

【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】 平成26年11月28日

【発行者名】 三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ
(Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.)

【代表者の役職氏名】 マネージング・ディレクター 磯村 尚賢

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 白川 剛士

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

【電話番号】 03(6212)8316

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

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
米ドル建 米ドルヘッジクラス：
20億アメリカ合衆国ドル（約2,027億2,000万円）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1,910億円）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、平成26年6月
30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値
(1米ドル=101.36円および1豪ドル=95.50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、平成26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。）の関係情報を新たな情報により追加・訂正するため、また記載事項のうち訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、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		更新
5 その他	(4) 訴訟事件その他の重要事項	4 管理会社の概況	(3) その他	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

（平成26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	22,899,611,731	19.78
	英国	20,759,627,918	17.93
	フランス	14,604,701,991	12.62
	オランダ	10,863,102,565	9.38
	日本	10,188,946,803	8.80
	ノルウェー	3,782,073,222	3.27
	メキシコ	3,767,110,859	3.25
	デンマーク	3,655,985,485	3.16
	ブラジル	3,304,445,134	2.85
	スイス	2,592,252,185	2.24
	ケイマン諸島	2,584,322,076	2.23
	アイルランド	2,190,982,552	1.89
	ルクセンブルグ	2,122,119,714	1.83
	ペルー	1,959,089,766	1.69
	ガーンジー	1,632,173,786	1.41
	スウェーデン	1,569,431,560	1.36
	ドイツ	1,303,306,473	1.13
	ジャージー	1,157,734,211	1.00
	小計	110,937,018,031	95.84
	現金・その他の資産 （負債控除後）	4,813,571,617	4.16
合計（純資産総額）		115,750,589,648	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。以下同じ。

（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、平成26年9月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝109.45円および1豪ドル＝95.19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

平成26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
平成25年10月末日	365,254,830.23	39,977,141	0.010031	1.0979
11月末日	366,105,924.67	40,070,293	0.009994	1.0938
12月末日	343,003,429.19	37,541,725	0.009965	1.0907
平成26年1月末日	340,521,383.11	37,270,065	0.010035	1.0983
2月末日	333,345,774.54	36,484,695	0.010117	1.1073
3月末日	324,168,290.40	35,480,219	0.010087	1.1040
4月末日	316,147,063.83	34,602,296	0.010144	1.1103
5月末日	308,204,321.45	33,732,963	0.010221	1.1187
6月末日	300,977,610.04	32,941,999	0.010210	1.1175
7月末日	296,110,558.12	32,409,301	0.010151	1.1110
8月末日	290,996,618.74	31,849,580	0.010182	1.1144
9月末日	278,232,347.31	30,452,530	0.010042	1.0991

< 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス >

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
平成25年10月末日	90,715,374.88	8,635,197	0.009867	0.9392
11月末日	92,920,744.47	8,845,126	0.009810	0.9338
12月末日	88,888,878.45	8,461,332	0.009752	0.9283
平成26年1月末日	92,246,278.39	8,780,923	0.009823	0.9351
2月末日	90,319,684.98	8,597,531	0.009880	0.9405
3月末日	87,454,306.08	8,324,775	0.009838	0.9365
4月末日	84,711,388.40	8,063,677	0.009870	0.9395
5月末日	86,885,045.32	8,270,587	0.009928	0.9450
6月末日	90,074,562.86	8,574,198	0.009898	0.9422
7月末日	89,481,354.28	8,517,730	0.009830	0.9357
8月末日	91,595,244.97	8,718,951	0.009846	0.9372
9月末日	91,495,346.78	8,709,442	0.009689	0.9223

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2012年12月13日～2014年9月30日）



分配の推移

平成26年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成25年10月1日～平成26年9月末日	0.000540	0.0591

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
平成25年10月1日～平成26年9月末日	0.000960	0.0914

<参考情報>

分配の推移（2014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1会計年度（2012年12月13日～2013年2月28日）	0.000045
第2会計年度（2013年3月1日～2014年2月28日）	0.000540
2014年5月	0.000045
2014年6月	0.000045
2014年7月	0.000045
2014年8月	0.000045
2014年9月	0.000045
直近1年間累計	0.000540
設定来累計	0.000900

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1会計年度（2012年12月13日～2013年2月28日）	0.000080
第2会計年度（2013年3月1日～2014年2月28日）	0.000960
2014年5月	0.000080
2014年6月	0.000080
2014年7月	0.000080
2014年8月	0.000080
2014年9月	0.000080
直近1年間累計	0.000960
設定来累計	0.001600

収益率の推移

平成26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）
平成25年10月1日～平成26年9月末日	7.67%

（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）
平成25年10月1日～平成26年9月末日	9.94%

（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

<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、2014年については2014年9月末日における課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

b＝当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格（ただし、2012年の場合は当初発行価格（米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券は1口当たり0.01米ドル、豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券は1口当たり0.01豪ドル））

（注2）2012年は12月13日（運用開始日）から12月末日までの収益率である。2014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

平成26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平成26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
平成25年10月1日～ 平成26年9月末日	10,691,168,662 (10,691,168,662)	18,821,409,269 (18,821,409,269)	27,706,176,082 (27,706,176,082)

<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
平成25年10月1日～ 平成26年9月末日	4,459,010,328 (4,459,010,328)	4,463,407,001 (4,463,407,001)	9,443,066,983 (9,443,066,983)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c . ファンドの原文の中間財務書類は日本円で表示されている。
- d . ファンドの評価日は、償還日までの期間におけるすべての営業日、または管理会社がファンドに関して随時定めるその他の日であり、営業日とは、(1) ロンドン、ルクセンブルグ、ニューヨークおよび東京において銀行が営業している日であつ(2) ニューヨーク証券取引所が取引を行っている日、または管理会社が随時定めるその他の日をいう。平成26年8月におけるファンドの最終評価日は、平成26年8月29日であった。そのため、第3期の中間財務書類は平成26年8月29日付で作成されている。

[次へ](#)

(１) 資産及び負債の状況

貸借対照表

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

2014年 8 月29日現在

円

資産		
現金		1,680,770,155
銀行預金 - 基準通貨		698,426,171
銀行預金 - 外国通貨		982,343,984
有価証券（取得原価）		89,544,972,976
債券（取得原価）		89,544,972,976
未実現評価損益		22,821,975,919
未実現時価評価損益		7,898,780,665
未実現通貨運用損益		14,908,676,045
未決済取引にかかる未実現為替差損益		178,132
未実現通貨繰延損益		14,341,077
未収収益		2,493,942,766
現金に係る未収利息		502,566
債券に係る未収利息		2,493,440,200
資本証券		645,192,417
受益証券販売未収金		645,192,417
前払費用		2,650,169
設立費用		2,650,169
資産合計：		117,189,504,402
負債		
資本証券		888,112,144
受益証券買戻未払金		888,112,144

2014年8月29日現在

	円
未払費用	191,835,249
未払監査費用	2,263,073
未払報告書作成費用	287,182
未払投資顧問報酬	116,659,209
未払受託報酬	1,926,362
未払管理報酬	29,073,782
未払代行協会員報酬	3,236,827
未払販売報酬	38,388,814
負債合計：	1,079,947,393
資本	
ファンド受益証券	108,235,414,864
発行済ファンド受益証券（額面価額）	71,748,354,006,452
米ドル建 米ドルヘッジ	41,108,430,817,449
ブラジル・レアル	10,990,000,052
米ドル	5,809,142,053
豪ドル	3,864,330,511
ユーロ	76,743,918
日本円	47,964,990,793
資源国通貨バスケット	188,116,290
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,570,299,106,761
メキシコ・ペソ	590,691,437
トルコ・リラ	130,344,642
ロシア・ルーブル	9,722,546
受益証券額面超過額	(71,640,118,591,588)
米ドル建 米ドルヘッジ	(41,082,435,441,418)
ブラジル・レアル	232,910,948
米ドル	1,566,058,947
豪ドル	(1,247,282,511)
ユーロ	23,978,082
日本円	3,268,165,207
資源国通貨バスケット	16,134,710
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,575,282,428)
メキシコ・ペソ	29,197,063
トルコ・リラ	1,503,858
ロシア・ルーブル	1,465,954

2014年 8 月29日現在

	円
分配金支払額	(23,960,079,167)
分配金支払額	(23,960,079,167)
米ドル建 米ドルヘッジ	(2,586,069,749)
ブラジル・レアル	(7,522,164,880)
米ドル	(1,115,927,529)
豪ドル	(2,317,080,014)
ユーロ	(7,335,325)
日本円	(8,903,127,510)
資源国通貨バスケット	(214,731,025)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(1,226,710,625)
メキシコ・ペソ	(54,143,709)
トルコ・リラ	(10,505,461)
ロシア・ルーブル	(2,283,340)
利益剰余金	24,424,172,594
利益剰余金	24,424,172,594
米ドル建 米ドルヘッジ	6,156,948,158
ブラジル・レアル	8,266,386,525
米ドル	2,062,213,203
豪ドル	6,706,675,154
ユーロ	16,668,200
日本円	9,678,810,434
資源国通貨バスケット	292,089,440
豪ドル建 豪ドルヘッジ	840,215,257
メキシコ・ペソ	26,912,981
トルコ・リラ	(578,196)
ロシア・ルーブル	(550,697)
当期純利益	7,410,048,718
資本合計：	116,109,557,009
負債および資本合計	117,189,504,402
純資産額合計	116,109,557,009
発行済受益証券総数	37,889,018,608.22420
受益証券 1 口当たり純資産額合計	3.064465

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

2014年3月1日から
2014年8月29日までの期間

円

収益

実現損益

6,032,783,700

為替取引に係る実現利益

9,821,141,451

ブラジル・レアル

2,169,480,269

豪ドル

442,645,504

ユーロ

5,787,878

日本円

1,035,122,106

資源国通貨バスケット

46,239,649

豪ドル建 豪ドルヘッジ

760,431,353

メキシコ・ペソ

56,677,942

トルコ・リラ

11,786,225

ロシア・ルーブル

1,974,030

為替取引に係る実現損失

(8,593,896,616)

ブラジル・レアル

(762,063,056)

豪ドル

(163,983,702)

ユーロ

(8,132,298)

日本円

(838,908,326)

資源国通貨バスケット

(18,063,053)

豪ドル建 豪ドルヘッジ

(280,316,861)

メキシコ・ペソ

(41,174,189)

トルコ・リラ

(7,198,285)

ロシア・ルーブル

(1,597,547)

市場に係る実現利益

1,539,932,390

市場に係る実現損失

(298,773,865)

2014年3月1日から
2014年8月29日までの期間

	円
通貨に係る実現利益	4,466,217,232
米ドル建 米ドルヘッジ	38,672,441
ブラジル・レアル	5
豪ドル	3
ユーロ	1
日本円	3
資源国通貨バスケット	9
豪ドル建 豪ドルヘッジ	12,840,448
メキシコ・ペソ	3
トルコ・リラ	1

2014年3月1日から
2014年8月29日までの期間

円

通貨に係る実現損失	(901,836,892)
米ドル建 米ドルヘッジ	(38,251,506)
ブラジル・レアル	(2)
豪ドル	(3)
日本円	(1)
資源国通貨バスケット	(6)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(12,032,782)
メキシコ・ペソ	(3)
トルコ・リラ	(1)
受取利息	3,298,008,773
現金に係る受取利息	2,167,312
債券に係る受取利息	3,295,841,461
未実現評価損益	(1,312,658,496)
未実現時価評価損益	596,176,478
未実現通貨運用損益	(1,855,922,617)
ブラジル・レアル	(336,998,834)
豪ドル	(9,293,218)
ユーロ	(2,978,306)
日本円	(1,184,776,808)
資源国通貨バスケット	(8,428,599)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(19,156,391)
メキシコ・ペソ	777,390
トルコ・リラ	(2,610,957)
ロシア・ルーブル	111,555
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(21,976,203)
米ドル建 米ドルヘッジ	(145,325)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	347,081
未実現通貨繰延損益	(30,936,154)
収益合計：	8,018,133,977

2014年3月1日から
2014年8月29日までの期間

円

費用	
費用 - 報酬	606,096,488
監査費用	1,049,590
報告書作成費用	(1,344,554)
投資顧問報酬	374,097,194
米ドル建 米ドルヘッジ	125,542,646
ブラジル・リアル	28,861,268
米ドル	25,970,423
豪ドル	12,458,880
ユーロ	273,467
日本円	145,578,189
資源国通貨バスケット	677,071
豪ドル建 豪ドルヘッジ	32,872,164
メキシコ・ペソ	1,637,911
トルコ・リラ	192,543
ロシア・ルーブル	32,632
受託報酬	6,101,447
設立費用償却	2,134,549
米ドル建 米ドルヘッジ	945,278
豪ドル建 豪ドルヘッジ	945,176
設立費用償却	81,365
設立費用償却	81,365
設立費用償却	81,365
印刷費用	1,378,044
現金支出費用	25,387
未払管理報酬	92,391,674
代行協会員報酬	9,938,186
米ドル建 米ドルヘッジ	7,875,944
豪ドル建 豪ドルヘッジ	2,062,242
販売報酬	117,866,991
米ドル建 米ドルヘッジ	93,408,775
豪ドル建 豪ドルヘッジ	24,458,216
副保管報酬	2,457,980
源泉徴収税	1,988,771
源泉徴収税	1,988,771
費用合計：	608,085,259
投資純利益	7,410,048,718

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
豪ドルクラス受益証券											
先物（ポジション）											
1,039,073.03000	AUD FORWARD 15 OCT FAU15OCT	7/30/2014		1,039,073.03	99,616,800	1.000000000 ^F	1,039,073.03	100,583,248	0	966,448	966,448
88,411,546.70000		8/5/2014	AUD	88,411,546.70	8,466,736,287	96.800941835 1.000000000 ^F	88,411,546.70	8,558,320,990	0	91,584,703	91,584,703
1,611,759.40000		8/27/2014	AUD	1,611,759.40	156,405,144	96.800941835 1.000000000 ^F	1,611,759.40	156,019,828	0	-385,316	-385,316
2,374,510.92000		8/19/2014	AUD	2,374,510.92	227,385,389	96.800941835 1.000000000 ^F	2,374,510.92	229,854,893	0	2,469,504	2,469,504
-1,733,000.00000		8/6/2014	AUD	-1,733,000.00	-164,657,850	96.800941835 1.000000000 ^F	-1,733,000.00	-167,756,032	0	-3,098,182	-3,098,182
91,703,890.05000 0.00000	合計		AUD	91,703,890	8,785,485,770	96.800941835	91,703,890	8,877,022,927	0	91,537,157	91,537,157
1,608,535.94000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	8/6/2014		1,608,535.94	164,657,849	0.009629492 1.000000000 ^F	1,608,535.94	167,042,658	0	2,384,809	2,384,809
81,943,800.00000		8/5/2014	AUD	81,943,800.00	8,466,736,279	0.009629492 1.000000000 ^F	81,943,800.00	8,509,670,084	0	42,933,805	42,933,805
-1,500,000.00000		8/27/2014	AUD	-1,500,000.00	-156,405,144	0.009629492 1.000000000 ^F	-1,500,000.00	-155,771,457	0	633,687	633,687
-964,000.00000		7/30/2014	AUD	-964,000.00	-99,616,801	0.009629492 1.000000000 ^F	-964,000.00	-100,109,123	0	-492,322	-492,322
-2,203,000.00000		8/19/2014	AUD	-2,203,000.00	-227,385,390	0.009629492 1.000000000 ^F	-2,203,000.00	-228,776,347	0	-1,390,957	-1,390,957
85,002,264.06000 0.00000	合計		AUD	-85,002,264	8,785,485,765	0.009629492	-85,002,264	8,827,284,353	0	41,798,588	41,798,588
6,701,625.99000	先物（ポ ジショ ン）合計			6,701,626	5		6,701,626	49,738,574	0	49,738,569	49,738,569
6,701,625.99000	豪ドルク ラス受益 証券合計			6,701,626	5		6,701,626	49,738,574	0	49,738,569	49,738,569

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
豪ドル建豪ドルヘッジクラス											
受益証券											
先物（ポジション）											
51,020,720.83000	AUD FORWARD 15 OCT FAU15OCT	8/5/2014		51,020,720.83	4,886,001,937	1.000000000 ^F	51,020,720.83	4,938,853,829	0	52,851,892	52,851,892
317,000.00000		8/12/2014	AUH	317,000.00	30,032,848	96.800941835	317,000.00	30,685,899	0	653,051	653,051
619,882.66000		8/27/2014	AUH	619,882.66	60,153,418	96.800941835 ^F	619,882.66	60,005,225	0	-148,193	-148,193
-367,000.00000		8/14/2014	AUH	-367,000.00	-34,878,250	96.800941835 ^F	-367,000.00	-35,525,946	0	-647,696	-647,696
-968,000.00000		8/13/2014	AUH	-968,000.00	-91,827,556	96.800941835 ^F	-968,000.00	-93,703,312	0	-1,875,756	-1,875,756
-310,000.00000		8/26/2014	AUH	-310,000.00	-29,958,315	96.800941835 ^F	-310,000.00	-30,008,292	0	-49,977	-49,977
50,312,603.49000	合計		AUH	50,312,603	4,819,524,082	96.800941835	50,312,603	4,870,307,403	0	50,783,321	50,783,321
0.00000											
287,977.60000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	8/26/2014		287,977.60	29,958,315	1.000000000 ^F	287,977.60	29,905,794	0	-52,521	-52,521
340,491.59000		8/14/2014	AUH	340,491.59	34,878,250	0.009629492	340,491.59	35,359,247	0	480,997	480,997
897,016.56000		8/13/2014	AUH	897,016.56	91,827,556	1.000000000 ^F	897,016.56	93,153,051	0	1,325,495	1,325,495
-		8/5/2014	AUH	-	-	0.009629492	-	-	0	-	-
47,288,300.00000		8/27/2014	AUH	47,288,300.00	4,886,001,933	1.000000000 ^F	47,288,300.00	4,910,778,263	0	24,776,330	24,776,330
-576,900.00000		8/27/2014	AUH	-576,900.00	-60,153,418	0.009629492 ^F	-576,900.00	-59,909,702	0	243,716	243,716
-292,641.72000		8/12/2014	AUH	-292,641.72	-30,032,847	0.009629492 ^F	-292,641.72	-30,390,151	0	-357,304	-357,304
46,632,355.97000	合計		AUH	-46,632,356	4,819,524,077	0.009629492	-46,632,356	4,842,660,024	0	23,135,947	23,135,947
0.00000											
3,680,247.52000	先物（ポ ジショ ン）合計			3,680,248	5		3,680,248	27,647,379	0	27,647,374	27,647,374
3,680,247.52000	豪ドル建豪ドルヘ ジクラス受益証券合 計			3,680,248	5		3,680,248	27,647,379	0	27,647,374	27,647,374

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通 貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通 貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
資源国通貨バスケットクラス受益証券											
先物 (ポジショ ン)											
18,307.92000	AUD FORWARD 15 OCT FAU15OCT	8/18/2014		18,307.92	1,750,175	1.000000000 ^F	18,307.92	1,772,224	0	22,049	22,049
			BKH			96.800941835					
694,938.20000		8/5/2014		694,938.20	66,550,792	1.000000000 ^F	694,938.20	67,270,672	0	719,880	719,880
			BKH			96.800941835					
-5,000.00000		8/14/2014		-5,000.00	-475,181	1.000000000 ^F	-5,000.00	-484,005	0	-8,824	-8,824
			BKH			96.800941835					
-5,000.00000		8/28/2014		-5,000.00	-483,825	1.000000000 ^F	-5,000.00	-484,005	0	-180	-180
			BKH			96.800941835					
703,246.12000 0.00000	合計			703,246	67,341,961		703,246	68,074,886	0	732,925	732,925
-11,000.00000	BRL FORWARD 15 OCT FBR15OCT	8/28/2014		-11,000.00	-500,946	1.000000000 ^F	-11,000.00	-503,813	0	-2,867	-2,867
			BKH			0.021833515					
-11,000.00000		8/14/2014		-11,000.00	-487,912	1.000000000 ^F	-11,000.00	-503,813	0	-15,901	-15,901
			BKH			0.021833515					
39,030.30000		8/18/2014		39,030.30	1,770,032	1.000000000 ^F	39,030.30	1,787,632	0	17,600	17,600
			BKH			0.021833515					
1,492,766.16000		8/5/2014		1,492,766.16	67,504,459	1.000000000 ^F	1,492,766.16	68,370,400	0	865,941	865,941
			BKH			0.021833515					
1,509,796.46000 0.00000	合計			1,509,796	68,285,633		1,509,796	69,150,406	0	864,773	864,773
4,828.16000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	8/28/2014		4,828.16	500,946	1.000000000 ^F	4,828.16	501,393	0	447	447
			BKH			0.009629492					
4,763.14000		8/14/2014		4,763.14	487,912	1.000000000 ^F	4,763.14	494,641	0	6,729	6,729
			BKH			0.009629492					
4,638.85000		8/14/2014		4,638.85	475,181	1.000000000 ^F	4,638.85	481,734	0	6,553	6,553
			BKH			0.009629492					
4,880.61000		8/14/2014		4,880.61	499,945	1.000000000 ^F	4,880.61	506,840	0	6,895	6,895
			BKH			0.009629492					
4,663.15000		8/28/2014		4,663.15	483,825	1.000000000 ^F	4,663.15	484,257	0	432	432
			BKH			0.009629492					

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注 1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラ ス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
資源国通貨バスケットクラス											
受益証券											
先物（ポジション）											
4,944.86000		8/28/2014		4,944.86	513,054	1.000000000 ^F 0.009629492	4,944.86	513,512	0	458	458
			BKH								
-644,100.00000		8/5/2014		-644,100.00	-67,504,460	1.000000000 ^F 0.009629492	-644,100.00	-66,888,264	0	616,196	616,196
			BKH								
-644,100.00000		8/5/2014		-644,100.00	-66,550,793	1.000000000 ^F 0.009629492	-644,100.00	-66,888,264	0	-337,471	-337,471
	FUS15OCT		BKH								
-644,100.00000		8/5/2014		-644,100.00	-66,995,164	1.000000000 ^F 0.009629492	-644,100.00	-66,888,264	0	106,900	106,900
			BKH								
-17,000.00000		8/18/2014		-17,000.00	-1,770,032	1.000000000 ^F 0.009629492	-17,000.00	-1,765,410	0	4,622	4,622
			BKH								
-17,000.00000		8/18/2014		-17,000.00	-1,750,175	1.000000000 ^F 0.009629492	-17,000.00	-1,765,410	0	-15,235	-15,235
			BKH								
-17,000.00000		8/18/2014		-17,000.00	-1,759,750	1.000000000 ^F 0.009629492	-17,000.00	-1,765,410	0	-5,660	-5,660
			BKH								
1,954,581.23000	合計			-1,954,581	203,369,511		-1,954,581	202,978,645	0	390,866	390,866
0.00000											
182,183.05000	ZAR FORWARD 15 OCT FZA15OCT	8/18/2014		182,183.05	1,759,750	1.000000000 ^F 0.103229297	182,183.05	1,764,839	0	5,089	5,089
			BKH								
6,999,016.04000		8/5/2014		6,999,016.04	66,995,164	1.000000000 ^F 0.103229297	6,999,016.04	67,800,675	0	805,511	805,511
			BKH								
-53,000.00000		8/28/2014		-53,000.00	-513,054	1.000000000 ^F 0.103229297	-53,000.00	-513,420	0	-366	-366
			BKH								
-52,000.00000		8/14/2014		-52,000.00	-499,945	1.000000000 ^F 0.103229297	-52,000.00	-503,733	0	-3,788	-3,788
			BKH								
7,076,199.09000	合計			7,076,199	67,741,915		7,076,199	68,548,361	0	806,446	806,446
0.00000											
7,334,660.44000	先物（ポジション）合計			7,334,660	-2		7,334,660	2,795,008	0	2,795,010	2,795,010
7,334,660.44000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			7,334,660	-2		7,334,660	2,795,008	0	2,795,010	2,795,010

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
ブラジル・レアルクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
-1,818,000.00000	BRL FORWARD 15 OCT FBR15OCT	8/7/2014		-1,818,000.00	-80,018,157	1.000000000 ^F	-1,818,000.00	-83,266,483	0	-3,248,326	-3,248,326
3,287,586.90000		8/28/2014	BRH	3,287,586.90	151,557,774	0.021833515	3,287,586.90	150,575,246	0	-982,528	-982,528
229,093,832.96000		8/5/2014	BRH	229,093,832.96	10,359,864,625	0.021833515 ^F	229,093,832.96	10,492,760,005	0	132,895,380	132,895,380
230,563,419.86000	合計		BRH	230,563,420	10,431,404,242	0.021833515	230,563,420	10,560,068,768	0	128,664,526	128,664,526
0.00000											
783,148.10000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	8/7/2014		783,148.10	80,018,156	1.000000000 ^F	783,148.10	81,328,080	0	1,309,924	1,309,924
-98,849,600.00000		8/5/2014	BRH	-98,849,600.00	-	0.009629492	-98,849,600.00	-	0	94,567,209	94,567,209
			BRH		10,359,864,693	0.009629492 ^F		10,265,297,484	0		
-1,443,000.00000		8/28/2014	BRH	-1,443,000.00	-151,557,774	0.009629492 ^F	-1,443,000.00	-149,852,142	0	1,705,632	1,705,632
			BRH			0.009629492			0		
-99,509,451.90000	合計			-99,509,452	-		-99,509,452	-	0	97,582,765	97,582,765
0.00000					10,431,404,311			10,333,821,546	0		
131,053,967.96000	先物 (ポ ジショ ン) 合計			131,053,968	-69		131,053,968	226,247,222	0	226,247,291	226,247,291
131,053,967.96000	ブラジル・レアルク ラス受益証券合計			131,053,968	-69		131,053,968	226,247,222	0	226,247,291	226,247,291

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
ユーロクラス受益証券											
先物（ポジション）											
787,249.08000	EUR FORWARD 15 OCT FEU15OCT	8/5/2014		787,249.08	108,235,091	1.000000000 ^F	787,249.08	107,718,979	0	-516,112	-516,112
3,711.81000		7/24/2014	EUH	3,711.81	508,868	136.829603358	3,711.81	507,885	0	-983	-983
790,960.89000	合計		EUH	790,961	108,743,959	136.829603358	790,961	108,226,864	0	-517,095	-517,095
0.00000											
-5,000.00000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	7/24/2014		-5,000.00	-508,868	1.000000000 ^F	-5,000.00	-519,238	0	-10,370	-10,370
-		8/5/2014	EUH	-	-	0.009629492	-	-	0	-	-
1,052,800.00000			EUH	1,052,800.00	108,235,092	1.000000000 ^F	1,052,800.00	109,330,793	0	1,095,701	1,095,701
-				-	-	0.009629492	-	-		-	-
1,057,800.00000	合計			-1,057,800	108,743,960		-1,057,800	109,850,031	0	1,106,071	1,106,071
0.00000											
-266,839.11000	先物（ポ ジショ ン）合計			-266,839	-1		-266,839	-1,623,167	0	-	-
-266,839.11000	ユーロクラス受益証 券合計			-266,839	-1		-266,839	-1,623,167	0	-	-

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
日本円クラス受益証券											
先物（ポジション）											
4,950,527.92000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	8/11/2014		4,950,527.92	505,439,002	1.000000000 ^F	4,950,527.92	514,230,184	0	8,791,182	8,791,182
			JPH			0.009627066					
346,578,200.00000		7/2/2014		346,578,200.00	35,191,515,878	1.000000000 ^F	346,578,200.00	36,000,397,213	0	-808,881,335	-808,881,335
			JPH			0.009627066					
341,627,672.08000	合計			-341,627,672	34,686,076,876		-341,627,672	35,486,167,029	0	-800,090,153	-800,090,153
0.00000											
4,963,502.29000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	8/7/2014		4,963,502.29	506,989,003	1.000000000 ^F	4,963,502.29	515,447,989	0	8,458,986	8,458,986
			JPH			0.009629492					
2,442,518.85000		8/13/2014		2,442,518.85	249,941,002	1.000000000 ^F	2,442,518.85	253,649,814	0	3,708,812	3,708,812
			JPH			0.009629492					
961,412.91000		8/26/2014		961,412.91	99,993,000	1.000000000 ^F	961,412.91	99,840,460	0	-152,540	-152,540
			JPH			0.009629492					
585,788.85000		8/14/2014		585,788.85	59,988,000	1.000000000 ^F	585,788.85	60,832,788	0	844,788	844,788
			JPH			0.009629492					
1,443,234.97000		8/27/2014		1,443,234.97	149,955,000	1.000000000 ^F	1,443,234.97	149,876,543	0	-78,457	-78,457
			JPH			0.009629492					
174,686,800.00000		8/5/2014		174,686,800.00	17,913,013,371	1.000000000 ^F	174,686,800.00	18,140,811,582	0	-227,798,211	-227,798,211
			JPH			0.009629492					
164,290,342.13000	合計			-164,290,342	16,846,147,366		-164,290,342	17,061,163,988	0	-215,016,622	-215,016,622
0.00000											
505,918,014.21000	先物（ポ ジショ ン）合計			-505,918,014	51,532,224,242		-505,918,014	52,547,331,017	0	1,015,106,775	1,015,106,775
505,918,014.21000	日本円クラス受益証 券合計			-505,918,014	51,532,224,242		-505,918,014	52,547,331,017	0	1,015,106,775	1,015,106,775

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注 1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラ ス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
メキシコ・ペソクラス受益証券											
先物（ポジション）											
1,280,570.56	MXN FORWARD 15 OCT FMX15OCT	8/14/2014		1,280,570.56	10,035,954	1.000000000 ^F	1,280,570.56	10,138,991	0	103,037	103,037
79,673,616.71		8/5/2014	MXH	79,673,616.71	617,507,563	0.126301579	79,673,616.71	630,820,433	0	13,312,870	13,312,870
80,954,187.27000 0.00000	合計		MXH	80,954,187	627,543,517	0.126301579	80,954,187	640,959,424	0	13,415,907	13,415,907
-5,976,200.00000	USD FORWARD 15 OCT FUS15OCT	8/5/2014		-5,976,200.00	-	1.000000000 ^F	-5,976,200.00	-	0	-3,106,689	-3,106,689
-97,600.00000		8/14/2014	MXH	-97,600.00	-10,035,954	0.009629492	-97,600.00	-10,135,529	0	-99,575	-99,575
-6,073,800.00000 0.00000	合計		MXH	-6,073,800	-	0.009629492	-6,073,800	-	0	-3,206,264	-3,206,264
74,880,387.27000	先物（ポ ジショ ン）合計			74,880,387	-3		74,880,387	10,209,640	0	10,209,643	10,209,643
74,880,387.27000	メキシコ・ペソクラ ス受益証券合計			74,880,387	-3		74,880,387	10,209,640	0	10,209,643	10,209,643

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通 貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通 貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
ロシア・ルーブルクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
3,383,928.10	RUB FORWARD 15 OCT	8/5/2014		3,383,928.10	9,690,021	1.000000000 ^F	3,383,928.10	9,361,315	0	-328,706	-328,706
	FRU15OCT		RUH			0.361480010					
-92,600.00000	USD FORWARD 15 OCT	8/5/2014		-92,600.00	-9,690,021	1.000000000 ^F	-92,600.00	-9,616,291	0	73,730	73,730
	FUS15OCT		RUH			0.009629492					
3,291,328.10000	先物 (ポジ ション) 合 計			3,291,328	0		3,291,328	-254,976	0	-254,976	-254,976
3,291,328.10000	ロシア・ルーブルクラ ス受益証券合計			3,291,328	0		3,291,328	-254,976	0	-254,976	-254,976

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注 1）	取得原価 （基準通貨） （注 2） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注 1）	価額 （基準通貨） （注 2） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
トルコ・リラクラス受益証券											
先物（ポジション）											
417,497.62	TRY FORWARD 15 OCT	8/7/2014		417,497.62	19,714,780	1.000000000 ^F	417,497.62	19,880,787	0	166,007	166,007
2,234,791.13	FTR15OCT	8/5/2014	TRH	2,234,791.13	107,202,096	0.021000055	2,234,791.13	106,418,347	0	-783,749	-783,749
2,652,288.75000	合計		TRH	2,652,289	126,916,876	0.021000055	2,652,289	126,299,134	0	-617,742	-617,742
0.00000											
1,026,900.00000	USD FORWARD 15 OCT	8/5/2014		1,026,900.00	107,202,097	1.000000000 ^F	1,026,900.00	106,641,140	0	560,957	560,957
-190,100.00000	FUS15OCT	8/7/2014	TRH	-190,100.00	-19,714,780	0.009629492	-190,100.00	-19,741,436	0	-26,656	-26,656
			TRH			1.000000000 ^F					
1,217,000.00000	合計			-1,217,000	126,916,877	0.009629492	-1,217,000	126,382,576	0	534,301	534,301
0.00000											
1,435,288.75000	先物（ポジ ション）合 計			1,435,289	-1		1,435,289	-83,442	0	-83,441	-83,441
1,435,288.75000	トルコ・リラクラス受 益証券合計			1,435,289	-1		1,435,289	-83,442	0	-83,441	-83,441

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
クラスに割当てられていない資産										
現金										
698,426,171.00000	JPY CASH	8/29/2014		698,426,171	698,426,171	1.000000000	698,426,171	698,426,171	0	0
	CASHJPY					1.000000000				
698,426,171.00000	現金合計			698,426,171	698,426,171		698,426,171	698,426,171	0	0
社債										
8,350,000.00000	ABN AMRO BANK NV FRN 03292049 BNLD0978 XS0246487457	3/27/2013		7,473,250.00	901,380,805	102.056999200 ^C 136.837336122	8,521,759.43	1,166,094,860	143,475,238	121,238,817 264
13,240,000.00000	ABN AMRO BANK NV 6.375 % 04272021 BNLD1156 XS0619548216	11/10/2011		13,342,266.10	1,420,776,255	124.836997900 ^C 136.837336122	16,528,418.52	2,261,704,761	435,984,610	404,943,896 840
2,490,000.00000	ABN AMRO BANK NV 7.125 % 07062022 BNLD1201 XS0802995166	8/13/2012		2,719,467.40	293,030,303	132.186996400 ^C 136.837336122	3,291,456.21	450,394,100	78,269,425	79,094,372 157
2,000,000.00000	ALL IANZ FINANCE FRN 07082041 BNLD1158 DE000A1GNAH1	11/9/2011		1,987,907.11	213,915,695	119.188003500 ^C 136.837336122	2,383,760.07	326,187,378	54,167,465	58,104,218 112
16,820,000.00000	AMERICAN EXPRESS FRN 09012066 BUSA7950 US025816AU39	11/9/2011		17,258,467.60	1,399,095,402	108.669998100 ^C 0.009626029	18,278,293.68	1,898,840,496	105,944,630	393,800,464 499
4,700,000.00	AMLIN PLC FRN 12192026 BGBR2174 XS0251382361	11/10/2011		3,943,830.60	492,892,679	104.654998700 ^C 172.527036281	4,918,784.94	848,623,388	168,205,983	187,524,726 355
5,600,000.00	AVIVA PLC FRN 05202058 BGBR2176 XS0364880186	1/23/2013		6,038,872.00	847,016,158	121.043998700 ^C 172.527036281	6,778,463.93	1,169,468,292	127,599,603	194,852,531 322
3,000,000.00000	AVIVA PLC FRN 07052043 BGBR2263 XS0951553592	9/11/2013		3,137,000.00	417,938,836	118.905998200 ^C 136.837336122	3,567,179.95	488,123,401	58,864,678	11,319,887 70

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>										
8,850,000.00	AXA SA	5/24/2013		9,511,804.90	1,576,865,704	109.176002500 ^C 172.527036281	9,662,076.22	1,666,969,375	25,925,866	64,177,805
	FRN 10292049 BFRA105Z XS0325823119									
19,590,000.00000	BANCO BRASL (CI) 5.875 % 01192023 BBRA0001 US05958AAH14	6/12/2012		20,225,334.50	1,633,218,778	106.035003600 ^C 0.009626029	20,772,257.21	2,157,925,891	56,817,064	467,890,049
10,330,000.00000	BANCO DE CREDITO FRN 04242027 BPER001A US05954TAJ07	2/21/2013		11,196,552.70	1,043,648,049	107.776000900 ^C 0.009626029	11,133,260.89	1,156,578,782	-6,575,069	119,505,802
5,000,000.00000	BANCO INTER PERU FRN 03192029 BPER001M USP13435AA33	3/11/2014		5,000,000.00	515,925,006	107.819242000 ^C 0.009626029	5,390,962.10	560,040,085	40,615,097	3,499,982
18,000,000.00000	BARCLAYS BK PLC FRN 04102023 BGBR225W US06739FHK03	8/14/2013		19,151,374.30	1,907,371,098	111.361999500 ^C 0.009626029	20,045,159.91	2,082,391,390	92,850,916	82,169,376
10,880,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0058 US05533UAB44	11/10/2011		11,887,850.00	1,081,561,710	112.240997300 ^C 0.009626029	12,211,820.51	1,268,624,945	33,655,675	153,407,559
8,850,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0060 USP16259AB20	11/9/2011		9,106,122.60	726,964,805	112.194999600 ^C 0.009626029	9,929,257.46	1,031,500,888	85,511,363	219,024,720
11,370,000.00000	BBVA BANCOMER SA 7.25 % 04222020 BMEX009H USP1R23DAA49	1/29/2013		13,136,847.00	1,201,507,199	114.378997800 ^C 0.009626029	13,004,892.05	1,351,013,180	13,708,140	163,214,121
5,200,000.00000	BNP PARIBAS FRN 04132049 BFRA0952 FR0010456764	2/26/2013		4,861,400.00	598,005,997	106.230003300 ^C 136.837336122	5,523,960.17	755,883,995	90,662,969	67,215,029
2,000,000.00000	BNP PARIBAS FRN 04292049 BFRA104L FR0010306738	1/31/2013		1,830,000.00	226,134,304	103.406997600 ^C 136.837336122	2,068,139.95	282,998,762	32,586,437	24,278,021

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>										
<u>社債</u>										
24,600,000.00000	BNP PARIBAS FRN 06292049 BFRA1050 USF1058YHV32	1/7/2013		24,193,500.00	2,119,362,095	102.151000900 ^C 0.009626029	25,129,146.22	2,610,541,296	97,199,606	393,979,596 491,
7,700,000.00000	BNP PARIBAS FORT FRN 10292049 BBEL0164 BE0119806116	3/19/2013		7,315,000.00	899,488,576	100.600997900 ^C 136.837336122	7,746,276.84	1,059,979,887	59,014,774	101,476,538 160,
4,200,000.00000	BPCE FRN 08292049 BFRA1041 USF11494AA36	4/20/2012		4,326,000.00	352,763,658	136.164993200 ^C 0.009626029	5,718,929.71	594,111,000	144,704,500	96,642,842 241,
11,790,000.00000	BPCE 9.25 % 10292049 BFRA1042 FR0010814558	4/24/2012		11,064,172.35	1,225,254,415	104.375999400 ^C 136.837336122	12,305,930.33	1,683,910,725	169,918,854	288,737,456 458,
8,600,000.00000	BPCE 4.625 % 07182023 BFRA106E FR0011538222	7/25/2013		8,525,438.00	1,130,331,610	116.829002300 ^C 136.837336122	10,047,294.20	1,374,844,973	208,246,748	36,266,615 244,
5,400,000.00	BUPA FINANCE PLC 5 % 04252023 BGBR2249 XS0920221453	4/18/2013		5,423,534.26	814,287,256	103.986999500 ^C 172.527036281	5,615,297.97	968,790,717	33,084,425	121,419,036 154,
11,400,000.00000	CA PREF FUND TRS 7 % 01292049 BUSA960N XS0161441000	1/28/2013		11,214,250.00	1,034,032,896	101.444000200 ^C 0.009626029	11,564,616.02	1,201,390,108	36,397,773	130,959,439 167,
5,000,000.00000	CBA CAP TRST II FRN 03292049 BUSA9290 US12479BAA08	4/24/2012		4,774,000.00	384,910,065	105.348999000 ^C 0.009626029	5,267,449.95	547,209,026	51,262,047	111,036,914 162,
3,500,000.00000	CITIGROUP INC 4.05 % 07302022 BUSA9630 US172967GK16	2/5/2013		3,500,000.00	326,882,509	103.317001300 ^C 0.009626029	3,616,095.05	375,658,025	12,060,534	36,714,983 48,
12,500,000.00000	CLOVERIE PLC FRN 09012042 BIRL027B XS0802738434	7/2/2012		14,141,323.91	1,573,062,646	128.423995900 ^C 136.837336122	16,052,999.49	2,196,649,687	261,588,594	361,998,447 623,

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年8月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>										
6,400,000.00000	CNP ASSURANCES FRN 06052045 BFRA10BM FR0011949403	6/11/2014		6,528,000.00	900,352,072	104.338996800 ^C 136.837336122	6,677,695.80	913,758,104	20,483,974	-7,077,942
1,400,000.00000	CORP FINANCIERA FRN 07152029 BPER002T USP3R94GAA71	7/8/2014		1,398,124.00	141,979,490	102.658996500 ^C 0.009626029	1,437,225.95	149,306,215	4,062,106	3,264,618
4,570,000.00	COVENTRY BDG SOC 5.875 % 09282022 BGBR2171 XS0544713356	11/9/2011		4,604,727.50	571,662,225	119.291999800 ^C 172.527036281	5,451,644.39	940,556,050	146,116,061	222,777,763
5,000,000.00000	CRED AGRICOLE SA FRN 09192033 BFRA106Q USF22797QT87	9/13/2013		4,993,000.00	494,856,240	114.649002000 ^C 0.009626029	5,732,450.10	595,515,565	76,817,772	23,841,553
8,750,000.00	CREDIT AGRICOLE FRN 12292049 BFRA105L FR0010291997	4/18/2013		8,519,867.50	1,353,455,394	102.615997300 ^C 172.527036281	8,978,899.76	1,549,102,965	79,195,476	116,452,095
4,450,000.00000	CREDIT SUISSE 6.5 % 08082023 BCHE010D US22546DAA46	8/2/2013		4,461,750.00	442,138,132	110.347000100 ^C 0.009626029	4,910,441.50	510,121,204	46,612,316	21,370,756
14,000,000.00000	CSG GUERNSEY FRN 02242041 BGGY0001 XS0595225318	11/9/2011		14,440,355.30	1,291,519,901	107.267997700 ^C 0.009626029	15,017,519.68	1,560,094,996	59,958,720	208,616,375
15,235,000.00	DANSKE BANK FRN 09292021 BDNK0229 XS0176929684	11/10/2011		14,521,576.50	2,009,635,628	106.509002600 ^C 172.527036281	16,226,646.55	2,799,535,237	294,170,682	495,728,928
11,050,000.00000	DANSKE BANK A/S FRN 10042023 BDNK0236 XS0974372467	9/26/2013		11,090,910.50	1,479,541,252	108.293998700 ^C 136.837336122	11,966,486.86	1,637,462,184	119,811,536	38,109,396
12,400,000.00000	DEUTSCHE BANK AG FRN 05242028 BDEU436N US251525AM33	11/19/2013		11,371,668.00	1,139,497,985	98.602996800 ^C 0.009626029	12,226,771.60	1,270,178,139	88,832,436	41,847,718

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>										
20,166,000.00	DNB NORBANK ASA FRN 03292049 BNOR0223 XS0285087358	11/9/2011		20,581,162.14	2,970,349,291	106.323997400 ^C 172.527036281	21,441,297.32	3,699,203,480	148,396,573	580,457,616
5,050,000.00000	ELM BV SWISS REIN CO FRN 05292049 BNLD0740 XS0253627136	3/11/2013		5,139,012.50	653,506,999	105.938003500 ^C 136.837336122	5,349,869.18	732,061,847	28,853,066	49,701,782
18,880,000.00000	GE CAP TRUST I FRN 11152067 BUSA7949 US36830GAA22	11/10/2011		19,172,105.80	1,539,700,973	111.180000300 ^C 0.009626029	20,990,784.06	2,180,627,552	188,933,386	451,993,193
4,920,000.00000	GEN ELEC CAP CRP FRN 09152067 BUSA95RR XS0319639232	12/20/2012		4,994,628.52	582,204,082	108.771003700 ^C 136.837336122	5,351,533.38	732,289,572	48,837,911	101,247,580
1,000,000.00	GEN ELEC CAP CRP FRN 09152066 BUSA96P5 XS0267167566	5/8/2013		1,043,750.00	160,547,827	106.394996600 ^C 172.527036281	1,063,949.97	183,560,134	3,485,040	19,527,267
4,820,000.00	GOLDMAN SACHS GP 5.5% 10122021 BUSA4203 XS0270349003	4/18/2012		4,853,269.60	679,412,153	110.647003100 ^C 172.527036281	5,333,185.55	920,118,697	82,798,476	157,908,067
13,700,000.00000	GOLDMAN SACHS GP 4.75 % 10122021 BUSA7943 XS0270347304	11/9/2011		12,136,118.89	1,305,148,613	116.874000500 ^C 136.837336122	16,011,738.07	2,191,003,584	530,329,404	355,525,567
5,000,000.00	GOLDMAN SACHS GP 6.875 % 01182038 BUSA96MS XS0340470490	4/25/2013		6,136,600.00	942,658,886	129.511001500 ^C 172.527036281	6,475,550.07	1,117,207,463	58,478,052	116,070,525
6,150,000.00	HSBC BANK FUND FRN 04292049 BJEY000C XS0189704140	4/25/2013		6,242,250.00	958,888,054	105.817001300 ^C 172.527036281	6,507,745.58	1,122,762,058	45,805,166	118,068,838
6,160,000.00000	HSBC HLDGS PLC 6.8% 06012038 BGBR2073 US404280AJ87	11/9/2011		7,300,106.60	586,445,501	132.337997400 ^C 0.009626029	8,152,020.64	846,872,645	88,501,088	171,926,056

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>										
6,690,000.00	ING BANK NV FRN 05292023 BNLD1155 XS0366066222	11/11/2011		6,641,617.00	837,014,201	111.857002200 ^C 172.527036281	7,483,233.45	1,291,060,088	145,201,591	308,844,296
9,150,000.00000	ING BANK NV 5.8 % 09252023 BNLD122U US449786AY82	9/16/2013		9,108,184.50	899,797,550	113.380996700 ^C 0.009626029	10,374,361.20	1,077,740,489	131,536,763	46,406,175
10,902,000.00000	ING BANK NV FRN 11212023 BNLD1236 XS0995102695	3/27/2012		10,569,196.40	1,204,699,290	105.365997300 ^C 136.837336122	11,487,001.03	1,571,850,620	125,589,940	241,561,390
10,000,000.00000	ITAU UNIBANCO 5.65 % 03192022 BBRA0024 US46556LAF13	3/12/2012		10,284,069.40	860,159,100	104.363998400 ^C 0.009626029	10,436,399.84	1,084,185,373	15,824,847	208,201,425
6,441,000.00000	JP MORGAN CHASE 6% 01152018 BUSA5084 US46625HGY09	2/13/2013		7,680,892.50	717,856,187	113.785003600 ^C 0.009626029	7,328,892.08	761,361,937	-36,567,563	80,073,312
10,000,000.00000	JPMORGAN CHASE 1.8 % 01252018 BUSA965N US46625HJG65	12/10/2013		9,955,400.00	1,024,261,311	100.483001700 ^C 0.009626029	10,048,300.17	1,043,867,640	9,650,934	9,955,395
6,270,000.00000	JPMORGAN CHASE 1.625 % 05152018 BUSA97MP US46625HJL50	12/18/2013		6,177,266.70	637,524,812	99.486000000 ^C 0.009626029	6,237,772.20	648,010,950	6,285,614	4,200,525
18,440,000.00	LLOYDS TSB BANK 7.625 % 04222025 GBBR223F XS0503834821	1/10/2013		21,967,181.60	3,205,114,542	127.947998000 ^C 172.527036281	23,593,610.83	4,070,535,752	280,603,015	584,818,195
25,390,000.00000	MITSU SUMITOMO FRN 03152072 BJPN3013 USJ45174AF61	3/9/2012		27,194,829.50	2,356,659,383	118.122001600 ^C 0.009626029	29,991,176.21	3,115,633,270	290,498,471	468,475,416
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	3/20/2014		1,795,572.00	183,857,592	105.805000300 ^C 0.009626029	1,904,490.01	197,847,940	11,314,947	2,675,401

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

										未実現損益
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>										
13,150,000.00000	MORGAN STANLEY 4.875 % 11012022 BUSA95EL US6174824M37	10/18/2012		13,465,176.80	1,149,095,926	108.027000400 ^C	14,205,550.55	1,475,743,586	76,913,726	249,733,934
	MUFG CAP FIN 5	7/13/2012		13,198,000.00	1,814,650,644	108.025001500 ^C	13,416,705.19	2,314,744,382	37,732,558	462,361,181
	FRN 01292049 BCYM055G XS0282533115					172.527036281				500
1,910,000.00000	NATIONAL CAP II	4/24/2012		1,810,567.65	147,175,099	101.878997800 ^C	1,945,888.86	202,148,659	14,057,843	40,915,717
	FRN 12292049 BUSA3266 US635192AA58					0.009626029				54
7,376,000.00	NATIONAL CAP TST	8/13/2012		6,809,147.50	890,898,589	105.511001500 ^C	7,782,491.47	1,342,690,188	167,928,151	283,863,449
	FRN 09292049 BUSA94UO XS0177395901					172.527036281				451
5,560,000.00000	NATIONWIDE BLDG	11/10/2011		5,814,266.07	695,980,403	124.603996200 ^C	6,927,982.19	948,006,627	152,397,947	99,628,278
	6.75 % 07222020 BGBR2178 XS0527239221					136.837336122				252
30,656,000.00000	NIPPON LIFE INS	10/24/2012		31,765,193.80	2,807,828,662	107.004997200 ^C	32,803,451.94	3,407,786,528	107,859,445	492,098,421
	FRN 10182042 BJPN301S USJ54675AA13					0.009626029				599
6,210,000.00000	NORDEA BANK AB	7/5/2012		6,185,953.20	497,147,805	109.555000300 ^C	6,803,365.52	706,767,611	64,139,877	145,479,929
	4.875% 05132021 BSWE0330 US65557FAA49					0.009626029				209
7,400,000.00000	NORDEA BANK AB	6/28/2013		7,308,462.00	725,986,086	105.059997500 ^C	7,774,439.81	807,647,662	48,408,104	33,253,472
	4.25 % 09212022 BSWE034A US65557HAD44					0.009626029				81
32,950,000.00000	PRUDENTIAL FIN	12/14/2012		33,708,216.00	3,096,866,830	106.874000500 ^C	35,214,983.16	3,658,308,443	156,530,503	404,911,110
	FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42					0.009626029				561
2,530,000.00	PRUDENTIAL PLC	11/9/2011		3,285,605.60	411,730,124	133.744003200 ^C	3,383,723.28	583,783,749	16,927,953	155,125,673
	FRN 05292039 BGBR2169 XS0431150902					172.527036281				172

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
18,200,000.00000	RABOBANK FRN 11292049 BNLD121G XS0703303262	12/13/2012		19,558,406.23	1,770,467,791	111.483001700 ^C 0.009626029	20,289,906.31	2,107,816,869	75,991,884	261,357,194	337,349,078
4,010,000.00000	RABOBANK CAP III FRN 12292049 BUSA96GT US749769AA35	4/9/2013		4,070,150.00	402,965,199	105.286003100 ^C 0.009626029	4,221,968.72	438,599,211	15,771,688	19,862,324	35,634,012
10,180,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.934 % 04092018 BGBR2179 XS0356705219	11/10/2011		9,244,592.40	980,707,453	116.144996600 ^C 136.837336122	11,823,560.65	1,617,904,543	352,899,146	284,297,945	637,197,090
23,480,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.125 % 12152022 BGBR223B US780099CE50	12/13/2012		24,414,224.40	2,051,409,830	109.748001000 ^C 0.009626029	25,768,830.63	2,676,994,910	140,723,266	484,861,814	625,585,080
23,000,000.00000	SANTANDER UK PLC 5 % 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		23,001,850.00	2,304,989,890	108.285003600 ^C 0.009626029	24,905,550.83	2,587,313,089	197,765,956	84,557,243	282,323,199
4,500,000.00000	SBERBANK 5.25 % 05232023 BLUX028Q XS0935311240	5/23/2013		4,466,250.00	462,279,207	84.845001200 ^C 0.009626029	3,818,025.05	396,635,524	-67,340,847	1,697,164	-65,643,683
9,700,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 09292049 BFRA1006 XS0449487619	11/10/2011		10,659,415.00	1,373,574,896	122.251998900 ^C 136.837336122	11,858,443.89	1,622,677,873	164,071,920	85,031,057	249,102,977
4,910,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 01292049 BFRA105W FR0010136382	5/2/2013		4,768,591.14	620,216,496	100.473999000 ^C 136.837336122	4,933,273.35	675,055,984	22,534,675	32,304,813	54,839,488
29,610,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		29,892,016.00	2,885,955,119	107.612998900 ^C 0.009626029	31,864,208.97	3,310,213,274	204,881,262	219,376,893	424,258,155
5,200,000.00000	UBS AG FRN 05222023 BCHE010B CH0214139930	5/15/2013		5,200,000.00	532,610,022	102.533996500 ^C 0.009626029	5,331,767.82	553,890,687	13,688,699	7,591,966	21,280,665

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
12,650,000.00000	UBS AG JERSEY FRN 02222022 BCHE0100 XS0747231362	2/15/2012		12,764,642.35	1,039,446,800	109.124000500 ^C 0.009626029	13,804,186.06	1,434,047,837	107,992,996	286,608,040	394,601,037
12,320,000.00000	VTB BANK 6.875 % 05292018 BLUX027U XS0365923977	12/13/2012		13,762,963.06	1,157,098,269	101.444000200 ^C 0.009626029	12,497,900.82	1,298,344,398	-131,420,987	272,667,116	141,246,129
2,900,000.00000	VTB BANK 6.95 % 10172022 BLUX027Z XS0842078536	1/31/2013		3,078,350.00	280,930,228	93.610000600 ^C 0.009626029	2,714,690.02	282,015,566	-37,778,816	38,864,155	1,085,338
12,610,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95 % 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		12,746,280.00	1,004,488,714	102.540000900 ^C 0.009626029	12,930,294.11	1,343,263,574	19,116,306	319,658,554	338,774,860
3,000,000.00000	WESTPAC CAP IV FRN 12292049 BUSA8426 USU96100AA73	4/24/2013		3,105,000.00	308,559,378	104.325996300 ^C 0.009626029	3,129,779.89	325,137,176	2,574,259	14,003,540	16,577,798
5,320,000.00000	WESTPAC CAP IV FRN 12292049 BUSA9291 US96122CAA27	4/24/2012		4,965,900.00	402,593,370	104.291000300 ^C 0.009626029	5,548,281.22	576,383,181	60,500,671	113,289,140	173,789,811
7,340,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	5/3/2012		7,878,833.00	1,241,250,971	114.382003700 ^C 172.527036281	8,395,639.07	1,448,474,727	89,163,020	118,060,736	207,223,756
834,236,000.00000	社債合計			854,116,810	89,544,972,976		915,357,521	112,192,277,021	7,898,780,670	14,748,523,380	22,647,304,045
外貨勘定											
106,271.98000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	8/18/2014		106,271.98	10,140,826	1.000000000 ^S 97.163647387	106,271.98	10,325,773	0	184,947	184,947
495,216.92000		8/5/2014		495,216.92	47,330,430	1.000000000 ^S 97.163647387	495,216.92	48,117,082	0	786,652	786,652
72,646.30000		7/28/2014		72,646.30	6,963,022	1.000000000 ^S 97.163647387	72,646.30	7,058,579	0	95,557	95,557

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
12,661.65000		7/8/2014		12,661.65	1,208,608	1.000000000 ^S 97.163647387	12,661.65	1,230,252	0	21,644	21,644
181,131.43000		7/29/2014		181,131.43	17,338,641	1.000000000 ^S 97.163647387	181,131.43	17,599,390	0	260,749	260,749
303,500.23000		7/31/2014		303,500.23	29,096,812	1.000000000 ^S 97.163647387	303,500.23	29,489,189	0	392,377	392,377
3,619.97000		6/30/2014		3,619.97	346,130	1.000000000 ^S 97.163647387	3,619.97	351,729	0	5,599	5,599
116,195.75000		7/7/2014		116,195.75	11,101,005	1.000000000 ^S 97.163647387	116,195.75	11,290,003	0	188,998	188,998
9,713.89000		7/24/2014		9,713.89	930,972	1.000000000 ^S 97.163647387	9,713.89	943,837	0	12,865	12,865
36,956.36000		8/6/2014		36,956.36	3,539,129	1.000000000 ^S 97.163647387	36,956.36	3,590,815	0	51,686	51,686
11,853,537.20000	AUD	6/12/2014		11,853,537.20	1,134,301,639	1.000000000 ^S 97.163647387	11,853,537.20	1,151,732,909	0	17,431,270	17,431,270
13,866.53000		7/23/2014		13,866.53	1,321,669	1.000000000 ^S 97.163647387	13,866.53	1,347,323	0	25,654	25,654
19,609.41000		7/14/2014		19,609.41	1,863,466	1.000000000 ^S 97.163647387	19,609.41	1,905,322	0	41,856	41,856
184,340.91000		6/26/2014		184,340.91	17,623,855	1.000000000 ^S 97.163647387	184,340.91	17,911,235	0	287,380	287,380
1,271,680.01000		8/13/2014		1,271,680.01	120,480,011	1.000000000 ^S 97.163647387	1,271,680.01	123,561,068	0	3,081,057	3,081,057
7,493.17000		7/31/2014		7,493.17	716,390	1.000000000 ^S 97.163647387	7,493.17	728,064	0	11,674	11,674
552,701.48000		6/19/2014		552,701.48	52,710,344	1.000000000 ^S 97.163647387	552,701.48	53,702,492	0	992,148	992,148
7,273.14000		8/21/2014		7,273.14	699,723	1.000000000 ^S 97.163647387	7,273.14	706,685	0	6,962	6,962

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
4,226,726.89000		7/1/2014		4,226,726.89	404,145,797	1.000000000 ^S 97.163647387	4,226,726.89	410,684,201	0	6,538,404	6,538,404
69,680.22000		8/19/2014		69,680.22	6,661,195	1.000000000 ^S 97.163647387	69,680.22	6,770,384	0	109,189	109,189
2,362,456.54000		8/26/2014		2,362,456.54	228,361,099	1.000000000 ^S 97.163647387	2,362,456.54	229,544,894	0	1,183,795	1,183,795
24,607.58000		7/25/2014		24,607.58	2,360,162	1.000000000 ^S 97.163647387	24,607.58	2,390,962	0	30,800	30,800
406,258.02000		6/20/2014		406,258.02	38,910,484	1.000000000 ^S 97.163647387	406,258.02	39,473,511	0	563,027	563,027
-3,946,749.49000		8/13/2014		-3,946,749.49	-373,918,296	1.000000000 ^S 97.163647387	-3,946,749.49	-383,480,576	0	-9,562,280	-9,562,280
-1,805,300.56000		8/13/2014		-1,805,300.56	-171,035,661	1.000000000 ^S 97.163647387	-1,805,300.56	-175,409,587	0	-4,373,926	-4,373,926
-11,391,491.79000		8/13/2014		-11,391,491.79	-1,079,239,310	1.000000000 ^S 97.163647387	-11,391,491.79	-1,106,838,891	0	-27,599,581	-27,599,581
-26,017.12000		8/20/2014		-26,017.12	-2,491,423	1.000000000 ^S 97.163647387	-26,017.12	-2,527,918	0	-36,495	-36,495
-121,004.88000		8/14/2014		-121,004.88	-11,528,213	1.000000000 ^S 97.163647387	-121,004.88	-11,757,275	0	-229,062	-229,062
-193,221.58000		8/27/2014		-193,221.58	-18,735,995	1.000000000 ^S 97.163647387	-193,221.58	-18,774,113	0	-38,118	-38,118
-136,604.80000		8/28/2014		-136,604.80	-13,256,126	1.000000000 ^S 97.163647387	-136,604.80	-13,273,021	0	-16,895	-16,895
-153,834.62000		8/13/2014		-153,834.62	-14,574,419	1.000000000 ^S 97.163647387	-153,834.62	-14,947,133	0	-372,714	-372,714
4,563,920.74000	合計			4,563,921	453,371,966		4,563,921	443,447,185	0	-9,924,781	-9,924,781
0.00000											
-632,326.40000	BRAZILIAN REAL BRL	5/14/2013		-632,326.40	-31,861,359	1.000000000 ^S 0.021538721	-632,326.40	-29,357,658	0	2,503,701	2,503,701

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-1,975,000.00000		6/11/2013		-1,975,000.00	-90,743,368	1.000000000 ^S 0.021538721	-1,975,000.00	-91,695,324	0	-951,956	-951,956
-4,089,000.00000		6/11/2013		-4,089,000.00	-187,873,231	1.000000000 ^S 0.021538721	-4,089,000.00	-189,844,142	0	-1,970,911	-1,970,911
-32,593,600.00000		6/11/2013		-32,593,600.00	-1,497,545,840	1.000000000 ^S 0.021538721	-32,593,600.00	-1,513,256,056	0	-15,710,216	-15,710,216
-99,000.00000		6/11/2013		-99,000.00	-4,548,655	1.000000000 ^S 0.021538721	-99,000.00	-4,596,373	0	-47,718	-47,718
-4,965,000.00000		6/11/2013		-4,965,000.00	-228,121,935	1.000000000 ^S 0.021538721	-4,965,000.00	-230,515,080	0	-2,393,145	-2,393,145
-4,950,000.00000		6/11/2013		-4,950,000.00	-227,432,745	1.000000000 ^S 0.021538721	-4,950,000.00	-229,818,660	0	-2,385,915	-2,385,915
-4,561,792.05000		6/11/2013		-4,561,792.05	-209,596,139	1.000000000 ^S 0.021538721	-4,561,792.05	-211,794,937	0	-2,198,798	-2,198,798
-353,472,791.10000		6/11/2013		-353,472,791.10	-16,240,664,051	1.000000000 ^S 0.021538721	-353,472,791.10	-16,411,039,035	0	-170,374,984	-170,374,984
369,451,791.10000		6/11/2013		369,451,791.10	16,974,835,330	1.000000000 ^S 0.021538721	369,451,791.10	17,152,912,241	0	178,076,911	178,076,911
32,593,600.00000		6/11/2013		32,593,600.00	1,497,545,840	1.000000000 ^S 0.021538721	32,593,600.00	1,513,256,056	0	15,710,216	15,710,216
1,056,403.20000		5/14/2013		1,056,403.20	53,229,538	1.000000000 ^S 0.021538721	1,056,403.20	49,046,701	0	-4,182,837	-4,182,837
184,874.70000		6/11/2013		184,874.70	8,494,255	1.000000000 ^S 0.021538721	184,874.70	8,583,365	0	89,110	89,110
90,499.50000		6/11/2013		90,499.50	4,158,091	1.000000000 ^S 0.021538721	90,499.50	4,201,712	0	43,621	43,621
3,892,793.65000		6/11/2013		3,892,793.65	178,858,332	1.000000000 ^S 0.021538721	3,892,793.65	180,734,671	0	1,876,339	1,876,339

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
68,547.40000		5/14/2013		68,547.40	3,453,934	1.000000000 ^S 0.021538721	68,547.40	3,182,520	0	-271,414	-271,414
0.00000 合計 0.00000				0	2,187,997		0	1	0	-2,187,996	-2,187,996
50,000.00	BRITISH POUND GBP	8/14/2014		50,000.00	8,545,080	1.000000000 ^S 172.527036281	50,000.00	8,626,352	0	81,272	81,272
50.00	CANADIAN DOLLAR CAD	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000 ^S 0.010441835	50.00	4,788	0	118	118
50,000.00000	EURO EUR	8/13/2014		50,000.00	6,824,681	1.000000000 ^S 136.837336122	50,000.00	6,841,867	0	17,186	17,186
-1,353,924.74000	UNITED STATES DOLLAR USD	6/12/2014		-1,353,924.74	-137,985,244	1.000000000 ^S 0.009626029	-1,353,924.74	-140,652,468	0	-2,667,224	-2,667,224
-7,239,156.48000		6/12/2014		-7,239,156.48	-737,778,657	1.000000000 ^S 0.009626029	-7,239,156.48	-752,039,754	0	-14,261,097	-14,261,097
-54,433,767.73000		6/12/2014		-54,433,767.73	-5,547,617,618	1.000000000 ^S 0.009626029	-54,433,767.73	-5,654,851,832	0	-107,234,214	-107,234,214
-2,743,282.18000		6/12/2014		-2,743,282.18	-279,581,612	1.000000000 ^S 0.009626029	-2,743,282.18	-284,985,863	0	-5,404,251	-5,404,251
-19,767,137.63000		6/12/2014		-19,767,137.63	-2,014,567,897	1.000000000 ^S 0.009626029	-19,767,137.63	-2,053,509,046	0	-38,941,149	-38,941,149
-1,070,846.77000		8/14/2014		-1,070,846.77	-109,622,582	1.000000000 ^S 0.009626029	-1,070,846.77	-111,244,914	0	-1,622,332	-1,622,332
-271,860.75000		7/3/2014		-271,860.75	-27,664,550	1.000000000 ^S 0.009626029	-271,860.75	-28,242,253	0	-577,703	-577,703
-41,080.95000		7/18/2014		-41,080.95	-4,171,770	1.000000000 ^S 0.009626029	-41,080.95	-4,267,694	0	-95,924	-95,924
-69,314,615.47000		6/12/2014		-69,314,615.47	-7,064,199,264	1.000000000 ^S 0.009626029	-69,314,615.47	-7,200,748,665	0	-136,549,401	-136,549,401
-531,334.17000		6/12/2014		-531,334.17	-54,150,924	1.000000000 ^S 0.009626029	-531,334.17	-55,197,649	0	-1,046,725	-1,046,725

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8 月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-19,576.02000		7/16/2014		-19,576.02	-1,990,685	1.000000000 ^S 0.009626029	-19,576.02	-2,033,655	0	-42,970	-42,970
-148,512.50000		8/29/2014		-148,512.50	-15,408,914	1.000000000 ^S 0.009626029	-148,512.50	-15,428,221	0	-19,307	-19,307
-8,885.93000		6/17/2014		-8,885.93	-905,343	1.000000000 ^S 0.009626029	-8,885.93	-923,115	0	-17,772	-17,772
-460,141.44000		6/20/2014		-460,141.44	-46,846,999	1.000000000 ^S 0.009626029	-460,141.44	-47,801,792	0	-954,793	-954,793
-1,077,263.85000		8/18/2014		-1,077,263.85	-110,349,526	1.000000000 ^S 0.009626029	-1,077,263.85	-111,911,553	0	-1,562,027	-1,562,027
-116,730.23000		7/25/2014		-116,730.23	-11,881,387	1.000000000 ^S 0.009626029	-116,730.23	-12,126,520	0	-245,133	-245,133
-21,216.13000		8/14/2014		-21,216.13	-2,171,895	1.000000000 ^S 0.009626029	-21,216.13	-2,204,038	0	-32,143	-32,143
-573,191.42000		8/7/2014		-573,191.42	-58,674,740	1.000000000 ^S 0.009626029	-573,191.42	-59,545,989	0	-871,249	-871,249
-3,408,000.00000		6/12/2014		-3,408,000.00	-347,326,331	1.000000000 ^S 0.009626029	-3,408,000.00	-354,040,072	0	-6,713,741	-6,713,741
-328,971.36000		8/22/2014		-328,971.36	-34,142,292	1.000000000 ^S 0.009626029	-328,971.36	-34,175,189	0	-32,897	-32,897
-154,408.06000		6/24/2014		-154,408.06	-15,773,555	1.000000000 ^S 0.009626029	-154,408.06	-16,040,681	0	-267,126	-267,126
-126,067.72000		8/20/2014		-126,067.72	-12,962,914	1.000000000 ^S 0.009626029	-126,067.72	-13,096,545	0	-133,631	-133,631
-1,250,000.00000		6/12/2014		-1,250,000.00	-127,393,754	1.000000000 ^S 0.009626029	-1,250,000.00	-129,856,247	0	-2,462,493	-2,462,493
-55,212,985.74000		6/12/2014		-55,212,985.74	-5,627,031,624	1.000000000 ^S 0.009626029	-55,212,985.74	-5,735,800,894	0	-108,769,270	-108,769,270
-3,998,988.94000		6/12/2014		-3,998,988.94	-407,556,971	1.000000000 ^S 0.009626029	-3,998,988.94	-415,434,957	0	-7,877,986	-7,877,986

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年8月29日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-4,110,000.00000		6/12/2014		-4,110,000.00	-418,870,664	1.000000000 ^S 0.009626029	-4,110,000.00	-426,967,340	0	-8,096,676	-8,096,676
47,357,459.06000		6/12/2014		47,357,459.06	4,826,435,596	1.000000000 ^S 0.009626029	47,357,459.06	4,919,729,523	0	93,293,927	93,293,927
-7,600,000.00000		6/12/2014		-7,600,000.00	-774,554,025	1.000000000 ^S 0.009626029	-7,600,000.00	-789,525,982	0	14,971,957	14,971,957
-7,130,496.67000		6/12/2014		-7,130,496.67	-726,704,592	1.000000000 ^S 0.009626029	-7,130,496.67	-740,751,630	0	14,047,038	14,047,038
-2,480,000.00000		6/12/2014		-2,480,000.00	-252,749,208	1.000000000 ^S 0.009626029	-2,480,000.00	-257,634,794	0	-4,885,586	-4,885,586
-2,150,000.00000		6/12/2014		-2,150,000.00	-219,117,257	1.000000000 ^S 0.009626029	-2,150,000.00	-223,352,745	0	-4,235,488	-4,235,488
-1,500,000.00000		6/12/2014		-1,500,000.00	-152,872,505	1.000000000 ^S 0.009626029	-1,500,000.00	-155,827,496	0	-2,954,991	-2,954,991
-3,000,000.00000		6/12/2014		-3,000,000.00	-305,745,010	1.000000000 ^S 0.009626029	-3,000,000.00	-311,654,993	0	-5,909,983	-5,909,983
-3,260,000.00000		6/12/2014		-3,260,000.00	-332,242,911	1.000000000 ^S 0.009626029	-3,260,000.00	-338,665,092	0	-6,422,181	-6,422,181
-133,305.55000		7/28/2014		-133,305.55	-13,573,171	1.000000000 ^S 0.009626029	-133,305.55	-13,848,447	0	-275,276	-275,276
-188,819.90000		8/8/2014		-188,819.90	-19,292,673	1.000000000 ^S 0.009626029	-188,819.90	-19,615,555	0	-322,882	-322,882
-790,552.40000		8/4/2014		-790,552.40	-81,011,855	1.000000000 ^S 0.009626029	-790,552.40	-82,126,534	0	-1,114,679	-1,114,679
-766,198.95000		8/27/2014		-766,198.95	-79,707,675	1.000000000 ^S 0.009626029	-766,198.95	-79,596,576	0	111,099	111,099
-325,281.15000		7/7/2014		-325,281.15	-33,203,074	1.000000000 ^S 0.009626029	-325,281.15	-33,791,832	0	-588,758	-588,758
-304,470.91000		8/11/2014		-304,470.91	-31,008,841	1.000000000 ^S 0.009626029	-304,470.91	-31,629,960	0	-621,119	-621,119

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-292,554.83000		8/12/2014		-292,554.83	-29,874,235	1.000000000 ^S 0.009626029	-292,554.83	-30,392,058	0	-517,823	-517,823
-276.85000		8/14/2014		-276.85	-28,341	1.000000000 ^S 0.009626029	-276.85	-28,761	0	-420	-420
-237,935.83000		7/1/2014		-237,935.83	-24,104,089	1.000000000 ^S 0.009626029	-237,935.83	-24,717,963	0	-613,874	-613,874
-117,917.85000		8/19/2014		-117,917.85	-12,093,066	1.000000000 ^S 0.009626029	-117,917.85	-12,249,896	0	-156,830	-156,830
-		6/19/2014		-	-	1.000000000 ^S 0.009626029	-	-	0	-	-
1,581,846.67000		6/19/2014		1,581,846.67	161,561,909	1.000000000 ^S 0.009626029	1,581,846.67	164,330,138	0	2,768,229	2,768,229
-509,785.09000		7/14/2014		-509,785.09	-51,643,779	1.000000000 ^S 0.009626029	-509,785.09	-52,959,023	0	-	-
										1,315,244	1,315,244
-10,354.66000		8/14/2014		-10,354.66	-1,060,006	1.000000000 ^S 0.009626029	-10,354.66	-1,075,694	0	-15,688	-15,688
-1,170.00000		8/14/2014		-1,170.00	-119,773	1.000000000 ^S 0.009626029	-1,170.00	-121,545	0	-1,772	-1,772
-822.09000		8/14/2014		-822.09	-84,157	1.000000000 ^S 0.009626029	-822.09	-85,403	0	-1,246	-1,246
-807,180.01000		8/28/2014		-807,180.01	-83,886,181	1.000000000 ^S 0.009626029	-807,180.01	-83,853,893	0	32,288	32,288
-890,799.69000		6/26/2014		-890,799.69	-90,692,315	1.000000000 ^S 0.009626029	-890,799.69	-92,540,724	0	-	-
										1,848,409	1,848,409
-343,647.58000		7/8/2014		-343,647.58	-34,998,789	1.000000000 ^S 0.009626029	-343,647.58	-35,699,828	0	-701,039	-701,039
-681,174.63000		7/24/2014		-681,174.63	-69,159,658	1.000000000 ^S 0.009626029	-681,174.63	-70,763,825	0	-	-
										1,604,167	1,604,167
-460,609.05000		7/22/2014		-460,609.05	-46,671,210	1.000000000 ^S 0.009626029	-460,609.05	-47,850,370	0	-	-
										1,179,160	1,179,160
-38,837.19000		7/22/2014		-38,837.19	-3,935,178	1.000000000 ^S 0.009626029	-38,837.19	-4,034,601	0	-99,423	-99,423

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられてい ない資産											
外貨勘定											
-619,064.77000		7/22/2014		-619,064.77	-62,726,736	1.000000000 ^S 0.009626029	-619,064.77	-64,311,542	0	1,584,806	1,584,806
-234,712.03000		7/22/2014		-234,712.03	-23,782,196	1.000000000 ^S 0.009626029	-234,712.03	-24,383,059	0	-600,863	-600,863
-197,490.93000		6/13/2014		-197,490.93	-20,107,538	1.000000000 ^S 0.009626029	-197,490.93	-20,516,345	0	-408,807	-408,807
-981,134.47000		6/30/2014		-981,134.47	-99,462,507	1.000000000 ^S 0.009626029	-981,134.47	101,925,152	0	2,462,645	2,462,645
-103,690.24000		8/13/2014		-103,690.24	-10,595,587	1.000000000 ^S 0.009626029	-103,690.24	-10,771,860	0	-176,273	-176,273
-149,557.51000		8/14/2014		-149,557.51	-15,310,202	1.000000000 ^S 0.009626029	-149,557.51	-15,536,782	0	-226,580	-226,580
-183,716.69000		7/2/2014		-183,716.69	-18,651,836	1.000000000 ^S 0.009626029	-183,716.69	-19,085,408	0	-433,572	-433,572
1,099,370.12000		6/18/2014		1,099,370.12	112,322,644	1.000000000 ^S 0.009626029	1,099,370.12	114,208,062	0	1,885,418	1,885,418
-220,575.99000		7/11/2014		-220,575.99	-22,342,142	1.000000000 ^S 0.009626029	-220,575.99	-22,914,536	0	-572,394	-572,394
1,323,943.58000		7/11/2014		1,323,943.58	134,102,244	1.000000000 ^S 0.009626029	1,323,943.58	137,537,876	0	3,435,632	3,435,632
-166,620.44000		6/27/2014		-166,620.44	-16,921,139	1.000000000 ^S 0.009626029	-166,620.44	-17,309,364	0	-388,225	-388,225
-424,382.98000		7/23/2014		-424,382.98	-43,074,871	1.000000000 ^S 0.009626029	-424,382.98	-44,087,025	0	1,012,154	1,012,154
1,311,201.92000		8/11/2014		1,311,201.92	133,539,364	1.000000000 ^S 0.009626029	1,311,201.92	136,214,208	0	2,674,844	2,674,844
2,756,000.00000		8/15/2014		2,756,000.00	282,310,868	1.000000000 ^S 0.009626029	2,756,000.00	286,307,054	0	3,996,186	3,996,186
165,709.36000		8/14/2014		165,709.36	16,963,667	1.000000000 ^S 0.009626029	165,709.36	17,214,716	0	251,049	251,049

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
590,663.66000		8/26/2014		590,663.66	61,402,440	1.000000000 ^S 0.009626029	590,663.66	61,361,093	0	-41,347	-41,347
551,250.00000		8/24/2014		551,250.00	57,382,371	1.000000000 ^S 0.009626029	551,250.00	57,266,605	0	-115,766	-115,766
108,181.00000		8/21/2014		108,181.00	11,177,261	1.000000000 ^S 0.009626029	108,181.00	11,238,383	0	61,122	61,122
25,142.39000		8/14/2014		25,142.39	2,573,826	1.000000000 ^S 0.009626029	25,142.39	2,611,917	0	38,091	38,091
137,286.60000		8/14/2014		137,286.60	14,054,029	1.000000000 ^S 0.009626029	137,286.60	14,262,018	0	207,989	207,989
88,774.45000		8/14/2014		88,774.45	9,087,840	1.000000000 ^S 0.009626029	88,774.45	9,222,334	0	134,494	134,494
97,256.25000		8/15/2014		97,256.25	9,962,444	1.000000000 ^S 0.009626029	97,256.25	10,103,465	0	141,021	141,021
194,437.50000		8/17/2014		194,437.50	19,917,206	1.000000000 ^S 0.009626029	194,437.50	20,199,139	0	281,933	281,933
5,992,500.00000		8/18/2014		5,992,500.00	613,841,755	1.000000000 ^S 0.009626029	5,992,500.00	622,530,848	0	8,689,093	8,689,093
1,080.21000		8/18/2014		1,080.21	110,651	1.000000000 ^S 0.009626029	1,080.21	112,218	0	1,567	1,567
4,786,875.00000		8/18/2014		4,786,875.00	490,343,555	1.000000000 ^S 0.009626029	4,786,875.00	497,284,498	0	6,940,943	6,940,943
171,281.25000		8/18/2014		171,281.25	17,545,195	1.000000000 ^S 0.009626029	171,281.25	17,793,552	0	248,357	248,357
217,534,594.11000		8/13/2014		217,534,594.11	22,228,772,814	1.000000000 ^S 0.009626029	217,534,594.11	22,598,580,797	0	369,807,983	369,807,983
3,255,000.00000		8/14/2014		3,255,000.00	333,214,345	1.000000000 ^S 0.009626029	3,255,000.00	338,145,667	0	4,931,322	4,931,322
10,095,635.68000		8/13/2014		10,095,635.68	1,031,622,547	1.000000000 ^S 0.009626029	10,095,635.68	1,048,785,089	0	17,162,542	17,162,542

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
35,787,872.37000		8/13/2014		35,787,872.37	3,656,983,790	1.000000000 ^S 0.009626029	35,787,872.37	3,717,823,037	0	60,839,247	60,839,247
27,886,422.32000		8/13/2014		27,886,422.32	2,849,574,105	1.000000000 ^S 0.009626029	27,886,422.32	2,896,980,917	0	47,406,812	47,406,812
1,689,400.26000		8/13/2014		1,689,400.26	172,631,368	1.000000000 ^S 0.009626029	1,689,400.26	175,503,342	0	2,871,974	2,871,974
4,470,000.00000		8/13/2014		4,470,000.00	456,766,956	1.000000000 ^S 0.009626029	4,470,000.00	464,365,939	0	7,598,983	7,598,983
37,187.50000		8/14/2014		37,187.50	3,806,884	1.000000000 ^S 0.009626029	37,187.50	3,863,223	0	56,339	56,339
80,083.33000		8/14/2014		80,083.33	8,198,130	1.000000000 ^S 0.009626029	80,083.33	8,319,457	0	121,327	121,327
3,146,500.00000		8/14/2014		3,146,500.00	322,107,200	1.000000000 ^S 0.009626029	3,146,500.00	326,874,145	0	4,766,945	4,766,945
77,413.89000		8/14/2014		77,413.89	7,924,860	1.000000000 ^S 0.009626029	77,413.89	8,042,142	0	117,282	117,282
1,060,000.00000		8/14/2014		1,060,000.00	108,512,198	1.000000000 ^S 0.009626029	1,060,000.00	110,118,098	0	1,605,900	1,605,900
37,187.50000		8/14/2014		37,187.50	3,806,884	1.000000000 ^S 0.009626029	37,187.50	3,863,223	0	56,339	56,339
1,060,000.00000		8/14/2014		1,060,000.00	108,512,198	1.000000000 ^S 0.009626029	1,060,000.00	110,118,098	0	1,605,900	1,605,900
4,124,830.14000	合計			4,124,830	511,409,590		4,124,830	428,507,968	0	-	-
0.00000										82,901,622	82,901,622
8,788,800.88000	外貨勘定 合計			8,788,801	982,343,984		8,788,801	887,428,161	0	-	-
先物（ポジション）											
39,014,740.40000	AUD FORWARD 7/30/2014 15 OCT FAU15OCT			39,014,740.40	3,740,489,363	1.000000000 ^F 96.800941835	39,014,740.40	3,776,663,616	0	36,174,253	36,174,253

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
先物（ポジション）											
1,246,470.59000		8/7/2014		1,246,470.59	118,988,731	1.000000000 ^F 96.800941835	1,246,470.59	120,659,527	0	1,670,796	1,670,796
11,391,491.79000		7/30/2014		11,391,491.79	1,084,583,935	1.000000000 ^F 96.800941835	11,391,491.79	1,102,707,134	0	18,123,199	18,123,199
6,012,078.55000		7/30/2014		6,012,078.55	576,400,500	1.000000000 ^F 96.800941835	6,012,078.55	581,974,866	0	5,574,366	5,574,366
1,805,300.56000		7/30/2014		1,805,300.56	173,080,930	1.000000000 ^F 96.800941835	1,805,300.56	174,754,795	0	1,673,865	1,673,865
-2,160,289.13000		8/20/2014		-2,160,289.13	-205,650,030	1.000000000 ^F 96.800941835	-2,160,289.13	-209,118,022	0	-3,467,992	-3,467,992
-		7/30/2014		-	-	1.000000000 ^F 96.800941835	-	-	0	-	-
57,785,206.09000		7/30/2014		57,785,206.09	5,499,300,134	1.000000000 ^F 96.800941835	57,785,206.09	5,593,662,374	0	94,362,240	94,362,240
-2,959,631.22000		7/30/2014		-2,959,631.22	-281,774,060	1.000000000 ^F 96.800941835	-2,959,631.22	-286,495,090	0	-4,721,030	-4,721,030
-3,435,044.55000	合計			-3,435,045	-293,180,765		-3,435,045	-332,515,548	0	-	-
0.00000											
3,534,832.60000	EUR FORWARD 15 OCT FEU15OCT	8/4/2014		3,534,832.60	486,300,005	1.000000000 ^F 136.829603358	3,534,832.60	483,669,743	0	-2,630,262	-2,630,262
26,912,914.43000		7/30/2014		26,912,914.43	3,686,611,775	1.000000000 ^F 136.829603358	26,912,914.43	3,682,483,407	0	-4,128,368	-4,128,368
-4,551,490.46000		7/30/2014		-4,551,490.46	-623,467,716	1.000000000 ^F 136.829603358	-4,551,490.46	-622,778,634	0	689,082	689,082
-860,000.00000		8/27/2014		-860,000.00	-117,832,299	1.000000000 ^F 136.829603358	-860,000.00	-117,673,459	0	158,840	158,840
-780,000.00000	FEU15OCT	8/4/2014		-780,000.00	-107,428,543	1.000000000 ^F 136.829603358	-780,000.00	-106,727,091	0	701,452	701,452
-5,122,334.56000		8/8/2014		-5,122,334.56	-701,153,869	1.000000000 ^F 136.829603358	-5,122,334.56	-700,887,006	0	266,863	266,863
-2,361,068.91000		8/11/2014		-2,361,068.91	-322,114,781	1.000000000 ^F 136.829603358	-2,361,068.91	-323,064,122	0	-949,341	-949,341

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
先物 (ポジション)											
110,159,553.15000		7/30/2014		110,159,553.15	15,089,688,694	1.000000000 ^F 136.829603358	110,159,553.15	15,073,087,964	0	16,600,730	16,600,730
-1,052,149.81000		8/20/2014		-1,052,149.81	-143,955,020	1.000000000 ^F 136.829603358	-1,052,149.81	-143,965,241	0	-10,221	-10,221
-24,432,181.33000		7/30/2014		-24,432,181.33	-3,345,310,383	1.000000000 ^F 136.829603358	-24,432,181.33	-3,343,045,681	0	2,264,702	2,264,702
-682,383.63000		7/30/2014		-682,383.63	-93,472,774	1.000000000 ^F 136.829603358	-682,383.63	-93,370,281	0	102,493	102,493
-14,545,826.79000		7/30/2014		-14,545,826.79	-1,991,670,292	1.000000000 ^F 136.829603358	-14,545,826.79	-1,990,299,710	0	1,370,582	1,370,582
-45,265,457.43000		7/30/2014		-45,265,457.43	-6,200,326,565	1.000000000 ^F 136.829603358	-45,265,457.43	-6,193,654,586	0	6,671,979	6,671,979
-4,178,391.46000		7/30/2014		-4,178,391.46	-576,400,503	1.000000000 ^F 136.829603358	-4,178,391.46	-571,727,646	0	4,672,857	4,672,857
183,543,090.50000 0.00000	合計			-183,543,091	25,139,909,659		-183,543,091	25,114,128,271	0	25,781,388	25,781,388
-5,067,630.27	GBP FORWARD 8/12/2014 15 OCT FGB15OCT			-5,067,630.27	-867,885,658	1.000000000 ^F 172.398277259	-5,067,630.27	-873,650,728	0	-5,765,070	-5,765,070
-1,190,411.64		8/7/2014		-1,190,411.64	-205,185,817	1.000000000 ^F 172.398277259	-1,190,411.64	-205,224,916	0	-39,099	-39,099
-1,360,000.00		8/27/2014		-1,360,000.00	-234,096,040	1.000000000 ^F 172.398277259	-1,360,000.00	-234,461,657	0	-365,617	-365,617
-732,864.64		8/6/2014		-732,864.64	-126,222,705	1.000000000 ^F 172.398277259	-732,864.64	-126,344,601	0	-121,896	-121,896
-760,000.00		8/4/2014		-760,000.00	-131,055,237	1.000000000 ^F 172.398277259	-760,000.00	-131,022,691	0	32,546	32,546
-6,466,644.33		8/8/2014		-6,466,644.33	-1,109,821,196	1.000000000 ^F 172.398277259	-6,466,644.33	-1,114,838,342	0	-5,017,146	-5,017,146
-4,545,345.74		8/11/2014		-4,545,345.74	-776,666,387	1.000000000 ^F 172.398277259	-4,545,345.74	-783,609,775	0	-6,943,388	-6,943,388

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

(注 1) 表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない											
資産											
先物 (ポジション)											
-43,367,928.80		7/30/2014		-43,367,928.80	-7,497,632,877	1.000000000 ^F 172.398277259	-43,367,928.80	-7,476,556,213	0	21,076,664	21,076,664
-21,477,028.48		7/30/2014		-21,477,028.48	-3,740,489,362	1.000000000 ^F 172.398277259	-21,477,028.48	-3,702,602,711	0	37,886,651	37,886,651
-39,981,592.02		7/30/2014		-39,981,592.02	-6,912,106,764	1.000000000 ^F 172.398277259	-39,981,592.02	-6,892,757,586	0	19,349,178	19,349,178
-795,079.36		7/30/2014		-795,079.36	-137,455,905	1.000000000 ^F 172.398277259	-795,079.36	-137,070,312	0	385,593	385,593
-14,007,558.38		7/30/2014		-14,007,558.38	-2,422,656,255	1.000000000 ^F 172.398277259	-14,007,558.38	-2,414,878,933	0	7,777,322	7,777,322
-4,326,275.31		7/30/2014		-4,326,275.31	-747,935,241	1.000000000 ^F 172.398277259	-4,326,275.31	-745,842,410	0	2,092,831	2,092,831
-21,397,549.55		7/30/2014		-21,397,549.55	-3,700,706,210	1.000000000 ^F 172.398277259	-21,397,549.55	-3,688,900,680	0	11,805,530	11,805,530
165,475,908.52000 0.00000	合計			-165,475,909	-		-165,475,909	-	0	82,154,099	82,154,099
8,499,100.09000	USD FORWARD 8/12/2014 15 OCT FUS15OCT	8/12/2014		8,499,100.09	867,885,657	1.000000000 ^F 0.009629492	8,499,100.09	882,611,470	0	14,725,813	14,725,813
53,840,787.92000		7/30/2014		53,840,787.92	5,499,300,128	1.000000000 ^F 0.009629492	53,840,787.92	5,591,238,657	0	91,938,529	91,938,529
100,593,491.09000		7/30/2014		100,593,491.09	10,278,884,391	1.000000000 ^F 0.009629492	100,593,491.09	10,446,396,455	0	167,512,064	167,512,064
19,499,408.10000		7/30/2014		19,499,408.10	1,991,670,286	1.000000000 ^F 0.009629492	19,499,408.10	2,024,967,475	0	33,297,189	33,297,189
7,322,644.94000		7/30/2014		7,322,644.94	747,935,233	1.000000000 ^F 0.009629492	7,322,644.94	760,439,381	0	12,504,148	12,504,148
32,752,194.20000		7/30/2014		32,752,194.20	3,345,310,363	1.000000000 ^F 0.009629492	32,752,194.20	3,401,238,009	0	55,927,646	55,927,646
1,345,759.28000		7/30/2014		1,345,759.28	137,455,904	1.000000000 ^F 0.009629492	1,345,759.28	139,753,923	0	2,298,019	2,298,019

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注 1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注 1）	取得原価 （基準通貨） （注 2） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注 1）	価額 （基準通貨） （注 2） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
先物（ポジション）											
67,672,842.65000		7/30/2014		67,672,842.65	6,912,106,725	1.000000000 ^F 0.009629492	67,672,842.65	7,027,664,871	0	115,558,146	115,558,146
7,402,242.55000		8/13/2014		7,402,242.55	758,000,007	1.000000000 ^F 0.009629492	7,402,242.55	768,705,405	0	10,705,398	10,705,398
248,317,102.53000		7/30/2014		248,317,102.53	25,374,407,422	1.000000000 ^F 0.009629492	248,317,102.53	25,787,144,590	0	412,737,168	412,737,168
7,625,962.91000		8/11/2014		7,625,962.91	776,666,379	1.000000000 ^F 0.009629492	7,625,962.91	791,938,236	0	15,271,857	15,271,857
3,162,793.47000		8/11/2014		3,162,793.47	322,114,778	1.000000000 ^F 0.009629492	3,162,793.47	328,448,632	0	6,333,854	6,333,854
6,862,284.04000		8/8/2014		6,862,284.04	701,153,866	1.000000000 ^F 0.009629492	6,862,284.04	712,631,989	0	11,478,123	11,478,123
10,861,964.28000		8/8/2014		10,861,964.28	1,109,821,192	1.000000000 ^F 0.009629492	10,861,964.28	1,127,989,335	0	18,168,143	18,168,143
7,560,860.40000		8/5/2014		7,560,860.40	776,300,007	1.000000000 ^F 0.009629492	7,560,860.40	785,177,494	0	8,877,487	8,877,487
4,842,623.92000		8/20/2014		4,842,623.92	500,000,002	1.000000000 ^F 0.009629492	4,842,623.92	502,895,056	0	2,895,054	2,895,054
1,233,064.54000		8/6/2014		1,233,064.54	126,222,703	1.000000000 ^F 0.009629492	1,233,064.54	128,050,840	0	1,828,137	1,828,137
5,149,033.23000		8/27/2014		5,149,033.23	535,000,004	1.000000000 ^F 0.009629492	5,149,033.23	534,714,939	0	-285,065	-285,065
2,004,452.02000		8/7/2014		2,004,452.02	205,185,815	1.000000000 ^F 0.009629492	2,004,452.02	208,157,608	0	2,971,793	2,971,793
73,405,423.65000		7/30/2014		73,405,423.65	7,497,632,767	1.000000000 ^F 0.009629492	73,405,423.65	7,622,979,867	0	125,347,100	125,347,100
2,000,000.00000		8/20/2014		2,000,000.00	205,650,029	1.000000000 ^F 0.009629492	2,000,000.00	207,695,276	0	2,045,247	2,045,247
1,400,000.00000		8/20/2014		1,400,000.00	143,955,020	1.000000000 ^F 0.009629492	1,400,000.00	145,386,693	0	1,431,673	1,431,673

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注 1）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

保有有価証券残高明細
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
クラス・カテゴリー別 2014年 8月29日現在

									未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	通貨 (円)
クラスに割当てられていない資産										
先物（ポジション）										
-3,380,000.00000		8/19/2014		-3,380,000.00	-346,651,787	1.000000000F 0.009629492	-3,380,000.00	-351,005,017	0	-4,353,230
-1,150,000.00000		8/7/2014		-1,150,000.00	-118,988,731	1.000000000F 0.009629492	-1,150,000.00	-119,424,784	0	-436,053
-27,886,422.32000		7/30/2014		27,886,422.32	-2,849,504,368	1.000000000F 0.009629492	27,886,422.32	-2,895,939,092	0	-46,434,724
-1,682,079.77000		7/30/2014		-1,682,079.77	-173,080,930	1.000000000F 0.009629492	-1,682,079.77	-174,680,011	0	-1,599,081
-67,195,183.51000		7/30/2014		67,195,183.51	-6,866,192,022	1.000000000F 0.009629492	67,195,183.51	-6,978,061,097	0	-111,869,075
-22,457,877.07000		7/30/2014		22,457,877.07	-2,294,779,576	1.000000000F 0.009629492	22,457,877.07	-2,332,197,490	0	-37,417,914
-4,530,000.00000		8/11/2014		-4,530,000.00	-462,211,576	1.000000000F 0.009629492	-4,530,000.00	-470,429,800	0	-8,218,224
-2,600,000.00000		8/21/2014		-2,600,000.00	-269,929,141	1.000000000F 0.009629492	-2,600,000.00	-270,003,859	0	-74,718
-6,870,000.00000		8/5/2014		-6,870,000.00	-704,407,212	1.000000000F 0.009629492	-6,870,000.00	-713,433,274	0	-9,026,062
-5,000,000.00000		8/14/2014		-5,000,000.00	-511,998,002	1.000000000F 0.009629492	-5,000,000.00	-519,238,190	0	-7,240,188
530,602,473.14000 0.00000	合計			530,602,473	54,214,915,333		530,602,473	55,101,813,587	0	886,898,254
178,148,429.57000	先物 (ポ ジ ショ ン) 合計			178,148,430	171,909,255		178,148,430	1,127,408,213	0	955,498,958
1,719,599,401.45000	クラスに割当て られていない資 産合計			1,739,480,212	91,397,652,386		1,800,720,923	114,905,539,566	7,898,780,670	15,609,106,515
1,441,792,054.16000	ポート フォ リオ 合計			1,461,672,865	39,865,428,078		1,522,913,576	62,672,884,787	7,898,780,670	14,908,676,044

取得毎の残高を表示する残高明細では、時価評価や評価損益の算定において端数処理が発生し、通算の残高を表示する貸借対照表上の数値に対して四捨五入による誤差が生じる場合があります。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。表示通貨は各投資対象により異なります。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は日本円です。

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（平成26年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約41億円）

発行済株式総数 1,002,080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へ要求した場合。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。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

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

管理会社は、平成26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	73	9,786,155,657.33米ドル

（３）その他

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

[次へ](#)

5 管理会社の経理の概況

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の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．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、円貨換算が併記されている。日本円への換算には平成26年9月30日現在における株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝109.45円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(１) 資産及び負債の状況

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2014年 6 月30日現在

(単位：米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	166,643,749.00	18,239,158
1.2	売買目的で保有される金融資産	12,741,166.00	1,394,521
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	12,741,166.00	1,394,521
1.2.2	持分証券		
1.2.3	債務証券		
1.2.4	ローンおよび貸付金		
1.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0.00	0
1.3.1	持分証券		
1.3.2	債務証券		
1.3.3	ローンおよび貸付金		
1.4	売却可能金融資産	10,579,181.00	1,157,891
1.4.1	持分証券	10,579,181.00	1,157,891
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	2,051,387,292.00	224,524,339
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	2,051,387,292.00	224,524,339
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	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		
1.9	有形資産	2,123,168.00	232,381
1.9.1	有形固定資産	2,123,168.00	232,381
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	5,758,216.00	630,237
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	5,758,216.00	630,237
1.12	税金資産	153,854.00	16,839
1.12.1	現行税金資産	153,854.00	16,839
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	29,475,495.00	3,226,093
1.14	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		
1.15	資産合計	2,278,862,121.00	249,421,459

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2014年 6 月30日現在

（単位：米ドル）

負債

		米ドル	千円
2.1	中央銀行預金		
2.2	売買目的で保有される金融負債	12,492,671.00	1,367,323
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	12,492,671.00	1,367,323
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証書（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証書（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	2,116,343,159.00	231,633,759
2.4.1	金融機関からの預金	770,002,106.00	84,276,731
2.4.2	金融機関以外からの預金	1,346,341,053.00	147,357,028
2.4.3	債務証書（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	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		
2.8	引当金	0.00	0
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務		
2.8.3	年金およびその他の退職後給付金債務		
2.8.4	ローン契約および保証		
2.8.5	有償契約		
2.8.99	その他の引当金		
2.9	税金負債	6,652,544.00	728,121
2.9.1	現行税金負債	2,871,321.00	314,266
2.9.2	繰延税金負債	3,781,223.00	413,855
2.10	その他の負債	15,318,840.00	1,676,647
2.11	要求払株式資本（例えば、共同株式）		
2.12	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		
2.13	負債合計	2,150,807,214.00	235,405,850

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2014年6月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	4,062,562
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	4,062,562
3.1.2	未払込請求資本		
3.2	株式発行差金		
3.3	その他のエクイティ	0.00	0
3.3.1	複合金融商品のエクイティ部分		
3.3.99	その他のエクイティ商品		
3.4	再評価準備金およびその他の評価差額：	2,906,721.00	318,141
3.4.1	有形資産		
3.4.2	無形資産		
3.4.3	外国事業純投資のヘッジ（有効部分）		
3.4.4	外貨換算		
3.4.5	キャッシュ・フロー・ヘッジ（有効部分）		
3.4.6	売却可能金融資産	2,906,721.00	318,141
3.4.7	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ	0.00	0
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	77,823,159.00	8,517,745
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	10,207,058.00	1,117,162
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	128,054,907.00	14,015,610
3.11	負債および資本合計	2,278,862,121.00	249,421,459

（２）損益の状況

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

損益計算書

2014年６月30日に終了した期間

（単位：米ドル）

		米ドル	千円
5.1	金融および運用収益および費用（＋／－）	34,909,076.00	3,820,798
5.2	利息収益	4,009,074.00	438,793
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	28,541.00	3,124
5.2.2	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）	1,493,866.00	163,504
5.2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.2.4	売却可能金融資産		
5.2.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）	2,486,667.00	272,166
5.2.6	満期保有目的投資有価証券		
5.2.7	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
5.2.99	その他の資産		
5.3	（支払利息）（－）	684,576.00	74,927
5.3.1	中央銀行からの預金	430.00	47
5.3.2	売買目的で保有される金融負債（区別して計上される場合）	40,022.00	4,380
5.3.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債		
5.3.4	償却後原価で測定される金融負債	644,124.00	70,499
5.3.5	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
5.3.99	その他の負債		
5.4	要求払株式資本に係る費用（－）		
5.5	受取配当（＋）	0.00	0
5.5.1	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）		
5.5.2	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.5.3	売却可能金融資産	0.00	0
5.6	受取手数料（＋）	52,937,310.00	5,793,989
5.7	（支払手数料）（－）	23,120,092.00	2,530,494
5.8	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に係る実現利益（損失）、純額（＋／－）	69.00	8
5.8.1	売却可能金融資産	69.00	8
5.8.2	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）		
5.8.3	満期保有目的投資有価証券		
5.8.4	償却後原価で測定される金融負債		
5.8.99	その他		
5.9	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）	2,250,805.00	246,351
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	2,250,805.00	246,351
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（＋／－）		
5.12	為替差額、純額（＋／－）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.14	その他の事業収益（＋）	458,262.00	50,157

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	941,776.00	103,077
5.16	一般管理費（－）	19,461,134.00	2,130,021
5.16.1	従業員費用（－）	8,939,148.00	978,390
5.16.2	一般管理費用（－）	10,521,986.00	1,151,631
5.17	減価償却（＋／－）	917,408.00	100,410
5.17.1	有形固定資産	200,660.00	21,962
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	716,748.00	78,448
5.18	引当金（＋／－）	0.00	0
5.19	減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1	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（＋／－）	0.00	0
5.19.1.1	取得原価で測定される金融資産（値付けされていないエクイティ）		
5.19.1.2	売却可能金融資産		
5.19.1.3	償却後原価で測定されるローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）		
5.19.1.4	償却後原価で測定される満期保有目的投資証券		
5.19.2	非金融資産に係る減損、純額（＋／－）	0.00	0
5.19.2.1	有形固定資産		
5.19.2.2	投資不動産		
5.19.2.3	営業権		
5.19.2.4	その他の無形資産		
5.19.2.99	その他		
5.20	直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）		
5.22	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除却グループからの損益（＋／－）		
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	14,530,534.00	1,590,367
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,323,476.00	473,204
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	10,207,058.00	1,117,162
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	10,207,058.00	1,117,162

[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 (平成26年 6 月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約38億円)

発行済株式総数 1,002,080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。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

() 資本金の額 (平成26年 9 月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約41億円)

発行済株式総数 1,002,080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、平成26年9月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場
の仲値 (1 米ドル = 109.45円) による。

(後略)

5 運用状況

(2) 投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄

(平成26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	LLOYDS TSB BANK	英国	社債	7.6250	2025/ 4 /22	18,440,000	173.81	3,205,114,542	217.88	4,017,743,415	3.35
2	BARCLAYS BK PLC	英国	社債	7.7500 (2018年 4 月以降 変動金利)	2023/ 4 /10	34,090,000	105.97	3,612,348,929	112.93	3,849,809,631	3.21
3	DNB NORBANK ASA	ノル ウェー	社債	6.0116 (2017年 3 月以降 変動金利)	2049/ 3 /29	20,166,000	147.29	2,970,349,291	185.26	3,735,990,537	3.11
4	CSG GUERNSEY	ガーン ジー	社債	7.8750 (2016年 8 月以降 変動金利)	2041/ 2 /24	33,040,000	92.25	3,047,986,965	109.52	3,618,568,457	3.01
5	PRUDENTIAL FIN	米国	社債	5.6250 (2023年 6 月以降 変動金利)	2043/ 6 /15	32,950,000	93.99	3,096,866,830	108.81	3,585,379,046	2.99
6	RABOBANK	オランダ	社債	8.4000 (2017年 6 月以降 変動金利)	2049/12/29	30,500,000	97.28	2,966,992,727	114.46	3,490,889,880	2.91
7	NIPPON LIFE INS	日本	社債	5.0000 (2022年10月以降 変動金利)	2042/10/18	30,656,000	91.59	2,807,828,662	109.47	3,355,917,882	2.79
8	SOMPO JAPAN INS	日本	社債	5.3250 (2023年 3 月以降 変動金利)	2073/ 3 /28	29,610,000	97.47	2,885,955,119	109.57	3,244,381,687	2.70
9	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.0000 (2022年 3 月以降 変動金利)	2072/ 3 /15	25,390,000	92.82	2,356,659,383	120.81	3,067,449,907	2.55
10	DANSKE BANK	デンマ ーク	社債	5.3750 (2018年 9 月以降 変動金利)	2021/ 9 /29	15,235,000	131.91	2,009,635,628	185.52	2,826,343,480	2.35
11	CLOVERIE PLC	アイル ランド	社債	6.6250 (2022年 9 月以降 変動金利)	2042/ 9 / 1	14,950,000	125.85	1,881,382,925	177.00	2,646,172,003	2.20
12	ROYAL BK SCOTLND	英国	社債	6.1250	2022/12/15	23,480,000	87.37	2,051,409,830	111.13	2,609,298,244	2.17
13	BNP PARIBAS	フランス	社債	5.1860 (2015年 6 月以降 変動金利)	2049/ 6 /29	24,600,000	86.15	2,119,362,095	103.52	2,546,705,044	2.12
14	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.0000	2023/11/ 7	23,000,000	100.22	2,304,989,890	108.96	2,506,117,523	2.09
15	ABN AMRO BANK NV	オランダ	社債	6.3750	2021/ 4 /27	13,240,000	107.31	1,420,776,255	169.81	2,248,226,545	1.87
16	GOLDMAN SACHS GP	米国	社債	4.7500	2021/10/12	13,700,000	95.27	1,305,148,613	158.26	2,168,182,209	1.81
17	GE CAP TRUST I	米国	社債	6.3750 (2017年11月以降 変動金利)	2067/11/15	18,880,000	81.55	1,539,700,973	112.81	2,129,875,921	1.77
18	BANCO BRASL (C1)	ブラジル	社債	5.8750	2023/ 1 /19	19,590,000	83.37	1,633,218,778	104.34	2,044,022,576	1.70
19	AMERICAN EXPRESS	米国	社債	6.8000 (2016年 9 月以降 変動金利)	2066/ 9 / 1	16,820,000	83.18	1,399,095,402	111.49	1,875,333,394	1.56
20	BANK OF AMER CRP	米国	社債	2.0000	2018/ 1 /11	17,650,000	94.35	1,665,350,611	102.03	1,800,746,155	1.50
21	MUFG CAP FIN 5	ケイマン 諸島	社債	6.2990 (2017年 1 月以降 変動金利)	2049/ 1 /25	9,320,000	133.25	1,241,860,241	187.57	1,748,143,985	1.46
22	BPCE	フランス	社債	9.2500	2049/10/22	11,790,000	103.92	1,225,254,415	145.42	1,714,540,060	1.43

	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	
23	DANSKE BANK A/S	デンマーク	社債	3.8750 (2018年10月以降 変動金利)	2023/10/4	11,050,000	133.90	1,479,541,252	149.31	1,649,871,866	1.37
24	ROYAL BK SCOTLND	英国	社債	6.9340	2018/4/9	10,180,000	96.34	980,707,453	160.90	1,637,985,982	1.36
25	ING BANK NV	オランダ	社債	3.5000 (2018年11月以降 変動金利)	2023/11/21	10,902,000	110.50	1,204,699,290	144.79	1,578,524,015	1.31
26	MORGAN STANLEY	米国	社債	4.8750	2022/11/1	13,150,000	87.38	1,149,095,926	109.04	1,433,911,206	1.19
27	UBS AG JERSEY	スイス	社債	7.2500 (2017年2月以降 変動金利)	2022/2/22	12,650,000	82.17	1,039,446,800	111.37	1,408,890,213	1.17
28	BUPA FINANCE PLC	英国	社債	5.0000	2023/4/25	7,870,000	150.79	1,186,748,279	176.93	1,392,426,550	1.16
29	NATIONAL CAP TST	米国	社債	5.6200 (2018年12月以降 変動金利)	2049/12/17	7,376,000	120.78	890,898,589	183.96	1,356,921,871	1.13
30	VTB BANK	ルクセンブルグ	社債	6.8750	2018/5/29	12,320,000	93.92	1,157,098,269	109.38	1,347,561,885	1.12

投資不動産物件

該当事項なし。（平成26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。（平成26年6月末日現在）

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

（平成26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	LLOYDS TSB BANK	英国	社債	7.6250	2025/ 4 / 22	18,440,000	173.81	3,205,114,542	222.49	4,102,668,921	3.54
2	DNB NORBANK ASA	ノル ウェー	社債	6.0116 (2017年3月以降 変動金利)	2049/ 3 / 29	20,166,000	147.29	2,970,349,291	187.55	3,782,073,222	3.27
3	PRUDENTIAL FIN	米国	社債	5.6250 (2023年6月以降 変動金利)	2043/ 6 / 15	32,950,000	93.99	3,096,866,830	114.58	3,775,256,960	3.26
4	NIPPON LIFE INS	日本	社債	5.0000 (2022年10月以降 変動金利)	2042/10/18	30,656,000	91.59	2,807,828,662	115.15	3,529,907,920	3.05
5	SOMPO JAPAN INS	日本	社債	5.3250 (2023年3月以降 変動金利)	2073/ 3 / 28	29,610,000	97.47	2,885,955,119	115.38	3,416,253,926	2.95
6	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.0000 (2022年3月以降 変動金利)	2072/ 3 / 15	25,390,000	92.82	2,356,659,383	127.72	3,242,784,957	2.80
7	DANSKE BANK	デンマ ーク	社債	5.3750 (2018年9月以降 変動金利)	2021/ 9 / 29	15,235,000	131.91	2,009,635,628	188.09	2,865,596,304	2.48
8	ROYAL BK SCOTLND	英国	社債	6.1250	2022/12/15	23,480,000	87.37	2,051,409,830	116.67	2,739,371,939	2.37
9	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.0000	2023/11/ 7	23,000,000	100.22	2,304,989,890	115.10	2,647,242,025	2.29
10	MUFG CAP FIN 5	ケイマン 諸島	社債	6.2990 (2017年1月以降 変動金利)	2049/ 1 / 25	12,420,000	146.11	1,814,650,644	191.66	2,380,398,637	2.06
11	ABN AMRO BANK NV	オランダ	社債	6.3750	2021/ 4 / 27	13,240,000	107.31	1,420,776,255	172.13	2,279,004,504	1.97
12	GE CAP TRUST I	米国	社債	6.3750 (2017年11月以降 変動金利)	2067/11/15	18,880,000	81.55	1,539,700,973	119.23	2,251,118,606	1.94
13	RABOBANK	オランダ	社債	8.4000 (2017年6月以降 変動金利)	2049/12/29	18,200,000	97.28	1,770,467,791	121.32	2,207,992,697	1.91
14	BANCO BRASL (C1)	ブラジル	社債	5.8750	2023/ 1 / 19	19,590,000	83.37	1,633,218,778	112.15	2,196,953,487	1.90
15	CLOVERIE PLC	アイル ランド	社債	6.6250 (2022年9月以降 変動金利)	2042/ 9 / 1	12,500,000	125.85	1,573,062,646	175.28	2,190,982,552	1.89
16	BARCLAYS BK PLC	英国	社債	7.7500 (2018年4月以降 変動金利)	2023/ 4 / 10	18,000,000	105.97	1,907,371,098	118.70	2,136,597,468	1.85
17	AMERICAN EXPRESS	米国	社債	6.8000 (2016年9月以降 変動金利)	2066/ 9 / 1	16,820,000	83.18	1,399,095,402	117.40	1,974,741,363	1.71
18	BNP PARIBAS	フランス	社債	5.1860 (2015年6月以降 変動金利)	2049/ 6 / 29	16,450,000	86.15	1,417,215,710	111.26	1,830,214,677	1.58
19	AXA SA	フランス	社債	6.7720 (2019年10月以降 変動金利)	2049/10/29	8,850,000	178.18	1,576,865,704	191.80	1,697,389,543	1.47
20	BPCE	フランス	社債	9.2500	2049/10/22	11,790,000	103.92	1,225,254,415	143.94	1,697,009,521	1.47
21	SOCIETE GENERALE	フランス	社債	9.3750 (2019年9月以降 変動金利)	2049/ 9 / 4	9,700,000	141.61	1,373,574,896	170.28	1,651,705,489	1.43
22	CSG GUERNSEY	ガーン ジー	社債	7.8750 (2016年8月以降 変動金利)	2041/ 2 / 24	14,000,000	92.25	1,291,519,901	116.58	1,632,173,786	1.41

	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	
23	ING BANK NV	オランダ	社債	3.5000 (2018年11月以降 変動金利)	2023/11/21	10,902,000	110.50	1,204,699,290	146.46	1,596,658,843	1.38
24	CREDIT AGRICOLE	フランス	社債	5.1360 (2016年2月以降 変動金利)	2049/2/24	8,750,000	154.68	1,353,455,394	181.76	1,590,403,233	1.37
25	SOCIETE GENERALE	フランス	社債	2.5000 (2021年9月以降 変動金利)	2026/9/16	11,500,000	136.29	1,567,283,607	136.40	1,568,577,166	1.36
26	MORGAN STANLEY	米国	社債	4.8750	2022/11/1	13,150,000	87.38	1,149,095,926	116.19	1,527,913,385	1.32
27	UBS AG JERSEY	スイス	社債	7.2500 (2017年2月以降 変動金利)	2022/2/22	12,650,000	82.17	1,039,446,800	117.61	1,487,760,016	1.29
28	ZURICH FINANCE	英国	社債	6.6250 (2022年10月以降 変動金利)	2049/10/2	7,340,000	169.11	1,241,250,971	202.37	1,485,364,728	1.28
29	WELLS FARGO CAP	米国	社債	5.9500	2036/12/15	12,610,000	79.66	1,004,488,714	112.36	1,416,894,642	1.22
30	BBVA BANCOMER SA	メキシコ	社債	7.2500	2020/4/22	11,370,000	105.67	1,201,507,199	122.80	1,396,226,459	1.21

投資不動産物件

該当事項なし。(平成26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。(平成26年9月末日現在)