

【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27年11月30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.)
(注) ルクセンブルグ当局の認可を前提として、平成28年5月1日付で、三菱ＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ(Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.)はその名称をルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)に変更する。

【代表者の役職氏名】 マネージング・ディレクター 寺脇 恒

【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、アールン通り 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

【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2,449億円)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1,878億6,000万円)を上限とする。
(注) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびオーストラリアドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、平成27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=122.45円および1豪ドル=93.93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27年8月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を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27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	英国	17,519,671,454	18.72
	フランス	17,111,814,326	18.29
	オランダ	13,642,396,573	14.58
	米国	13,322,547,208	14.24
	日本	12,386,498,243	13.24
	スウェーデン	3,502,860,973	3.74
	メキシコ	3,306,516,429	3.53
	スペイン	2,469,704,474	2.64
	ドイツ	2,183,214,731	2.33
	ノルウェー	1,999,267,063	2.14
	イタリア	1,455,849,204	1.56
	ジャージー	1,172,942,648	1.25
	デンマーク	1,094,720,454	1.17
	ケイマン諸島	225,741,442	0.24
小計		91,393,745,222	97.67
現金・その他の資産 （負債控除後）		2,180,779,610	2.33
合計（純資産総額）		93,574,524,832	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27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＝119.96円および１豪ドル＝84.06円）による。以下、米ドルおよび豪ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

（注３）ファンドは、ケイマン法に基づいて設定されているが、米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券は米ドル建、豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券は豪ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨または豪ドル貨をもって行う。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

(2) 運用実績

純資産の推移

平成27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26年10月末日	272,994,743.44	32,748,449	0.010043	1.2048
11月末日	257,037,313.75	30,834,196	0.010081	1.2093
12月末日	250,237,498.61	30,018,490	0.010021	1.2021
平成27年1月末日	253,958,847.62	30,464,903	0.010201	1.2237
2月末日	246,873,401.15	29,614,933	0.010205	1.2242
3月末日	242,572,942.88	29,099,050	0.010194	1.2229
4月末日	239,891,774.68	28,777,417	0.010139	1.2163
5月末日	234,572,342.11	28,139,298	0.010060	1.2068
6月末日	213,929,446.79	25,662,976	0.009768	1.1718
7月末日	208,724,876.70	25,038,636	0.009860	1.1828
8月末日	197,461,057.35	23,687,428	0.009720	1.1660
9月末日	190,805,539.11	22,889,032	0.009598	1.1514

< 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26年10月末日	91,766,108.24	7,713,859	0.009696	0.8150
11月末日	86,120,363.46	7,239,278	0.009719	0.8170
12月末日	82,911,127.76	6,969,509	0.009650	0.8112
平成27年 1月末日	85,396,101.86	7,178,396	0.009821	0.8256
2月末日	86,996,905.56	7,312,960	0.009799	0.8237
3月末日	86,240,073.62	7,249,341	0.009774	0.8216
4月末日	84,405,350.44	7,095,114	0.009699	0.8153
5月末日	82,516,774.67	6,936,360	0.009621	0.8087
6月末日	78,918,159.42	6,633,860	0.009334	0.7846
7月末日	78,986,103.16	6,639,572	0.009399	0.7901
8月末日	67,779,502.45	5,697,545	0.009239	0.7766
9月末日	62,991,419.26	5,295,059	0.009097	0.7647

< 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～2015年9月30日）



(注) 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、各クラスの公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金（課税前）をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なります。以下同じです。

分配の推移

平成27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26年10月1日～平成27年9月末日	0.000540	0.0648

<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26年10月1日～平成27年9月末日	0.000960	0.0807

<参考情報>

分配の推移（2015年9月末日現在）

米ドル建 米ドルヘッジクラス		豪ドル建 豪ドルヘッジクラス	
(単位:米ドル、1口当たり課税前)		(単位:豪ドル、1口当たり課税前)	
第1会計年度(2012年12月13日～2013年2月28日)	0.000045	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)	0.000540	第2会計年度(2013年3月1日～2014年2月28日)	0.000960
第3会計年度(2014年3月1日～2015年2月28日)	0.000540	第3会計年度(2014年3月1日～2015年2月28日)	0.000960
2015年5月	0.000045	2015年5月	0.000080
2015年6月	0.000045	2015年6月	0.000080
2015年7月	0.000045	2015年7月	0.000080
2015年8月	0.000045	2015年8月	0.000080
2015年9月	0.000045	2015年9月	0.000080
直近1年間累計	0.000540	直近1年間累計	0.000960
設定来累計	0.001440	設定来累計	0.002560

収益率の推移

平成27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26年10月1日～平成27年9月末日	0.96%

（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26年10月1日～平成27年9月末日	3.80%

（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、2015年については2015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す。2015年は1月1日から9月末日までの収益率です。

（注3）ファンドおよび各クラスに、ベンチマークはありません。

2 販売及び買戻しの実績

平成27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27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26年10月1日～ 平成27年9月末日	5,504,075,587 (5,504,075,587)	13,331,376,165 (13,331,376,165)	19,878,875,504 (19,878,875,504)

<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26年10月1日～ 平成27年9月末日	1,909,491,999 (1,909,491,999)	4,427,783,983 (4,427,783,983)	6,924,774,999 (6,924,774,999)

（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27年8月におけるファンドの最終評価日は、平成27年8月28日であった。そのため、第4期の中間財務書類は平成27年8月28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

2015年 8 月28日現在

	円
資産	
現金	1,909,162,637
銀行預金 - 基準通貨	367,407,721
銀行預金 - 外国通貨	1,541,754,916
有価証券（取得原価）	82,908,963,585
債券（取得原価）	82,908,963,585
未実現評価損益	14,225,613,276
未実現時価評価損益	1,336,514,923
未実現通貨運用損益	12,906,638,966
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(1,663,475)
未実現通貨繰延損益	(15,877,138)
未収収益	2,029,489,712
現金に係る未収利息	85,293
債券に係る未収利息	2,029,404,419
投資売却未収金	123,225,492
投資売却未収金	123,225,492
資本証券	74,626,363
受益証券販売未収金	74,626,363
前払費用	251,739
設立費用	251,739
資産合計：	101,271,332,804
負債	
資本証券	541,503,474
受益証券買戻未払金	541,503,474

2015年 8 月28日現在

	円
未払費用	166,395,406
未払監査費用	1,024,768
未払報告書作成費用	473,016
未払投資顧問報酬	104,034,468
未払受託報酬	1,698,065
未払管理報酬	21,551,665
未払代行協会員報酬	2,590,223
未払販売報酬	30,719,982
未払副管理報酬	4,303,219
負債合計：	707,898,880
資本	
ファンド受益証券	99,407,673,350
発行済ファンド受益証券（額面価額）	71,746,154,211,550
米ドル建 米ドルヘッジ	41,101,157,618,972
ブラジル・レアル	22,877,358,166
米ドル	4,777,090,744
豪ドル	5,548,367,201
ユーロ	26,027,417
日本円	38,866,947,327
資源国通貨バスケット	212,470,494
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,568,565,265,100
メキシコ・ペソ	706,546,625
トルコ・リラ	259,498,228
ロシア・ルーブル	3,157,021,276
受益証券額面超過額	(71,646,746,538,200)
米ドル建 米ドルヘッジ	(41,084,912,026,084)
ブラジル・レアル	(2,082,847,166)
米ドル	887,064,256
豪ドル	(930,319,201)
ユーロ	(1,055,417)
日本円	2,836,108,673
資源国通貨バスケット	17,480,506
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,610,393,138)
メキシコ・ペソ	30,341,875
トルコ・リラ	(13,399,728)
ロシア・ルーブル	(967,492,776)

2015年8月28日現在

	円
分配金支払額	(34,082,411,175)
分配金支払額	(34,082,411,175)
米ドル建 米ドルヘッジ	(4,148,647,548)
ブラジル・レアル	(10,699,917,882)
米ドル	(1,580,895,155)
豪ドル	(2,953,744,926)
ユーロ	(10,899,743)
日本円	(12,044,565,246)
資源国通貨バスケット	(247,642,610)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(2,032,601,646)
メキシコ・ペソ	(129,216,853)
トルコ・リラ	(41,617,805)
ロシア・ルーブル	(192,661,761)
利益剰余金	39,909,875,086
利益剰余金	39,909,875,086
米ドル建 米ドルヘッジ	18,107,973,614
ブラジル・レアル	13,564,193,835
米ドル	5,943,456,762
豪ドル	10,510,099,479
ユーロ	35,594,719
日本円	19,968,018,827
資源国通貨バスケット	452,847,285
豪ドル建 豪ドルヘッジ	2,335,670,297
メキシコ・ペソ	148,470,698
トルコ・リラ	19,437,867
ロシア・ルーブル	49,610,741
中間純利益	(4,671,703,337)
資本合計：	100,563,433,924
負債および資本合計	101,271,332,804
純資産額合計	100,563,433,924
発行済受益証券総数	27,658,448,317.74780口
受益証券1口当たり純資産額合計	3.635903

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

2015年3月1日から2015年8月28日までの期間

円

収益

実現損益	7,218,226,273
------	---------------

為替取引に係る実現利益	9,398,489,791
-------------	---------------

ブラジル・レアル	1,388,892,382
----------	---------------

豪ドル	453,108,479
-----	-------------

ユーロ	5,297,732
-----	-----------

日本円	721,415,937
-----	-------------

資源国通貨バスケット	15,563,934
------------	------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	627,392,511
-------------	-------------

メキシコ・ペソ	29,113,764
---------	------------

トルコ・リラ	11,876,490
--------	------------

ロシア・ルーブル	549,774,775
----------	-------------

為替取引に係る実現損失	(15,171,676,601)
-------------	------------------

ブラジル・レアル	(3,922,247,039)
----------	-----------------

豪ドル	(800,406,630)
-----	---------------

ユーロ	(6,039,905)
-----	-------------

日本円	(2,766,052,964)
-----	-----------------

資源国通貨バスケット	(36,103,442)
------------	--------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(1,037,653,058)
-------------	-----------------

メキシコ・ペソ	(75,339,323)
---------	--------------

トルコ・リラ	(25,473,079)
--------	--------------

ロシア・ルーブル	(553,093,575)
----------	---------------

市場に係る実現利益	2,024,496,281
-----------	---------------

市場に係る実現損失	(168,908,941)
-----------	---------------

2015年3月1日から2015年8月28日までの期間

	円
通貨に係る実現利益	13,688,636,487
米ドル建 米ドルヘッジ	45,472,860
ブラジル・レアル	6
豪ドル	3
ユーロ	2
日本円	2
資源国通貨バスケット	8
豪ドル建 豪ドルヘッジ	23,654,945
トルコ・リラ	5
ロシア・ルーブル	5

2015年3月1日から2015年8月28日までの期間

	円
通貨に係る実現損失	(2,553,290,563)
米ドル建 米ドルヘッジ	(46,111,735)
ブラジル・レアル	(8)
豪ドル	(4)
ユーロ	(3)
日本円	(1)
資源国通貨バスケット	(13)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(10,400,844)
メキシコ・ペソ	(1)
トルコ・リラ	(2)
ロシア・ルーブル	(2)
雑収益	479,819
ブラジル・レアル	462,701
受取利息	2,815,461,422
現金に係る受取利息	867,508
債券に係る受取利息	2,814,593,914
未実現評価損益	(14,151,097,640)
未実現時価評価損益	(5,996,170,742)
未実現通貨運用損益	(8,120,214,912)
ブラジル・レアル	272,094,501
豪ドル	(132,675,307)
ユーロ	1,119,254
日本円	1,256,647,983
資源国通貨バスケット	(1,262,960)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(138,695,375)
メキシコ・ペソ	(25,558,721)
トルコ・リラ	(4,694,051)
ロシア・ルーブル	(152,531,776)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	2,206,087
米ドル建 米ドルヘッジ	2,074,983
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(157,582)
未実現通貨繰延損益	(36,918,073)
収益合計：	(4,117,409,945)

2015年3月1日から2015年8月28日までの期間

円

費用

費用 - 報酬	543,624,320
監査費用	1,104,714
報告書作成費用	2,179,885
投資顧問報酬	336,988,199
米ドル建 米ドルヘッジ	109,393,157
ブラジル・リアル	38,670,771
米ドル	21,301,690
豪ドル	15,390,502
ユーロ	102,356
日本円	112,124,532
資源国通貨バスケット	524,900
豪ドル建 豪ドルヘッジ	29,954,718
メキシコ・ペソ	1,791,286
トルコ・リラ	502,724
ロシア・ルーブル	4,827,919
受託報酬	5,524,739
設立費用償却	259,023
米ドル建 米ドルヘッジ	5,193
豪ドル建 豪ドルヘッジ	5,193
設立費用償却	82,844
設立費用償却	82,844
設立費用償却	82,844
現金支出費用	203,236
未払管理報酬	69,059,295
代行協会員報酬	8,742,026
米ドル建 米ドルヘッジ	6,862,815
豪ドル建 豪ドルヘッジ	1,879,211
販売報酬	103,680,413
米ドル建 米ドルヘッジ	81,392,898
豪ドル建 豪ドルヘッジ	22,287,515
副保管報酬	2,070,939
副管理報酬	13,811,851
源泉徴収税	10,669,072
源泉徴収税	10,669,072
費用合計：	554,293,392
投資純利益	(4,671,703,337)

[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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
豪ドルクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
非グループ化の有価証券											
78,204,032.30000	AUD FORWARD 09 OCT	8/3/2015		78,204,032.30	7,052,713,592	1.000000000F	78,204,032.30	6,748,218,592	0	-304,495,000	-304,495,000
	FAU09OCT		AUD			86.289905954					
-7,463,000.00000		8/6/2015		-7,463,000.00	-681,450,120	1.000000000F	-7,463,000.00	-643,981,568	0	37,468,552	37,468,552
			AUD			86.289905954					
-817,000.00000		8/7/2015		-817,000.00	-74,846,618	1.000000000F	-817,000.00	-70,498,853	0	4,347,765	4,347,765
			AUD			86.289905954					
-670,000.00000		8/14/2015		-670,000.00	-61,222,366	1.000000000F	-670,000.00	-57,814,237	0	3,408,129	3,408,129
			AUD			86.289905954					
-716,000.00000		8/21/2015		-716,000.00	-64,112,665	1.000000000F	-716,000.00	-61,783,573	0	2,329,092	2,329,092
			AUD			86.289905954					
-654,000.00000		8/26/2015		-654,000.00	-55,257,452	1.000000000F	-654,000.00	-56,433,598	0	-1,176,146	-1,176,146
			AUD			86.289905954					
67,884,032.30000	合計 -----			67,884,032	6,115,824,371		67,884,032	5,857,706,763	0	-258,117,608	-258,117,608
0.00000											
5,464,057.84000	USD FORWARD 09 OCT	8/6/2015		5,464,057.84	681,450,116	1.000000000F	5,464,057.84	660,742,200	0	-20,707,916	-20,707,916
	FUS09OCT		AUD			0.008269576					
602,120.83000		8/7/2015		602,120.83	74,846,618	1.000000000F	602,120.83	72,811,572	0	-2,035,046	-2,035,046
			AUD			0.008269576					
492,557.20000		8/14/2015		492,557.20	61,222,366	1.000000000F	492,557.20	59,562,570	0	-1,659,796	-1,659,796
			AUD			0.008269576					
523,689.56000		8/21/2015		523,689.56	64,112,665	1.000000000F	523,689.56	63,327,256	0	-785,409	-785,409
			AUD			0.008269576					
463,666.38000		8/26/2015		463,666.38	55,257,451	1.000000000F	463,666.38	56,068,942	0	811,491	811,491
			AUD			0.008269576					
-56,813,900.00000		8/3/2015		-56,813,900.00	-7,052,713,647	1.000000000F	-56,813,900.00	-6,870,231,315	0	182,482,332	182,482,332
			AUD			0.008269576					

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
豪ドルクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
非グループ化の有価証券											
-49,267,808.19000	合計	-----		-49,267,808	-6,115,824,431		-49,267,808	-5,957,718,775	0	158,105,656	158,105,656
0.00000											
18,616,224.11000	非グループ化の有価証券小計			18,616,224	-60		18,616,224	-100,012,012	0	-100,011,952	-100,011,952
18,616,224.11000	先物 (ポジション) 合計			18,616,224	-60		18,616,224	-100,012,012	0	-100,011,952	-100,011,952
18,616,224.11000	豪ドルクラス受益証券合計			18,616,224	-60		18,616,224	-100,012,012	0	-100,011,952	-100,011,952

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 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）											
非グループ化の有価証券											
711,738.93000	AUD FORWARD 09 OCT FAU09OCT	7/22/2015		711,738.93	65,143,052	1.000000000F 86.289905954	711,738.93	61,415,885	0	-3,727,167	-3,727,167
245,928.43000		7/23/2015	AUH	245,928.43	22,484,303	1.000000000F 86.289905954	245,928.43	21,221,141	0	-1,263,162	-1,263,162
335,197.83000		7/28/2015	AUH	335,197.83	30,253,731	1.000000000F 86.289905954	335,197.83	28,924,189	0	-1,329,542	-1,329,542
65,582,539.44000		8/3/2015	AUH	65,582,539.44	5,914,463,151	1.000000000F 86.289905954	65,582,539.44	5,659,111,160	0	-255,351,991	-255,351,991
386,789.48000		8/19/2015	AUH	386,789.48	35,203,799	1.000000000F 86.289905954	386,789.48	33,376,028	0	-1,827,771	-1,827,771
67,262,194.11000 0.00000	合計 -----			67,262,194	6,067,548,036		67,262,194	5,804,048,403	0	-263,499,633	-263,499,633
-523,000.00000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	7/22/2015		-523,000.00	-65,143,052	1.000000000F 0.008269576	-523,000.00	-63,243,871	0	1,899,181	1,899,181
-180,600.00000		7/23/2015	AUH	-180,600.00	-22,484,303	1.000000000F 0.008269576	-180,600.00	-21,839,088	0	645,215	645,215
-243,900.00000		7/28/2015	AUH	-243,900.00	-30,253,731	1.000000000F 0.008269576	-243,900.00	-29,493,652	0	760,079	760,079
-47,644,600.00000		8/3/2015	AUH	-47,644,600.00	-5,914,463,197	1.000000000F 0.008269576	-47,644,600.00	-5,761,432,025	0	153,031,172	153,031,172
-282,600.00000		8/19/2015	AUH	-282,600.00	-35,203,799	1.000000000F 0.008269576	-282,600.00	-34,173,457	0	1,030,342	1,030,342
-48,874,700.00000 0.00000	合計 -----			-48,874,700	-6,067,548,082		-48,874,700	-5,910,182,093	0	157,365,989	157,365,989
18,387,494.11000	非グループ化の有価証券小計			18,387,494	-46		18,387,494	-106,133,690	0	-106,133,644	-106,133,644
18,387,494.11000	先物（ポジション）合計			18,387,494	-46		18,387,494	-106,133,690	0	-106,133,644	-106,133,644
18,387,494.11000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			18,387,494	-46		18,387,494	-106,133,690	0	-106,133,644	-106,133,644

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 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）											
非グループ化の有価証券											
733,809.33000	AUD FORWARD 09 OCT FAU09OCT	8/3/2015		733,809.33	66,177,496	1.000000000F 86.289905954	733,809.33	63,320,338	0	-2,857,158	-2,857,158
-10,000.00000		8/5/2015	BKH	-10,000.00	-914,651	1.000000000F 86.289905954	-10,000.00	-862,899	0	51,752	51,752
723,809.33000	合計 -----			723,809	65,262,845		723,809	62,457,439	0	-2,805,406	-2,805,406
0.00000											
1,878,804.33000	BRL FORWARD 09 OCT FBR09OCT	8/3/2015		1,878,804.33	67,590,649	1.000000000F 0.029995117	1,878,804.33	62,637,006	0	-4,953,643	-4,953,643
-27,000.00000		8/5/2015	BKH	-27,000.00	-945,446	1.000000000F 0.029995117	-27,000.00	-900,147	0	45,299	45,299
1,851,804.33000	合計 -----			1,851,804	66,645,203		1,851,804	61,736,859	0	-4,908,344	-4,908,344
0.00000											
7,317.50000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/5/2015		7,317.50	914,651	1.000000000F 0.008269576	7,317.50	884,870	0	-29,781	-29,781
7,563.87000		8/5/2015	BKH	7,563.87	945,446	1.000000000F 0.008269576	7,563.87	914,662	0	-30,784	-30,784
7,803.69000		8/5/2015	BKH	7,803.69	975,422	1.000000000F 0.008269576	7,803.69	943,663	0	-31,759	-31,759
-533,100.00000		8/3/2015	BKH	-533,100.00	-66,957,256	1.000000000F 0.008269576	-533,100.00	-64,465,216	0	2,492,040	2,492,040
-533,100.00000		8/3/2015	BKH	-533,100.00	-67,590,649	1.000000000F 0.008269576	-533,100.00	-64,465,216	0	3,125,433	3,125,433
-533,100.00000		8/3/2015	BKH	-533,100.00	-66,177,496	1.000000000F 0.008269576	-533,100.00	-64,465,216	0	1,712,280	1,712,280
-1,576,614.94000	合計 -----			-1,576,615	-197,889,882		-1,576,615	-190,652,453	0	7,237,429	7,237,429
0.00000											
6,854,386.56000	ZAR FORWARD 09 OCT FZA09OCT	8/3/2015		6,854,386.56	66,957,256	1.000000000F 0.110290131	6,854,386.56	62,148,685	0	-4,808,571	-4,808,571
			BKH								

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-101,000.00000		8/5/2015		-101,000.00	-975,422	1.0000000000 ^F 0.110290131	-101,000.00	-915,766	0	59,656	59,656
			BKH								
6,753,386.56000	合計 -----			6,753,387	65,981,834		6,753,387	61,232,919	0	-4,748,915	-4,748,915
0.00000											
7,752,385.28000	非グループ化の有価証券小計			7,752,385	0		7,752,385	-5,225,236	0	-5,225,236	-5,225,236
7,752,385.28000	先物（ポジション）合計			7,752,385	0		7,752,385	-5,225,236	0	-5,225,236	-5,225,236
7,752,385.28000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			7,752,385	0		7,752,385	-5,225,236	0	-5,225,236	-5,225,236

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 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）											
非グループ化の有価証券											
3,652,959.00000	BRL FORWARD 09 OCT FBR09OCT	7/23/2015		3,652,959.00	137,783,863	1.000000000F 0.029995117	3,652,959.00	121,785,123	0	-15,998,740	-15,998,740
480,585.00000		7/28/2015	BRH	480,585.00	17,471,401	1.000000000F 0.029995117	480,585.00	16,022,108	0	-1,449,293	-1,449,293
78,564,015.00000		8/3/2015	BRH	78,564,015.00	2,826,368,158	1.000000000F 0.029995117	78,564,015.00	2,619,226,823	0	-207,141,335	-207,141,335
361,424,366.03000		8/3/2015	BRH	361,424,366.03	13,002,369,082	1.000000000F 0.029995117	361,424,366.03	12,049,440,115	0	-952,928,967	-952,928,967
-4,070,000.00000		8/14/2015	BRH	-4,070,000.00	-143,098,098	1.000000000F 0.029995117	-4,070,000.00	-135,688,752	0	7,409,346	7,409,346
-1,461,000.00000		8/21/2015	BRH	-1,461,000.00	-50,349,860	1.000000000F 0.029995117	-1,461,000.00	-48,707,928	0	1,641,932	1,641,932
-6,932,000.00000		8/27/2015	BRH	-6,932,000.00	-232,082,517	1.000000000F 0.029995117	-6,932,000.00	-231,104,283	0	978,234	978,234
431,658,925.03000 0.00000	合計 -----			431,658,925	15,558,462,029		431,658,925	14,390,973,206	0	-1,167,488,823	-1,167,488,823
1,151,278.57000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/14/2015		1,151,278.57	143,098,097	1.000000000F 0.008269576	1,151,278.57	139,218,573	0	-3,879,524	-3,879,524
411,271.25000		8/21/2015	BRH	411,271.25	50,349,860	1.000000000F 0.008269576	411,271.25	49,733,052	0	-616,808	-616,808
1,922,884.88000		8/27/2015	BRH	1,922,884.88	232,082,517	1.000000000F 0.008269576	1,922,884.88	232,525,208	0	442,691	442,691
-1,083,000.00000		7/23/2015	BRH	-1,083,000.00	-137,783,863	1.000000000F 0.008269576	-1,083,000.00	-130,961,974	0	6,821,889	6,821,889
-138,000.00000		7/28/2015	BRH	-138,000.00	-17,471,401	1.000000000F 0.008269576	-138,000.00	-16,687,675	0	783,726	783,726
-102,552,100.00000		8/3/2015	BRH	-102,552,100.00	-13,002,369,147	1.000000000F 0.008269576	-102,552,100.00	-12,401,131,570	0	601,237,577	601,237,577

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>ブラジル・レアルクラス受益証券</u>											
<u>先物 (ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-22,300,000.00000		8/3/2015		-22,300,000.00	-2,826,368,180	1.0000000000 ^F 0.008269576	-22,300,000.00	-2,696,631,605	0	129,736,575	129,736,575
			BRH								
-122,587,665.30000	合計 -----			-122,587,665	-15,558,462,117		-122,587,665	-14,823,935,991	0	734,526,126	734,526,126
0.00000											
309,071,259.73000	非グループ化の有価証券小計			309,071,260	-88		309,071,260	-432,962,785	0	-432,962,697	-432,962,697
309,071,259.73000	先物 (ポジション) 合計			309,071,260	-88		309,071,260	-432,962,785	0	-432,962,697	-432,962,697
309,071,259.73000	ブラジル・レアルクラス受益証券合計			309,071,260	-88		309,071,260	-432,962,785	0	-432,962,697	-432,962,697

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>ユーロクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
259,750.91000	EUR FORWARD 09 OCT FEU09OCT	8/3/2015		259,750.91	35,328,640	1.000000000F 135.786340736	259,750.91	35,270,626	0	-58,014	-58,014
-2,600.00000		8/27/2015	EUH	-2,600.00	-352,097	1.000000000F 135.786340736	-2,600.00	-353,044	0	-947	-947
257,150.91000	合計 -----		EUH	257,151	34,976,543		257,151	34,917,582	0	-58,961	-58,961
0.00000											
2,917.25000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/27/2015		2,917.25	352,097	1.000000000F 0.008269576	2,917.25	352,769	0	672	672
-285,100.00000		8/3/2015	EUH	-285,100.00	-35,328,641	1.000000000F 0.008269576	-285,100.00	-34,475,770	0	852,871	852,871
-282,182.75000	合計 -----		EUH	-282,183	-34,976,544		-282,183	-34,123,001	0	853,543	853,543
0.00000											
-25,031.84000	非グループ化の有価証券小計			-25,032	-1		-25,032	794,581	0	794,582	794,582
-25,031.84000	先物（ポジション）合計			-25,032	-1		-25,032	794,581	0	794,582	794,582
-25,031.84000	ユーロクラス受益証券合計			-25,032	-1		-25,032	794,581	0	794,582	794,582

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
日本円クラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
-91,558,600.00000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/3/2015		-91,558,600.00	-11,358,888,195	1.000000000F 0.008269576	-91,558,600.00	-11,071,740,558	0	287,147,637	287,147,637
3,191,298.11000	USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP	7/10/2015	JPH	3,191,298.11	391,234,003	1.000000000F 0.008266669	3,191,298.11	386,044,017	0	-5,189,986	-5,189,986
1,813,856.78000		8/12/2015	JPH	1,813,856.78	224,638,002	1.000000000F 0.008266669	1,813,856.78	219,418,097	0	-5,219,905	-5,219,905
1,804,721.63000		8/14/2015	JPH	1,804,721.63	224,289,002	1.000000000F 0.008266669	1,804,721.63	218,313,039	0	-5,975,963	-5,975,963
2,233,605.44000		8/21/2015	JPH	2,233,605.44	273,486,002	1.000000000F 0.008266669	2,233,605.44	270,194,130	0	-3,291,872	-3,291,872
2,967,411.92000		8/26/2015	JPH	2,967,411.92	353,579,003	1.000000000F 0.008266669	2,967,411.92	358,961,018	0	5,382,015	5,382,015
-241,554,300.00000		7/2/2015	JPH	-241,554,300.00	-29,815,578,961	1.000000000F 0.008266669	-241,554,300.00	-29,220,269,978	0	595,308,983	595,308,983
-229,543,406.12000 0.00000	合計 -----			-229,543,406	-28,348,352,949		-229,543,406	-27,767,339,677	0	581,013,272	581,013,272
-321,102,006.12000	非グループ化の有価証券小計			-321,102,006	-39,707,241,144		-321,102,006	-38,839,080,235	0	868,160,909	868,160,909
-321,102,006.12000	先物（ポジション）合計			-321,102,006	-39,707,241,144		-321,102,006	-38,839,080,235	0	868,160,909	868,160,909
-321,102,006.12000	日本円クラス受益証券合計			-321,102,006	-39,707,241,144		-321,102,006	-38,839,080,235	0	868,160,909	868,160,909

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
メキシコ・ベソクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
94,545,418.55	MXN FORWARD 09 OCT FMX09OCT	8/3/2015		94,545,418.55	727,715,083	1.000000000F 0.138874187	94,545,418.55	680,799,079	0	-46,916,004	-46,916,004
-2,075,000.00		8/21/2015	MXH	-2,075,000.00	-14,964,171	1.000000000F 0.138874187	-2,075,000.00	-14,941,582	0	22,589	22,589
-1,637,000.00		8/26/2015	MXH	-1,637,000.00	-11,391,356	1.000000000F 0.138874187	-1,637,000.00	-11,787,648	0	-396,292	-396,292
90,833,418.55000 0.00000	合計 -----			90,833,419	701,359,556		90,833,419	654,069,849	0	-47,289,707	-47,289,707
122,231.39000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/21/2015		122,231.39	14,964,171	1.000000000F 0.008269576	122,231.39	14,780,853	0	-183,318	-183,318
95,585.10000		8/26/2015	MXH	95,585.10	11,391,356	1.000000000F 0.008269576	95,585.10	11,558,646	0	167,290	167,290
-5,822,300.00000		8/3/2015	MXH	-5,822,300.00	-727,715,083	1.000000000F 0.008269576	-5,822,300.00	-704,062,699	0	23,652,384	23,652,384
-5,604,483.51000 0.00000	合計 -----			-5,604,484	-701,359,556		-5,604,484	-677,723,200	0	23,636,356	23,636,356
85,228,935.04000	非グループ化の有価証券小計			85,228,935	0		85,228,935	-23,653,351	0	-23,653,351	-23,653,351
85,228,935.04000	先物（ポジション）合計			85,228,935	0		85,228,935	-23,653,351	0	-23,653,351	-23,653,351
85,228,935.04000	メキシコ・ベソクラス受益証券合計			85,228,935	0		85,228,935	-23,653,351	0	-23,653,351	-23,653,351

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>ロシア・ルーブルクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
1,071,770,159.00	RUB FORWARD 09 OCT FRU09OCT	8/3/2015		1,071,770,159.00	2,127,879,803	1.000000000F 0.551011481	1,071,770,159.00	1,945,095,875	0	-182,783,928	-182,783,928
-10,136,000.00		8/12/2015	RUH	-10,136,000.00	-19,143,125	1.000000000F 0.551011481	-10,136,000.00	-18,395,261	0	747,864	747,864
-11,066,000.00		8/14/2015	RUH	-11,066,000.00	-20,723,938	1.000000000F 0.551011481	-11,066,000.00	-20,083,066	0	640,872	640,872
-12,405,000.00		8/26/2015	RUH	-12,405,000.00	-20,931,136	1.000000000F 0.551011481	-12,405,000.00	-22,513,143	0	-1,582,007	-1,582,007
1,038,163,159.00000 0.00000	合計 -----			1,038,163,159	2,067,081,604		1,038,163,159	1,884,104,405	0	-182,977,199	-182,977,199
154,535.75000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/12/2015		154,535.75	19,143,125	1.000000000F 0.008269576	154,535.75	18,687,264	0	-455,861	-455,861
166,731.96000		8/14/2015	RUH	166,731.96	20,723,938	1.000000000F 0.008269576	166,731.96	20,162,093	0	-561,845	-561,845
175,633.58000		8/26/2015	RUH	175,633.58	20,931,136	1.000000000F 0.008269576	175,633.58	21,238,523	0	307,387	307,387
-16,870,300.00000		8/3/2015	RUH	-16,870,300.00	-2,127,879,822	1.000000000F 0.008269576	-16,870,300.00	-2,040,044,133	0	87,835,689	87,835,689
-16,373,398.71000 0.00000	合計 -----			-16,373,399	-2,067,081,623		-16,373,399	-1,979,956,253	0	87,125,370	87,125,370
1,021,789,760.29000	非グループ化の有価証券小計			1,021,789,760	-19		1,021,789,760	-95,851,848	0	-95,851,829	-95,851,829
1,021,789,760.29000	先物（ポジション）合計			1,021,789,760	-19		1,021,789,760	-95,851,848	0	-95,851,829	-95,851,829
1,021,789,760.29000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			1,021,789,760	-19		1,021,789,760	-95,851,848	0	-95,851,829	-95,851,829

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 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）											
非グループ化の有価証券											
5,051,849.88	TRY FORWARD 09 OCT FTR09OCT	8/3/2015		5,051,849.88	225,285,062	1.000000000F 0.024406593	5,051,849.88	206,987,099	0	-18,297,963	-18,297,963
39,614.40		8/6/2015	TRH	39,614.40	1,777,097	1.000000000F 0.024406593	39,614.40	1,623,102	0	-153,995	-153,995
-89,000.00		8/5/2015	TRH	-89,000.00	-3,917,787	1.000000000F 0.024406593	-89,000.00	-3,646,556	0	271,231	271,231
5,002,464.28000 0.00000	合計 -----			5,002,464	223,144,372		5,002,464	204,963,645	0	-18,180,727	-18,180,727
31,343.55000	USD FORWARD 09 OCT FUS09OCT	8/5/2015		31,343.55	3,917,787	1.000000000F 0.008269576	31,343.55	3,790,225	0	-127,562	-127,562
-1,786,400.00000		8/3/2015	TRH	-1,786,400.00	-225,285,063	1.000000000F 0.008269576	-1,786,400.00	-216,020,749	0	9,264,314	9,264,314
-14,000.00000		8/6/2015	TRH	-14,000.00	-1,777,097	1.000000000F 0.008269576	-14,000.00	-1,692,953	0	84,144	84,144
-1,769,056.45000 0.00000	合計 -----			-1,769,056	-223,144,373		-1,769,056	-213,923,477	0	9,220,896	9,220,896
3,233,407.83000	非グループ化の有価証券小計			3,233,408	-1		3,233,408	-8,959,832	0	-8,959,831	-8,959,831
3,233,407.83000	先物（ポジション）合計			3,233,408	-1		3,233,408	-8,959,832	0	-8,959,831	-8,959,831
3,233,407.83000	トルコ・リラクラス受益証券合計			3,233,408	-1		3,233,408	-8,959,832	0	-8,959,831	-8,959,831

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
現金											
基準通貨現金											
367,407,721.00000	JPY CASH	8/28/2015		367,407,721	367,407,721	1.000000000	367,407,721	367,407,721	0	0	0
	CASHJPY					1.000000000					
367,407,721.00000	基準通貨現金小計			367,407,721	367,407,721		367,407,721	367,407,721	0	0	0
367,407,721.00000	現金合計			367,407,721	367,407,721		367,407,721	367,407,721	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
8,400,000.00000	ASSICURAZIONI FRN 07102042 BITA034T XS0802638642	10/14/2014		11,710,125.00	1,626,534,583	135.111999512 ^C 135.785760755	11,349,407.96	1,541,087,994	-48,980,238	-36,466,351	-85,446,589
6,250,000.00	AVIVA PLC FRN 06042050 BGBR22DX XS1242413166	5/29/2015		6,254,385.50	1,186,043,097	94.362998962 ^C 185.785026755	5,897,687.44	1,095,702,018	-66,269,160	-24,071,920	-90,341,080
14,000,000.00	AXA SA FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561	5/24/2013		15,084,178.40	2,546,711,730	101.736999512 ^C 185.785026755	14,243,179.93	2,646,169,565	-156,244,923	255,702,758	99,457,835
5,800,000.00000	BBVA SUB CAP UNI FRN 04112024 BESPO25A XS1055241373	2/9/2015		6,103,236.00	823,557,868	103.663002014 ^C 135.785760755	6,012,454.12	816,405,656	-12,326,887	5,174,675	-7,152,212
12,200,000.00000	CAIXABANK FRN 11142023 BESPO259 XS0989061345	2/9/2015		13,256,138.00	1,768,735,194	105.530998230 ^C 135.785760755	12,874,781.78	1,748,212,039	-51,782,744	31,259,589	-20,523,155
10,500,000.00000	CNP ASSURANCES FRN 06052045 BFRA10BM FR0011949403	6/11/2014		10,735,625.00	1,473,142,484	101.364997864 ^C 135.785760755	10,643,324.78	1,445,211,952	-12,533,056	-15,397,476	-27,930,532
17,000,000.00000	COM BK AUSTRALIA FRN 04222027 BAUS087L XS1219642441	4/28/2015		17,006,447.50	2,249,141,569	95.656997681 ^C 135.785760755	16,261,689.61	2,208,105,894	-101,127,517	60,091,843	-41,035,674

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
1,400,000.00000	CORP FINANCIERA FRN 07152029 BPER002T USP3R94GAA71	7/8/2014		1,398,124.00	141,979,490	100.281997681 ^C 0.008264121	1,403,947.97	169,884,730	704,729	27,200,511	27,905,240
18,310,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		18,800,562.50	2,111,856,782	103.748001099 ^C 0.008264121	18,996,259.00	2,298,642,409	23,680,256	163,105,371	186,785,627
9,400,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN3042 XS1262602532	7/22/2015		9,400,000.00	1,166,022,935	100.351997375 ^C 0.008264121	9,433,087.75	1,141,450,827	4,003,784	-28,575,891	-24,572,107
7,150,000.00000	GENERALI FINANCE FRN PERP/CALL BNLD1280 XS1140860534	11/14/2014		7,253,750.00	1,014,869,196	98.319000244 ^C 135.785760755	7,029,808.52	954,547,898	-30,408,065	-29,913,234	-60,321,299
14,150,000.00000	HSBC HOLDINGS FRN PERP/CALL BGBR22CP XS1111123987	4/8/2015		14,876,439.23	1,915,478,729	100.552001953 ^C 135.785760755	14,228,108.28	1,931,974,506	-88,034,112	104,529,889	16,495,777
14,300,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		14,244,655.00	2,051,282,311	99.196998596 ^C 135.785760755	14,185,170.80	1,926,144,208	-8,077,107	-117,060,995	-125,138,102
15,800,000.00000	NORDEA BANK AB FRN PERP/CALL BSWE0367 XS1202090947	4/9/2015		15,773,000.00	1,897,394,764	95.550003052 ^C 0.008264121	15,096,900.48	1,826,800,513	-81,811,425	11,217,174	-70,594,251
10,000,000.00	PRUDENTIAL PLC FRN 07202055 BGBR22DZ XS1243995302	6/2/2015		9,891,800.00	1,881,391,931	95.699996948 ^C 185.785026755	9,569,999.69	1,777,962,649	-59,785,678	-43,643,603	-103,429,281
14,100,000.00000	RABOBANK FRN PERP/CALL BNLD128M XS1171914515	4/8/2015		14,932,605.00	1,933,259,296	102.522003174 ^C 135.785760755	14,455,602.45	1,962,864,976	-64,770,154	94,375,834	29,605,680

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>社債</u>											
<u>固定利率から変動利率に転換される社債</u>											
11,500,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 09162026 BFRA10CK XS1110558407	9/9/2014		11,424,659.00	1,567,283,607	97.958000183 ^C 135.785760755	11,265,170.02	1,529,649,681	-21,656,332	-15,977,593	-37,633,925
15,400,000.00000	SWEDBANK AB FRN PERP/CALL BSWE0364 XS1190655776	3/24/2015		15,425,837.77	1,849,779,017	99.172996521 ^C 0.008264121	15,272,641.46	1,848,066,051	-18,537,520	16,824,554	-1,712,966
205,660,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			213,571,568	29,204,464,583		208,219,222	28,868,883,566	-793,956,149	458,375,135	-335,581,014
<u>変動利率</u>											
16,820,000.00000	AMERICAN EXPRESS FRN 09012066 BUSA7950 US025816AU39	11/9/2011		17,258,467.60	1,399,095,402	102.042999268 ^C 0.008264121	17,163,632.48	2,076,885,428	-11,475,525	689,265,550	677,790,025
4,700,000.00	AMLI PLC FRN 12192026 BGBR2174 XS0251382361	11/10/2011		3,943,830.60	492,892,679	101.523002625 ^C 185.785026755	4,771,581.12	886,488,327	153,783,653	239,811,995	393,595,648
5,600,000.00	AVIVA PLC FRN 05202058 BGBR2176 XS0364880186	1/23/2013		6,038,872.00	847,016,158	111.600997925 ^C 185.785026755	6,249,655.88	1,161,092,486	39,160,489	274,915,838	314,076,327
3,000,000.00000	AVIVA PLC FRN 07052043 BGBR2263 XS0951553592	9/11/2013		3,137,000.00	417,938,836	118.300003052 ^C 135.785760755	3,549,000.09	481,903,677	55,943,746	8,021,095	63,964,841
4,200,000.00000	BPCE FRN 08292049 BFRA1041 USF11494AA36	4/20/2012		4,326,000.00	352,763,658	131.686996460 ^C 0.008264121	5,530,853.85	669,260,996	145,793,346	170,703,992	316,497,338
8,750,000.00	CREDIT AGRICOLE FRN 12292049 BFRA105L FR0010291997	4/18/2013		8,519,867.50	1,353,455,394	100.547996521 ^C 185.785026755	8,797,949.70	1,634,527,320	51,663,508	229,408,417	281,071,925
5,745,000.00	DANSKE BANK FRN 09292021 BDNK0229 XS0176929684	11/10/2011		5,475,973.55	757,817,965	105.839996338 ^C 185.785026755	6,080,507.79	1,129,667,302	112,313,410	259,535,927	371,849,337

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
変動利率											
10,700,000.00	DNB NORBANK ASA FRN 03292049 BNOR0223 XS0285087358	11/9/2011		10,920,283.39	1,576,055,609	103.496002197 ^C 185.785026755	11,074,072.24	2,057,396,806	28,571,665	452,769,533	481,341,198
5,880,000.00000	GE CAP TRUST I FRN 11152067 BUSA7949 US36830GAA22	11/10/2011		5,970,973.63	479,525,515	106.946998596 ^C 0.008264121	6,288,483.52	760,937,977	38,420,285	242,992,177	281,412,462
1,000,000.00	GEN ELEC CAP CRP FRN 09152066 BUSA96P5 XS0267167566	5/8/2013		1,043,750.00	160,547,827	101.388000000 ^C 185.785026755	1,013,880.00	188,363,723	-5,549,399	33,365,295	27,815,896
6,150,000.00	HSBC BANK FUND FRN 04292049 BJEY000C XS0189704140	4/25/2013		6,242,250.00	958,888,054	105.602996826 ^C 185.785026755	6,494,584.30	1,206,596,519	46,879,936	200,828,529	247,708,465
6,690,000.00	ING BANK NV FRN 05292023 BNLD1155 XS0366066222	11/11/2011		6,641,617.00	837,014,201	109.971000671 ^C 185.785026755	7,357,059.94	1,366,831,579	132,918,587	396,898,791	529,817,378
23,390,000.00000	MITSUI SUMITOMO FRN 03152072 BJPN3013 USJ45174AF61	3/9/2012		25,052,660.97	2,171,022,567	114.805999756 ^C 0.008264121	26,853,123.34	3,249,362,315	217,864,958	860,474,790	1,078,339,748
7,376,000.00	NATIONAL CAP TST FRN 09292049 BUSA94U0 XS0177395901	8/13/2012		6,809,147.50	890,898,589	104.885002136 ^C 185.785026755	7,736,317.76	1,437,292,002	172,254,351	374,139,061	546,393,412
25,700,000.00000	NIPPON LIFE INS FRN 10182042 BJPN301S USJ54675AA13	10/24/2012		26,629,876.06	2,353,901,247	103.325996399 ^C 0.008264121	26,554,781.07	3,213,261,407	-9,086,869	868,447,029	859,360,160
25,450,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		26,035,632.69	2,391,965,427	103.505996704 ^C 0.008264121	26,342,276.16	3,187,547,249	37,105,395	758,476,428	795,581,823

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
変動利率											
2,530,000.00	PRUDENTIAL PLC FRN 05292039 BGBR2169 XS0431150902	11/9/2011		3,285,605.60	411,730,124	127.016998291 ^C 185.785026755	3,213,530.06	597,025,768	-13,390,557	198,686,200	185,295,643
4,010,000.00000	RABOBANK CAP III FRN 12292049 BUSA96GT US749769AA35	4/9/2013		4,070,150.00	402,965,199	102.805999756 ^C 0.008264121	4,122,520.59	498,845,623	6,337,104	89,543,321	95,880,425
9,700,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 09292049 BFRA1006 XS0449487619	11/10/2011		10,659,415.00	1,373,574,896	123.642997742 ^C 135.785760755	11,993,370.78	1,628,528,976	181,132,201	73,821,879	254,954,080
20,400,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		20,594,296.74	1,988,297,347	105.097000122 ^C 0.008264121	21,439,788.02	2,594,321,650	102,308,677	503,715,626	606,024,303
7,340,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	5/3/2012		7,878,833.00	1,241,250,971	112.180000305 ^C 185.785026755	8,234,012.02	1,529,756,144	65,986,944	222,518,229	288,505,173
205,131,000.00000	変動利率小計			210,534,503	22,858,617,665		220,860,981	31,555,893,274	1,548,935,905	7,148,339,702	8,697,275,607
メディアム・ターム・ノート											
5,300,000.00000	ABN AMRO BANK NV 6.375 % 04272021 BNLD1156 XS0619548216	11/10/2011		5,340,937.34	568,739,740	120.968002319 ^C 135.785760755	6,411,304.12	870,563,808	145,340,568	156,483,500	301,824,068
2,490,000.00000	ABN AMRO BANK NV 7.125 % 07062022 BNLD1201 XS0802995166	8/13/2012		2,719,467.40	293,030,303	126.094001770 ^C 135.785760755	3,139,740.64	426,332,072	57,067,122	76,234,647	133,301,769
16,100,000.00000	ABN AMRO BANK NV 2.875 % 06302025 BNLD129W XS1253955469	6/23/2015		16,158,170.00	2,245,873,831	101.990997314 ^C 135.785760755	16,420,550.57	2,229,676,951	35,627,545	-51,824,425	-16,196,880
18,150,000.00000	BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		18,136,570.50	2,012,951,380	97.251998901 ^C 0.008264121	17,651,237.80	2,135,888,112	-58,727,686	181,664,418	122,936,732

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
ミディアム・ターム・ノート											
16,500,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249	6/9/2015		16,437,465.00	2,299,021,395	100.254997253 ^C 135.785760755	16,542,074.55	2,246,178,177	14,204,487	-67,047,705	-52,843,218
12,350,000.00	LLOYDS TSB BANK 7.625 % 04222025 BGBR223F XS0503834821	1/10/2013		14,712,293.53	2,146,592,440	126.225997925 ^C 185.785026755	15,588,910.74	2,896,186,200	162,862,353	586,731,407	749,593,760
70,890,000.00000	ミディアム・ターム・ノート小計			73,504,904	9,566,209,089		75,753,818	10,804,825,320	356,374,389	882,241,842	1,238,616,231
私募債											
5,000,000.00000	ABN AMRO BANK NV 4.75 % 07282025 BNLD129Y US00080QAF28	7/21/2015		4,986,600.00	617,490,716	100.372001648 ^C 0.008264121	5,018,600.08	607,275,726	3,872,170	-14,087,160	-10,214,990
10,880,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0058 US05533UAB44	11/10/2011		11,887,850.00	1,081,561,710	107.978996277 ^C 0.008264121	11,748,114.79	1,421,580,685	-16,908,659	356,927,634	340,018,975
22,600,000.00000	ING BANK NV 5.8 % 09252023 BNLD122U US449786AY82	9/16/2013		24,287,030.50	2,524,768,899	108.783996582 ^C 0.008264121	24,585,183.23	2,974,930,211	36,077,972	414,083,339	450,161,311
23,000,000.00000	SANTANDER UK PLC 5 % 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		23,001,850.00	2,304,989,890	104.083000183 ^C 0.008264121	23,939,090.04	2,896,749,702	113,410,736	478,349,076	591,759,812
61,480,000.00000	私募債小計			64,163,331	6,528,811,215		65,290,988	7,900,536,324	136,452,219	1,235,272,889	1,371,725,108
公募債											
9,400,000.00000	BANK OF AMER CRP 3.95 % 04212025 BUSA99D5 US06051GFP90	4/16/2015		9,372,270.00	1,118,439,871	97.085998535 ^C 0.008264121	9,126,083.86	1,104,301,820	-29,789,755	15,651,704	-14,138,051
8,850,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0060 USP16259AB20	11/9/2011		9,106,122.60	726,964,805	107.904998779 ^C 0.008264121	9,549,592.39	1,155,548,472	53,662,064	374,921,603	428,583,667

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
公募債											
11,370,000.00000	BBVA BANCOMER SA 7.25 % 04222020 BMEX009H USP1R23DAA49	1/29/2013		13,136,847.00	1,201,507,199	109.583000183 ^C 0.008264121	12,459,587.12	1,507,672,397	-81,951,835	388,117,033	306,165,198
21,800,000.00000	BNP PARIBAS 4.25 % 10152024 BFRA10D5 US05579T5G71	10/6/2014		21,610,840.00	2,346,891,715	99.589996338 ^C 0.008264121	21,710,619.20	2,627,093,577	12,073,783	268,128,080	280,201,863
28,000,000.00000	CRED AGRICOLE SA 4.375 % 03172025 BFRA10ER USF2R125AC99	3/10/2015		28,047,660.00	3,399,706,976	97.143997192 ^C 0.008264121	27,200,319.21	3,291,374,753	-102,532,476	-5,799,747	-108,332,223
4,820,000.00	GOLDMAN SACHS GP 5.5 % 10122021 BUSA4203 XS0270349003	4/18/2012		4,853,269.60	679,412,153	110.319999695 ^C 185.785026755	5,317,423.99	987,897,757	86,232,935	222,252,669	308,485,604
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GP 6.875 % 01182038 BUSA96MS XS0340470490	4/25/2013		1,227,320.00	188,531,777	127.769996643 ^C 185.785026755	1,277,699.97	237,377,522	9,359,843	39,485,902	48,845,745
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	3/20/2014		1,795,572.00	183,857,592	103.513000488 ^C 0.008264121	1,863,234.01	225,460,640	8,187,442	33,415,606	41,603,048
13,150,000.00000	MORGAN STANLEY 4.875 % 11012022 BUSA95EL US6174824M37	10/18/2012		13,465,176.80	1,149,095,926	106.168998718 ^C 0.008264121	13,961,223.33	1,689,377,894	60,024,113	480,257,855	540,281,968
3,000,000.00000	MORGAN STANLEY 3.95 % 04232027 BUSA99DZ US61761JZN26	4/20/2015		2,989,200.00	356,477,031	95.681999207 ^C 0.008264121	2,870,459.98	347,340,023	-14,368,137	5,231,129	-9,137,008
26,430,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.125 % 12152022 BGBR223B US780099CE50	12/13/2012		27,628,249.40	2,395,487,274	107.596000671 ^C 0.008264121	28,437,622.98	3,441,094,700	97,938,253	947,669,173	1,045,607,426

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
公募債											
12,610,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95 % 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		12,746,280.00	1,004,488,714	100.416999817C 0.008264121	12,662,583.68	1,532,235,997	-10,127,674	537,874,957	527,747,283
142,230,000.00000	公募債小計			145,978,807	14,750,861,033		146,436,450	18,146,775,552	88,708,556	3,307,205,964	3,395,914,520
685,391,000.0000	社債合計			707,753,112	82,908,963,585		716,561,459	97,276,914,036	1,336,514,920	13,031,435,532	14,367,950,452
0 外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,197,562.57000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	7/1/2014		1,197,562.57	114,507,015	1.000000000S 86.542775996	1,197,562.57	103,640,389	0	-10,866,626	-10,866,626
116,195.75000		7/7/2014		116,195.75	11,101,005	1.000000000S 86.542775996	116,195.75	10,055,903	0	-1,045,102	-1,045,102
12,661.65000		7/8/2014		12,661.65	1,208,608	1.000000000S 86.542775996	12,661.65	1,095,774	0	-112,834	-112,834
19,609.41000		7/14/2014		19,609.41	1,863,466	1.000000000S 86.542775996	19,609.41	1,697,053	0	-166,413	-166,413
13,866.53000		7/23/2014		13,866.53	1,321,669	1.000000000S 86.542775996	13,866.53	1,200,048	0	-121,621	-121,621
9,713.89000		7/24/2014		9,713.89	930,972	1.000000000S 86.542775996	9,713.89	840,667	0	-90,305	-90,305
24,607.58000		7/25/2014		24,607.58	2,360,162	1.000000000S 86.542775996	24,607.58	2,129,608	0	-230,554	-230,554
72,646.30000		7/28/2014		72,646.30	6,963,022	1.000000000S 86.542775996	72,646.30	6,287,012	0	-676,010	-676,010
181,131.43000		7/29/2014		181,131.43	17,338,641	1.000000000S 86.542775996	181,131.43	15,675,617	0	-1,663,024	-1,663,024
7,493.17000		7/31/2014		7,493.17	716,390	1.000000000S 86.542775996	7,493.17	648,480	0	-67,910	-67,910
303,500.23000		7/31/2014		303,500.23	29,096,812	1.000000000S 86.542775996	303,500.23	26,265,752	0	-2,831,060	-2,831,060

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
495,216.92000		8/5/2014		495,216.92	47,330,430	1.000000000 ^S 86.542775996	495,216.92	42,857,447	0	-4,472,983	-4,472,983
36,956.36000		8/6/2014		36,956.36	3,539,129	1.000000000 ^S 86.542775996	36,956.36	3,198,306	0	-340,823	-340,823
1,271,680.01000		8/13/2014		1,271,680.01	120,480,011	1.000000000 ^S 86.542775996	1,271,680.01	110,054,718	0	-10,425,293	-10,425,293
106,271.98000		8/18/2014		106,271.98	10,140,826	1.000000000 ^S 86.542775996	106,271.98	9,197,072	0	-943,754	-943,754
69,680.22000		8/19/2014		69,680.22	6,661,195	1.000000000 ^S 86.542775996	69,680.22	6,030,320	0	-630,875	-630,875
7,273.14000		8/21/2014		7,273.14	699,723	1.000000000 ^S 86.542775996	7,273.14	629,438	0	-70,285	-70,285
2,362,456.54000		8/26/2014		2,362,456.54	228,361,099	1.000000000 ^S 86.542775996	2,362,456.54	204,453,547	0	-23,907,552	-23,907,552
5,722.47000		8/29/2014		5,722.47	556,016	1.000000000 ^S 86.542775996	5,722.47	495,238	0	-60,778	-60,778
19,318.75000		9/2/2014		19,318.75	1,881,269	1.000000000 ^S 86.542775996	19,318.75	1,671,898	0	-209,371	-209,371
1,607,716.44000		9/3/2014		1,607,716.44	156,782,241	1.000000000 ^S 86.542775996	1,607,716.44	139,136,244	0	-17,645,997	-17,645,997
2,093,263.14000		9/11/2014		2,093,263.14	204,473,184	1.000000000 ^S 86.542775996	2,093,263.14	181,156,803	0	-23,316,381	-23,316,381
206,869.01000		9/12/2014		206,869.01	20,130,886	1.000000000 ^S 86.542775996	206,869.01	17,903,018	0	-2,227,868	-2,227,868
32,827.64000		9/16/2014		32,827.64	3,178,630	1.000000000 ^S 86.542775996	32,827.64	2,840,995	0	-337,635	-337,635
190,691.93000		9/17/2014		190,691.93	18,451,593	1.000000000 ^S 86.542775996	190,691.93	16,503,009	0	-1,948,584	-1,948,584

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
246,997.33000		9/22/2014		246,997.33	24,069,629	1.000000000 ^S 86.542775996	246,997.33	21,375,835	0	-2,693,794	-2,693,794
779,044.36000		9/26/2014		779,044.36	74,670,301	1.000000000 ^S 86.542775996	779,044.36	67,420,662	0	-7,249,639	-7,249,639
4,808.27000		9/30/2014		4,808.27	461,539	1.000000000 ^S 86.542775996	4,808.27	416,121	0	-45,418	-45,418
193,723.40000		10/1/2014		193,723.40	18,595,241	1.000000000 ^S 86.542775996	193,723.40	16,765,361	0	-1,829,880	-1,829,880
93,320.89000		10/3/2014		93,320.89	8,882,531	1.000000000 ^S 86.542775996	93,320.89	8,076,249	0	-806,282	-806,282
1,179,910.48000		10/7/2014		1,179,910.48	112,450,563	1.000000000 ^S 86.542775996	1,179,910.48	102,112,728	0	-10,337,835	-10,337,835
22,257.67000		10/9/2014		22,257.67	2,108,924	1.000000000 ^S 86.542775996	22,257.67	1,926,241	0	-182,683	-182,683
25,335.57000		10/14/2014		25,335.57	2,380,321	1.000000000 ^S 86.542775996	25,335.57	2,192,611	0	-187,710	-187,710
155,694.36000		10/27/2014		155,694.36	14,815,589	1.000000000 ^S 86.542775996	155,694.36	13,474,222	0	-1,341,367	-1,341,367
1,012,066.41000		10/30/2014		1,012,066.41	97,410,767	1.000000000 ^S 86.542775996	1,012,066.41	87,587,037	0	-9,823,730	-9,823,730
2,442.23000		11/3/2014		2,442.23	240,658	1.000000000 ^S 86.542775996	2,442.23	211,357	0	-29,301	-29,301
701,249.41000		11/4/2014		701,249.41	69,693,864	1.000000000 ^S 86.542775996	701,249.41	60,688,071	0	-9,005,793	-9,005,793
1,642,127.35000		11/12/2014		1,642,127.35	164,665,136	1.000000000 ^S 86.542775996	1,642,127.35	142,114,259	0	-22,550,877	-22,550,877
2,700,000.00000		11/21/2014		2,700,000.00	275,018,538	1.000000000 ^S 86.542775996	2,700,000.00	233,665,495	0	-41,353,043	-41,353,043

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
2,200,000.00000		11/24/2014		2,200,000.00	224,592,650	1.000000000 ^S 86.542775996	2,200,000.00	190,394,107	0	-34,198,543	-34,198,543
1,775.32000		11/28/2014		1,775.32	179,836	1.000000000 ^S 86.542775996	1,775.32	153,641	0	-26,195	-26,195
25,737.85000		12/5/2014		25,737.85	2,588,276	1.000000000 ^S 86.542775996	25,737.85	2,227,425	0	-360,851	-360,851
1,200,271.26000		12/10/2014		1,200,271.26	119,256,313	1.000000000 ^S 86.542775996	1,200,271.26	103,874,807	0	-15,381,506	-15,381,506
1,159,803.53000		12/15/2014		1,159,803.53	113,414,608	1.000000000 ^S 86.542775996	1,159,803.53	100,372,617	0	-13,041,991	-13,041,991
58,528.71000		12/18/2014		58,528.71	5,610,975	1.000000000 ^S 86.542775996	58,528.71	5,065,237	0	-545,738	-545,738
24,573.92000		12/29/2014		24,573.92	2,401,342	1.000000000 ^S 86.542775996	24,573.92	2,126,695	0	-274,647	-274,647
485,468.43000		12/30/2014		485,468.43	47,691,683	1.000000000 ^S 86.542775996	485,468.43	42,013,786	0	-5,677,897	-5,677,897
1,564.21000		12/31/2014		1,564.21	153,474	1.000000000 ^S 86.542775996	1,564.21	135,371	0	-18,103	-18,103
1,300,000.00000		1/12/2015		1,300,000.00	126,516,938	1.000000000 ^S 86.542775996	1,300,000.00	112,505,609	0	-14,011,329	-14,011,329
207,747.74000		1/27/2015		207,747.74	19,495,459	1.000000000 ^S 86.542775996	207,747.74	17,979,066	0	-1,516,393	-1,516,393
696,374.06000		1/29/2015		696,374.06	65,271,775	1.000000000 ^S 86.542775996	696,374.06	60,266,144	0	-5,005,631	-5,005,631
1,406.23000		1/30/2015		1,406.23	128,636	1.000000000 ^S 86.542775996	1,406.23	121,699	0	-6,937	-6,937
206,582.45000		1/30/2015		206,582.45	18,993,836	1.000000000 ^S 86.542775996	206,582.45	17,878,219	0	-1,115,617	-1,115,617

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
54,791.29000		2/2/2015		54,791.29	5,012,081	1.000000000 ^S 86.542775996	54,791.29	4,741,790	0	-270,291	-270,291
253,877.80000		2/3/2015		253,877.80	23,278,426	1.000000000 ^S 86.542775996	253,877.80	21,971,290	0	-1,307,136	-1,307,136
205,542.23000		2/4/2015		205,542.23	18,576,235	1.000000000 ^S 86.542775996	205,542.23	17,788,195	0	-788,040	-788,040
115,628.17000		2/13/2015		115,628.17	10,612,693	1.000000000 ^S 86.542775996	115,628.17	10,006,783	0	-605,910	-605,910
29,412.99000		2/17/2015		29,412.99	2,709,706	1.000000000 ^S 86.542775996	29,412.99	2,545,482	0	-164,224	-164,224
667,933.59000		2/17/2015		667,933.59	61,534,158	1.000000000 ^S 86.542775996	667,933.59	57,804,827	0	-3,729,331	-3,729,331
326,807.08000		2/19/2015		326,807.08	30,343,940	1.000000000 ^S 86.542775996	326,807.08	28,282,792	0	-2,061,148	-2,061,148
2,192,063.20000		2/24/2015		2,192,063.20	203,418,105	1.000000000 ^S 86.542775996	2,192,063.20	189,707,234	0	-13,710,871	-13,710,871
53,434.29000		2/26/2015		53,434.29	5,009,829	1.000000000 ^S 86.542775996	53,434.29	4,624,352	0	-385,477	-385,477
2,003.28000		2/27/2015		2,003.28	187,455	1.000000000 ^S 86.542775996	2,003.28	173,369	0	-14,086	-14,086
61,389.07000		2/27/2015		61,389.07	5,734,296	1.000000000 ^S 86.542775996	61,389.07	5,312,781	0	-421,515	-421,515
8,272.79000		3/4/2015		8,272.79	774,772	1.000000000 ^S 86.542775996	8,272.79	715,950	0	-58,822	-58,822
73,974.98000		3/5/2015		73,974.98	6,922,876	1.000000000 ^S 86.542775996	73,974.98	6,402,000	0	-520,876	-520,876
6,525.72000		3/10/2015		6,525.72	610,308	1.000000000 ^S 86.542775996	6,525.72	564,754	0	-45,554	-45,554

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
30,000.03000		3/12/2015		30,000.03	2,763,346	1.000000000 ^S 86.542775996	30,000.03	2,596,286	0	-167,060	-167,060
169,508.06000		3/16/2015		169,508.06	15,673,421	1.000000000 ^S 86.542775996	169,508.06	14,669,698	0	-1,003,723	-1,003,723
494,617.75000		3/18/2015		494,617.75	45,673,172	1.000000000 ^S 86.542775996	494,617.75	42,805,593	0	-2,867,579	-2,867,579
493,314.13000		3/19/2015		493,314.13	45,648,649	1.000000000 ^S 86.542775996	493,314.13	42,692,774	0	-2,955,875	-2,955,875
60,525.11000		3/20/2015		60,525.11	5,576,441	1.000000000 ^S 86.542775996	60,525.11	5,238,011	0	-338,430	-338,430
637,230.13000		3/24/2015		637,230.13	59,886,633	1.000000000 ^S 86.542775996	637,230.13	55,147,664	0	-4,738,969	-4,738,969
3,884.02000		3/31/2015		3,884.02	355,841	1.000000000 ^S 86.542775996	3,884.02	336,134	0	-19,707	-19,707
281,169.60000		4/1/2015		281,169.60	25,759,832	1.000000000 ^S 86.542775996	281,169.60	24,333,198	0	-1,426,634	-1,426,634
52,665.13000		4/10/2015		52,665.13	4,878,576	1.000000000 ^S 86.542775996	52,665.13	4,557,787	0	-320,789	-320,789
94,219.67000		4/16/2015		94,219.67	8,562,177	1.000000000 ^S 86.542775996	94,219.67	8,154,032	0	-408,145	-408,145
185,609.77000		4/16/2015		185,609.77	16,867,218	1.000000000 ^S 86.542775996	185,609.77	16,063,185	0	-804,033	-804,033
979,482.42000		4/16/2015		979,482.42	89,010,097	1.000000000 ^S 86.542775996	979,482.42	84,767,128	0	-4,242,969	-4,242,969
1,084,907.81000		4/16/2015		1,084,907.81	98,590,590	1.000000000 ^S 86.542775996	1,084,907.81	93,890,934	0	-4,699,656	-4,699,656
95,260.21000		4/22/2015		95,260.21	8,815,560	1.000000000 ^S 86.542775996	95,260.21	8,244,083	0	-571,477	-571,477

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,200,000.00000		4/27/2015		1,200,000.00	111,722,034	1.000000000 ^S 86.542775996	1,200,000.00	103,851,331	0	-7,870,703	-7,870,703
1,624.58000		4/30/2015		1,624.58	153,344	1.000000000 ^S 86.542775996	1,624.58	140,596	0	-12,748	-12,748
97,398.84000		5/7/2015		97,398.84	9,322,518	1.000000000 ^S 86.542775996	97,398.84	8,429,166	0	-893,352	-893,352
1,200,000.00000		5/12/2015		1,200,000.00	113,914,267	1.000000000 ^S 86.542775996	1,200,000.00	103,851,331	0	-10,062,936	-10,062,936
1,204.66000		5/18/2015		1,204.66	115,742	1.000000000 ^S 86.542775996	1,204.66	104,255	0	-11,487	-11,487
102,958.65000		5/21/2015		102,958.65	9,829,791	1.000000000 ^S 86.542775996	102,958.65	8,910,327	0	-919,464	-919,464
240,337.15000		5/27/2015		240,337.15	22,898,966	1.000000000 ^S 86.542775996	240,337.15	20,799,444	0	-2,099,522	-2,099,522
1,040.35000		5/29/2015		1,040.35	98,821	1.000000000 ^S 86.542775996	1,040.35	90,035	0	-8,786	-8,786
58,140.06000		6/4/2015		58,140.06	5,632,409	1.000000000 ^S 86.542775996	58,140.06	5,031,602	0	-600,807	-600,807
463,495.15000		6/5/2015		463,495.15	44,299,139	1.000000000 ^S 86.542775996	463,495.15	40,112,157	0	-4,186,982	-4,186,982
86,583.78000		6/9/2015		86,583.78	8,282,560	1.000000000 ^S 86.542775996	86,583.78	7,493,201	0	-789,359	-789,359
1,000,000.00000		6/11/2015		1,000,000.00	95,109,932	1.000000000 ^S 86.542775996	1,000,000.00	86,542,776	0	-8,567,156	-8,567,156
950,000.00000		6/23/2015		950,000.00	90,927,877	1.000000000 ^S 86.542775996	950,000.00	82,215,637	0	-8,712,240	-8,712,240
742.88000		6/30/2015		742.88	69,868	1.000000000 ^S 86.542775996	742.88	64,291	0	-5,577	-5,577

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
87,175.55000		7/2/2015		87,175.55	8,216,800	1.000000000 ^S 86.542775996	87,175.55	7,544,414	0	-672,386	-672,386
1,500,000.00000		7/8/2015		1,500,000.00	136,124,157	1.000000000 ^S 86.542775996	1,500,000.00	129,814,164	0	-6,309,993	-6,309,993
5,077.27000		7/9/2015		5,077.27	457,130	1.000000000 ^S 86.542775996	5,077.27	439,401	0	-17,729	-17,729
100,237.08000		7/17/2015		100,237.08	9,227,204	1.000000000 ^S 86.542775996	100,237.08	8,674,795	0	-552,409	-552,409
945.93000		7/31/2015		945.93	86,063	1.000000000 ^S 86.542775996	945.93	81,863	0	-4,200	-4,200
88,380.65000		7/31/2015		88,380.65	7,994,358	1.000000000 ^S 86.542775996	88,380.65	7,648,707	0	-345,651	-345,651
1,940,000.00000		8/7/2015		1,940,000.00	177,758,540	1.000000000 ^S 86.542775996	1,940,000.00	167,892,985	0	-9,865,555	-9,865,555
7,650,000.00000		8/11/2015		7,650,000.00	704,316,836	1.000000000 ^S 86.542775996	7,650,000.00	662,052,236	0	-42,264,600	-42,264,600
479,833.36000		8/13/2015		479,833.36	43,809,780	1.000000000 ^S 86.542775996	479,833.36	41,526,111	0	-2,283,669	-2,283,669
75,403.65000		8/18/2015		75,403.65	6,920,738	1.000000000 ^S 86.542775996	75,403.65	6,525,641	0	-395,097	-395,097
1,260,000.00000		8/25/2015		1,260,000.00	107,638,641	1.000000000 ^S 86.542775996	1,260,000.00	109,043,898	0	1,405,257	1,405,257
20,000.03000		8/28/2015		20,000.03	1,724,493	1.000000000 ^S 86.542775996	20,000.03	1,730,858	0	6,365	6,365
-10,158,303.20000		10/15/2014		-10,158,303.20	-949,004,463	1.000000000 ^S 86.542775996	-10,158,303.20	-879,127,758	0	69,876,705	69,876,705
-2,000,000.00000		10/15/2014		-2,000,000.00	-186,843,106	1.000000000 ^S 86.542775996	-2,000,000.00	-173,085,552	0	13,757,554	13,757,554

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-124,452.66000		10/16/2014		-124,452.66	-11,611,456	1.000000000 ^S 86.542775996	-124,452.66	-10,770,479	0	840,977	840,977
-95,422.92000		10/17/2014		-95,422.92	-8,874,101	1.000000000 ^S 86.542775996	-95,422.92	-8,258,164	0	615,937	615,937
-212,367.10000		10/20/2014		-212,367.10	-19,830,814	1.000000000 ^S 86.542775996	-212,367.10	-18,378,838	0	1,451,976	1,451,976
-96,073.00000		10/21/2014		-96,073.00	-9,020,412	1.000000000 ^S 86.542775996	-96,073.00	-8,314,424	0	705,988	705,988
-180,163.29000		10/22/2014		-180,163.29	-16,932,785	1.000000000 ^S 86.542775996	-180,163.29	-15,591,831	0	1,340,954	1,340,954
-134,048.72000		10/22/2014		-134,048.72	-12,598,672	1.000000000 ^S 86.542775996	-134,048.72	-11,600,948	0	997,724	997,724
-11,302.59000		10/22/2014		-11,302.59	-1,062,283	1.000000000 ^S 86.542775996	-11,302.59	-978,158	0	84,125	84,125
-107,152.67000		10/23/2014		-107,152.67	-10,114,159	1.000000000 ^S 86.542775996	-107,152.67	-9,273,290	0	840,869	840,869
-31,285.75000		10/24/2014		-31,285.75	-2,965,041	1.000000000 ^S 86.542775996	-31,285.75	-2,707,556	0	257,485	257,485
-132,121.93000		10/28/2014		-132,121.93	-12,520,174	1.000000000 ^S 86.542775996	-132,121.93	-11,434,199	0	1,085,975	1,085,975
-482,451.36000		10/29/2014		-482,451.36	-46,100,869	1.000000000 ^S 86.542775996	-482,451.36	-41,752,680	0	4,348,189	4,348,189
-290,633.73000		10/30/2014		-290,633.73	-27,973,317	1.000000000 ^S 86.542775996	-290,633.73	-25,152,250	0	2,821,067	2,821,067
-237,376.05000		11/5/2014		-237,376.05	-23,468,631	1.000000000 ^S 86.542775996	-237,376.05	-20,543,182	0	2,925,449	2,925,449
-60,273.52000		11/6/2014		-60,273.52	-5,930,648	1.000000000 ^S 86.542775996	-60,273.52	-5,216,238	0	714,410	714,410

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-911,057.13000		11/7/2014		-911,057.13	-89,780,968	1.000000000 ^S 86.542775996	-911,057.13	-78,845,413	0	10,935,555	10,935,555
-395,964.91000		11/10/2014		-395,964.91	-39,200,790	1.000000000 ^S 86.542775996	-395,964.91	-34,267,903	0	4,932,887	4,932,887
-614,649.22000		11/12/2014		-614,649.22	-61,634,256	1.000000000 ^S 86.542775996	-614,649.22	-53,193,450	0	8,440,806	8,440,806
-70,444.68000		11/12/2014		-70,444.68	-7,063,875	1.000000000 ^S 86.542775996	-70,444.68	-6,096,478	0	967,397	967,397
-54,603.48000		11/13/2014		-54,603.48	-5,490,877	1.000000000 ^S 86.542775996	-54,603.48	-4,725,537	0	765,340	765,340
-319,964.21000		11/17/2014		-319,964.21	-32,542,269	1.000000000 ^S 86.542775996	-319,964.21	-27,690,591	0	4,851,678	4,851,678
-20,035.87000		11/18/2014		-20,035.87	-2,032,868	1.000000000 ^S 86.542775996	-20,035.87	-1,733,960	0	298,908	298,908
-213,850.66000		11/19/2014		-213,850.66	-21,776,026	1.000000000 ^S 86.542775996	-213,850.66	-18,507,230	0	3,268,796	3,268,796
-9,364.59000		11/20/2014		-9,364.59	-950,919	1.000000000 ^S 86.542775996	-9,364.59	-810,438	0	140,481	140,481
-2,545,581.34000		11/21/2014		-2,545,581.34	-259,289,652	1.000000000 ^S 86.542775996	-2,545,581.34	-220,301,676	0	38,987,976	38,987,976
-89,212.14000		11/25/2014		-89,212.14	-9,098,869	1.000000000 ^S 86.542775996	-89,212.14	-7,720,666	0	1,378,203	1,378,203
-603,479.44000		11/26/2014		-603,479.44	-60,728,438	1.000000000 ^S 86.542775996	-603,479.44	-52,226,786	0	8,501,652	8,501,652
-86,787.10000		11/28/2014		-86,787.10	-8,741,712	1.000000000 ^S 86.542775996	-86,787.10	-7,510,797	0	1,230,915	1,230,915
-336,619.36000		12/1/2014		-336,619.36	-34,098,751	1.000000000 ^S 86.542775996	-336,619.36	-29,131,974	0	4,966,777	4,966,777

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-93,678.58000		12/2/2014		-93,678.58	-9,411,623	1.000000000 ^S 86.542775996	-93,678.58	-8,107,204	0	1,304,419	1,304,419
-214,564.97000		12/3/2014		-214,564.97	-21,617,415	1.000000000 ^S 86.542775996	-214,564.97	-18,569,048	0	3,048,367	3,048,367
-435,539.26000		12/4/2014		-435,539.26	-43,903,822	1.000000000 ^S 86.542775996	-435,539.26	-37,692,777	0	6,211,045	6,211,045
-301,627.51000		12/9/2014		-301,627.51	-30,314,256	1.000000000 ^S 86.542775996	-301,627.51	-26,103,682	0	4,210,574	4,210,574
-128,649.45000		12/10/2014		-128,649.45	-12,782,326	1.000000000 ^S 86.542775996	-128,649.45	-11,133,681	0	1,648,645	1,648,645
-701,988.29000		12/11/2014		-701,988.29	-69,264,315	1.000000000 ^S 86.542775996	-701,988.29	-60,752,015	0	8,512,300	8,512,300
-69,226.87000		12/11/2014		-69,226.87	-6,830,529	1.000000000 ^S 86.542775996	-69,226.87	-5,991,086	0	839,443	839,443
-233,220.13000		12/12/2014		-233,220.13	-22,988,872	1.000000000 ^S 86.542775996	-233,220.13	-20,183,517	0	2,805,355	2,805,355
-1,012,066.41000		12/15/2014		-1,012,066.41	-98,967,724	1.000000000 ^S 86.542775996	-1,012,066.41	-87,587,037	0	11,380,687	11,380,687
-882,994.13000		12/15/2014		-882,994.13	-86,346,033	1.000000000 ^S 86.542775996	-882,994.13	-76,416,763	0	9,929,270	9,929,270
-667,933.59000		12/15/2014		-667,933.59	-65,315,741	1.000000000 ^S 86.542775996	-667,933.59	-57,804,827	0	7,510,914	7,510,914
-230,255.10000		12/16/2014		-230,255.10	-22,377,237	1.000000000 ^S 86.542775996	-230,255.10	-19,926,916	0	2,450,321	2,450,321
-67,739.36000		12/17/2014		-67,739.36	-6,523,402	1.000000000 ^S 86.542775996	-67,739.36	-5,862,352	0	661,050	661,050
-244,669.86000		12/19/2014		-244,669.86	-23,723,117	1.000000000 ^S 86.542775996	-244,669.86	-21,174,409	0	2,548,708	2,548,708

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-148,648.91000		12/22/2014		-148,648.91	-14,467,922	1.000000000 ^S 86.542775996	-148,648.91	-12,864,489	0	1,603,433	1,603,433
-151,043.46000		12/24/2014		-151,043.46	-14,765,543	1.000000000 ^S 86.542775996	-151,043.46	-13,071,720	0	1,693,823	1,693,823
-105,843.81000		1/5/2015		-105,843.81	-10,336,129	1.000000000 ^S 86.542775996	-105,843.81	-9,160,017	0	1,176,112	1,176,112
-204,027.32000		1/7/2015		-204,027.32	-19,651,794	1.000000000 ^S 86.542775996	-204,027.32	-17,657,091	0	1,994,703	1,994,703
-92,171.03000		1/8/2015		-92,171.03	-8,853,375	1.000000000 ^S 86.542775996	-92,171.03	-7,976,737	0	876,638	876,638
-686,560.80000		1/9/2015		-686,560.80	-66,622,818	1.000000000 ^S 86.542775996	-686,560.80	-59,416,878	0	7,205,940	7,205,940
-296,399.69000		1/13/2015		-296,399.69	-28,690,461	1.000000000 ^S 86.542775996	-296,399.69	-25,651,252	0	3,039,209	3,039,209
-20,527.98000		1/14/2015		-20,527.98	-1,983,598	1.000000000 ^S 86.542775996	-20,527.98	-1,776,548	0	207,050	207,050
-39,405.57000		1/15/2015		-39,405.57	-3,758,292	1.000000000 ^S 86.542775996	-39,405.57	-3,410,267	0	348,025	348,025
-39,335.92000		1/21/2015		-39,335.92	-3,807,263	1.000000000 ^S 86.542775996	-39,335.92	-3,404,240	0	403,023	403,023
-144,341.08000		1/22/2015		-144,341.08	-13,851,088	1.000000000 ^S 86.542775996	-144,341.08	-12,491,678	0	1,359,410	1,359,410
-140,447.93000		1/22/2015		-140,447.93	-13,477,498	1.000000000 ^S 86.542775996	-140,447.93	-12,154,754	0	1,322,744	1,322,744
-131,846.04000		1/22/2015		-131,846.04	-12,652,054	1.000000000 ^S 86.542775996	-131,846.04	-11,410,322	0	1,241,732	1,241,732
-11,116.87000		1/22/2015		-11,116.87	-1,066,784	1.000000000 ^S 86.542775996	-11,116.87	-962,085	0	104,699	104,699

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-9,303.87000		1/28/2015		-9,303.87	-869,334	1.000000000 ^S 86.542775996	-9,303.87	-805,183	0	64,151	64,151
-258,206.95000		2/5/2015		-258,206.95	-23,515,972	1.000000000 ^S 86.542775996	-258,206.95	-22,345,946	0	1,170,026	1,170,026
-128,192.28000		2/9/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.000000000 ^S 86.542775996	-128,192.28	-11,094,116	0	818,135	818,135
-76,498.09000		2/10/2015		-76,498.09	-7,094,696	1.000000000 ^S 86.542775996	-76,498.09	-6,620,357	0	474,339	474,339
-643,025.87000		2/12/2015		-643,025.87	-59,704,371	1.000000000 ^S 86.542775996	-643,025.87	-55,649,244	0	4,055,127	4,055,127
-195,720.57000		2/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.000000000 ^S 86.542775996	-195,720.57	-16,938,201	0	1,232,116	1,232,116
-12,078.57000		2/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.000000000 ^S 86.542775996	-12,078.57	-1,045,313	0	74,645	74,645
-203,751.45000		2/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000 ^S 86.542775996	-203,751.45	-17,633,216	0	1,315,865	1,315,865
-16,686.40000		2/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.000000000 ^S 86.542775996	-16,686.40	-1,444,087	0	110,626	110,626
-164,421.91000		3/2/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.000000000 ^S 86.542775996	-164,421.91	-14,229,529	0	1,156,063	1,156,063
-12,405.71000		3/3/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.000000000 ^S 86.542775996	-12,405.71	-1,073,625	0	86,248	86,248
-125,474.92000		3/6/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000 ^S 86.542775996	-125,474.92	-10,858,948	0	865,202	865,202
-152,618.80000		3/9/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.000000000 ^S 86.542775996	-152,618.80	-13,208,055	0	1,087,644	1,087,644
-708,611.63000		3/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.000000000 ^S 86.542775996	-708,611.63	-61,325,218	0	4,282,013	4,282,013

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-27,978.64000		3/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.000000000 ^S 86.542775996	-27,978.64	-2,421,349	0	169,070	169,070
-174,287.44000		3/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.000000000 ^S 86.542775996	-174,287.44	-15,083,319	0	1,202,516	1,202,516
-7,763.28000		3/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000 ^S 86.542775996	-7,763.28	-671,856	0	49,128	49,128
-302,844.98000		3/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000 ^S 86.542775996	-302,844.98	-26,209,045	0	2,054,803	2,054,803
-97,995.40000		3/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000 ^S 86.542775996	-97,995.40	-8,480,794	0	767,521	767,521
-172,798.05000		3/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000 ^S 86.542775996	-172,798.05	-14,954,423	0	1,252,488	1,252,488
-975,466.76000		3/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000 ^S 86.542775996	-975,466.76	-84,419,601	0	6,535,021	6,535,021
-256,508.24000		3/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000 ^S 86.542775996	-256,508.24	-22,198,935	0	1,495,459	1,495,459
-189,563.24000		3/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000 ^S 86.542775996	-189,563.24	-16,405,329	0	971,969	971,969
-206,250.64000		4/2/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000 ^S 86.542775996	-206,250.64	-17,849,503	0	949,439	949,439
-90,318.63000		4/7/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000 ^S 86.542775996	-90,318.63	-7,816,425	0	378,256	378,256
-74,243.21000		4/8/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000 ^S 86.542775996	-74,243.21	-6,425,213	0	410,438	410,438
-78,171.43000		4/9/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000 ^S 86.542775996	-78,171.43	-6,765,173	0	453,717	453,717
-705,086.17000		4/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000 ^S 86.542775996	-705,086.17	-61,020,114	0	4,088,589	4,088,589

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-37,651.50000		4/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000 ^S 86.542775996	-37,651.50	-3,258,465	0	218,330	218,330
-246,307.80000		4/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000 ^S 86.542775996	-246,307.80	-21,316,161	0	1,117,602	1,117,602
-57,294.63000		4/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000 ^S 86.542775996	-57,294.63	-4,958,436	0	261,688	261,688
-39,422.26000		4/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000 ^S 86.542775996	-39,422.26	-3,411,712	0	234,910	234,910
-167,462.13000		4/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000 ^S 86.542775996	-167,462.13	-14,492,638	0	936,722	936,722
-11,204.33000		4/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000 ^S 86.542775996	-11,204.33	-969,654	0	62,673	62,673
-58,785.17000		4/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000 ^S 86.542775996	-58,785.17	-5,087,432	0	380,733	380,733
-203,446.05000		4/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000 ^S 86.542775996	-203,446.05	-17,606,786	0	1,303,483	1,303,483
-19,719.18000		4/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000 ^S 86.542775996	-19,719.18	-1,706,553	0	129,336	129,336
-746,896.35000		4/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000 ^S 86.542775996	-746,896.35	-64,638,484	0	5,360,242	5,360,242
-47,545.85000		4/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000 ^S 86.542775996	-47,545.85	-4,114,750	0	441,293	441,293
-35,878.86000		5/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000 ^S 86.542775996	-35,878.86	-3,105,056	0	290,888	290,888
-59,220.06000		5/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000 ^S 86.542775996	-59,220.06	-5,125,068	0	496,607	496,607
-684,441.51000		5/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000 ^S 86.542775996	-684,441.51	-59,233,468	0	6,228,060	6,228,060

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-157,020.19000		5/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000 ^S 86.542775996	-157,020.19	-13,588,963	0	1,428,802	1,428,802
-45,251.01000		5/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000 ^S 86.542775996	-45,251.01	-3,916,148	0	448,368	448,368
-518,763.75000		5/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000 ^S 86.542775996	-518,763.75	-44,895,255	0	4,628,830	4,628,830
-6,306.57000		5/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000 ^S 86.542775996	-6,306.57	-545,788	0	56,072	56,072
-52,113.71000		5/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000 ^S 86.542775996	-52,113.71	-4,510,065	0	442,542	442,542
-393,354.22000		5/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000 ^S 86.542775996	-393,354.22	-34,041,966	0	3,291,019	3,291,019
-245,742.67000		6/1/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000 ^S 86.542775996	-245,742.67	-21,267,253	0	2,075,479	2,075,479
-5,170.70000		6/2/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000 ^S 86.542775996	-5,170.70	-447,487	0	42,750	42,750
-78,821.02000		6/3/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000 ^S 86.542775996	-78,821.02	-6,821,390	0	756,790	756,790
-113,860.14000		6/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000 ^S 86.542775996	-113,860.14	-9,853,773	0	1,015,233	1,015,233
-666,844.90000		6/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000 ^S 86.542775996	-666,844.90	-57,710,609	0	5,712,964	5,712,964
-110,710.67000		6/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000 ^S 86.542775996	-110,710.67	-9,581,209	0	948,475	948,475
-54,834.71000		6/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000 ^S 86.542775996	-54,834.71	-4,745,548	0	489,149	489,149
-83,284.46000		6/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000 ^S 86.542775996	-83,284.46	-7,207,668	0	738,716	738,716

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-479,833.36000		6/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000 ^S 86.542775996	-479,833.36	-41,526,111	0	4,493,994	4,493,994
-17,695.85000		6/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000 ^S 86.542775996	-17,695.85	-1,531,448	0	165,735	165,735
-470,587.90000		6/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000 ^S 86.542775996	-470,587.90	-40,725,983	0	4,100,463	4,100,463
-156,011.32000		6/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000 ^S 86.542775996	-156,011.32	-13,501,653	0	1,513,175	1,513,175
-49,769.29000		6/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000 ^S 86.542775996	-49,769.29	-4,307,173	0	431,188	431,188
-106,347.76000		6/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000 ^S 86.542775996	-106,347.76	-9,203,630	0	975,292	975,292
-13,612.05000		6/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000 ^S 86.542775996	-13,612.05	-1,178,025	0	123,355	123,355
-255,184.50000		6/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000 ^S 86.542775996	-255,184.50	-22,084,375	0	2,091,502	2,091,502
-321,067.80000		6/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000 ^S 86.542775996	-321,067.80	-27,786,099	0	2,350,373	2,350,373
-64,733.44000		7/1/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000 ^S 86.542775996	-64,733.44	-5,602,212	0	485,952	485,952
-28,970.18000		7/6/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000 ^S 86.542775996	-28,970.18	-2,507,160	0	165,586	165,586
-19,343.07000		7/8/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000 ^S 86.542775996	-19,343.07	-1,674,003	0	81,370	81,370
-676,268.27000		7/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000 ^S 86.542775996	-676,268.27	-58,526,133	0	2,415,204	2,415,204
-68,449.88000		7/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000 ^S 86.542775996	-68,449.88	-5,923,843	0	244,459	244,459

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-275,119.99000		7/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000 ^S 86.542775996	-275,119.99	-23,809,648	0	1,233,463	1,233,463
-93,052.47000		7/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000 ^S 86.542775996	-93,052.47	-8,053,019	0	472,973	472,973
-73,784.97000		7/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000 ^S 86.542775996	-73,784.97	-6,385,556	0	375,039	375,039
-110,427.24000		7/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000 ^S 86.542775996	-110,427.24	-9,556,680	0	615,562	615,562
-164,563.52000		7/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000 ^S 86.542775996	-164,563.52	-14,241,784	0	820,156	820,156
-87,873.33000		7/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000 ^S 86.542775996	-87,873.33	-7,604,802	0	306,110	306,110
-13,601.15000		7/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000 ^S 86.542775996	-13,601.15	-1,177,081	0	44,855	44,855
-59,933.50000		8/5/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000 ^S 86.542775996	-59,933.50	-5,186,811	0	323,324	323,324
-143,187.55000		8/6/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000 ^S 86.542775996	-143,187.55	-12,391,848	0	753,139	753,139
-158,035.75000		8/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000 ^S 86.542775996	-158,035.75	-13,676,853	0	852,319	852,319
-669,741.07000		8/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000 ^S 86.542775996	-669,741.07	-57,961,251	0	3,700,175	3,700,175
-284,337.22000		8/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000 ^S 86.542775996	-284,337.22	-24,607,332	0	1,570,902	1,570,902
-7,892,527.01000		8/12/2015		-7,892,527.01	-718,905,956	1.000000000 ^S 86.542775996	-7,892,527.01	-683,041,197	0	35,864,759	35,864,759
-156,845.94000		8/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000 ^S 86.542775996	-156,845.94	-13,573,883	0	746,476	746,476

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-53,128.21000		8/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000 ^S 86.542775996	-53,128.21	-4,597,863	0	265,256	265,256
-162,199.09000		8/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000 ^S 86.542775996	-162,199.09	-14,037,160	0	828,212	828,212
-21,061.93000		8/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000 ^S 86.542775996	-21,061.93	-1,822,758	0	98,403	98,403
-265,076.96000		8/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000 ^S 86.542775996	-265,076.96	-22,940,496	0	1,185,578	1,185,578
-19,404.32000		8/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000 ^S 86.542775996	-19,404.32	-1,679,304	0	-1,679,091	-1,679,091
-196,668.41000		8/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000 ^S 86.542775996	-196,668.41	-17,020,230	0	-219,341	-219,341
-462,149.98000		8/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000 ^S 86.542775996	-462,149.98	-39,995,742	0	-236,130	-236,130
-32,107.10000		8/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000 ^S 86.542775996	-32,107.10	-2,778,638	0	-59,815	-59,815
861,132.99000 0.00000	合計 -----			861,133	109,663,577		861,133	74,524,832	0	-35,138,745	-35,138,745
68,547.40000	BRAZILIAN REAL BRL	5/14/2013		68,547.40	3,453,934	1.000000000 ^S 0.029541341	68,547.40	2,320,389	0	-1,133,545	-1,133,545
1,056,403.20000		5/14/2013		1,056,403.20	53,229,538	1.000000000 ^S 0.029541341	1,056,403.20	35,760,164	0	-17,469,374	-17,469,374
90,499.50000		6/11/2013		90,499.50	4,158,091	1.000000000 ^S 0.029541341	90,499.50	3,063,487	0	-1,094,604	-1,094,604
184,874.70000		6/11/2013		184,874.70	8,494,255	1.000000000 ^S 0.029541341	184,874.70	6,258,169	0	-2,236,086	-2,236,086
3,892,793.65000		6/11/2013		3,892,793.65	178,858,332	1.000000000 ^S 0.029541341	3,892,793.65	131,774,439	0	-47,083,893	-47,083,893

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
32,593,600.00000		6/11/2013		32,593,600.00	1,497,545,840	1.000000000 ^S 0.029541341	32,593,600.00	1,103,321,613	0	-394,224,227	-394,224,227
369,451,791.10000		6/11/2013		369,451,791.10	16,974,835,330	1.000000000 ^S 0.029541341	369,451,791.10	12,506,263,378	0	-4,468,571,952	-4,468,571,952
-632,326.40000		5/14/2013		-632,326.40	-31,861,359	1.000000000 ^S 0.029541341	-632,326.40	-21,404,797	0	10,456,562	10,456,562
-353,472,791.10000		6/11/2013		-353,472,791.10	-16,240,664,051	1.000000000 ^S 0.029541341	-353,472,791.10	-11,965,360,378	0	4,275,303,673	4,275,303,673
-32,593,600.00000		6/11/2013		-32,593,600.00	-1,497,545,840	1.000000000 ^S 0.029541341	-32,593,600.00	-1,103,321,613	0	394,224,227	394,224,227
-4,965,000.00000		6/11/2013		-4,965,000.00	-228,121,935	1.000000000 ^S 0.029541341	-4,965,000.00	-168,069,554	0	60,052,381	60,052,381
-4,950,000.00000		6/11/2013		-4,950,000.00	-227,432,745	1.000000000 ^S 0.029541341	-4,950,000.00	-167,561,791	0	59,870,954	59,870,954
-4,561,792.05000		6/11/2013		-4,561,792.05	-209,596,139	1.000000000 ^S 0.029541341	-4,561,792.05	-154,420,615	0	55,175,524	55,175,524
-4,089,000.00000		6/11/2013		-4,089,000.00	-187,873,231	1.000000000 ^S 0.029541341	-4,089,000.00	-138,416,194	0	49,457,037	49,457,037
-1,975,000.00000		6/11/2013		-1,975,000.00	-90,743,368	1.000000000 ^S 0.029541341	-1,975,000.00	-66,855,462	0	23,887,906	23,887,906
-99,000.00000		6/11/2013		-99,000.00	-4,548,655	1.000000000 ^S 0.029541341	-99,000.00	-3,351,236	0	1,197,419	1,197,419
0.00000	合計 -----			0	2,187,997		0	-1	0	-2,187,998	-2,187,998
0.00000											
57,776.55	BRITISH POUND GBP	8/13/2015		57,776.55	11,191,154	1.000000000 ^S 185.785026755	57,776.55	10,734,018	0	-457,136	-457,136
50.00	CANADIAN DOLLAR CAD	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000 ^S 0.010929714	50.00	4,575	0	-95	-95

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
6,912.57000	EURO	8/14/2015		6,912.57	957,226	1.000000000 ^S	6,912.57	938,629	0	-18,597	-18,597
	EUR					135.785760755					
97,687.70000		8/14/2015		97,687.70	13,527,421	1.000000000 ^S	97,687.70	13,264,599	0	-262,822	-262,822
						135.785760755					
104,600.27000	合計 -----			104,600	14,484,647		104,600	14,203,228	0	-281,419	-281,419
0.00000											
350,278.35000	UNITED STATES DOLLAR	8/13/2015		350,278.35	43,390,730	1.000000000 ^S	350,278.35	42,385,433	0	-1,005,297	-1,005,297
	USD					0.008264121					
777,188.22000		8/13/2015		777,188.22	96,274,189	1.000000000 ^S	777,188.22	94,043,664	0	-2,230,525	-2,230,525
						0.008264121					
1,831,000.00000		8/13/2015		1,831,000.00	226,815,122	1.000000000 ^S	1,831,000.00	221,560,164	0	-5,254,958	-5,254,958
						0.008264121					
2,173,300.00000		8/13/2015		2,173,300.00	269,217,534	1.000000000 ^S	2,173,300.00	262,980,177	0	-6,237,357	-6,237,357
						0.008264121					
3,028,956.59000		8/13/2015		3,028,956.59	375,211,992	1.000000000 ^S	3,028,956.59	366,518,906	0	-8,693,086	-8,693,086
						0.008264121					
3,793,556.80000		8/13/2015		3,793,556.80	469,926,842	1.000000000 ^S	3,793,556.80	459,039,358	0	-10,887,484	-10,887,484
						0.008264121					
4,123,000.00000		8/13/2015		4,123,000.00	510,736,618	1.000000000 ^S	4,123,000.00	498,903,634	0	-11,832,984	-11,832,984
						0.008264121					
5,445,421.80000		8/13/2015		5,445,421.80	674,551,616	1.000000000 ^S	5,445,421.80	658,923,290	0	-15,628,326	-15,628,326
						0.008264121					
8,559,261.15000		8/13/2015		8,559,261.15	1,060,278,460	1.000000000 ^S	8,559,261.15	1,035,713,435	0	-24,565,025	-24,565,025
						0.008264121					
9,336,321.74000		8/13/2015		9,336,321.74	1,156,536,839	1.000000000 ^S	9,336,321.74	1,129,741,656	0	-26,795,183	-26,795,183
						0.008264121					
12,823,806.70000		8/13/2015		12,823,806.70	1,588,549,032	1.000000000 ^S	12,823,806.70	1,551,744,789	0	-36,804,243	-36,804,243
						0.008264121					

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
19,983,185.85000		8/13/2015		19,983,185.85	2,475,417,112	1.000000000 ^S 0.008264121	19,983,185.85	2,418,065,497	0	-57,351,615	-57,351,615
26,229,589.23000		8/13/2015		26,229,589.23	3,249,190,320	1.000000000 ^S 0.008264121	26,229,589.23	3,173,911,567	0	-75,278,753	-75,278,753
44,125,264.17000		8/13/2015		44,125,264.17	5,466,017,021	1.000000000 ^S 0.008264121	44,125,264.17	5,339,377,796	0	-126,639,225	-126,639,225
54,410,720.38000		8/13/2015		54,410,720.38	6,740,127,891	1.000000000 ^S 0.008264121	54,410,720.38	6,583,969,472	0	-156,158,419	-156,158,419
83,462,387.68000		8/13/2015		83,462,387.68	10,338,903,127	1.000000000 ^S 0.008264121	83,462,387.68	10,099,366,609	0	-239,536,518	-239,536,518
84,120,269.71000		8/13/2015		84,120,269.71	10,420,398,262	1.000000000 ^S 0.008264121	84,120,269.71	10,178,973,627	0	-241,424,635	-241,424,635
95,825,408.27000		8/13/2015		95,825,408.27	11,870,372,280	1.000000000 ^S 0.008264121	95,825,408.27	11,595,353,973	0	-275,018,307	-275,018,307
64,974.00000		8/19/2015		64,974.00	8,083,740	1.000000000 ^S 0.008264121	64,974.00	7,862,179	0	-221,561	-221,561
5,399,912.70000		8/19/2015		5,399,912.70	671,830,142	1.000000000 ^S 0.008264121	5,399,912.70	653,416,461	0	-18,413,681	-18,413,681
133,894.17000		8/24/2015		133,894.17	16,639,029	1.000000000 ^S 0.008264121	133,894.17	16,201,865	0	-437,164	-437,164
6,541,000.00000		8/24/2015		6,541,000.00	812,850,115	1.000000000 ^S 0.008264121	6,541,000.00	791,493,735	0	-21,356,380	-21,356,380
-95,867,496.75000		6/16/2015		-95,867,496.75	-11,838,676,715	1.000000000 ^S 0.008264121	-95,867,496.75	-11,600,446,890	0	238,229,825	238,229,825
-84,156,665.36000		6/16/2015		-84,156,665.36	-10,392,506,202	1.000000000 ^S 0.008264121	-84,156,665.36	-10,183,377,683	0	209,128,519	209,128,519
-83,400,864.91000		6/16/2015		-83,400,864.91	-10,299,172,408	1.000000000 ^S 0.008264121	-83,400,864.91	-10,091,922,046	0	207,250,362	207,250,362

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-54,370,123.76000		6/16/2015		-54,370,123.76	-6,714,166,323	1.000000000\$ 0.008264121	-54,370,123.76	-6,579,057,078	0	135,109,245	135,109,245
-44,144,789.58000		6/16/2015		-44,144,789.58	-5,451,439,854	1.000000000\$ 0.008264121	-44,144,789.58	-5,341,740,468	0	109,699,386	109,699,386
-9,329,070.64000		6/16/2015		-9,329,070.64	-1,152,046,889	1.000000000\$ 0.008264121	-9,329,070.64	-1,128,864,236	0	23,182,653	23,182,653
-7,686,152.82000		6/16/2015		-7,686,152.82	-949,162,975	1.000000000\$ 0.008264121	-7,686,152.82	-930,062,958	0	19,100,017	19,100,017
-7,312,079.56000		6/16/2015		-7,312,079.56	-902,968,670	1.000000000\$ 0.008264121	-7,312,079.56	-884,798,221	0	18,170,449	18,170,449
-6,796,914.10000		6/16/2015		-6,796,914.10	-839,350,890	1.000000000\$ 0.008264121	-6,796,914.10	-822,460,622	0	16,890,268	16,890,268
-4,710,000.00000		6/16/2015		-4,710,000.00	-581,637,877	1.000000000\$ 0.008264121	-4,710,000.00	-569,933,572	0	11,704,305	11,704,305
-3,790,556.00000		6/16/2015		-3,790,556.00	-468,095,742	1.000000000\$ 0.008264121	-3,790,556.00	-458,676,246	0	9,419,496	9,419,496
-3,026,655.83000		6/16/2015		-3,026,655.83	-373,761,714	1.000000000\$ 0.008264121	-3,026,655.83	-366,240,503	0	7,521,211	7,521,211
-1,200,000.00000		6/16/2015		-1,200,000.00	-148,187,994	1.000000000\$ 0.008264121	-1,200,000.00	-145,206,006	0	2,981,988	2,981,988
-777,511.23000		6/16/2015		-777,511.23	-96,014,858	1.000000000\$ 0.008264121	-777,511.23	-94,082,750	0	1,932,108	1,932,108
-737,663.56000		6/16/2015		-737,663.56	-91,094,069	1.000000000\$ 0.008264121	-737,663.56	-89,260,983	0	1,833,086	1,833,086
-581,209.28000		6/17/2015		-581,209.28	-71,741,567	1.000000000\$ 0.008264121	-581,209.28	-70,329,232	0	1,412,335	1,412,335
-587,307.65000		6/18/2015		-587,307.65	-72,972,973	1.000000000\$ 0.008264121	-587,307.65	-71,067,165	0	1,905,808	1,905,808

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-778,087.42000		6/19/2015		-778,087.42	-95,693,080	1.000000000 ^S 0.008264121	-778,087.42	-94,152,472	0	1,540,608	1,540,608
-546,881.25000		6/22/2015		-546,881.25	-67,135,141	1.000000000 ^S 0.008264121	-546,881.25	-66,175,368	0	959,773	959,773
-582,324.00000		6/24/2015		-582,324.00	-72,141,211	1.000000000 ^S 0.008264121	-582,324.00	-70,464,118	0	1,677,093	1,677,093
-2,432,186.63000		6/25/2015		-2,432,186.63	-302,418,094	1.000000000 ^S 0.008264121	-2,432,186.63	-294,306,754	0	8,111,340	8,111,340
-635,073.33000		6/26/2015		-635,073.33	-78,555,397	1.000000000 ^S 0.008264121	-635,073.33	-76,847,051	0	1,708,346	1,708,346
-120,339.75000		6/29/2015		-120,339.75	-14,916,713	1.000000000 ^S 0.008264121	-120,339.75	-14,561,712	0	355,001	355,001
-1,903,307.30000		6/30/2015		-1,903,307.30	-233,469,181	1.000000000 ^S 0.008264121	-1,903,307.30	-230,309,709	0	3,159,472	3,159,472
-401,578.79000		7/1/2015		-401,578.79	-49,139,192	1.000000000 ^S 0.008264121	-401,578.79	-48,593,043	0	546,149	546,149
-166,650.71000		7/2/2015		-166,650.71	-20,488,872	1.000000000 ^S 0.008264121	-166,650.71	-20,165,570	0	323,302	323,302
-30,114.32000		7/8/2015		-30,114.32	-3,680,121	1.000000000 ^S 0.008264121	-30,114.32	-3,643,983	0	36,138	36,138
-31,968.05000		7/9/2015		-31,968.05	-3,869,892	1.000000000 ^S 0.008264121	-31,968.05	-3,868,294	0	1,598	1,598
-9,654,002.11000		7/10/2015		-9,654,002.11	-1,171,271,854	1.000000000 ^S 0.008264121	-9,654,002.11	-1,168,182,570	0	3,089,284	3,089,284
-985,811.93000		7/10/2015		-985,811.93	-119,603,637	1.000000000 ^S 0.008264121	-985,811.93	-119,288,177	0	315,460	315,460
-318,153.83000		7/10/2015		-318,153.83	-38,600,015	1.000000000 ^S 0.008264121	-318,153.83	-38,498,206	0	101,809	101,809

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-572,533.39000		7/13/2015		-572,533.39	-70,241,256	1.000000000 ^S 0.008264121	-572,533.39	-69,279,406	0	961,850	961,850
-36,781.13000		7/14/2015		-36,781.13	-4,540,815	1.000000000 ^S 0.008264121	-36,781.13	-4,450,701	0	90,114	90,114
-1,939,746.57000		7/15/2015		-1,939,746.57	-239,413,229	1.000000000 ^S 0.008264121	-1,939,746.57	-234,719,043	0	4,694,186	4,694,186
-173,841.63000		7/16/2015		-173,841.63	-21,545,062	1.000000000 ^S 0.008264121	-173,841.63	-21,035,707	0	509,355	509,355
-165,104.66000		7/17/2015		-165,104.66	-20,480,406	1.000000000 ^S 0.008264121	-165,104.66	-19,978,490	0	501,916	501,916
-342,841.23000		7/21/2015		-342,841.23	-42,599,736	1.000000000 ^S 0.008264121	-342,841.23	-41,485,505	0	1,114,231	1,114,231
-159,090.92000		7/21/2015		-159,090.92	-19,767,842	1.000000000 ^S 0.008264121	-159,090.92	-19,250,798	0	517,044	517,044
-28,907.36000		7/21/2015		-28,907.36	-3,591,884	1.000000000 ^S 0.008264121	-28,907.36	-3,497,935	0	93,949	93,949
-728,480.71000		7/22/2015		-728,480.71	-90,207,772	1.000000000 ^S 0.008264121	-728,480.71	-88,149,812	0	2,057,960	2,057,960
-446,253.94000		7/23/2015		-446,253.94	-55,355,567	1.000000000 ^S 0.008264121	-446,253.94	-53,998,960	0	1,356,607	1,356,607
-572,674.94000		7/24/2015		-572,674.94	-71,031,741	1.000000000 ^S 0.008264121	-572,674.94	-69,296,534	0	1,735,207	1,735,207
-220,112.07000		7/27/2015		-220,112.07	-27,228,962	1.000000000 ^S 0.008264121	-220,112.07	-26,634,662	0	594,300	594,300
-290,086.98000		7/28/2015		-290,086.98	-35,715,510	1.000000000 ^S 0.008264121	-290,086.98	-35,101,976	0	613,534	613,534
-459,011.54000		7/29/2015		-459,011.54	-56,736,119	1.000000000 ^S 0.008264121	-459,011.54	-55,542,694	0	1,193,425	1,193,425

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-268,254.83000		7/30/2015		-268,254.83	-33,215,312	1.000000000 ^S 0.008264121	-268,254.83	-32,460,177	0	755,135	755,135
-295,358.72000		7/31/2015		-295,358.72	-36,723,425	1.000000000 ^S 0.008264121	-295,358.72	-35,739,883	0	983,542	983,542
-402,300.43000		8/3/2015		-402,300.43	-49,843,010	1.000000000 ^S 0.008264121	-402,300.43	-48,680,365	0	1,162,645	1,162,645
-392,138.08000		8/4/2015		-392,138.08	-48,607,475	1.000000000 ^S 0.008264121	-392,138.08	-47,450,670	0	1,156,805	1,156,805
-244,578.11000		8/5/2015		-244,578.11	-30,310,566	1.000000000 ^S 0.008264121	-244,578.11	-29,595,175	0	715,391	715,391
-80,525.12000		8/7/2015		-80,525.12	-10,042,690	1.000000000 ^S 0.008264121	-80,525.12	-9,743,943	0	298,747	298,747
-487,802.58000		8/10/2015		-487,802.58	-60,636,297	1.000000000 ^S 0.008264121	-487,802.58	-59,026,553	0	1,609,744	1,609,744
-6,516,965.23000		8/11/2015		-6,516,965.23	-811,525,091	1.000000000 ^S 0.008264121	-6,516,965.23	-788,585,408	0	22,939,683	22,939,683
-2,360,076.89000		8/11/2015		-2,360,076.89	-293,888,573	1.000000000 ^S 0.008264121	-2,360,076.89	-285,581,115	0	8,307,458	8,307,458
-1,605,000.00000		8/11/2015		-1,605,000.00	-199,862,624	1.000000000 ^S 0.008264121	-1,605,000.00	-194,213,032	0	5,649,592	5,649,592
-1,489,715.52000		8/11/2015		-1,489,715.52	-185,506,824	1.000000000 ^S 0.008264121	-1,489,715.52	-180,263,033	0	5,243,791	5,243,791
-1,332,000.00000		8/11/2015		-1,332,000.00	-165,867,299	1.000000000 ^S 0.008264121	-1,332,000.00	-161,178,666	0	4,688,633	4,688,633
-950,294.36000		8/11/2015		-950,294.36	-118,335,405	1.000000000 ^S 0.008264121	-950,294.36	-114,990,373	0	3,345,032	3,345,032
-941,000.00000		8/11/2015		-941,000.00	-117,178,024	1.000000000 ^S 0.008264121	-941,000.00	-113,865,709	0	3,312,315	3,312,315

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-900,000.00000		8/11/2015		-900,000.00	-112,072,499	1.000000000 ^S 0.008264121	-900,000.00	-108,904,504	0	3,167,995	3,167,995
-851,000.00000		8/11/2015		-851,000.00	-105,970,774	1.000000000 ^S 0.008264121	-851,000.00	-102,975,259	0	2,995,515	2,995,515
-809,200.00000		8/11/2015		-809,200.00	-100,765,630	1.000000000 ^S 0.008264121	-809,200.00	-97,917,250	0	2,848,380	2,848,380
-677,370.00000		8/11/2015		-677,370.00	-84,349,499	1.000000000 ^S 0.008264121	-677,370.00	-81,965,160	0	2,384,339	2,384,339
-510,000.00000		8/11/2015		-510,000.00	-63,507,750	1.000000000 ^S 0.008264121	-510,000.00	-61,712,552	0	1,795,198	1,795,198
-494,100.00000		8/11/2015		-494,100.00	-61,527,802	1.000000000 ^S 0.008264121	-494,100.00	-59,788,573	0	1,739,229	1,739,229
-490,500.00000		8/11/2015		-490,500.00	-61,079,512	1.000000000 ^S 0.008264121	-490,500.00	-59,352,955	0	1,726,557	1,726,557
-277,908.34000		8/11/2015		-277,908.34	-34,606,536	1.000000000 ^S 0.008264121	-277,908.34	-33,628,300	0	978,236	978,236
-269,380.00000		8/11/2015		-269,380.00	-33,544,544	1.000000000 ^S 0.008264121	-269,380.00	-32,596,328	0	948,216	948,216
-244,765.53000		8/11/2015		-244,765.53	-30,479,427	1.000000000 ^S 0.008264121	-244,765.53	-29,617,854	0	861,573	861,573
-229,044.87000		8/11/2015		-229,044.87	-28,521,812	1.000000000 ^S 0.008264121	-229,044.87	-27,715,576	0	806,236	806,236
-143,800.00000		8/11/2015		-143,800.00	-17,906,695	1.000000000 ^S 0.008264121	-143,800.00	-17,400,520	0	506,175	506,175
-49,506.68000		8/11/2015		-49,506.68	-6,164,819	1.000000000 ^S 0.008264121	-49,506.68	-5,990,556	0	174,263	174,263
-30,548.38000		8/11/2015		-30,548.38	-3,804,037	1.000000000 ^S 0.008264121	-30,548.38	-3,696,507	0	107,530	107,530

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-24,000.00000		8/11/2015		-24,000.00	-2,988,600	1.000000000 ^S 0.008264121	-24,000.00	-2,904,120	0	84,480	84,480
-8,000.00000		8/11/2015		-8,000.00	-996,200	1.000000000 ^S 0.008264121	-8,000.00	-968,040	0	28,160	28,160
-8,000.00000		8/11/2015		-8,000.00	-996,200	1.000000000 ^S 0.008264121	-8,000.00	-968,040	0	28,160	28,160
-8,000.00000		8/11/2015		-8,000.00	-996,200	1.000000000 ^S 0.008264121	-8,000.00	-968,040	0	28,160	28,160
-4,380.30000		8/11/2015		-4,380.30	-545,457	1.000000000 ^S 0.008264121	-4,380.30	-530,038	0	15,419	15,419
-251,033.80000		8/12/2015		-251,033.80	-31,340,316	1.000000000 ^S 0.008264121	-251,033.80	-30,376,346	0	963,970	963,970
-543,939.54000		8/13/2015		-543,939.54	-67,380,510	1.000000000 ^S 0.008264121	-543,939.54	-65,819,407	0	1,561,103	1,561,103
-568,818.11000		8/14/2015		-568,818.11	-70,786,573	1.000000000 ^S 0.008264121	-568,818.11	-68,829,838	0	1,956,735	1,956,735
-491,832.86000		8/17/2015		-491,832.86	-61,132,365	1.000000000 ^S 0.008264121	-491,832.86	-59,514,238	0	1,618,127	1,618,127
-456,555.82000		8/18/2015		-456,555.82	-56,784,130	1.000000000 ^S 0.008264121	-456,555.82	-55,245,539	0	1,538,591	1,538,591
-989,847.23000		8/19/2015		-989,847.23	-123,151,844	1.000000000 ^S 0.008264121	-989,847.23	-119,776,469	0	3,375,375	3,375,375
-747,350.70000		8/20/2015		-747,350.70	-92,873,277	1.000000000 ^S 0.008264121	-747,350.70	-90,433,175	0	2,440,102	2,440,102
-86,371.65000		8/21/2015		-86,371.65	-10,677,695	1.000000000 ^S 0.008264121	-86,371.65	-10,451,402	0	226,293	226,293
-200,244.20000		8/24/2015		-200,244.20	-24,913,382	1.000000000 ^S 0.008264121	-200,244.20	-24,230,550	0	682,832	682,832

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-779,051.13000		8/25/2015		-779,051.13	-92,504,529	1.000000000 ^S 0.008264121	-779,051.13	-94,269,086	0	-1,764,557	-1,764,557
-626,546.44000		8/26/2015		-626,546.44	-75,126,049	1.000000000 ^S 0.008264121	-626,546.44	-75,815,255	0	-689,206	-689,206
-325,441.50000		8/27/2015		-325,441.50	-38,784,489	1.000000000 ^S 0.008264121	-325,441.50	-39,380,050	0	-595,561	-595,561
-56,649.85000		8/28/2015		-56,649.85	-6,837,354	1.000000000 ^S 0.008264121	-56,649.85	-6,854,915	0	-17,561	-17,561
9,822,493.19000	合計 -----			9,822,493	1,404,222,871		9,822,493	1,188,570,834	0	-215,652,037	-215,652,037
0.00000											
10,846,053.00000	非グループ化の有価証券小計			10,846,053	1,541,754,916		10,846,053	1,288,037,486	0	-253,717,430	-253,717,430
10,846,053.00000	外貨建現金勘定合計			10,846,053	1,541,754,916		10,846,053	1,288,037,486	0	-253,717,430	-253,717,430
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
479,833.36000	AUD FORWARD 14 OCT FAU14OCT	7/29/2015		479,833.36	43,308,005	1.000000000 ^F 86.259901774	479,833.36	41,390,379	0	-1,917,626	-1,917,626
2,100,000.00000	EUR FORWARD 14 OCT FEU14OCT	8/11/2015		2,100,000.00	288,918,844	1.000000000 ^F 135.786396050	2,100,000.00	285,151,432	0	-3,767,412	-3,767,412
2,300,000.00000		8/14/2015		2,300,000.00	318,569,092	1.000000000 ^F 135.786396050	2,300,000.00	312,308,711	0	-6,260,381	-6,260,381
2,900,000.00000		8/25/2015		2,900,000.00	396,788,226	1.000000000 ^F 135.786396050	2,900,000.00	393,780,549	0	-3,007,677	-3,007,677
-75,027,766.20000		7/29/2015		-75,027,766.20	-10,267,307,055	1.000000000 ^F 135.786396050	-75,027,766.20	-10,187,749,976	0	79,557,079	79,557,079
-48,911,590.28000		7/29/2015		-48,911,590.28	-6,693,664,932	1.000000000 ^F 135.786396050	-48,911,590.28	-6,641,528,569	0	52,136,363	52,136,363
-27,902,665.12000	FEU14OCT	7/29/2015		-27,902,665.12	-3,818,458,419	1.000000000 ^F 135.786396050	-27,902,665.12	-3,788,802,337	0	29,656,082	29,656,082

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・グループ別 2015年 8 月28日現在

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)	未実現損益 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）											
非グループ化の有価証券											
-15,746,819.02000		7/29/2015		-15,746,819.02	-2,154,930,429	1.000000000F 135.786396050	-15,746,819.02	-2,138,203,804	0	16,726,625	16,726,625
-9,937,470.89000		7/29/2015		-9,937,470.89	-1,359,934,076	1.000000000F 135.786396050	-9,937,470.89	-1,349,373,358	0	10,560,718	10,560,718
-3,410,000.00000		7/29/2015		-3,410,000.00	-466,670,649	1.000000000F 135.786396050	-3,410,000.00	-463,031,611	0	3,639,038	3,639,038
-3,313,884.14000		7/29/2015		-3,313,884.14	-455,655,352	1.000000000F 135.786396050	-3,313,884.14	-449,980,384	0	5,674,968	5,674,968
-176,950,195.65000 0.00000	合計 -----			-176,950,196	-24,212,344,750		-176,950,196	-24,027,429,347	0	184,915,403	184,915,403
2,351,200.80	GBP FORWARD 14 OCT FGB14OCT	7/29/2015		2,351,200.80	455,655,352	1.000000000F 185.599553373	2,351,200.80	436,381,818	0	-19,273,534	-19,273,534
11,300,000.00		8/6/2015		11,300,000.00	2,204,400,608	1.000000000F 185.599553373	11,300,000.00	2,097,274,953	0	-107,125,655	-107,125,655
3,600,000.00		8/10/2015		3,600,000.00	692,324,055	1.000000000F 185.599553373	3,600,000.00	668,158,392	0	-24,165,663	-24,165,663
1,000,000.00		8/25/2015		1,000,000.00	188,190,805	1.000000000F 185.599553373	1,000,000.00	185,599,553	0	-2,591,252	-2,591,252
-62,818,620.50		7/29/2015		-62,818,620.50	-12,115,250,948	1.000000000F 185.599553373	-62,818,620.50	-11,659,107,908	0	456,143,040	456,143,040
-55,144,921.93		7/29/2015		-55,144,921.93	-10,635,636,023	1.000000000F 185.599553373	-55,144,921.93	-10,234,872,881	0	400,763,142	400,763,142
-25,854,508.75		7/29/2015		-25,854,508.75	-4,986,452,955	1.000000000F 185.599553373	-25,854,508.75	-4,798,585,277	0	187,867,678	187,867,678
-125,566,850.38000 0.00000	合計 -----			-125,566,850	-24,196,769,106		-125,566,850	-23,305,151,350	0	891,617,756	891,617,756
-2,485,641.28000	USD FORWARD 01 SEP FUS01SEP	8/27/2015		-2,485,641.28	-300,000,001	1.000000000F 0.008264361	-2,485,641.28	-300,766,300	0	-766,299	-766,299

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・グループ別 2015年 8月28日現在

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)	未実現損益 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）											
非グループ化の有価証券											
3,775,500.85000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	7/29/2015		3,775,500.85	466,670,645	1.000000000F 0.008270226	3,775,500.85	456,517,252	0	-10,153,393	-10,153,393
9,190,875.58000		7/29/2015		9,190,875.58	1,135,063,951	1.000000000F 0.008270226	9,190,875.58	1,111,320,970	0	-23,742,981	-23,742,981
11,002,260.96000		7/29/2015		11,002,260.96	1,359,934,064	1.000000000F 0.008270226	11,002,260.96	1,330,345,865	0	-29,588,199	-29,588,199
17,434,011.94000		7/29/2015		17,434,011.94	2,154,930,409	1.000000000F 0.008270226	17,434,011.94	2,108,045,408	0	-46,885,001	-46,885,001
30,892,435.69000		7/29/2015		30,892,435.69	3,818,458,385	1.000000000F 0.008270226	30,892,435.69	3,735,379,866	0	-83,078,519	-83,078,519
40,341,850.04000		7/29/2015		40,341,850.04	4,986,452,901	1.000000000F 0.008270226	40,341,850.04	4,877,962,227	0	-108,490,674	-108,490,674
54,153,689.97000		7/29/2015		54,153,689.97	6,693,664,871	1.000000000F 0.008270226	54,153,689.97	6,548,030,244	0	-145,634,627	-145,634,627
83,065,490.79000		7/29/2015		83,065,490.79	10,267,306,956	1.000000000F 0.008270226	83,065,490.79	10,043,920,298	0	-223,386,658	-223,386,658
86,045,378.93000		7/29/2015		86,045,378.93	10,635,635,920	1.000000000F 0.008270226	86,045,378.93	10,404,235,499	0	-231,400,421	-231,400,421
98,015,893.57000		7/29/2015		98,015,893.57	12,115,250,945	1.000000000F 0.008270226	98,015,893.57	11,851,658,415	0	-263,592,530	-263,592,530
-8,559,261.15000		7/29/2015		-8,559,261.15	-1,057,034,522	1.000000000F 0.008270226	-8,559,261.15	-1,034,948,882	0	22,085,640	22,085,640
-349,136.35000		7/29/2015		-349,136.35	-43,308,005	1.000000000F 0.008270226	-349,136.35	-42,216,059	0	1,091,946	1,091,946
-17,622,542.10000		8/6/2015		-17,622,542.10	-2,204,400,605	1.000000000F 0.008270226	-17,622,542.10	-2,130,841,660	0	73,558,945	73,558,945
-5,567,666.40000		8/10/2015		-5,567,666.40	-692,324,049	1.000000000F 0.008270226	-5,567,666.40	-673,218,168	0	19,105,881	19,105,881

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・グループ別 2015年8月28日現在

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)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-2,405,600.24000		8/11/2015		-2,405,600.24	-300,000,002	1.000000000F 0.008270226	-2,405,600.24	-290,874,789	0	9,125,213	9,125,213
-1,802,120.68000		8/12/2015		-1,802,120.68	-223,000,002	1.000000000F 0.008270226	-1,802,120.68	-217,904,647	0	5,095,355	5,095,355
-3,311,710.10000		8/25/2015		-3,311,710.10	-396,788,229	1.000000000F 0.008270226	-3,311,710.10	-400,437,678	0	-3,649,449	-3,649,449
-1,569,165.00000		8/25/2015		-1,569,165.00	-188,190,804	1.000000000F 0.008270226	-1,569,165.00	-189,736,653	0	-1,545,849	-1,545,849
392,730,186.30000 0.00000	合計 -----			392,730,186	48,528,322,829		392,730,186	47,487,237,508	0	-1,041,085,321	-1,041,085,321
88,207,332.35000	非グループ化の有価証券小計			88,207,332	-137,483,023		88,207,332	-104,719,110	0	32,763,913	32,763,913
88,207,332.35000	先物（ポジション）合計			88,207,332	-137,483,023		88,207,332	-104,719,110	0	32,763,913	32,763,913
1,151,852,106.35000	クラスに割当てられていない資産合計			1,174,214,219	84,680,643,199		1,183,022,565	98,827,640,133	1,336,514,920	12,810,482,015	14,146,996,935
2,294,804,534.78000	ポートフォリオ合計			2,317,166,647	44,973,401,840		2,325,974,994	59,216,555,725	1,336,514,920	12,906,638,966	14,243,153,886

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27年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約45億円）

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27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	77	7,409,096,494.74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27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＝119.96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

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2015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	519,439,178.00	62,311,924
1.2	売買目的で保有される金融資産	34,858,941.00	4,181,679
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	34,858,941.00	4,181,679
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	11,186,554.00	1,341,939
1.4.1	持分証券	11,186,554.00	1,341,939
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）	2,906,711,056.00	348,689,058
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	2,906,711,056.00	348,689,058
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	1,535,715.00	184,224
1.9.1	有形固定資産	1,535,715.00	184,224
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	4,450,467.00	533,878
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	4,450,467.00	533,878
1.12	税金資産	125,205.00	15,020
1.12.1	現行税金資産	125,205.00	15,020
1.12.2	繰延税金資産	0.00	0
1.13	その他の資産	26,301,732.00	3,155,156
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	3,504,608,848.00	420,412,877

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2015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	33,793,836.00	4,053,909
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	33,793,836.00	4,053,909
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	3,302,165,834.00	396,127,813
2.4.1	金融機関からの預金	1,529,647,118.00	183,496,468
2.4.2	金融機関以外からの預金	1,772,518,716.00	212,631,345
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	2,512,372.00	301,384
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務	2,512,372.00	301,384
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	8,791,098.00	1,054,580
2.9.1	現行税金負債	8,791,098.00	1,054,580
2.9.2	繰延税金負債	0.00	0
2.10	その他の負債	13,032,619.00	1,563,393
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	3,360,295,759.00	403,101,079

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2015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	4,452,672
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	4,452,672
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：	2,710,210.00	325,117
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	2,710,210.00	325,117
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）	97,351,501.00	11,678,286
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	7,133,409.00	855,724
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	144,313,089.00	17,311,798
3.11	負債および資本合計	3,504,608,848.00	420,412,877

(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

2015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（＋／－）	34,029,531.00	4,082,183
5.2	利息収益	4,552,560.00	546,125
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	5,689.00	682
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）	1,872,091.00	224,576
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。）	2,674,780.00	320,867
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）（－）	1,039,554.00	124,705
5.3.1	中央銀行からの預金	124,672.00	14,956
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）	5,262.00	631
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	909,620.00	109,118
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（＋）	433,483.00	52,001
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	433,483.00	52,001
5.6	受取手数料（＋）	50,295,855.00	6,033,491
5.7	（支払手数料）（－）	22,178,453.00	2,660,527
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（＋／－）	0.00	0
5.8.1	売却可能金融資産	0.00	0
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（＋／－）	2,156,603.00	258,706
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	2,156,603.00	258,706
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（＋）	209,735.00	25,160

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	400,698.00	48,068
5.16	一般管理費（－）	19,470,102.00	2,335,633
5.16.1	従業員費用（－）	8,271,884.00	992,295
5.16.2	一般管理費用（－）	11,198,218.00	1,343,338
5.17	減価償却（＋／－）	990,405.00	118,809
5.17.1	有形固定資産	180,115.00	21,607
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	810,290.00	97,202
5.18	引当金（＋／－）	2,512,372.00	301,384
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（＋／－）	0.00	0
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	11,056,652.00	1,326,356
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	3,923,243.00	470,632
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	7,133,409.00	855,724
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（＋／－）	7,133,409.00	855,724

[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。

第一部 証券情報

<訂正前>

(前略)

(2) 外国投資信託受益証券の形態
等

米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券および豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券（以下、個別にまたは総称して「ファンド証券」または「受益証券」という。）の2種類のクラスの受益証券について、本書により募集が行われる。ファンド証券は、記名式無額面受益証券である。三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ（Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.）（以下「管理会社」という。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はない。ファンドは、追加型である。

(中略)

(12) その他

(中略)

(ロ) 引受等の概要

(中略)

管理会社は、三菱UFJモルガン・スタンレー証券をファンド証券に関して日本における代行協会に指定している。

(注) 代行協会とは、外国投資信託受益証券の発行者と契約を締結し、ファンド証券に関する目論見書を日本証券業協会に提出し、ファンド証券1口当たりの純資産価格の公表を行い、また決算報告書その他の書類を日本証券業協会に提出する等の業務を行う協会をいう。

(後略)

<訂正後>

(2) 外国投資信託受益証券の形態
等

(前略)

米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券および豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券（以下、個別にまたは総称して「ファンド証券」または「受益証券」という。）の2種類のクラスの受益証券について、本書により募集が行われる。

ファンド証券は、記名式無額面受益証券である。

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

(Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.) (以下「管理会社」という。) の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はない。

(注) ルクセンブルグ当局の認可を前提として、平成28年5月1日付で、三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ (Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.) はその名称をルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.) に変更する。以下同じ。

ファンドは、追加型である。

(中略)

(1 2) その他

(中略)

(口) 引受等の概要

(中略)

管理会社は、三菱UFJモルガン・スタンレー証券をファンド証券に関して日本における代行協会に指定している。

(注) 代行協会とは、外国投資信託受益証券の発行者と契約を締結し、ファンド証券1口当たりの純資産価格の公表を行い、またファンド証券に関する目論見書、決算報告書その他の書類を販売会社に交付する等の業務を行う協会をいう。

(後略)

第二部 ファンド情報

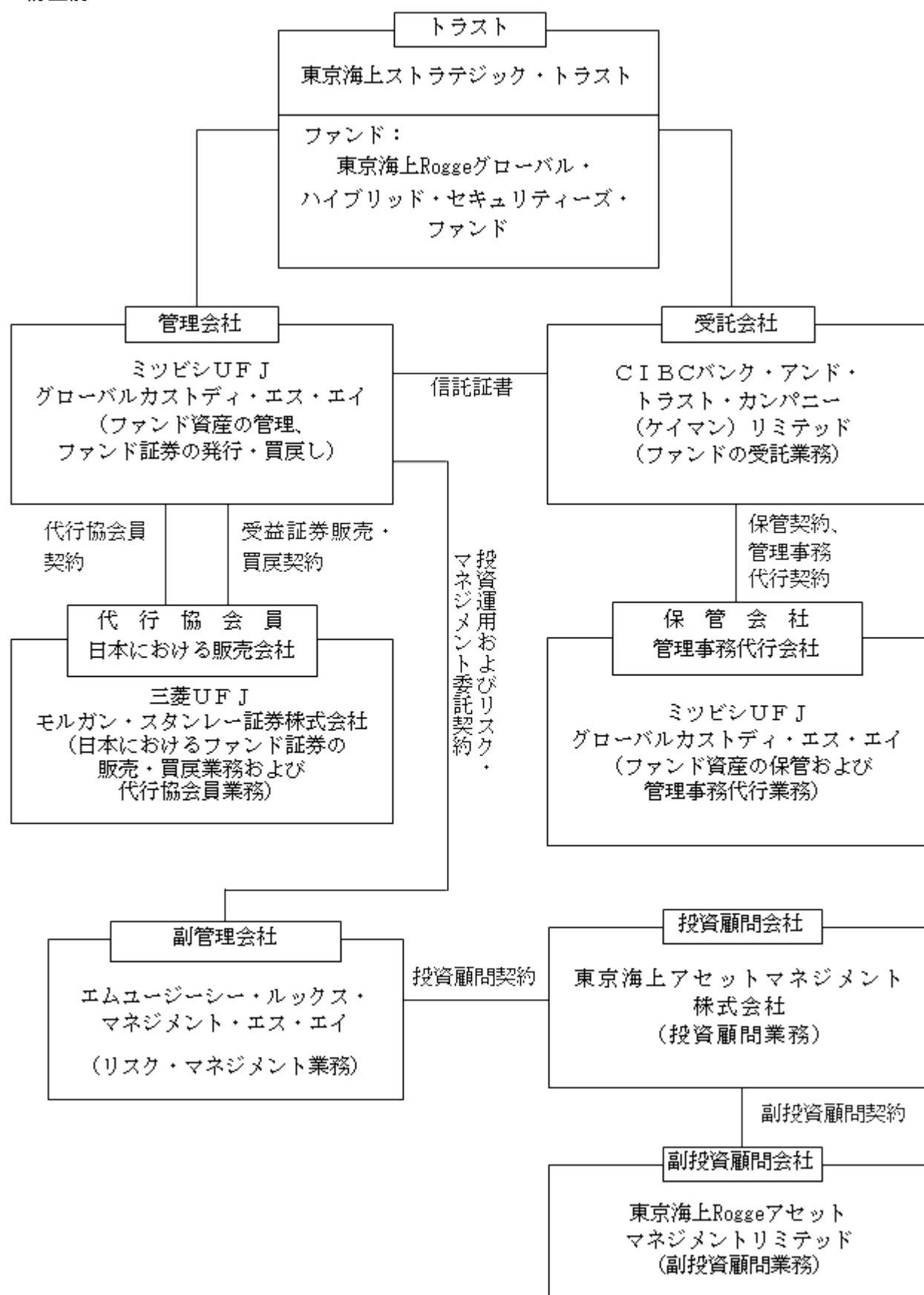
第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

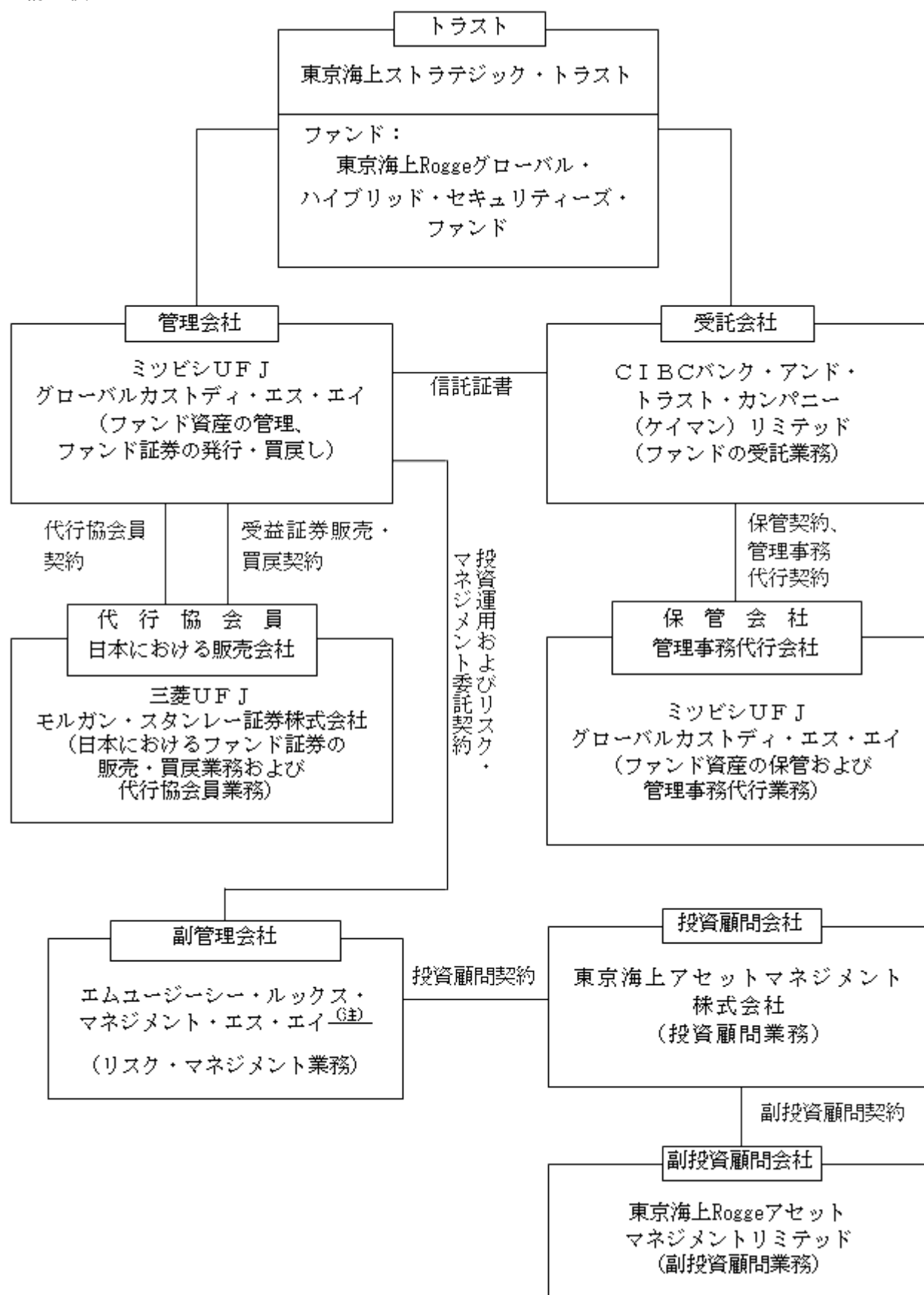
(3) ファンドの仕組み

ファンドの仕組み

<訂正前>



<訂正後>



(注) ルクセンブルグ当局の認可を前提として、平成28年5月1日付で、エムユージーシー・ルックス・マネジメント・エス・エイ (MUGC Lux Management S.A.) はその名称をMUFGルクスマネジメントカンパニーS.A. (MUFG Lux Management Company S.A.) に変更する。以下同じ。

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

< 訂正前 >

（前略）

（注５）代行協会員契約とは、管理会社によって任命された代行協会員が、ファンドに対し、ファンド証券に関する目論見書の日本証券業協会に対する提出、受益証券１口当たり純資産価格の公表および決算報告書その他の書類の日本証券業協会に対する提出等、代行協会員業務を提供することを約する契約である。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（注５）代行協会員契約とは、管理会社によって任命された代行協会員が、ファンドに対し、ファンド証券１口当たり純資産価格の公表およびファンド証券に関する目論見書、決算報告書その他の書類を販売会社に交付する等、代行協会員業務を提供することを約する契約である。

（後略）

管理会社の概況

< 訂正前 >

（前略）

（ ）資本金の額（平成27年 6 月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約45億円）

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27年 9 月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約45億円）

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27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相場
の仲値（１米ドル＝119.96円）による。

（後略）

4 手数料等及び税金

（３）管理報酬等

< 訂正前 >

（前略）

（ ）代行協会員報酬

代行協会員は、米ドル建 米ドルヘッジクラスおよび豪ドル建 豪ドルヘッジクラスに係るファンドの保管資産から、純資産総額の年率0.05%の報酬を受領する権利を有する。代行協会員報酬は、日々発生し、直前の評価日現在の純資産総額に基づき計算され、四半期毎に後払いで支払われる。また、代行協会員は、自己が提供した業務に関連して合理的に負担した立替費用について払戻しを受けることができる。

代行協会員報酬は、ファンド証券に関する目論見書を日本証券業協会に提出し、ファンド証券 1 口当たりの純資産価格の公表を行い、また決算報告書その他の書類を日本証券業協会に提出する等の業務の対価として代行協会員に支払われる。

平成27年 2 月28日に終了した会計年度中の代行協会員報酬は19,645,435円であった。

< 訂正後 >

() 代行協会員報酬

代行協会員は、米ドル建 米ドルヘッジクラスおよび豪ドル建 豪ドルヘッジクラスに係るファンドの保管資産から、純資産総額の年率0.05%の報酬を受領する権利を有する。代行協会員報酬は、日々発生し、直前の評価日現在の純資産総額に基づき計算され、四半期毎に後払いで支払われる。また、代行協会員は、自己が提供した業務に関連して合理的に負担した立替費用について払戻しを受けることができる。

代行協会員報酬は、ファンド証券 1 口当たりの純資産価格の公表を行い、またファンド証券に関する目論見書、決算報告書その他の書類を販売会社に交付する等の業務の対価として代行協会員に支払われる。

平成27年 2 月28日に終了した会計年度中の代行協会員報酬は19,645,435円であった。

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

(A) 日本

平成27年 8 月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(A) 日本

平成27年 11 月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

５ 運用状況

（２）投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄

（平成27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 BANK PLC	英国	社債	7.625	2025/4/22	15,900,000.00	173.81	2,763,629,133.00	243.50	3,871,720,771.00	3.49
2	NIPPON LIFE INSURANCE	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	27,700,000.00	91.59	2,537,084,223.00	126.83	3,513,194,014.00	3.16
3	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	英国	社債	6.125	2022/12/15	26,430,000.00	90.64	2,395,487,274.00	131.61	3,478,346,974.00	3.13
4	SOMPO JAPAN INSURANCE	日本	社債	5.325 (2023年3月以降変動金利)	2073/3/28	26,600,000.00	97.47	2,592,583,795.00	128.87	3,427,842,632.00	3.09
5	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.000 (2022年3月以降変動金利)	2072/3/15	23,390,000.00	92.82	2,171,022,567.00	143.04	3,345,758,212.00	3.01
6	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	28,000,000.00	121.42	3,399,706,976.00	118.15	3,308,323,900.00	2.98
7	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	25,450,000.00	93.99	2,391,965,427.00	126.89	3,229,227,598.00	2.91
8	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	22,600,000.00	111.72	2,524,768,899.00	133.16	3,009,359,014.00	2.71
9	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	23,000,000.00	100.22	2,304,989,890.00	125.98	2,897,644,978.00	2.61
10	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年3月以降変動金利)	永久債	14,000,000.00	181.91	2,546,711,730.00	196.96	2,757,387,359.00	2.48
11	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.250	2024/10/15	21,800,000.00	107.66	2,346,891,715.00	121.50	2,648,644,185.00	2.39
12	RSA INSURANCE GROUP PLC	英国	社債	5.125 (2025年10月以降変動金利)	2045/10/10	12,750,000.00	173.81	2,216,072,296.00	190.84	2,433,239,427.00	2.19
13	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	18,310,000.00	115.34	2,111,856,782.00	128.80	2,358,376,194.00	2.12
14	ABN AMRO BANK NV	オランダ	社債	2.875	2025/6/30	16,100,000.00	139.50	2,245,873,831.00	137.34	2,211,215,173.00	1.99
15	COMMONWEALTH BANK AUST	オーストラリア	社債	2.000 (2022年4月以降変動金利)	2027/4/22	17,000,000.00	132.30	2,249,141,569.00	129.76	2,205,932,647.00	1.99
16	DNB BANK ASA	ノルウェー	社債	5.750 (2020年3月以降変動金利)	永久債	18,300,000.00	120.79	2,210,530,857.00	119.70	2,190,463,327.00	1.97
17	LB BADEN-WUERTTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	16,500,000.00	139.33	2,299,021,395.00	132.59	2,187,686,316.00	1.97
18	SWEDBANK AB	スウェーデン	社債	5.500 (2020年3月以降変動金利)	永久債	18,000,000.00	120.12	2,162,079,371.00	120.53	2,169,575,605.00	1.95
19	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	18,150,000.00	110.91	2,012,951,380.00	118.77	2,155,629,634.00	1.94
20	DNB BANK ASA	ノルウェー	社債	6.0116 (2017年3月以降変動金利)	永久債	10,700,000.00	147.29	1,576,055,609.00	199.52	2,134,880,171.00	1.92

	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	
21	AMERICAN EXPRESS CO	米国	社債	6.800 (2016年9月以降変動金利)	2066/9/1	16,820,000.00	83.18	1,399,095,402.00	125.85	2,116,734,651.00	1.91
22	HSBC HOLDINGS PLC	英国	社債	5.250 (2022年9月以降変動金利)	永久債	15,350,000.00	135.37	2,077,922,155.00	136.58	2,096,572,264.00	1.89
23	RABOBANK NEDERLAND	オランダ	社債	5.500 (2020年6月以降変動金利)	永久債	15,100,000.00	137.11	2,070,369,884.00	137.70	2,079,307,637.00	1.87
24	NN GROUP NV	オランダ	社債	4.500 (2026年1月以降変動金利)	永久債	14,300,000.00	143.45	2,051,282,311.00	135.78	1,941,675,153.00	1.75
25	PRUDENTIAL PLC	英国	社債	5.000 (2035年7月以降変動金利)	2055/7/20	10,000,000.00	188.14	1,881,391,931.00	186.28	1,862,756,231.00	1.68
26	NORDEA BANK AB	スウェーデン	社債	5.250 (2021年9月以降変動金利)	永久債	15,800,000.00	120.09	1,897,394,764.00	117.06	1,849,497,697.00	1.67
27	CAIXABANK	スペイン	社債	5.000 (2018年11月以降変動金利)	2023/11/14	12,200,000.00	144.98	1,768,735,194.00	145.25	1,772,086,047.00	1.60
28	MORGAN STANLEY	米国	社債	4.875	2022/11/1	13,150,000.00	87.38	1,149,095,926.00	129.88	1,707,930,729.00	1.54
29	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	5.136 (2016年2月以降変動金利)	永久債	8,750,000.00	154.68	1,353,455,394.00	193.94	1,696,980,675.00	1.53
30	SOCIETE GENERALE	フランス	社債	9.375 (2019年9月以降変動金利)	永久債	9,700,000.00	141.61	1,373,574,896.00	168.21	1,631,594,719.00	1.47

投資不動産物件

該当事項なし。（平成27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27年6月末日現在）

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

（平成27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	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	英国	社債	6.1250	2022/12/15	26,430,000	90.64	2,395,487,274	129.92	3,433,718,806	3.67
2	mitsui sumitomo insurance co ltd	日本	社債	7.0000 (2022年3月 以降変動金 利)	2072/ 3 /15	23,390,000	92.82	2,171,022,567	137.77	3,222,479,334	3.44
3	CREDIT AGRICOLE SA	フラン ス	社債	4.3750	2025/ 3 /17	28,000,000	121.42	3,399,706,976	115.01	3,220,212,020	3.44
4	NIPPON LIFE insurance co	日本	社債	5.0000 (2022年10月 以降変動金 利)	2042/10/18	25,700,000	91.59	2,353,901,247	124.39	3,196,708,192	3.42
5	ING BANK NV	オラン ダ	社債	5.8000	2023/ 9 /25	22,600,000	111.72	2,524,768,899	130.23	2,943,199,386	3.15
6	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.0000	2023/11/ 7	23,000,000	100.22	2,304,989,890	126.07	2,899,602,320	3.10
7	LLOYDS BANK PLC	英国	社債	7.6250	2025/ 4 /22	12,350,000	173.81	2,146,592,440	230.29	2,844,066,581	3.04
8	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.6250 (2023年6月 以降変動金 利)	2043/ 6 /15	21,050,000	93.99	1,978,423,271	124.07	2,611,659,886	2.79
9	BNP PARIBAS SA	フラン ス	社債	4.2500	2024/10/15	21,800,000	107.66	2,346,891,715	119.00	2,594,297,813	2.77
10	SOMPO JAPAN insurance inc	日本	社債	5.3250 (2023年3月 以降変動金 利)	2073/ 3 /28	20,400,000	97.47	1,988,297,347	125.83	2,566,929,963	2.74
11	AXA SA	フラン ス	社債	5.4530 (2026年3月 以降変動金 利)	2049/11/ 4	14,000,000	181.91	2,546,711,730	182.00	2,548,025,349	2.72
12	DAI-ICHI LIFE insurance co ltd/THE	日本	社債	5.1000 (2024年10月 以降変動金 利)	2049/10/29	18,310,000	115.34	2,111,856,782	124.00	2,270,525,675	2.43
13	LBBW	ドイツ	社債	3.6250	2025/ 6 /16	16,500,000	139.33	2,299,021,395	132.32	2,183,214,731	2.33
14	ABN AMRO BANK NV	オラン ダ	社債	2.8750	2025/ 6 /30	16,100,000	139.50	2,245,873,831	134.93	2,172,453,267	2.32
15	BPCE SA	フラン ス	社債	4.5000	2025/ 3 /15	18,150,000	110.91	2,012,951,380	115.89	2,103,392,642	2.25
16	AMERICAN EXPRESS CO	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	121.14	2,037,593,292	2.18
17	DNB BANK ASA	ノル ウェー	社債	6.0116 (2017年3月 以降変動金 利)	2049/ 3 /29	10,700,000	147.29	1,576,055,609	186.85	1,999,267,063	2.14
18	HSBC HOLDINGS PLC	英国	社債	5.2500 (2022年9月 以降変動金 利)	2049/12/29	14,150,000	135.37	1,915,478,729	127.35	1,801,996,159	1.93
19	NN GROUP NV	オラン ダ	社債	4.5000 (2026年1月 以降変動金 利)	2049/ 7 /15	14,300,000	143.45	2,051,282,311	125.25	1,791,007,803	1.91
20	SWEDBANK AB	スウェー デン	社債	5.5000 (2020年3月 以降変動金 利)	2049/12/29	15,400,000	120.12	1,849,779,017	114.41	1,761,900,237	1.88

	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	
21	COOPERATIEVE CENTRALE RAIFFEISEN- BOERENLEENBANK BA/NETHERLANDS	オランダ	社債	5.5000 (2020年6月 以降変動金利)	2049/12/29	13,100,000	137.11	1,796,148,708	133.45	1,748,138,760	1.87
22	NORDEA BANK AB	スウェーデン	社債	5.2500 (2021年9月 以降変動金利)	2049/9/13	15,800,000	120.09	1,897,394,764	110.19	1,740,960,736	1.86
23	MORGAN STANLEY	米国	社債	4.8750	2022/11/1	13,150,000	87.38	1,149,095,926	128.32	1,687,358,256	1.80
24	CAIXABANK SA	スペイン	社債	5.0000 (2018年11月 以降変動金利)	2023/11/14	12,200,000	144.98	1,768,735,194	137.89	1,682,235,380	1.80
25	SOCIETE GENERALE SA	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	165.01	1,600,616,803	1.71
26	CREDIT AGRICOLE SA	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	182.15	1,593,769,906	1.70
27	WELLS FARGO CAPITAL X	米国	社債	5.9500	2036/12/15	12,610,000	79.66	1,004,488,714	120.36	1,517,697,232	1.62
28	SOCIETE GENERALE SA	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	129.17	1,485,443,975	1.59
29	BBVA BANCOMER SA/TEXAS	メキシコ	社債	7.2500	2020/4/22	11,370,000	105.67	1,201,507,199	130.05	1,478,659,575	1.58
30	ZURICH FINANCE UK PLC	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	199.72	1,465,961,999	1.57

投資不動産物件

該当事項なし。(平成27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27年9月末日現在)