.78	268,592,525.53	0.98%
ING GROEP NV FLT 06/09/32 SR: EMTN	XS217662117 0	1,200,000.00000	99.5876	1,198,056.00	141,564,503.00	63,815,300.42	1,152,630.07	205,379,803.42	0.75%
MAPFRE SA 2.875% 04/13/30	XS235075644 6	500,000.00000	96.6894	497,620.00	66,582,328.00	16,502,237.95	168,915.86	83,084,565.95	0.30%
MAPFRE SA FLT 03/31/47	ES022424410 5	700,000.00000	98.3270	693,420.00	93,697,233.36	24,591,124.84	1,317,131.76	118,288,358.20	0.43%
MUTUELLE ASSURANCE FLT 06/21/52	ES022424408 9	600,000.00000	101.7407	600,000.00	71,996,318.00	32,913,777.49	1,878,674.01	104,910,095.49	0.38%
NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32 SR: EMTN	FR0014003XZ 7	1,900,000.00000	86.8854	1,697,655.00	231,308,526.56	52,399,616.86	1,330,727.43	283,708,143.42	1.03%
PHOENIX GRP HLD PLC 4.375% 01/24/29 SR: EMTN	XS238295033 0	4,150,000.00000	96.4098	4,056,896.50	542,594,981.89	145,012,342.92	7,133,110.97	687,607,324.81	2.50%
RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	XS188100511 7	1,870,000.00000	103.5278	2,033,416.82	248,228,469.79	84,484,825.68	8,397,590.42	332,713,295.47	1.21%
	XS234824104 8	2,500,000.00000	95.8464	2,381,565.00	348,907,861.68	62,892,875.18	965,233.52	411,800,736.86	1.50%

## 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

2025年8月31日現在

## 明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
SAMPO OYJ FLT 09/03/52 SR: EMTN SOCIETE GENERALE	XS22266452 7 8	1,550,000.0000 0	90.9604	1,548,891.0 0	194,383,740.01	47,917,398.98	6,586,541.62	242,301,138.99	0.88%
FLT 06/30/31 SR: EMTN TALANX AG	FR0014002Q E 8	4,200,000.0000 0	98.3179	3,997,996.0 0	562,174,578.07	147,490,103.2 9	1,357,094.77	709,664,681.36	2.58%
FLT 12/01/42 UNIQA INSURANCE GROUP AG FLT 12/09/41	XS24112416 9 3	1,000,000.0000 0	88.6905	991,310.00	128,134,747.98	24,287,496.44	2,241,225.13	152,422,244.42	0.55%
	XS24183921 4 3	600,000.00000	89.3080	599,148.00	76,560,701.96	15,529,453.18	1,771,321.54	92,090,155.14	0.33%
英ポンド					3,422,395,747.4 4	711,186,631.9 4	59,921,081.6 2	4,133,582,379.3 8	15.01%
AVIVA PLC FLT 06/03/55	XS21813484 0 5	2,000,000.0000 0	83.7056	2,042,380.0 0	285,230,621.00	46,859,460.80	3,815,601.14	332,090,081.80	1.21%
AXA SA FLT PERP SR: eMTN BANCO SANTANDER SA FLT 10/04/32 SR: EMTN BARCLAYS PLC FLT PERP BNP PARIBAS FLT 05/24/31 SR: EMTN HSBC HOLDINGS PLC 6.000% 03/29/40 SR: EMTN LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31 M&G PLC FLT 10/20/51 NATIONAL AUSTRALIA BANK FLT 09/15/31 SR: GMTN NATIONWID E BLDG SOCIETY FLT 08/19/31 SR: EMTN NATWEST GROUP PLC FLT 11/28/31 SR: EMTN NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32 SR: EMTN	XS11345415 6 1	2,850,000.0000 0	99.8389	3,070,707.7 5	518,437,744.79	46,000,051.28	15,118,611.9 4	564,437,796.07	2.05%
	XS23935185 9 7	1,600,000.0000 0	94.9712	1,452,048.0 0	236,594,823.10	64,832,850.02	6,456,467.54	301,427,673.12	1.09%
	XS28133235 0 3	500,000.00000	105.1310	496,250.00	93,018,067.69	11,254,981.03	1,741,109.56	104,273,048.72	0.38%
	FR0014003N 1 0	1,000,000.0000 0	97.9325	997,690.00	153,807,644.00	40,458,900.48	1,065,208.45	194,266,544.48	0.71%
	XS04987683 1 5	800,000.00000	94.5314	1,017,096.0 0	141,259,280.00	8,756,618.94	4,017,357.58	150,015,898.94	0.54%
	XS23511664 2 1	4,350,000.0000 0	96.7953	3,866,811.5 0	663,857,453.91	171,389,287.2 0	3,556,752.72	835,246,741.11	3.03%
	XS18889202 7 6	1,250,000.0000 0	98.3396	1,373,600.0 0	188,771,192.00	55,071,533.43	5,030,333.53	243,842,725.43	0.89%
	XS23862874 1 6	1,200,000.0000 0	96.3038	1,200,000.0 0	182,332,560.00	46,910,502.23	1,846,322.17	229,243,062.23	0.83%
	XS23438515 1 0	1,100,000.0000 0	98.3010	1,100,242.0 0	169,641,846.00	44,855,459.04	171,213.60	214,497,305.04	0.78%
	XS23465162 5 0	500,000.00000	97.0340	500,000.00	76,971,853.00	19,270,330.80	533,302.40	96,242,183.80	0.35%
	XS23851226 3 0	3,200,000.0000 0	93.4353	2,738,344.0 0	479,761,167.95	113,344,572.5 5	2,311,040.24	593,105,740.50	2.15%

RL FINANCE BONDS NO3 6.125% 11/13/28	XS13197385 3 7	400,000.00000	103.1467	499,000.00	76,129,201.00	5,714,807.82	3,861,380.63	81,844,008.82	0.30%
RL FINANCE NO 4 PLC FLT 10/07/49	XS20619624 6 5	1,200,000.0000 0	81.0991	1,175,712.0 0	156,582,293.00	36,467,276.32	10,396,380.1 2	193,049,569.32	0.70%

## 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

2025年8月31日現在

## 明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通 貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比 率
米ドル					9,535,990,723.1 2	1,145,745,711.0 7	143,342,041.3 7	10,681,736,434.1 9	38.78 %
AIA GROUP LTD FLT PERP SR: GMTN BANCO BILBAO VIZCAYA ARG FLT 11/15/34 BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38 BANK OF AMERICA CORP FLT PERP CAPITAL ONE FINANCIAL CO FLT 02/01/34 CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39 COMMONWEAL TH BANK AUST 3.784% 03/14/32 SR: REGS DEUTSCHE BANK NY FLT 01/14/32 FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33 GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34 HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32 SR: REGS HARTFORD INSUR GRP INC/T FLT 02/12/47 SR: ICON HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39 SR: BKNT HSBC HOLDINGS PLC FLT PERP HUNTINGTON BANCSHARES FLT 05/17/33 INTESA SANPAOLO SPA FLT 06/01/32 INTESA SANPAOLO SPA FLT 11/21/33 SR: 144A	XS23282612 6 3 US05946KAN 1 9 US59023VAA 8 9 US06055HAH 66 US14040HCY 9 9 US172967EW 71 USQ2704MAH 18 US251526CF 4 7 US316773DF 4 7 US38143VAA 7 0 USY306AXAD 2 6 US416515BC 7 6 US4042Q1AD 94 US404280DT 3 3 US446150BA 1 8 US46115HBQ 92 US46115HBV 8 7	1,800,000.0000 0 1,600,000.0000 0 2,950,000.0000 0 1,950,000.0000 0 1,950,000.0000 0 2,230,000.0000 0 700,000.00000 1,700,000.0000 0 6,200,000.0000 0 3,450,000.0000 0 2,000,000.0000 0 1,090,000.0000 0 2,500,000.0000 0 1,900,000.0000 0 1,750,000.0000 0 1,050,000.0000 0 1,400,000.0000 0	98.8159 0 115.168 0 120.112 3 103.124 0 104.035 4 126.045 0 93.8194 93.4074 0 96.7190 96.7190 105.942 5 98.1159 98.1159 93.1907 0 116.661 3 105.571 6 99.9764 99.9764 93.5979 93.5979 116.878 1	1,806,300.0 0 1,600,000.0 0 4,374,083.0 0 1,950,000.0 0 1,858,428.0 0 3,098,418.0 0 640,388.59 1,762,713.0 0 5,853,572.0 0 4,319,030.3 2 2,000,000.0 0 1,043,675.0 0 3,080,345.0 0 1,911,789.1 6 1,750,000.0 0 940,569.00 940,569.00 1,596,912.0 0	199,243,925.00 61,911,597.03 2,834,456.63 240,800,000.00 29,752,665.60 5,401,300.22 496,152,227.99 24,094,638.63 9,883,871.55 520,246,866.62 1.89% 277,836,000.00 17,417,149.87 1,527,974.13 295,253,149.87 1.07% 270,670,746.06 27,191,679.34 1,341,618.94 297,862,425.40 1.08% 401,564,551.31 11,131,574.20 3,325,356.83 412,696,125.51 1.50% 80,456,389.25 15,968,844.58 1,793,307.50 96,425,233.83 0.35% 197,265,211.83 35,881,868.95 1,189,314.31 233,147,080.78 0.85% 805,536,058.11 74,911,688.81 13,708,458.88 880,447,746.92 3.20% 481,492,676.23 55,155,185.99 1,339,181.65 536,647,862.22 1.95% 227,870,000.00 60,247,281.62 716,620.20 288,117,281.62 1.05% 117,643,047.25 31,498,666.25 439,973.90 149,141,713.50 0.54% 353,538,974.10 74,680,836.80 3,211,796.88 428,219,810.90 1.55% 260,806,176.59 33,704,137.15 10,724,750.56 294,510,313.74 1.07% 228,208,750.00 28,674,233.54 3,692,631.42 256,882,983.54 0.93% 135,441,936.00 8,854,405.68 1,599,997.30 144,296,341.68 0.52% 248,418,653.04 -8,169,874.59 4,662,398.51 240,248,778.45 0.87%				

JPMORGAN  
CHASE & CO  
FLT  
05/13/31

US46647PBP	3,400,000.0000	93.3428	3,400,000.00	360,570,014.99	105,402,009.59	4,385,959.66	465,972,024.58	1.69%
0	0		0					
9								

## 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

2025年8月31日現在

## 明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比 率
LIBERTY MUTUAL GROUP INC FLT 12/15/51 SR:144A LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP METLIFE INC FLT 03/15/55 SR:G MITSUI SUMITOMO INSURANC FLT PERP SR:REGS NEW YORK LIFE INSURANCE 6.750% 11/15/39 SR:144A SANTANDER UK GROUP HLDGS 5.625% 09/15/45 SR:REGS STANDARD CHARTERED PLC 5.300% 01/09/43 SR:REGS STATE STREET CORP FLT PERP STATE STREET CORP FLT PERP SR:I SYNOVUS BANK GA FLT 10/29/30 SR:* UBS GROUP AG FLT 08/12/33 SR:144A UBS GROUP AG FLT PERP SR:144A ZIONS BANCORP NA FLT 11/19/35 ZURICH FINANCE IRELAND FLT 04/19/51 SR:EMTN ZURICH FINANCE IRELAND FLT 05/02/52 SR:EMTN	US53079EBM 57	2,016,000.00000	98.0431	1,847,365.00	226,817,222.32	63,389,480.36	2,543,743.13	290,206,702.68	1.05%
	US53944YAV5 6	1,500,000.00000	107.3696	1,465,250.00	203,526,423.75	32,941,765.12	3,083,325.00	236,468,188.87	0.86%
	US59156RCQ9 2	4,400,000.00000	104.2547	4,400,000.00	648,956,000.00	24,560,703.01	19,030,069.82	673,516,703.01	2.45%
	USJ4517MAA 74	3,100,000.00000	100.3335	3,100,000.00	343,774,503.99	112,900,946.27	10,889,643.19	456,675,450.26	1.66%
	US64952GAF5 4	1,500,000.00000	112.7418	1,722,315.00	254,635,661.18	-6,335,895.36	4,335,925.78	248,299,765.82	0.90%
	XS129135271 1	1,500,000.00000	87.8730	1,794,255.00	194,703,578.01	-1,174,301.66	5,677,998.05	193,529,276.35	0.70%
	XS087526739 4	1,150,000.00000	92.9249	1,284,964.00	139,193,730.00	17,708,718.40	1,267,772.70	156,902,448.40	0.57%
	US857477CS0 3	2,050,000.00000	101.9798	2,049,811.00	314,800,670.84	-7,850,545.84	4,044,569.93	306,950,125.00	1.11%
	US857477CH4 8	750,000.00000	103.5747	753,750.00	111,245,962.50	2,809,158.41	1,537,074.22	114,055,120.91	0.41%
	US87164DSE1 2	1,750,000.00000	99.2899	1,750,000.00	183,408,741.01	71,710,451.42	3,454,465.97	255,119,192.43	0.93%
	US225401AZ1 5	5,212,000.00000	109.4521	5,404,702.84	802,149,759.75	35,434,362.10	2,501,225.83	837,584,121.85	3.04%
	US902613BE7 4	550,000.00000	117.4136	558,050.00	84,218,647.50	10,597,253.66	2,220,167.34	94,815,901.16	0.34%
	US98971DAC4 8	1,900,000.00000	104.7598	1,869,315.00	269,181,360.00	23,064,379.27	5,334,602.51	292,245,739.27	1.06%
	XS228317756 1	1,800,000.00000	89.9430	1,800,000.00	187,559,999.99	50,145,857.56	2,885,111.25	237,705,857.55	0.86%
	XS241697819 0	1,637,000.00000	89.8006	1,631,106.80	188,303,124.53	27,534,789.31	2,757,377.58	215,837,913.84	0.78%
優先株式					154,807,322.17	-7,179,571.16	0.00	147,627,751.01	0.54%
米ドル					154,807,322.17	-7,179,571.16	0.00	147,627,751.01	0.54%

CITIGROUP  
CAPITAL  
XIII FLT  
10/30/40

US173080201 4	33,684.00000	29.8500	1,019,588.53	154,807,322.17	-7,179,571.16	0.00	147,627,751.01	0.54%
------------------	--------------	---------	--------------	----------------	---------------	------	----------------	-------

## 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

2025年8月31日現在

## 明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収 利息	帳簿上の時価	投資比率
債権投資					28,276,157,274.92	300,712,551.29	0.00	28,576,869,826.21	100.00%
設定払込未収金					100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	0.35%
現金および 現金同等物					100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	0.35%
日本円					100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	0.35%
日本円	JPY	100,000,000.00000	1.0000	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	0.35%
先渡為替取引 未収金					28,175,866,449.80	300,719,556.34	0.00	28,476,586,006.14	99.65%
先渡為替取引 未収金					28,175,866,449.80	300,719,556.34	0.00	28,476,586,006.14	99.65%
豪ドル					2,044,556,601.54	12,935,199.87	0.00	2,057,491,801.41	7.20%
AUD.FWD	AUD.FWD	21,435,571.44000	1.0000	21,435,571.44	2,044,556,601.54	12,935,199.87	0.00	2,057,491,801.41	7.20%
ブラジル・ レアル					873,121,243.00	5,499,936.22	0.00	878,621,179.22	3.07%
BRL.FWD	BRL.FWD	32,636,418.75000	1.0000	32,636,418.75	873,121,243.00	5,499,936.22	0.00	878,621,179.22	3.07%
ユーロ					966,867,126.34	22,128,220.56	0.00	988,995,346.90	3.46%
EUR.FWD	EUR.FWD	5,757,832.95000	1.0000	5,757,832.95	966,867,126.34	22,128,220.56	0.00	988,995,346.90	3.46%
日本円					5,213,078,753.00	0.00	0.00	5,213,078,753.00	18.24%
JPY.FWD	JPY.FWD	5,213,078,753.00000	1.0000	5,213,078,753.00	5,213,078,753.00	0.00	0.00	5,213,078,753.00	18.24%
メキシコ・ ペソ					361,679,551.81	882,249.23	0.00	362,561,801.04	1.27%
MXN.FWD	MXN.FWD	46,167,525.82000	1.0000	46,167,525.82	361,679,551.81	882,249.23	0.00	362,561,801.04	1.27%
新トルコ・ リラ					312,040,262.91	-8,724,154.68	0.00	303,316,108.23	1.06%
TRY.FWD	TRY.FWD	86,066,352.96000	1.0000	86,066,352.96	312,040,262.91	-8,724,154.68	0.00	303,316,108.23	1.06%
英ポンド					235,247,520.00	2,514,443.74	0.00	237,761,963.74	0.83%
GBP.FWD	GBP.FWD	1,200,000.00000	1.0000	1,200,000.00	235,247,520.00	2,514,443.74	0.00	237,761,963.74	0.83%
南アフリ カ・ランド					11,409,928.56	92,071.25	0.00	11,501,999.81	0.04%
ZAR.FWD	ZAR.FWD	1,389,241.70000	1.0000	1,389,241.70	11,409,928.56	92,071.25	0.00	11,501,999.81	0.04%
米ドル					18,157,865,462.64	265,391,590.15	0.00	18,423,257,052.79	64.47%
USD.FWD	USD.FWD	125,641,166.04000	1.0000	125,641,166.04	18,157,865,462.64	265,391,590.15	0.00	18,423,257,052.79	64.47%

## 東京海上ストラテジック・トラスト -

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

## 投資ポジション

2025年8月31日現在

## ン評価明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
未収金					0.00	-7,005.05	0.00	-7,005.05	0.00%
現金および現金 同等物					0.00	-7,005.05	0.00	-7,005.05	0.00%
米ドル					0.00	-7,005.05	0.00	-7,005.05	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-7,005.05	0.00	-7,005.05	0.00%
前払登録報酬					290,825.12	0.00	0.00	290,825.12	0.00%
現金および現金 同等物					290,825.12	0.00	0.00	290,825.12	0.00%
米ドル					290,825.12	0.00	0.00	290,825.12	0.00%
米ドル	USD	1,933.05000	1.0000	1,933.05	290,825.12	0.00	0.00	290,825.12	0.00%
債務投資					-	-567,703,947.05	0.00	-	100.00%
					28,262,010,059.38			28,829,714,006.43	
AIFMD報酬未払金					-207,211.64	0.00	0.00	-207,211.64	0.00%
現金および現金 同等物					-207,211.64	0.00	0.00	-207,211.64	0.00%
ユーロ					-207,211.64	0.00	0.00	-207,211.64	0.00%
ユーロ	EUR	-1,239.84000	1.0000	-1,239.84	-207,211.64	0.00	0.00	-207,211.64	0.00%
未払監査報酬					-2,883,758.31	0.00	0.00	-2,883,758.31	0.01%
現金および現金 同等物					-2,883,758.31	0.00	0.00	-2,883,758.31	0.01%
米ドル					-2,883,758.31	0.00	0.00	-2,883,758.31	0.01%
米ドル	USD	-19,135.06000	1.0000	-19,135.06	-2,883,758.31	0.00	0.00	-2,883,758.31	0.01%
代行協会員報酬 未払金					-1,263,819.85	0.00	0.00	-1,263,819.85	0.00%
現金および現金 同等物					-1,263,819.85	0.00	0.00	-1,263,819.85	0.00%
豪ドル					-98,723.81	0.00	0.00	-98,723.81	0.00%
豪ドル	AUD	-1,029.39000	1.0000	-1,029.39	-98,723.81	0.00	0.00	-98,723.81	0.00%
米ドル					-1,165,096.04	0.00	0.00	-1,165,096.04	0.00%
米ドル	USD	-7,908.51000	1.0000	-7,908.51	-1,165,096.04	0.00	0.00	-1,165,096.04	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

2025年8月31日現在

## 評価明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損 益	未収利息	帳簿上の時価	投資比 率
監査報酬未払金					-6,028,861.96	0.00	0.00	-6,028,861.96	0.02%
現金および現金同 等物					-6,028,861.96	0.00	0.00	-6,028,861.96	0.02%
ユーロ					-6,028,861.96	0.00	0.00	-6,028,861.96	0.02%
ユーロ	EUR	-37,110.43000	1.0000	-37,110.43	-6,028,861.96	0.00	0.00	-6,028,861.96	0.02%
設定払込未払金					-12,000,000.00	0.00	0.00	-12,000,000.00	0.04%
現金および現金同 等物					-12,000,000.00	0.00	0.00	-12,000,000.00	0.04%
日本円					-12,000,000.00	0.00	0.00	-12,000,000.00	0.04%
日本円	JPY	-12,000,000.00000	1.0000	-12,000,000.00	-12,000,000.00	0.00	0.00	-12,000,000.00	0.04%
販売会社報酬未払金					-14,940,483.88	0.00	0.00	-14,940,483.88	0.05%
現金および現金同 等物					-14,940,483.88	0.00	0.00	-14,940,483.88	0.05%
豪ドル					-1,122,464.86	0.00	0.00	-1,122,464.86	0.00%
豪ドル	AUD	-11,697.28000	1.0000	-11,697.28	-1,122,464.86	0.00	0.00	-1,122,464.86	0.00%
米ドル					-13,818,019.02	0.00	0.00	-13,818,019.02	0.05%
米ドル	USD	-93,794.79000	1.0000	-93,794.79	-13,818,019.02	0.00	0.00	-13,818,019.02	0.05%
FATCA報酬未払金					-36,069.04	0.00	0.00	-36,069.04	0.00%
現金および現金同 等物					-36,069.04	0.00	0.00	-36,069.04	0.00%
米ドル					-36,069.04	0.00	0.00	-36,069.04	0.00%
米ドル	USD	-244.77000	1.0000	-244.77	-36,069.04	0.00	0.00	-36,069.04	0.00%
財務書類作成報酬未 払金					-160,121.23	0.00	0.00	-160,121.23	0.00%
現金および現金同 等物					-160,121.23	0.00	0.00	-160,121.23	0.00%
ユーロ					-160,121.23	0.00	0.00	-160,121.23	0.00%
ユーロ	EUR	-951.81000	1.0000	-951.81	-160,121.23	0.00	0.00	-160,121.23	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

2025年8月31日現在

## 明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収 利息	帳簿上の時価	投資比 率
先渡為替取引 未払金					-	567,531,232.92	0.00	-	99.70%
					28,175,866,449.80			28,743,397,682.72	
先渡為替取引 未払金					-	567,531,232.92	0.00	-	99.70%
					28,175,866,449.80			28,743,397,682.72	
豪ドル					-156,052,897.09	-442,517.84	0.00	-156,495,414.93	0.54%
AUD.FWD	AUD.FWD	-1,630,279.42000	1.0000	-1,630,279.42	-156,052,897.09	-442,517.84	0.00	-156,495,414.93	0.54%
ブラジル・ レアル					-27,889,019.21	-190,099.92	0.00	-28,079,119.13	0.10%
BRL.FWD	BRL.FWD	-1,043,000.00000	1.0000	-1,043,000.00	-27,889,019.21	-190,099.92	0.00	-28,079,119.13	0.10%
ユーロ					-	-	0.00	-	45.26%
					12,521,969,927.63	525,278,026.57		13,047,247,954.20	
EUR.FWD	EUR.FWD	-75,959,572.41000	1.0000	-75,959,572.41	12,521,969,927.63	525,278,026.57	0.00	13,047,247,954.20	45.26%
日本円					-1,049,795,143.00	0.00	0.00	-1,049,795,143.00	3.64%
JPY.FWD	JPY.FWD	1,049,795,143.00000	1.0000	1,049,795,143.00	-1,049,795,143.00	0.00	0.00	-1,049,795,143.00	3.64%
英ポンド					-4,402,158,475.71	-70,048,856.37	0.00	-4,472,207,332.08	15.51%
GBP.FWD	GBP.FWD	-22,571,519.49000	1.0000	-22,571,519.49	-4,402,158,475.71	-70,048,856.37	0.00	-4,472,207,332.08	15.51%
米ドル					-	28,428,267.78	0.00	-9,989,572,719.38	34.65%
					10,018,000,987.16	28,428,267.78		-9,989,572,719.38	34.65%
USD.FWD	USD.FWD	-68,131,551.42000	1.0000	-68,131,551.42	10,018,000,987.16	28,428,267.78	0.00	-9,989,572,719.38	34.65%
MLRO報酬未払 金					-73,322.01	0.00	0.00	-73,322.01	0.00%
現金および 現金同等物					-73,322.01	0.00	0.00	-73,322.01	0.00%
米ドル					-73,322.01	0.00	0.00	-73,322.01	0.00%
米ドル	USD	-497.76000	1.0000	-497.76	-73,322.01	0.00	0.00	-73,322.01	0.00%
管理会社報酬 未払金					-14,435,495.00	0.00	0.00	-14,435,495.00	0.05%
現金および 現金同等物					-14,435,495.00	0.00	0.00	-14,435,495.00	0.05%
日本円					-14,435,495.00	0.00	0.00	-14,435,495.00	0.05%
日本円	JPY	-14,435,495.00000	1.0000	-14,435,495.00	-14,435,495.00	0.00	0.00	-14,435,495.00	0.05%

## 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

2025年8月31日現在

## 価明細表

種類	投資ID	数量	価額 (現地 通貨)	取得原価 (現地通貨)	帳簿上の 取得原価	帳簿上の 未実現損益	未収利息	帳簿上の時価	投資比率
管理報酬 未払金					-30,769,201.40	0.00	0.00	-30,769,201.40	0.11%
現金およ び現金同 等物					-30,769,201.40	0.00	0.00	-30,769,201.40	0.11%
豪ドル					-1,508,614.42	0.00	0.00	-1,508,614.42	0.01%
豪ドル	AUD	-15,721.37000	1.0000	-15,721.37	-1,508,614.42	0.00	0.00	-1,508,614.42	0.01%
日本円					-10,688,988.00	0.00	0.00	-10,688,988.00	0.04%
日本円	JPY	10,688,988.00000	1.0000	10,688,988.00	-10,688,988.00	0.00	0.00	-10,688,988.00	0.04%
米ドル					-18,571,598.98	0.00	0.00	-18,571,598.98	0.06%
米ドル	USD	-126,061.43000	1.0000	-126,061.43	-18,571,598.98	0.00	0.00	-18,571,598.98	0.06%
未払金					0.00	-172,714.13	0.00	-172,714.13	0.00%
現金およ び現金同 等物					0.00	-172,714.13	0.00	-172,714.13	0.00%
豪ドル					0.00	-3,967.13	0.00	-3,967.13	0.00%
豪ドル	AUD	0.00000	NA	0.00	0.00	-3,967.13	0.00	-3,967.13	0.00%
ユーロ					0.00	-358,207.69	0.00	-358,207.69	0.00%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	-358,207.69	0.00	-358,207.69	0.00%
米ドル					0.00	189,460.69	0.00	189,460.69	0.00%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	189,460.69	0.00	189,460.69	0.00%
副投資顧 問報酬未 払金					-2,892,361.00	0.00	0.00	-2,892,361.00	0.01%
現金およ び現金同 等物					-2,892,361.00	0.00	0.00	-2,892,361.00	0.01%
日本円					-2,892,361.00	0.00	0.00	-2,892,361.00	0.01%
日本円	JPY	-2,892,361.00000	1.0000	-2,892,361.00	-2,892,361.00	0.00	0.00	-2,892,361.00	0.01%
受託報酬 未払金					-452,904.26	0.00	0.00	-452,904.26	0.00%
現金およ び現金同 等物					-452,904.26	0.00	0.00	-452,904.26	0.00%
米ドル					-452,904.26	0.00	0.00	-452,904.26	0.00%
米ドル	USD	-3,073.20000	1.0000	-3,073.20	-452,904.26	0.00	0.00	-452,904.26	0.00%
報告金額合 計:					23,428,169,632.44	3,861,807,142.68	370,257,164.12	27,289,976,775.12	100.00%

[次へ](#)

## 4 管理会社の概況

### (1) 資本金の額(2025年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約279億円)  
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、2025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	15	3,273,462,920.62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、2025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=148.88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)

2025年6月30日現在

(単位:米ドル)

## 資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	7,073,867,940.71	1,053,157,459
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	5,286,976,523.82	787,125,065
040	その他の要求払預金	1,786,891,416.89	266,032,394
050	売買目的で保有される金融資産	7,314,646.15	1,089,005
060	デリバティブ	7,314,646.15	1,089,005
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		
142	持分証券		
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	2,676,833,909.74	398,527,032
182	債務証券	200,121,997.10	29,794,163
183	ローンおよび貸付金	2,476,711,912.64	368,732,870
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	3,535,383.85	526,348
280	有形固定資産	3,535,383.85	526,348
290	投資不動産		
300	無形資産	3,854,946.40	573,924
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,854,946.40	573,924
330	税金資産	205,693.19	30,624
340	現行税金資産	54,693.19	8,143
350	繰延税金資産	151,000.00	22,481
360	その他の資産	28,834,681.42	4,292,907
370	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
380	資産合計	9,794,447,201.45	1,458,197,299

## 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)

2025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	45,284,888.19	6,742,014
020	デリバティブ	45,284,888.19	6,742,014
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債		
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	8,877,059,683.25	1,321,616,646
120	預金	8,874,159,320.75	1,321,184,840
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	2,900,362.50	431,806
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	19,943,130.78	2,969,133
250	現行税金負債	19,943,130.78	2,969,133
260	繰延税金負債		
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	31,363,057.90	4,669,332
290	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
300	負債合計	8,973,650,760.12	1,335,997,125

## 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)

2025年6月30日現在

(単位:米ドル)

## 資本

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	資本	187,117,965.90	27,858,123
020	払込資本	187,117,965.90	27,858,123
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	311,172.00	46,327
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	577,902,940.12	86,038,190
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	577,902,940.12	86,038,190
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	55,464,363.31	8,257,534

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	820,796,441.33	122,200,174
310	資本および負債合計	9,794,447,201.45	1,458,197,299

## (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

2025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	163,277,168.12	24,308,705
020	売買目的で保有される金融資産	33,629,592.98	5,006,774
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	121,674,591.62	18,114,913
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	7,972,659.04	1,186,969
085	負債に係る利息収益	324.48	48
090	(支払利息)	97,367,308.15	14,496,045
100	(売買目的で保有される金融負債)	530,889.77	79,039
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)	96,768,975.69	14,406,965
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	22,795.79	3,394
145	(資産に係る支払利息)	44,646.90	6,647
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、合弁会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	58,175,220.51	8,661,127
210	(支払手数料)	19,516,151.75	2,905,565
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	2,710,980.89	403,611
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、合弁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	2,497,419.28	371,816

米ドル

千円

		米ドル	千円
350	(その他の事業費用)	2,589,674.00	385,551
355	事業収益合計、純額	107,187,654.90	15,958,098
360	(管理費用)	32,206,480.57	4,794,901
370	(従業員費用)	15,342,379.97	2,284,174
380	(その他の管理費用)	16,864,100.60	2,510,727
385	(破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金)	2,330.43	347
390	(減価償却)	1,480,506.43	220,418
400	(有形固定資産)	714,137.26	106,321
410	(投資不動産)		
420	(その他の無形資産)	766,369.17	114,097
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)	40,210.64	5,987
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)	40,210.64	5,987
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	73,458,126.83	10,936,446
620	(継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入)	17,993,763.52	2,678,912
630	継続事業からの税引後利益または(-)損失	55,464,363.31	8,257,534
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	55,464,363.31	8,257,534
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	55,464,363.31	8,257,534

## 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

2025年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	当期利益または(-)損失	55,464,363.31	8,257,534
020	その他の包括利益		
030	損益に再分類されることがない項目		
040	有形固定資産		
050	無形固定資産		
060	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		
070	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
080	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		
081	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		
083	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		
084	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)		
085	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)		
086	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		
090	再分類されることがない項目に関する法人税等		
100	損益に再分類されることがある項目		
110	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
120	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
130	損益に振替		
140	その他の再分類		
150	外貨換算		
160	持分に帰属する為替差益または(-)差損		
170	損益に振替		
180	その他の再分類		
190	キャッシュ・フロー・ヘッジ〔有効部分〕		
200	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
210	損益に振替		
220	ヘッジ項目の当初帳簿価への振替		
230	その他の再分類		
231	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
232	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
233	損益に振替		
234	その他の再分類		
241	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		
251	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
261	損益に振替		
270	その他の再分類		
280	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
290	持分に帰属する評価益または(-)評価損		
300	損益に振替		
310	その他の再分類		

米ドル

千円

		米ドル	千円
320	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		
330	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		
340	当期包括利益合計	55,464,363.31	8,257,534
350	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
360	親会社株主に帰属する金額	55,464,363.31	8,257,534

[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 (2025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 (2025年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約279億円)

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、2025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=148.88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

2025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

2025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

(2025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	6,412,000	153.90	986,835,046	157.19	1,007,894,245	3.61
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	137.87	854,791,184	3.06
3	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	190.33	827,934,354	2.96
4	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	166.27	698,329,560	2.50
5	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	162.88	675,932,841	2.42
6	METLIFE INC FLT 03/15/55	米国	社債	6.350 (2035年3月 以降変動金利)	2055/3/15	4,400,000	147.49	648,956,000	148.40	652,972,289	2.34
7	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	3,500,000	159.78	559,227,818	185.27	648,448,850	2.32
8	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	183.81	588,196,757	2.10
9	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	166.29	582,008,953	2.08
10	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	185.61	575,401,439	2.06
11	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	198.19	564,849,174	2.02
12	GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	米国	社債	6.345	2034/2/15	3,450,000	139.56	481,492,676	150.14	517,978,578	1.85
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	172.39	508,538,254	1.82
14	CAIXABANK SA FLT 06/18/31	スペイ 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	167.23	484,972,431	1.73
15	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	133.52	453,982,549	1.62
16	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	177.33	452,189,367	1.62

	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 INSURANCE 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	143.31	444,261,655	1.59
18	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	148.27	429,987,186	1.54
19	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	165.75	414,375,691	1.48
20	CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	米国	社債	8.125	2039/7/15	2,230,000	180.07	401,564,551	181.90	405,642,267	1.45
21	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	160.94	402,354,565	1.44
22	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	144.45	382,779,250	1.37
23	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	126.56	379,686,567	1.36
24	ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	オラン ダ	社債	3.375 (2029年5月 以降変動金利)	2049/5/2	2,250,000	126.09	283,695,075	167.27	376,360,757	1.35
25	CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.500% 03/15/38	米国	社債	2.500	2038/3/15	2,481,000	137.45	341,022,145	147.86	366,846,038	1.31
26	BNP PARIBAS FLT 08/31/33	フラン ス	社債	0.875 (2028年8月 以降変動金利)	2033/8/31	2,300,000	128.69	295,992,597	157.76	362,852,076	1.30
27	CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	フラン ス	社債	4.000	永久債	2,000,000	142.69	285,386,531	167.36	334,717,843	1.20
28	DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31	デン マーク	社債	1.000 (2026年5月 以降変動金利)	2031/5/15	2,000,000	126.75	253,491,441	167.30	334,592,846	1.20
29	AVIVA PLC FLT 06/03/55	英国	社債	4.000 (2035年6月 以降変動金利)	2055/6/3	2,000,000	142.62	285,230,621	166.76	333,523,022	1.19
30	CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	フラン ス	社債	2.625 (2028年1月 以降変動金利)	2048/1/29	2,000,000	136.27	272,543,704	166.20	332,395,085	1.19

## 投資不動産物件

該当事項なし。(2025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。(2025年6月末日現在)

&lt; 訂正後 &gt;

## 投資有価証券の主要銘柄

(2025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 FLT 08/12/33	スイス	社債	6.537 (2032年8月 以降変動金利)	2033/8/12	5,212,000	153.90	802,149,760	162.94	849,267,778	3.12
2	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	193.26	840,697,638	3.09
3	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	171.10	718,638,275	2.64
4	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	167.69	695,893,096	2.55
5	METLIFE INC FLT 03/15/55	米国	社債	6.350 (2035年3月 以降変動金利)	2055/3/15	4,400,000	147.49	648,956,000	156.95	690,562,406	2.54
6	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	3,500,000	159.78	559,227,818	189.05	661,668,251	2.43
7	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	171.44	600,048,963	2.20
8	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	186.39	596,434,729	2.19
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	198.56	565,896,561	2.08
10	GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	米国	社債	6.345	2034/2/15	3,450,000	139.56	481,492,676	157.78	544,328,648	2.00
11	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	180.09	531,256,477	1.95
12	CAIXABANK SA FLT 06/18/31	スペイ 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	172.01	498,838,773	1.83
13	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	3,400,000	129.93	441,745,580	143.90	489,260,840	1.80
14	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	2,500,000	163.24	408,106,185	190.66	476,637,613	1.75
15	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	138.33	470,336,100	1.73
16	MITSUMI SUMITOMO INSURANCE 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	150.33	466,027,697	1.71
17	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	182.68	465,842,788	1.71

	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	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	153.22	444,335,017	1.63
19	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	174.23	435,580,662	1.60
20	CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	米国	社債	8.125	2039/7/15	2,230,000	180.07	401,564,551	189.23	421,981,092	1.55
21	RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	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	166.98	417,447,996	1.53
22	COMERICA INC FLT 01/30/30	米国	社債	5.982 (2029年1月 以降変動金利)	2030/1/30	2,600,000	154.35	401,319,074	153.67	399,553,388	1.47
23	ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	オランダ	社債	3.375 (2029年5月 以降変動金利)	2049/5/2	2,250,000	126.09	283,695,075	173.50	390,366,413	1.43
24	BNP PARIBAS FLT 08/31/33	フランス	社債	0.875 (2028年8月 以降変動金利)	2033/8/31	2,300,000	128.69	295,992,597	162.35	373,395,126	1.37
25	CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	フランス	社債	4.000	永久債	2,000,000	142.69	285,386,531	172.71	345,424,315	1.27
26	DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31	デン マーク	社債	1.000 (2026年5月 以降変動金利)	2031/5/15	2,000,000	126.75	253,491,441	172.24	344,484,026	1.26
27	CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	フランス	社債	2.625 (2028年1月 以降変動金利)	2048/1/29	2,000,000	136.27	272,543,704	170.92	341,839,361	1.25
28	AVIVA PLC FLT 06/03/55	英国	社債	4.000 (2035年6月 以降変動金利)	2055/6/3	2,000,000	142.62	285,230,621	167.86	335,724,125	1.23
29	DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	ドイツ	社債	1.375 (2031年2月 以降変動金利)	2032/2/17	2,100,000	122.94	258,168,804	156.43	328,507,708	1.21
30	BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34	ベル ギー	社債	1.250 (2029年4月 以降変動金利)	2034/4/6	2,000,000	129.64	259,281,359	162.17	324,346,367	1.19

## 投資不動産物件

該当事項なし。(2025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。(2025年9月末日現在)