

【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28年11月30日
【発行者名】	ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)
【代表者の役職氏名】	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、アロン通り 287-289番 (287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三浦 健
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三浦 健
【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・トラストー東京海上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2,058億2,000万円）を上限とする。 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス： 20億オーストラリアドル（約1,534億8,000万円）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28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=102.91円および1豪ドル=76.74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28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15 ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第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11 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
	2 事業の内容及び営業の概況		(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
3 管理会社の経理状況		5 管理会社の経理の概況		追加
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28年9月末日現在）

資産の種類	地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
社債	米国	12,529,497,473	18.59
	フランス	11,696,277,768	17.35
	英国	10,157,590,218	15.07
	オランダ	9,918,471,270	14.71
	日本	5,801,373,018	8.61
	ジャージー	2,246,822,664	3.33
	メキシコ	2,072,866,915	3.07
	ドイツ	2,012,077,825	2.98
	スウェーデン	1,667,075,594	2.47
	スペイン	1,549,383,598	2.30
	オーストリア	1,339,692,272	1.99
	バーミューダ	853,968,840	1.27
	デンマーク	803,393,986	1.19
	ノルウェー	764,260,019	1.13
	カナダ	508,760,450	0.75
	ケイマン諸島	200,641,407	0.30
小計		64,122,153,317	95.11
現金・その他の資産 （負債控除後）		3,294,683,546	4.89
合計（純資産総額）		67,416,836,863	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28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＝101.12円および1豪ドル＝77.04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**① 純資産の推移**

平成28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27年10月末日	187,922,552.41	19,002,728	0.009709	0.9818
11月末日	183,217,796.22	18,526,984	0.009717	0.9826
12月末日	176,345,133.34	17,832,020	0.009622	0.9730
平成28年1月末日	171,783,284.47	17,370,726	0.009532	0.9639
2月末日	164,478,580.54	16,632,074	0.009333	0.9438
3月末日	165,860,829.28	16,771,847	0.009547	0.9654
4月末日	165,534,615.89	16,738,860	0.009647	0.9755
5月末日	164,877,128.25	16,672,375	0.009658	0.9766
6月末日	162,343,113.71	16,416,136	0.009574	0.9681
7月末日	163,511,881.83	16,534,321	0.009779	0.9889
8月末日	161,440,317.58	16,324,845	0.009856	0.9966
9月末日	158,697,281.52	16,047,469	0.009771	0.9880

＜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27年10月末日	62,394,669.58	4,806,885	0.009199	0.7087
11月末日	59,468,023.68	4,581,417	0.009207	0.7093
12月末日	57,648,607.98	4,441,249	0.009114	0.7021
平成28年1月末日	57,435,347.96	4,424,819	0.009015	0.6945
2月末日	55,677,286.24	4,289,378	0.008824	0.6798
3月末日	56,127,269.73	4,324,045	0.009015	0.6945
4月末日	53,417,828.33	4,115,309	0.009072	0.6989
5月末日	52,773,931.92	4,065,704	0.009062	0.6981
6月末日	52,889,412.64	4,074,600	0.008979	0.6917
7月末日	54,385,671.48	4,189,872	0.009160	0.7057
8月末日	54,362,831.99	4,188,113	0.009224	0.7106
9月末日	54,114,627.37	4,168,991	0.009131	0.7035

＜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～2016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。

② 分配の推移

平成28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27年10月1日～平成28年9月末日	0.000540	0.054605

＜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27年10月1日～平成28年9月末日	0.000720	0.055469

＜参考情報＞

分配の推移（2016年9月末日現在）

米ドル建 米ドルヘッジクラス	
（単位：米ドル、1口当たり課税前）	
第1会計年度（2012年12月13日～2013年2月28日）	0.000045
第2会計年度（2013年3月1日～2014年2月28日）	0.000540
第3会計年度（2014年3月1日～2015年2月28日）	0.000540
第4会計年度（2015年3月1日～2016年2月29日）	0.000540
2016年5月	0.000045
2016年6月	0.000045
2016年7月	0.000045
2016年8月	0.000045
2016年9月	0.000045
直近1年間累計	0.000540
設定来累計	0.001980

豪ドル建 豪ドルヘッジクラス	
（単位：豪ドル、1口当たり課税前）	
第1会計年度（2012年12月13日～2013年2月28日）	0.000080
第2会計年度（2013年3月1日～2014年2月28日）	0.000960
第3会計年度（2014年3月1日～2015年2月28日）	0.000960
第4会計年度（2015年3月1日～2016年2月29日）	0.000860
2016年5月	0.000060
2016年6月	0.000060
2016年7月	0.000060
2016年8月	0.000060
2016年9月	0.000060
直近1年間累計	0.000720
設定来累計	0.003280

③ 収益率の推移

平成28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27年10月1日～平成28年9月末日	7.43%

（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27年10月1日～平成28年9月末日	8.29%

（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、2016年については2016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。2016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28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28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27年10月1日～ 平成28年9月末日	1,723,747,267 (1,723,747,267)	5,361,516,347 (5,361,516,347)	16,241,106,424 (16,241,106,424)

＜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27年10月1日～ 平成28年9月末日	780,963,823 (780,963,823)	1,779,566,013 (1,779,566,013)	5,926,172,809 (5,926,172,809)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

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

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

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

2016年8月31日現在

	円
資産	
現金	4,935,165,432
銀行預金－基準通貨	107,389,341
銀行預金－外国通貨	4,827,776,091
有価証券（取得原価）	67,013,391,552
債券（取得原価）	67,013,391,552
未実現評価損益	(3,876,657,191)
未実現時価評価損益	2,989,527,216
未実現通貨運用損益	(6,778,935,696)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(1,862,884)
未実現通貨繰延損益	(85,385,827)
未収収益	1,509,722,321
現金に係る未収利息	7,224
債券に係る未収利息	1,509,715,097
資本証券	64,608,266
受益証券販売未収金	64,608,266
前払費用	54
設立費用	54
資産合計：	69,646,230,434

2016年8月31日現在

		円
負債		
資本証券		125,969,892
受益証券買戻未払金		125,969,892
未払費用		114,570,259
未払監査費用		913,265
未払報告書作成費用		79,656
未払投資顧問報酬		71,947,377
未払受託報酬		1,178,406
未払管理報酬		14,724,855
未払代行協会員報酬		1,771,518
未払販売報酬		21,010,213
未払副管理報酬		2,944,969
負債合計：		240,540,151
資本		
ファンド受益証券		75,326,999,944
発行済ファンド受益証券（額面価額）		71,719,617,443,079
米ドル建 米ドルヘッジ	41,097,695,558,115	
ブラジル・レアル	15,259,631,289	
米ドル	3,473,832,229	
豪ドル	4,613,293,261	
ユーロ	26,523,278	
日本円	28,432,033,561	
資源国通貨バスケット	108,149,922	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,567,293,151,547	
メキシコ・ペソ	562,347,562	
トルコ・リラ	128,024,190	
ロシア・ルーブル	2,024,898,125	

2016年8月31日現在

円

受益証券額面超過額	(71,644,290,443,135)
-----------	----------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(41,085,837,718,045)
ブラジル・レアル	1,347,879,711
米ドル	119,552,771
豪ドル	(947,245,261)
ユーロ	(951,278)
日本円	2,869,922,439
資源国通貨バスケット	37,501,078
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,465,110,173)
メキシコ・ペソ	49,140,938
トルコ・リラ	24,294,310
ロシア・ルーブル	(487,709,625)

分配金支払額	(41,518,516,323)
--------	------------------

配当金支払額	(41,518,516,323)
--------	------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(5,260,185,575)
ブラジル・レアル	(13,068,097,073)
米ドル	(1,941,832,727)
豪ドル	(3,446,521,062)
ユーロ	(13,105,608)
日本円	(14,442,038,887)
資源国通貨バスケット	(263,975,146)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(2,424,076,336)
メキシコ・ペソ	(190,092,213)
トルコ・リラ	(67,736,913)
ロシア・ルーブル	(400,854,783)

2016年8月31日現在

		円
利益剰余金		30,418,100,888
利益剰余金		30,418,100,888
米ドル建 米ドルヘッジ	28,302,015,580	
ブラジル・リアル	15,059,127,427	
米ドル	9,324,565,042	
豪ドル	13,483,033,074	
ユーロ	50,770,083	
日本円	29,084,500,135	
資源国通貨バスケット	576,253,913	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	2,930,693,853	
メキシコ・ペソ	126,129,779	
トルコ・リラ	16,765,413	
ロシア・ルーブル	(220,670,708)	
中間純利益		5,179,105,774
資本合計：		69,405,690,283
負債および資本合計		69,646,230,434
純資産額合計		69,405,690,283
発行済受益証券総数		22,279,475,294.34170口
受益証券1口当たり純資産額合計		3.115230

損益計算書

東京海上ストラテジック・トラストー

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

2016年3月1日から2016年8月31日までの期間

円

収益

実現損益

14,053,711,571

為替取引に係る実現利益

23,932,981,308

ブラジル・レアル

3,672,379,670

豪ドル

1,173,887,237

ユーロ

6,903,285

日本円

5,805,931,116

資源国通貨バスケット

34,219,607

豪ドル建 豪ドルヘッジ

1,177,348,420

メキシコ・ペソ

121,532,954

トルコ・リラ

41,847,028

ロシア・ルーブル

441,223,014

為替取引に係る実現損失

(14,837,260,188)

ブラジル・レアル

(1,118,458,056)

豪ドル

(800,883,409)

ユーロ

(6,141,775)

日本円

(1,545,187,131)

資源国通貨バスケット

(16,175,889)

豪ドル建 豪ドルヘッジ

(779,267,435)

メキシコ・ペソ

(114,230,260)

トルコ・リラ

(30,631,553)

ロシア・ルーブル

(149,205,599)

市場に係る実現利益

315,291,771

市場に係る実現損失

(57,748,417)

2016年3月1日から2016年8月31日までの期間

円

通貨に係る実現利益		10,441,939,181
米ドル建 米ドルヘッジ	21,471,098	
ブラジル・レアル	6	
豪ドル	1	
ユーロ	1	
日本円	1	
資源国通貨バスケット	4	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	6,123,508	
トルコ・リラ	2	
ロシア・ルーブル	2	
通貨に係る実現損失		(5,741,492,084)
米ドル建 米ドルヘッジ	(15,067,750)	
ブラジル・レアル	(4)	
ユーロ	(2)	
資源国通貨バスケット	(2)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(10,292,187)	
メキシコ・ペソ	(1)	
トルコ・リラ	(4)	
ロシア・ルーブル	(2)	
受取利息		1,730,073,740
現金に係る受取利息		252,613
債券に係る受取利息		1,729,821,127
未実現評価損益		(10,259,282,786)
未実現時価評価損益		4,177,663,726
未実現通貨運用損益		(14,478,237,441)
ブラジル・レアル	(336,045,424)	
豪ドル	(126,664,330)	
ユーロ	(203,917)	
日本円	(1,965,076,499)	
資源国通貨バスケット	(5,336,941)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(149,699,461)	
メキシコ・ペソ	(16,837,976)	
トルコ・リラ	(4,932,672)	
ロシア・ルーブル	(113,149,813)	

2016年3月1日から2016年8月31日までの期間

円

未決済取引にかかる未実現為替差損益	(315,314)
-------------------	-----------

米ドル建 米ドルヘッジ	(2,166,554)
-------------	-------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	19,943
-------------	--------

未実現通貨繰延損益	41,606,243
-----------	------------

収益合計：	5,524,502,525
-------	---------------

2016年3月1日から2016年8月31日までの期間

円

費用

費用一報酬		345,281,189
監査費用		1,023,508
報告書作成費用		59,274
投資顧問報酬		216,618,450
米ドル建 米ドルヘッジ	70,556,135	
ブラジル・レアル	23,326,817	
米ドル	13,941,648	
豪ドル	11,472,482	
ユーロ	80,170	
日本円	77,609,136	
資源国通貨バスケット	230,235	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	17,443,826	
メキシコ・ペソ	1,108,735	
トルコ・リラ	332,760	
ロシア・ルーブル	2,802,093	
受託報酬		3,583,668
現金支出費用		314,191
未払管理報酬		45,224,535
代行協会員報酬		5,283,745
米ドル建 米ドルヘッジ	4,218,120	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	1,065,625	
販売報酬		62,665,239
米ドル建 米ドルヘッジ	50,357,020	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	12,308,219	
副保管報酬		1,463,672
副管理報酬		9,044,907
支払利息		115,562
当座借越利息		81,846
支払利息		33,716
費用合計：		345,396,751
投資純利益		5,179,105,774

[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・トラストー
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 2016年8月31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											
53,813,866.80000	AUD FORWARD 14 OCT FAU14OCT	8/1/2016	AUD	53,813,866.80	4,163,093,728	1.0000000000 ^F 77.501746696	53,813,866.80	4,170,668,673	0	7,574,945	7,574,945
-40,565,700.00000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/1/2016		-40,565,700.00	-4,163,093,701	1.0000000000 ^F 0.009686497	-40,565,700.00	-4,187,860,689	0	-24,766,988	-24,766,988
13,248,166.80000	非グループ化の有価証券小計			13,248,167	27		13,248,167	-17,192,016	0	-17,192,043	-17,192,043
13,248,166.80000	先物（ポジション）合計			13,248,167	27		13,248,167	-17,192,016	0	-17,192,043	-17,192,043
13,248,166.80000	豪ドルクラス受益証券合計			13,248,167	27		13,248,167	-17,192,016	0	-17,192,043	-17,192,043

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
26,262,076.73000	AUD FORWARD 09 SEP FAU09SEP	7/1/2016	AUH	26,262,076.73	2,017,293,500	1.000000000 ^F 77.684733909	26,262,076.73	2,040,162,443	0	22,868,943	22,868,943
-26,262,076.73000		8/30/2016	AUH	-26,262,076.73	-2,027,028,350	1.000000000 ^F 77.684733909	-26,262,076.73	-2,040,162,443	0	-13,134,093	-13,134,093
0.00000	合計 -----			0	-9,734,850		0	0	0	9,734,850	9,734,850
25,985,936.53000	AUD FORWARD 14 NOV FAU14NOV	8/30/2016	AUH	25,985,936.53	2,006,694,816	1.000000000 ^F 77.343157358	25,985,936.53	2,009,834,378	0	3,139,562	3,139,562
28,175,480.72000	AUD FORWARD 14 OCT FAU14OCT	8/1/2016	AUH	28,175,480.72	2,179,682,934	1.000000000 ^F 77.501746696	28,175,480.72	2,183,648,970	0	3,966,036	3,966,036
380,469.00000		8/22/2016	AUH	380,469.00	29,142,125	1.000000000 ^F 77.501746696	380,469.00	29,487,012	0	344,887	344,887
28,555,949.72000	合計 -----			28,555,950	2,208,825,059		28,555,950	2,213,135,982	0	4,310,923	4,310,923
19,721,060.07000	USD FORWARD 09 SEP FUS09SEP	8/30/2016	AUH	19,721,060.07	2,027,028,340	1.000000000 ^F 0.009672038	19,721,060.07	2,038,976,694	0	11,948,354	11,948,354
-19,598,600.00000		7/1/2016	AUH	-19,598,600.00	-2,017,293,496	1.000000000 ^F 0.009672038	-19,598,600.00	-2,026,315,447	0	-9,021,951	-9,021,951
122,460.07000	合計 -----			122,460	9,734,844		122,460	12,661,247	0	2,926,403	2,926,403
-19,482,800.00000	USD FORWARD 14 NOV FUS14NOV	8/30/2016	AUH	-19,482,800.00	-2,006,694,826	1.000000000 ^F 0.009699180	-19,482,800.00	-2,008,705,891	0	-2,011,065	-2,011,065
-21,239,100.00000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/1/2016	AUH	-21,239,100.00	-2,179,682,920	1.000000000 ^F 0.009686497	-21,239,100.00	-2,192,650,243	0	-12,967,323	-12,967,323
-290,100.00000		8/22/2016	AUH	-290,100.00	-29,142,125	1.000000000 ^F 0.009686497	-290,100.00	-29,948,907	0	-806,782	-806,782
-21,529,200.00000	合計 -----			-21,529,200	-2,208,825,045		-21,529,200	-2,222,599,150	0	-13,774,105	-13,774,105
13,652,346.32000	非グループ化の有価証券小 計			13,652,346	-2		13,652,346	4,326,566	0	4,326,568	4,326,568
13,652,346.32000	先物（ポジション）合計			13,652,346	-2		13,652,346	4,326,566	0	4,326,568	4,326,568
13,652,346.32000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			13,652,346	-2		13,652,346	4,326,566	0	4,326,568	4,326,568

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
369,056.07000	AUD FORWARD 14 OCT FAU14OCT	8/1/2016		369,056.07	28,550,541	1.000000000F 77.501746696	369,056.07	28,602,490	0	51,949	51,949
-9,000.00000		8/3/2016	BKH	-9,000.00	-689,271	1.000000000F 77.501746696	-9,000.00	-697,516	0	-8,245	-8,245
-14,000.00000		8/5/2016	BKH	-14,000.00	-1,082,289	1.000000000F 77.501746696	-14,000.00	-1,085,024	0	-2,735	-2,735
346,056.07000	合計 -----			346,056	26,778,981		346,056	26,819,950	0	40,969	40,969
0.00000											
928,103.02000	BRL FORWARD 14 OCT FBR14OCT	8/1/2016		928,103.02	29,111,121	1.000000000F 0.031752830	928,103.02	29,228,986	0	117,865	117,865
-22,000.00000		8/3/2016	BKH	-22,000.00	-665,121	1.000000000F 0.031752830	-22,000.00	-692,852	0	-27,731	-27,731
-35,000.00000		8/5/2016	BKH	-35,000.00	-1,092,745	1.000000000F 0.031752830	-35,000.00	-1,102,264	0	-9,519	-9,519
871,103.02000	合計 -----			871,103	27,353,255		871,103	27,433,870	0	80,615	80,615
0.00000											
6,566.18000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/3/2016		6,566.18	665,121	1.000000000F 0.009686497	6,566.18	677,869	0	12,748	12,748
6,804.59000		8/3/2016	BKH	6,804.59	689,271	1.000000000F 0.009686497	6,804.59	702,482	0	13,211	13,211
6,904.28000		8/3/2016	BKH	6,904.28	699,369	1.000000000F 0.009686497	6,904.28	712,774	0	13,405	13,405
10,623.69000		8/5/2016	BKH	10,623.69	1,082,289	1.000000000F 0.009686497	10,623.69	1,096,753	0	14,464	14,464
10,726.33000		8/5/2016	BKH	10,726.33	1,092,745	1.000000000F 0.009686497	10,726.33	1,107,349	0	14,604	14,604
10,746.37000		8/5/2016	BKH	10,746.37	1,094,787	1.000000000F 0.009686497	10,746.37	1,109,418	0	14,631	14,631
-278,200.00000		8/1/2016	BKH	-278,200.00	-28,550,541	1.000000000F 0.009686497	-278,200.00	-28,720,393	0	-169,852	-169,852

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-278,200.00000		8/1/2016		-278,200.00	-29,111,121	1.000000000 ^F	-278,200.00	-28,720,393	0	390,728	390,728
			BKH			0.009686497					
-278,200.00000		8/1/2016		-278,200.00	-28,887,328	1.000000000 ^F	-278,200.00	-28,720,393	0	166,935	166,935
			BKH			0.009686497					
-782,228.56000	合計 -----			-782,229	-81,225,408		-782,229	-80,754,534	0	470,874	470,874
0.00000											
3,921,368.10000	ZAR FORWARD 14 OCT	8/1/2016		3,921,368.10	28,887,328	1.000000000 ^F	3,921,368.10	27,273,053	0	-1,614,275	-1,614,275
	FZA14OCT		BKH			0.143781779					
-98,000.00000		8/3/2016		-98,000.00	-699,369	1.000000000 ^F	-98,000.00	-681,588	0	17,781	17,781
			BKH			0.143781779					
-150,000.00000		8/5/2016		-150,000.00	-1,094,787	1.000000000 ^F	-150,000.00	-1,043,248	0	51,539	51,539
			BKH			0.143781779					
3,673,368.10000	合計 -----			3,673,368	27,093,172		3,673,368	25,548,217	0	-1,544,955	-1,544,955
0.00000											
4,108,298.63000	非グループ化の有価証券小			4,108,299	0		4,108,299	-952,497	0	-952,497	-952,497
	計										
4,108,298.63000	先物（ポジション）合計			4,108,299	0		4,108,299	-952,497	0	-952,497	-952,497
4,108,298.63000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			4,108,299	0		4,108,299	-952,497	0	-952,497	-952,497

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
36,901,529.10000	BRL FORWARD 09 SEP FBR09SEP	7/1/2016	BRH	36,901,529.10	1,168,674,832	1.000000000 ^F 0.031363991	36,901,529.10	1,176,557,189	0	7,882,357	7,882,357
111,713,576.92000		7/1/2016	BRH	111,713,576.92	3,537,979,292	1.000000000 ^F 0.031363991	111,713,576.92	3,561,841,888	0	23,862,596	23,862,596
-9,403,000.00000		8/18/2016	BRH	-9,403,000.00	-290,291,642	1.000000000 ^F 0.031363991	-9,403,000.00	-299,802,407	0	-9,510,765	-9,510,765
-102,310,576.92000		8/30/2016	BRH	-102,310,576.92	-3,219,837,241	1.000000000 ^F 0.031363991	-102,310,576.92	-3,262,039,481	0	-42,202,240	-42,202,240
-36,901,529.10000		8/30/2016	BRH	-36,901,529.10	-1,160,553,863	1.000000000 ^F 0.031363991	-36,901,529.10	-1,176,557,189	0	-16,003,326	-16,003,326
0.00000	合計 -----			0	35,971,378		0	0	0	-35,971,378	-35,971,378
0.00000											
36,749,109.39000	BRL FORWARD 14 NOV FBRI4NOV	8/30/2016	BRH	36,749,109.39	1,158,506,984	1.000000000 ^F 0.032091905	36,749,109.39	1,145,120,846	0	-13,386,138	-13,386,138
101,790,900.00000		8/30/2016	BRH	101,790,900.00	3,208,934,052	1.000000000 ^F 0.032091905	101,790,900.00	3,171,855,956	0	-37,078,096	-37,078,096
138,540,009.39000	合計 -----			138,540,009	4,367,441,036		138,540,009	4,316,976,802	0	-50,464,234	-50,464,234
0.00000											
37,885,957.50000	BRL FORWARD 14 OCT FBRI4OCT	8/1/2016	BRH	37,885,957.50	1,188,340,805	1.000000000 ^F 0.031752830	37,885,957.50	1,193,152,154	0	4,811,349	4,811,349
97,161,577.23000		8/1/2016	BRH	97,161,577.23	3,047,595,324	1.000000000 ^F 0.031752830	97,161,577.23	3,059,934,413	0	12,339,089	12,339,089
-2,210,000.00000		8/5/2016	BRH	-2,210,000.00	-68,999,011	1.000000000 ^F 0.031752830	-2,210,000.00	-69,600,095	0	-601,084	-601,084
132,837,534.73000	合計 -----			132,837,535	4,166,937,118		132,837,535	4,183,486,472	0	16,549,354	16,549,354
0.00000											
2,898,135.31000	USD FORWARD 09 SEP FUS09SEP	8/18/2016	BRH	2,898,135.31	290,291,641	1.000000000 ^F 0.009672038	2,898,135.31	299,640,604	0	9,348,963	9,348,963
11,291,086.56000		8/30/2016	BRH	11,291,086.56	1,160,553,863	1.000000000 ^F 0.009672038	11,291,086.56	1,167,394,768	0	6,840,905	6,840,905

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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・リ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											
31,325,957.42000		8/30/2016		31,325,957.42	3,219,837,232	1.000000000 ^F 0.009672038	31,325,957.42	3,238,816,620	0	18,979,388	18,979,388
-33,823,900.00000		7/1/2016	BRH	-33,823,900.00	-3,537,979,291	1.000000000 ^F 0.009672038	-33,823,900.00	-3,497,080,967	0	40,898,324	40,898,324
-11,163,000.00000		7/1/2016	BRH	-11,163,000.00	-1,168,674,841	1.000000000 ^F 0.009672038	-11,163,000.00	-1,154,151,793	0	14,523,048	14,523,048
528,279.29000 0.00000	合計 -----			528,279	-35,971,396		528,279	54,619,232	0	90,590,628	90,590,628
-30,600,000.00000	USD FORWARD 14 NOV FUS14NOV	8/30/2016	BRH	-30,600,000.00	-3,208,934,075	1.000000000 ^F 0.009699180	-30,600,000.00	-3,154,905,879	0	54,028,196	54,028,196
-11,036,100.00000		8/30/2016	BRH	-11,036,100.00	-1,158,506,989	1.000000000 ^F 0.009699180	-11,036,100.00	-1,137,838,456	0	20,668,533	20,668,533
-41,636,100.00000 0.00000	合計 -----			-41,636,100	-4,367,441,064		-41,636,100	-4,292,744,335	0	74,696,729	74,696,729
677,290.84000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/5/2016	BRH	677,290.84	68,999,011	1.000000000 ^F 0.009686497	677,290.84	69,921,132	0	922,121	922,121
-29,124,300.00000		8/1/2016	BRH	-29,124,300.00	-3,047,595,333	1.000000000 ^F 0.009686497	-29,124,300.00	-3,006,690,654	0	40,904,679	40,904,679
-11,355,000.00000		8/1/2016	BRH	-11,355,000.00	-1,188,340,810	1.000000000 ^F 0.009686497	-11,355,000.00	-1,172,250,402	0	16,090,408	16,090,408
-39,802,009.16000 0.00000	合計 -----			-39,802,009	-4,166,937,132		-39,802,009	-4,109,019,924	0	57,917,208	57,917,208
190,467,714.25000	非グループ化の有価証券小計			190,467,714	-60		190,467,714	153,318,247	0	153,318,307	153,318,307
190,467,714.25000	先物（ポジション）合計			190,467,714	-60		190,467,714	153,318,247	0	153,318,307	153,318,307
190,467,714.25000	ブラジル・リアルクラス受益証券合計			190,467,714	-60		190,467,714	153,318,247	0	153,318,307	153,318,307

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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)
ユーロクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
124,221.38000	EUR FORWARD 09 SEP FEU09SEP	7/1/2016		124,221.38	14,196,846	1.000000000 ^F 115.198215810	124,221.38	14,310,081	0	113,235	113,235
5,138.28000		7/15/2016	EUH	5,138.28	601,924	1.000000000 ^F 115.198215810	5,138.28	591,921	0	-10,003	-10,003
-129,359.66000		8/30/2016	EUH	-129,359.66	-14,831,011	1.000000000 ^F 115.198215810	-129,359.66	-14,902,002	0	-70,991	-70,991
0.00000	合計 -----			0	-32,241		0	0	0	32,241	32,241
0.00000											
127,558.77000	EUR FORWARD 14 NOV FEU14NOV	8/30/2016	EUH	127,558.77	14,620,869	1.000000000 ^F 115.202595284	127,558.77	14,695,101	0	74,232	74,232
126,101.04000	EUR FORWARD 14 OCT FEU14OCT	8/1/2016	EUH	126,101.04	14,421,244	1.000000000 ^F 115.199197845	126,101.04	14,526,739	0	105,495	105,495
144,291.65000	USD FORWARD 09 SEP FUS09SEP	8/30/2016	EUH	144,291.65	14,831,011	1.000000000 ^F 0.009672038	144,291.65	14,918,433	0	87,422	87,422
-138,600.00000		7/1/2016	EUH	-138,600.00	-14,196,846	1.000000000 ^F 0.009672038	-138,600.00	-14,329,969	0	-133,123	-133,123
-5,700.00000		7/15/2016	EUH	-5,700.00	-601,924	1.000000000 ^F 0.009672038	-5,700.00	-589,328	0	12,596	12,596
-8.35000	合計 -----			-8	32,241		-8	-864	0	-33,105	-33,105
0.00000											
-142,700.00000	USD FORWARD 14 NOV FUS14NOV	8/30/2016	EUH	-142,700.00	-14,620,869	1.000000000 ^F 0.009699180	-142,700.00	-14,712,584	0	-91,715	-91,715
-141,300.00000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/1/2016	EUH	-141,300.00	-14,421,244	1.000000000 ^F 0.009686497	-141,300.00	-14,587,317	0	-166,073	-166,073
-30,348.54000	非グループ化の有価証券小 計			-30,349	0		-30,349	-78,925	0	-78,925	-78,925
-30,348.54000	先物（ポジション）合計			-30,349	0		-30,349	-78,925	0	-78,925	-78,925
-30,348.54000	ユーロクラス受益証券合計			-30,349	0		-30,349	-78,925	0	-78,925	-78,925

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
224,944,136.19000	USD FORWARD 09 SEP FUS09SEP	8/30/2016	JPH	224,944,136.19	23,119,196,020	1.000000000F 0.009672038	224,944,136.19	23,257,160,093	0	137,964,073	137,964,073
-217,107,900.00000		7/1/2016		-217,107,900.00	-22,245,635,360	1.000000000F 0.009672038	-217,107,900.00	-22,446,965,159	0	-201,329,799	-201,329,799
-8,274,000.00000		7/15/2016		-8,274,000.00	-873,560,648	1.000000000F 0.009672038	-8,274,000.00	-855,455,696	0	18,104,952	18,104,952
-437,763.81000 0.00000	合計 -----			-437,764	12		-437,764	-45,260,762	0	-45,260,774	-45,260,774
-224,370,600.00000	USD FORWARD 14 NOV FUS14NOV	8/30/2016	JPH	-224,370,600.00	-22,990,806,684	1.000000000F 0.009699180	-224,370,600.00	-23,132,945,259	0	-142,138,575	-142,138,575
-51,196,500.00000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/1/2016		-51,196,500.00	-5,226,957,877	1.000000000F 0.009686497	-51,196,500.00	-5,285,347,221	0	-58,389,344	-58,389,344
-2,135,000.00000		8/18/2016		-2,135,000.00	-213,288,635	1.000000000F 0.009686497	-2,135,000.00	-220,409,917	0	-7,121,282	-7,121,282
-53,331,500.00000 0.00000	合計 -----			-53,331,500	-5,440,246,512		-53,331,500	-5,505,757,138	0	-65,510,626	-65,510,626
-278,139,863.81000	非グループ化の有価証券小計			-278,139,864	-28,431,053,184		-278,139,864	-28,683,963,159	0	-252,909,975	-252,909,975
-278,139,863.81000	先物（ポジション）合計			-278,139,864	-28,431,053,184		-278,139,864	-28,683,963,159	0	-252,909,975	-252,909,975
-278,139,863.81000	日本円クラス受益証券合計			-278,139,864	-28,431,053,184		-278,139,864	-28,683,963,159	0	-252,909,975	-252,909,975

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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・ペソクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
37,628,395.95	MXN FORWARD 09 SEP	7/1/2016		37,628,395.95	211,188,958	1.000000000 ^F	37,628,395.95	206,005,463	0	-5,183,495	-5,183,495
	FMX09SEP		MXH			0.182657272					
-37,628,395.95		8/30/2016		-37,628,395.95	-205,413,767	1.000000000 ^F	-37,628,395.95	-206,005,463	0	-591,696	-591,696
			MXH			0.182657272					
0.00000	合計 -----			0	5,775,191		0	0	0	-5,775,191	-5,775,191
0.00000											
37,356,585.75	MXN FORWARD 14 NOV	8/30/2016		37,356,585.75	204,133,551	1.000000000 ^F	37,356,585.75	202,671,527	0	-1,462,024	-1,462,024
	FMX14NOV		MXH			0.184320838					
32,986,369.68	MXN FORWARD 14 OCT	8/1/2016		32,986,369.68	179,099,439	1.000000000 ^F	32,986,369.68	179,703,072	0	603,633	603,633
	FMX14OCT		MXH			0.183560411					
1,998,480.81000	USD FORWARD 09 SEP	8/30/2016		1,998,480.81	205,413,767	1.000000000 ^F	1,998,480.81	206,624,582	0	1,210,815	1,210,815
	FUS09SEP		MXH			0.009672038					
-2,043,500.00000		7/1/2016		-2,043,500.00	-211,188,960	1.000000000 ^F	-2,043,500.00	-211,279,153	0	-90,193	-90,193
			MXH			0.009672038					
-45,019.19000	合計 -----			-45,019	-5,775,193		-45,019	-4,654,571	0	1,120,622	1,120,622
0.00000											
-1,972,500.00000	USD FORWARD 14 NOV	8/30/2016		-1,972,500.00	-204,133,553	1.000000000 ^F	-1,972,500.00	-203,367,707	0	765,846	765,846
	FUS14NOV		MXH			0.009699180					
-1,736,600.00000	USD FORWARD 14 OCT	8/1/2016		-1,736,600.00	-179,099,440	1.000000000 ^F	-1,736,600.00	-179,280,497	0	-181,057	-181,057
	FUS14OCT		MXH			0.009686497					
66,588,836.24000	非グループ化の有価証券小計			66,588,836	-5		66,588,836	-4,928,176	0	-4,928,171	-4,928,171
66,588,836.24000	先物（ポジション）合計			66,588,836	-5		66,588,836	-4,928,176	0	-4,928,171	-4,928,171
66,588,836.24000	メキシコ・ペソクラス受益証券合計			66,588,836	-5		66,588,836	-4,928,176	0	-4,928,171	-4,928,171

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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)
ロシア・ルーブルクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
370,245,093.00	RUB FORWARD 09 SEP FRU09SEP	7/1/2016		370,245,093.00	593,050,807	1.000000000 ^F 0.633496772	370,245,093.00	584,446,692	0	-8,604,115	-8,604,115
10,303,130.00		7/15/2016	RUH	10,303,130.00	17,279,521	1.000000000 ^F 0.633496772	10,303,130.00	16,263,903	0	-1,015,618	-1,015,618
-25,574,000.00		8/4/2016	RUH	-25,574,000.00	-38,680,468	1.000000000 ^F 0.633496772	-25,574,000.00	-40,369,582	0	-1,689,114	-1,689,114
-354,974,223.00		8/30/2016	RUH	-354,974,223.00	-557,826,102	1.000000000 ^F 0.633496772	-354,974,223.00	-560,341,013	0	-2,514,911	-2,514,911
0.00000	合計 -----			0	13,823,758		0	0	0	-13,823,758	-13,823,758
354,250,164.60	RUB FORWARD 14 NOV FRU14NOV	8/30/2016	RUH	354,250,164.60	558,189,651	1.000000000 ^F 0.645293910	354,250,164.60	548,974,908	0	-9,214,743	-9,214,743
301,061,297.60	RUB FORWARD 14 OCT FRU14OCT	8/1/2016	RUH	301,061,297.60	463,465,673	1.000000000 ^F 0.639807701	301,061,297.60	470,549,662	0	7,083,989	7,083,989
382,615.20000	USD FORWARD 09 SEP FUS09SEP	8/4/2016	RUH	382,615.20	38,680,468	1.000000000 ^F 0.009672038	382,615.20	39,558,902	0	878,434	878,434
5,427,118.04000		8/30/2016	RUH	5,427,118.04	557,826,102	1.000000000 ^F 0.009672038	5,427,118.04	561,114,218	0	3,288,116	3,288,116
-5,683,400.00000		7/1/2016	RUH	-5,683,400.00	-593,050,808	1.000000000 ^F 0.009672038	-5,683,400.00	-587,611,422	0	5,439,386	5,439,386
-160,360.00000		7/15/2016	RUH	-160,360.00	-17,279,521	1.000000000 ^F 0.009672038	-160,360.00	-16,579,753	0	699,768	699,768
-34,026.76000	合計 -----			-34,027	-13,823,759		-34,027	-3,518,055	0	10,305,704	10,305,704
-5,331,600.00000	USD FORWARD 14 NOV FUS14NOV	8/30/2016	RUH	-5,331,600.00	-558,189,654	1.000000000 ^F 0.009699180	-5,331,600.00	-549,695,954	0	8,493,700	8,493,700
-4,446,400.00000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/1/2016	RUH	-4,446,400.00	-463,465,674	1.000000000 ^F 0.009686497	-4,446,400.00	-459,030,752	0	4,434,922	4,434,922
645,499,435.44000	非グループ化の有価証券小 計			645,499,435	-5		645,499,435	7,279,809	0	7,279,814	7,279,814
645,499,435.44000	先物（ポジション）合計			645,499,435	-5		645,499,435	7,279,809	0	7,279,814	7,279,814
645,499,435.44000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			645,499,435	-5		645,499,435	7,279,809	0	7,279,814	7,279,814

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
1,419,723.86	TRY FORWARD 09 SEP	7/1/2016		1,419,723.86	50,371,788	1.000000000 ^F	1,419,723.86	49,503,007	0	-868,781	-868,781
	FTR09SEP		TRH			0.028679548					
45,068.25		7/15/2016		45,068.25	1,606,475	1.000000000 ^F	45,068.25	1,571,442	0	-35,033	-35,033
			TRH			0.028679548					
-89,000.00		8/3/2016		-89,000.00	-2,962,571	1.000000000 ^F	-89,000.00	-3,103,257	0	-140,686	-140,686
			TRH			0.028679548					
-77,000.00		8/4/2016		-77,000.00	-2,560,376	1.000000000 ^F	-77,000.00	-2,684,840	0	-124,464	-124,464
			TRH			0.028679548					
-1,298,792.11		8/30/2016		-1,298,792.11	-44,963,386	1.000000000 ^F	-1,298,792.11	-45,286,352	0	-322,966	-322,966
			TRH			0.028679548					
0.00000	合計 -----			0	1,491,930		0	0	0	-1,491,930	-1,491,930
0.00000											
1,285,227.30	TRY FORWARD 14 NOV	8/30/2016		1,285,227.30	44,588,400	1.000000000 ^F	1,285,227.30	44,071,292	0	-517,108	-517,108
	FTRI14NOV		TRH			0.029162460					
1,133,337.42	TRY FORWARD 14 OCT	8/1/2016		1,133,337.42	38,790,263	1.000000000 ^F	1,133,337.42	39,165,510	0	375,247	375,247
	FTRI14OCT		TRH			0.028937129					
29,246.97000	USD FORWARD 09 SEP	8/3/2016		29,246.97	2,962,571	1.000000000 ^F	29,246.97	3,023,868	0	61,297	61,297
	FUS09SEP		TRH			0.009672038					
25,326.45000		8/4/2016		25,326.45	2,560,376	1.000000000 ^F	25,326.45	2,618,523	0	58,147	58,147
			TRH			0.009672038					
437,451.03000		8/30/2016		437,451.03	44,963,386	1.000000000 ^F	437,451.03	45,228,423	0	265,037	265,037
			TRH			0.009672038					
-483,600.00000		7/1/2016		-483,600.00	-50,371,788	1.000000000 ^F	-483,600.00	-49,999,804	0	371,984	371,984
			TRH			0.009672038					
-15,400.00000		7/15/2016		-15,400.00	-1,606,475	1.000000000 ^F	-15,400.00	-1,592,219	0	14,256	14,256
			TRH			0.009672038					
-6,975.55000	合計 -----			-6,976	-1,491,930		-6,976	-721,209	0	770,721	770,721
0.00000											

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-427,000.00000	USD FORWARD 14 NOV FUS14NOV	8/30/2016	TRH	-427,000.00	-44,588,400	1.000000000 ^F 0.009699180	-427,000.00	-44,024,340	0	564,060	564,060
-372,600.00000	USD FORWARD 14 OCT FUS14OCT	8/1/2016	TRH	-372,600.00	-38,790,263	1.000000000 ^F 0.009686497	-372,600.00	-38,465,918	0	324,345	324,345
1,611,989.17000	非グループ化の有価証券小 計			1,611,989	0		1,611,989	25,335	0	25,335	25,335
1,611,989.17000	先物（ポジション）合計			1,611,989	0		1,611,989	25,335	0	25,335	25,335
1,611,989.17000	トルコ・リラクラス受益証券合計			1,611,989	0		1,611,989	25,335	0	25,335	25,335

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
107,389,341.00000	JPY CASH	8/31/2016		107,389,341	107,389,341	1.000000000	107,389,341	107,389,341	0	0	0
	CASHJPY					1.000000000					
107,389,341.00000	基準通貨現金小計			107,389,341	107,389,341		107,389,341	107,389,341	0	0	0
107,389,341.00000	現金合計			107,389,341	107,389,341		107,389,341	107,389,341	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
5,900,000.00000	ASR NEDERLAND NV FRN 09292045 BNLD12AD XS1293505639	9/22/2015		5,877,627.68	777,249,320	108.532997131C 115.200731246	6,403,446.83	737,681,757	60,574,751	-100,142,313	-39,567,562
6,250,000.00	AVIVA PLC FRN 06042050 BGBR22DX XS1242413166	5/29/2015		6,254,385.50	1,186,043,097	107.503997803C 135.468819497	6,718,999.86	910,214,980	62,940,759	-338,768,877	-275,828,118
11,600,000.00	AXA SA FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561	5/24/2013		12,498,319.25	2,110,132,576	107.543998718C 135.468819497	12,475,103.85	1,689,987,592	-3,144,963	-417,000,022	-420,144,985
2,300,000.00000	BARCLAYS PLC FRN 11112025 BGBR22FO XS1319647068	11/4/2015		2,288,431.00	302,209,165	98.238998413C 115.200731246	2,259,496.96	260,295,702	-3,333,222	-38,580,240	-41,913,462
5,800,000.00000	BBVA SUB CAP UNI FRN 04112024 BESP025A XS1055241373	2/9/2015		6,103,236.00	823,557,868	104.657997131C 115.200731246	6,070,163.83	699,287,312	-3,809,938	-120,460,618	-124,270,556
12,200,000.00000	CAIXABANK FRN 11142023 BESP0259 XS0989061345	2/9/2015		13,256,138.00	1,768,735,194	106.045997620C 115.200731246	12,937,611.71	1,490,422,330	-36,694,462	-241,618,403	-278,312,865
4,100,000.00000	CREDIT AGRICOLE FRN PERP/CALL BFRA10I5 US225313AA37	7/7/2016		4,069,500.00	415,223,661	101.008003235C 0.009667907	4,141,328.13	428,358,292	7,429,543	5,705,088	13,134,631
6,910,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		7,095,133.09	796,992,374	111.059997559C 0.009667907	7,674,245.83	793,785,649	59,900,529	-63,107,254	-3,206,725

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
9,400,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN3042 XS1262602532	7/22/2015		9,400,000.00	1,166,022,935	109.217002869 ^C 0.009667907	10,266,398.27	1,061,904,947	89,615,909	-193,733,897	-104,117,988
7,150,000.00000	GENERALI FINANCE FRN PERP/CALL BNLD1280 XS1140860534	11/14/2014		7,253,750.00	1,014,869,196	98.325996399 ^C 115.200731246	7,030,308.74	809,896,708	-25,740,596	-179,231,892	-204,972,488
6,100,000.00	HISCOX LTD FRN 11242045 BBMU003B XS1323450236	11/17/2015		6,066,500.00	1,061,449,735	106.074996948 ^C 135.468819497	6,470,574.81	876,561,131	54,739,538	-239,628,142	-184,888,604
5,950,000.00000	HSBC HOLDINGS FRN PERP/CALL BGBR22CP XS1111123987	4/8/2015		6,255,463.85	805,448,653	98.333999634 ^C 115.200731246	5,850,872.98	674,024,846	-46,609,164	-84,814,643	-131,423,807
5,000,000.00	LEGAL & GENL GRP FRN 10272045 BGBR22EX XS1310962839	10/20/2015		4,991,326.00	924,386,234	108.024002075 ^C 135.468819497	5,401,200.10	731,694,202	55,525,161	-248,217,193	-192,692,032
14,300,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		14,244,655.00	2,051,282,311	104.149002075 ^C 115.200731246	14,893,307.30	1,715,719,891	74,725,219	-410,287,639	-335,562,420
12,500,000.00000	NORDEA BANK AB FRN PERP/CALL BSWE0367 XS1202090947	4/9/2015		12,478,639.24	1,501,103,453	97.571998596 ^C 0.009667907	12,196,499.82	1,261,545,009	-29,183,092	-210,375,352	-239,558,444
10,900,000.00000	RABOBANK FRN PERP/CALL BNLD128M XS1171914515	4/8/2015		11,543,645.00	1,494,505,414	101.487998962 ^C 115.200731246	11,062,191.89	1,274,372,595	-55,463,751	-164,669,069	-220,132,820
11,500,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 09162026 BFRA10CK XS1110558407	9/9/2014		11,424,659.00	1,567,283,607	102.806999207 ^C 115.200731246	11,822,804.91	1,361,995,771	45,866,700	-251,154,536	-205,287,836
4,400,000.00000	SWEDBANK AB FRN PERP/CALL BSWE0364 XS1190655776	3/24/2015		4,407,382.22	528,508,290	102.843002319 ^C 0.009667907	4,525,092.10	468,052,920	12,175,322	-72,630,692	-60,455,370

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
2,550,000.00	TSB BANKING FRN 05062026	8/3/2016		2,592,177.00	349,880,616	105.267997742 ^C 135.468819497	2,684,333.94	363,643,550	12,484,392	1,278,542	13,762,934
3,000,000.00000	BGBR22GV XS1061206337 VONOVIA BV FRN PERP/CALL BNLD12BW XS1117300837	7/11/2016		3,090,000.00	342,824,315	107.512001038 ^C 115.200731246	3,225,360.03	371,563,834	15,593,575	13,145,945	28,739,520
147,810,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			151,190,968	20,987,708,014		154,109,342	17,981,009,018	347,592,210	-3,354,291,207	-3,006,698,997
変動利率											
16,820,000.00000	AMERICAN EXPRESS FRN 09012066	11/9/2011		17,258,467.60	1,399,095,402	100.050000000 ^C 0.009667907	16,828,410.00	1,740,646,657	-44,483,010	386,034,265	341,551,255
3,000,000.00000	BUSA7950 US025816AU39 AVIVA PLC FRN 07052043	9/11/2013		3,137,000.00	417,938,836	117.482002258 ^C 115.200731246	3,524,460.07	406,020,377	44,635,683	-56,554,142	-11,918,459
4,200,000.00000	BGBR2263 XS0951553592 BPCE FRN 08292049	4/20/2012		4,326,000.00	352,763,658	127.278999329 ^C 0.009667907	5,345,717.97	552,934,360	105,474,533	94,696,170	200,170,703
5,745,000.00	BFRA1041 USF11494AA36 DANSKE BANK FRN 09292021	11/10/2011		5,475,973.55	757,817,965	105.366996765 ^C 135.468819497	6,053,333.96	820,038,006	78,214,334	-15,994,293	62,220,041
5,700,000.00	BDNK0229 XS0176929684 DNB NORBANK ASA FRN 03292049	11/9/2011		5,817,347.23	839,581,025	102.069999695 ^C 135.468819497	5,817,989.98	788,156,235	87,073	-51,511,863	-51,424,790
6,150,000.00	BNOR0223 XS0285087358 HSBC BANK FUND FRN 04292049	4/25/2013		6,242,250.00	958,888,054	107.054000854 ^C 135.468819497	6,583,821.05	891,902,466	46,272,227	-113,257,815	-66,985,588
16,800,000.00000	BJEY000C XS0189704140 MITSUI SUMITOMO FRN 03152072	3/9/2012		17,994,215.66	1,559,349,257	121.214996338 ^C 0.009667907	20,364,119.38	2,106,362,772	245,131,001	301,882,513	547,013,514
	BJPN3013 USJ45174AF61										

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
7,376,000.00	NATIONAL CAP TST FRN 09292049 BUSA94UO XS0177395901	8/13/2012		6,809,147.50	890,898,589	104.990997314 ^C 135.468819497	7,744,135.96	1,049,088,957	126,661,783	31,528,585	158,190,368
9,000,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		9,207,099.97	845,881,683	107.410003662 ^C 0.009667907	9,666,900.33	999,895,875	47,559,452	106,454,740	154,014,192
2,530,000.00	PRUDENTIAL PLC FRN 05292039 BGBR2169 XS0431150902	11/9/2011		3,285,605.60	411,730,124	123.469001770 ^C 135.468819497	3,123,765.74	423,172,858	-21,924,254	33,366,988	11,442,734
4,010,000.00000	RABOBANK CAP III FRN 12292049 BUSA96GT US749769AA35	4/9/2013		4,070,150.00	402,965,199	100.310800000 ^C 0.009667907	4,022,463.08	416,063,485	-4,932,497	18,030,783	13,098,286
9,700,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 09292049 BFRA1006 XS0449487619	11/10/2011		10,659,415.00	1,373,574,896	121.969001770 ^C 115.200731246	11,830,993.17	1,362,939,065	134,966,662	-145,602,493	-10,635,831
17,200,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		17,363,818.82	1,676,407,567	112.815002441 ^C 0.009667907	19,404,180.42	2,007,071,481	211,044,810	119,619,104	330,663,914
7,340,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	5/3/2012		7,878,833.00	1,241,250,971	115.195999146 ^C 135.468819497	8,455,386.34	1,145,441,206	78,105,000	-173,914,765	-95,809,765
115,571,000.00000	変動利率小計			119,525,324	13,128,143,226		128,765,677	14,709,733,800	1,046,812,797	534,777,777	1,581,590,574
ミディアム・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	123.411003113 ^C 115.200731246	6,540,783.16	753,503,004	138,223,116	46,540,147	184,763,263
2,490,000.00000	ABN AMRO BANK NV 7.125 % 07062022 BNLD120I XS0802995166	8/13/2012		2,719,467.40	293,030,303	129.930999756 ^C 115.200731246	3,235,281.89	372,706,840	59,422,207	20,254,330	79,676,537

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
メディアム・ターム・ノート											
16,100,000.00000	ABN AMRO BANK NV 2.875 % 06302025 BNLD129W XS1253955469	6/23/2015		16,158,170.00	2,245,873,831	104.857002258 ^C 115.200731246	16,881,977.36	1,944,816,137	83,383,138	-384,440,831	-301,057,693
18,150,000.00000	BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		18,136,570.50	2,012,951,380	102.226997375 ^C 0.009667907	18,554,200.02	1,919,153,755	43,197,511	-136,995,136	-93,797,625
16,500,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249	6/9/2015		16,437,465.00	2,299,021,395	109.483001709 ^C 115.200731246	18,064,695.28	2,081,066,106	187,458,118	-405,413,407	-217,955,289
7,050,000.00	LLOYDS TSB BANK 7.625 % 04222025 BGBR223F XS0503834821	1/10/2013		8,398,515.74	1,225,382,729	133.141006470 ^C 135.468819497	9,386,440.96	1,271,570,076	133,833,063	-87,645,716	46,187,347
65,590,000.00000	メディアム・ターム・ノート小計			67,191,126	8,644,999,378		72,663,379	8,342,815,918	645,517,153	-947,700,613	-302,183,460
私募債											
7,250,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0058 US05533UAB44	11/10/2011		7,921,591.22	720,709,780	111.060997009 ^C 0.009667907	8,051,922.28	832,850,614	13,480,794	98,660,040	112,140,834
19,850,000.00000	BNP PARIBAS 4.375 % 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97	10/1/2015		19,259,441.50	2,271,381,455	103.694000244 ^C 0.009667907	20,583,259.05	2,129,029,484	136,929,074	-279,281,045	-142,351,971
19,000,000.00000	ING BANK NV 5.8 % 09252023 BNLD122U US449786AY82	9/16/2013		20,418,299.98	2,122,593,322	112.066001892 ^C 0.009667907	21,292,540.36	2,202,393,999	90,427,057	-10,626,380	79,800,677
23,000,000.00000	SANTANDER UK PLC 5 % 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		23,001,850.00	2,304,989,890	105.137001038 ^C 0.009667907	24,181,510.24	2,501,214,610	122,018,162	74,206,559	196,224,721
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64	8/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	101.079002380 ^C 0.009667907	6,014,200.64	622,078,868	10,234,753	17,627,470	27,862,223
75,050,000.00000	私募債小計			76,516,435	8,013,891,092		80,123,433	8,287,567,575	373,089,840	-99,413,356	273,676,484

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米ドルです。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
14,300,000.00000	BANK OF AMER CRP 3.95 % 04212025 BUSA99D5 US06051GFP90	4/16/2015		14,120,517.00	1,653,496,060	104.063003540C 0.009667907	14,881,009.51	1,539,217,279	78,661,545	-192,940,326	-114,278,781
11,370,000.00000	BBVA BANCOR SA 7.25 % 04222020 BMEX009H USP1R23DAA49	1/29/2013		13,136,847.00	1,201,507,199	111.103996277C 0.009667907	12,632,524.38	1,306,645,210	-52,164,613	157,302,624	105,138,011
6,450,000.00000	CAPITAL ONE FINL 3.75 % 07282026 BUSA9AR8 US14040HBK05	7/28/2016		6,476,122.50	678,924,307	100.628997803C 0.009667907	6,490,570.36	671,352,171	1,494,414	-9,066,550	-7,572,136
1,030,000.00000	CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71	5/5/2016		1,581,977.00	169,137,062	157.684800000C 0.009667907	1,624,153.44	167,994,318	4,362,520	-5,505,265	-1,142,745
12,600,000.00000	CITIGROUP INC 4.6 % 03092026 BUSA9ACG US172967KJ96	3/1/2016		12,575,052.00	1,428,400,135	107.551002502C 0.009667907	13,551,426.32	1,401,691,836	100,991,281	-127,699,580	-26,708,299
24,000,000.00000	CRED AGRICOLE SA 4.375 % 03172025 BFRA10ER USF2R125AC99	3/10/2015		24,040,851.43	2,914,034,551	103.099998474C 0.009667907	24,743,999.63	2,559,395,703	72,730,137	-427,368,985	-354,638,848
12,250,000.00000	DISCOVER BANK 4.25 % 03132026 BUSA97XY US25466AAE10	8/8/2016		13,017,217.50	1,334,720,444	107.073997498C 0.009667907	13,116,564.69	1,356,711,923	10,275,977	11,715,501	21,991,478
4,820,000.00	GOLDMAN SACHS GP 5.5% 10122021 BUSA4203 XS0270349003	4/18/2012		4,853,269.60	679,412,153	115.637001038C 135.468819497	5,573,703.45	755,063,027	97,596,323	-21,945,450	75,650,873
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GP 6.875 % 01182038 BUSA96MS XS0340470490	4/25/2013		1,227,320.00	188,531,777	153.386001587C 135.468819497	1,533,860.02	207,790,206	41,526,614	-22,268,185	19,258,429
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	3/20/2014		1,795,572.00	183,857,592	110.549003601C 0.009667907	1,989,882.06	205,823,459	20,098,462	1,867,405	21,965,867

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
3,000,000.00000	MORGAN STANLEY 3.95 % 04232027 BUSA99DZ US61761JZN26	4/20/2015		2,989,200.00	356,477,031	104.119003296 ^C 0.009667907	3,123,570.10	323,086,486	13,898,572	-47,289,117	-33,390,545
22,800,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.125 % 12152022 BGBR223B US780099CE50	12/13/2012		23,833,677.12	2,066,481,644	106.871002197 ^C 0.009667907	24,366,588.50	2,520,358,181	55,121,691	398,754,846	453,876,537
9,900,000.00000	SYNCHRONY FINANC 3.7 % 08042026 BUSA9ARZ US87165BAL71	8/1/2016		9,862,281.00	1,009,601,692	99.192001343 ^C 0.009667907	9,820,008.13	1,015,732,581	-4,372,494	10,503,383	6,130,889
12,900,000.00000	UBS GROUP FUNDIN 4.125 % 09242025 BJEY000Y USG91703AB73	8/4/2016		13,539,173.00	1,369,579,481	105.697998047 ^C 0.009667907	13,635,041.75	1,410,340,599	9,916,184	30,844,934	40,761,118
12,610,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95 % 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		12,746,280.00	1,004,488,714	110.769996643 ^C 0.009667907	13,968,096.58	1,444,790,126	126,378,603	313,922,810	440,301,413
150,830,000.00000	公募債小計			155,795,357	16,238,649,842		161,050,999	16,885,993,105	576,515,216	70,828,045	647,343,261
554,851,000.00000	社債合計			570,219,210	67,013,391,552		596,712,830	66,207,119,416	2,989,527,216	-3,795,799,354	-806,272,138
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
381,969.34000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	8/13/2014		381,969.34	36,188,090	1.000000000 ^S 77.736574249	381,969.34	29,692,988	0	-6,495,102	-6,495,102
106,271.98000		8/18/2014		106,271.98	10,140,826	1.000000000 ^S 77.736574249	106,271.98	8,261,220	0	-1,879,606	-1,879,606
69,680.22000		8/19/2014		69,680.22	6,661,195	1.000000000 ^S 77.736574249	69,680.22	5,416,702	0	-1,244,493	-1,244,493
7,273.14000		8/21/2014		7,273.14	699,723	1.000000000 ^S 77.736574249	7,273.14	565,389	0	-134,334	-134,334
2,362,456.54000		8/26/2014		2,362,456.54	228,361,099	1.000000000 ^S 77.736574249	2,362,456.54	183,649,278	0	-44,711,821	-44,711,821

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
5,722.47000		8/29/2014		5,722.47	556,016	1.000000000S 77.736574249	5,722.47	444,845	0	-111,171	-111,171
19,318.75000		9/2/2014		19,318.75	1,881,269	1.000000000S 77.736574249	19,318.75	1,501,773	0	-379,496	-379,496
1,607,716.44000		9/3/2014		1,607,716.44	156,782,241	1.000000000S 77.736574249	1,607,716.44	124,978,368	0	-31,803,873	-31,803,873
2,093,263.14000		9/11/2014		2,093,263.14	204,473,184	1.000000000S 77.736574249	2,093,263.14	162,723,106	0	-41,750,078	-41,750,078
206,869.01000		9/12/2014		206,869.01	20,130,886	1.000000000S 77.736574249	206,869.01	16,081,288	0	-4,049,598	-4,049,598
32,827.64000		9/16/2014		32,827.64	3,178,630	1.000000000S 77.736574249	32,827.64	2,551,908	0	-626,722	-626,722
190,691.93000		9/17/2014		190,691.93	18,451,593	1.000000000S 77.736574249	190,691.93	14,823,737	0	-3,627,856	-3,627,856
246,997.33000		9/22/2014		246,997.33	24,069,629	1.000000000S 77.736574249	246,997.33	19,200,726	0	-4,868,903	-4,868,903
779,044.36000		9/26/2014		779,044.36	74,670,301	1.000000000S 77.736574249	779,044.36	60,560,240	0	-14,110,061	-14,110,061
4,808.27000		9/30/2014		4,808.27	461,539	1.000000000S 77.736574249	4,808.27	373,778	0	-87,761	-87,761
193,723.40000		10/1/2014		193,723.40	18,595,241	1.000000000S 77.736574249	193,723.40	15,059,393	0	-3,535,848	-3,535,848
93,320.89000		10/3/2014		93,320.89	8,882,531	1.000000000S 77.736574249	93,320.89	7,254,446	0	-1,628,085	-1,628,085
1,179,910.48000		10/7/2014		1,179,910.48	112,450,563	1.000000000S 77.736574249	1,179,910.48	91,722,199	0	-20,728,364	-20,728,364
22,257.67000		10/9/2014		22,257.67	2,108,924	1.000000000S 77.736574249	22,257.67	1,730,235	0	-378,689	-378,689
25,335.57000		10/14/2014		25,335.57	2,380,321	1.000000000S 77.736574249	25,335.57	1,969,500	0	-410,821	-410,821

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
155,694.36000		10/27/2014		155,694.36	14,815,589	1.000000000S 77.736574249	155,694.36	12,103,146	0	-2,712,443	-2,712,443
1,012,066.41000		10/30/2014		1,012,066.41	97,410,767	1.000000000S 77.736574249	1,012,066.41	78,674,576	0	-18,736,191	-18,736,191
2,442.23000		11/3/2014		2,442.23	240,658	1.000000000S 77.736574249	2,442.23	189,851	0	-50,807	-50,807
701,249.41000		11/4/2014		701,249.41	69,693,864	1.000000000S 77.736574249	701,249.41	54,512,727	0	-15,181,137	-15,181,137
1,642,127.35000		11/12/2014		1,642,127.35	164,665,136	1.000000000S 77.736574249	1,642,127.35	127,653,355	0	-37,011,781	-37,011,781
2,700,000.00000		11/21/2014		2,700,000.00	275,018,538	1.000000000S 77.736574249	2,700,000.00	209,888,750	0	-65,129,788	-65,129,788
2,200,000.00000		11/24/2014		2,200,000.00	224,592,650	1.000000000S 77.736574249	2,200,000.00	171,020,463	0	-53,572,187	-53,572,187
1,775.32000		11/28/2014		1,775.32	179,836	1.000000000S 77.736574249	1,775.32	138,007	0	-41,829	-41,829
25,737.85000		12/5/2014		25,737.85	2,588,276	1.000000000S 77.736574249	25,737.85	2,000,772	0	-587,504	-587,504
1,200,271.26000		12/10/2014		1,200,271.26	119,256,313	1.000000000S 77.736574249	1,200,271.26	93,304,976	0	-25,951,337	-25,951,337
1,159,803.53000		12/15/2014		1,159,803.53	113,414,608	1.000000000S 77.736574249	1,159,803.53	90,159,153	0	-23,255,455	-23,255,455
58,528.71000		12/18/2014		58,528.71	5,610,975	1.000000000S 77.736574249	58,528.71	4,549,821	0	-1,061,154	-1,061,154
24,573.92000		12/29/2014		24,573.92	2,401,342	1.000000000S 77.736574249	24,573.92	1,910,292	0	-491,050	-491,050
485,468.43000		12/30/2014		485,468.43	47,691,683	1.000000000S 77.736574249	485,468.43	37,738,653	0	-9,953,030	-9,953,030
1,564.21000		12/31/2014		1,564.21	153,474	1.000000000S 77.736574249	1,564.21	121,596	0	-31,878	-31,878

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米ドルです。

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 2016年8月31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											
1,300,000.00000		1/12/2015		1,300,000.00	126,516,938	1.000000000S 77.736574249	1,300,000.00	101,057,547	0	-25,459,391	-25,459,391
207,747.74000		1/27/2015		207,747.74	19,495,459	1.000000000S 77.736574249	207,747.74	16,149,598	0	-3,345,861	-3,345,861
696,374.06000		1/29/2015		696,374.06	65,271,775	1.000000000S 77.736574249	696,374.06	54,133,734	0	-11,138,041	-11,138,041
1,406.23000		1/30/2015		1,406.23	128,636	1.000000000S 77.736574249	1,406.23	109,316	0	-19,320	-19,320
206,582.45000		1/30/2015		206,582.45	18,993,836	1.000000000S 77.736574249	206,582.45	16,059,012	0	-2,934,824	-2,934,824
54,791.29000		2/2/2015		54,791.29	5,012,081	1.000000000S 77.736574249	54,791.29	4,259,287	0	-752,794	-752,794
253,877.80000		2/3/2015		253,877.80	23,278,426	1.000000000S 77.736574249	253,877.80	19,735,590	0	-3,542,836	-3,542,836
205,542.23000		2/4/2015		205,542.23	18,576,235	1.000000000S 77.736574249	205,542.23	15,978,149	0	-2,598,086	-2,598,086
115,628.17000		2/13/2015		115,628.17	10,612,693	1.000000000S 77.736574249	115,628.17	8,988,538	0	-1,624,155	-1,624,155
29,412.99000		2/17/2015		29,412.99	2,709,706	1.000000000S 77.736574249	29,412.99	2,286,465	0	-423,241	-423,241
667,933.59000		2/17/2015		667,933.59	61,534,158	1.000000000S 77.736574249	667,933.59	51,922,869	0	-9,611,289	-9,611,289
326,807.08000		2/19/2015		326,807.08	30,343,940	1.000000000S 77.736574249	326,807.08	25,404,863	0	-4,939,077	-4,939,077
2,192,063.20000		2/24/2015		2,192,063.20	203,418,105	1.000000000S 77.736574249	2,192,063.20	170,403,484	0	-33,014,621	-33,014,621
53,434.29000		2/26/2015		53,434.29	5,009,829	1.000000000S 77.736574249	53,434.29	4,153,799	0	-856,030	-856,030
2,003.28000		2/27/2015		2,003.28	187,455	1.000000000S 77.736574249	2,003.28	155,728	0	-31,727	-31,727

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
61,389.07000		2/27/2015		61,389.07	5,734,296	1.000000000S 77.736574249	61,389.07	4,772,176	0	-962,120	-962,120
8,272.79000		3/4/2015		8,272.79	774,772	1.000000000S 77.736574249	8,272.79	643,098	0	-131,674	-131,674
73,974.98000		3/5/2015		73,974.98	6,922,876	1.000000000S 77.736574249	73,974.98	5,750,562	0	-1,172,314	-1,172,314
6,525.72000		3/10/2015		6,525.72	610,308	1.000000000S 77.736574249	6,525.72	507,287	0	-103,021	-103,021
30,000.03000		3/12/2015		30,000.03	2,763,346	1.000000000S 77.736574249	30,000.03	2,332,100	0	-431,246	-431,246
169,508.06000		3/16/2015		169,508.06	15,673,421	1.000000000S 77.736574249	169,508.06	13,176,976	0	-2,496,445	-2,496,445
494,617.75000		3/18/2015		494,617.75	45,673,172	1.000000000S 77.736574249	494,617.75	38,449,889	0	-7,223,283	-7,223,283
493,314.13000		3/19/2015		493,314.13	45,648,649	1.000000000S 77.736574249	493,314.13	38,348,550	0	-7,300,099	-7,300,099
60,525.11000		3/20/2015		60,525.11	5,576,441	1.000000000S 77.736574249	60,525.11	4,705,015	0	-871,426	-871,426
637,230.13000		3/24/2015		637,230.13	59,886,633	1.000000000S 77.736574249	637,230.13	49,536,087	0	-10,350,546	-10,350,546
3,884.02000		3/31/2015		3,884.02	355,841	1.000000000S 77.736574249	3,884.02	301,930	0	-53,911	-53,911
281,169.60000		4/1/2015		281,169.60	25,759,832	1.000000000S 77.736574249	281,169.60	21,857,161	0	-3,902,671	-3,902,671
52,665.13000		4/10/2015		52,665.13	4,878,576	1.000000000S 77.736574249	52,665.13	4,094,007	0	-784,569	-784,569
94,219.67000		4/16/2015		94,219.67	8,562,177	1.000000000S 77.736574249	94,219.67	7,324,314	0	-1,237,863	-1,237,863
185,609.77000		4/16/2015		185,609.77	16,867,218	1.000000000S 77.736574249	185,609.77	14,428,668	0	-2,438,550	-2,438,550

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
979,482.42000		4/16/2015		979,482.42	89,010,097	1.000000000S 77.736574249	979,482.42	76,141,608	0	-12,868,489	-12,868,489
1,084,907.81000		4/16/2015		1,084,907.81	98,590,590	1.000000000S 77.736574249	1,084,907.81	84,337,017	0	-14,253,573	-14,253,573
95,260.21000		4/22/2015		95,260.21	8,815,560	1.000000000S 77.736574249	95,260.21	7,405,202	0	-1,410,358	-1,410,358
1,200,000.00000		4/27/2015		1,200,000.00	111,722,034	1.000000000S 77.736574249	1,200,000.00	93,283,889	0	-18,438,145	-18,438,145
1,624.58000		4/30/2015		1,624.58	153,344	1.000000000S 77.736574249	1,624.58	126,289	0	-27,055	-27,055
97,398.84000		5/7/2015		97,398.84	9,322,518	1.000000000S 77.736574249	97,398.84	7,571,452	0	-1,751,066	-1,751,066
1,200,000.00000		5/12/2015		1,200,000.00	113,914,267	1.000000000S 77.736574249	1,200,000.00	93,283,889	0	-20,630,378	-20,630,378
1,204.66000		5/18/2015		1,204.66	115,742	1.000000000S 77.736574249	1,204.66	93,646	0	-22,096	-22,096
102,958.65000		5/21/2015		102,958.65	9,829,791	1.000000000S 77.736574249	102,958.65	8,003,653	0	-1,826,138	-1,826,138
240,337.15000		5/27/2015		240,337.15	22,898,966	1.000000000S 77.736574249	240,337.15	18,682,987	0	-4,215,979	-4,215,979
1,040.35000		5/29/2015		1,040.35	98,821	1.000000000S 77.736574249	1,040.35	80,873	0	-17,948	-17,948
58,140.06000		6/4/2015		58,140.06	5,632,409	1.000000000S 77.736574249	58,140.06	4,519,609	0	-1,112,800	-1,112,800
463,495.15000		6/5/2015		463,495.15	44,299,139	1.000000000S 77.736574249	463,495.15	36,030,525	0	-8,268,614	-8,268,614
86,583.78000		6/9/2015		86,583.78	8,282,560	1.000000000S 77.736574249	86,583.78	6,730,726	0	-1,551,834	-1,551,834
1,000,000.00000		6/11/2015		1,000,000.00	95,109,932	1.000000000S 77.736574249	1,000,000.00	77,736,574	0	-17,373,358	-17,373,358

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
950,000.00000		6/23/2015		950,000.00	90,927,877	1.000000000S 77.736574249	950,000.00	73,849,746	0	-17,078,131	-17,078,131
742.88000		6/30/2015		742.88	69,868	1.000000000S 77.736574249	742.88	57,749	0	-12,119	-12,119
87,175.55000		7/2/2015		87,175.55	8,216,800	1.000000000S 77.736574249	87,175.55	6,776,729	0	-1,440,071	-1,440,071
1,500,000.00000		7/8/2015		1,500,000.00	136,124,157	1.000000000S 77.736574249	1,500,000.00	116,604,861	0	-19,519,296	-19,519,296
5,077.27000		7/9/2015		5,077.27	457,130	1.000000000S 77.736574249	5,077.27	394,690	0	-62,440	-62,440
100,237.08000		7/17/2015		100,237.08	9,227,204	1.000000000S 77.736574249	100,237.08	7,792,087	0	-1,435,117	-1,435,117
945.93000		7/31/2015		945.93	86,063	1.000000000S 77.736574249	945.93	73,533	0	-12,530	-12,530
88,380.65000		7/31/2015		88,380.65	7,994,358	1.000000000S 77.736574249	88,380.65	6,870,409	0	-1,123,949	-1,123,949
1,940,000.00000		8/7/2015		1,940,000.00	177,758,540	1.000000000S 77.736574249	1,940,000.00	150,808,954	0	-26,949,586	-26,949,586
7,650,000.00000		8/11/2015		7,650,000.00	704,316,836	1.000000000S 77.736574249	7,650,000.00	594,684,793	0	-109,632,043	-109,632,043
479,833.36000		8/13/2015		479,833.36	43,809,780	1.000000000S 77.736574249	479,833.36	37,300,602	0	-6,509,178	-6,509,178
75,403.65000		8/18/2015		75,403.65	6,920,738	1.000000000S 77.736574249	75,403.65	5,861,621	0	-1,059,117	-1,059,117
1,260,000.00000		8/25/2015		1,260,000.00	107,638,641	1.000000000S 77.736574249	1,260,000.00	97,948,084	0	-9,690,557	-9,690,557
20,000.03000		8/28/2015		20,000.03	1,724,493	1.000000000S 77.736574249	20,000.03	1,554,734	0	-169,759	-169,759
1,123.56000		8/31/2015		1,123.56	96,530	1.000000000S 77.736574249	1,123.56	87,342	0	-9,188	-9,188

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
1,500,000.00000		9/8/2015		1,500,000.00	124,005,422	1.000000000S 77.736574249	1,500,000.00	116,604,861	0	-7,400,561	-7,400,561
1,500,000.00000		9/14/2015		1,500,000.00	127,701,060	1.000000000S 77.736574249	1,500,000.00	116,604,861	0	-11,096,199	-11,096,199
1,200,000.00000		9/17/2015		1,200,000.00	104,033,759	1.000000000S 77.736574249	1,200,000.00	93,283,889	0	-10,749,870	-10,749,870
4,580.00000		9/29/2015		4,580.00	384,148	1.000000000S 77.736574249	4,580.00	356,034	0	-28,114	-28,114
1,050.33000		9/30/2015		1,050.33	88,338	1.000000000S 77.736574249	1,050.33	81,649	0	-6,689	-6,689
41,308.36000		10/2/2015		41,308.36	3,484,596	1.000000000S 77.736574249	41,308.36	3,211,170	0	-273,426	-273,426
1,200,000.00000		10/7/2015		1,200,000.00	102,916,819	1.000000000S 77.736574249	1,200,000.00	93,283,889	0	-9,632,930	-9,632,930
479,833.36000		10/14/2015		479,833.36	41,980,363	1.000000000S 77.736574249	479,833.36	37,300,602	0	-4,679,761	-4,679,761
34,504.30000		10/19/2015		34,504.30	2,988,523	1.000000000S 77.736574249	34,504.30	2,682,246	0	-306,277	-306,277
1,500,000.00000		10/21/2015		1,500,000.00	130,659,384	1.000000000S 77.736574249	1,500,000.00	116,604,861	0	-14,054,523	-14,054,523
146,966.97000		10/23/2015		146,966.97	12,774,602	1.000000000S 77.736574249	146,966.97	11,424,709	0	-1,349,893	-1,349,893
33,373.73000		10/28/2015		33,373.73	2,903,788	1.000000000S 77.736574249	33,373.73	2,594,359	0	-309,429	-309,429
1,210.89000		10/30/2015		1,210.89	104,252	1.000000000S 77.736574249	1,210.89	94,130	0	-10,122	-10,122
191,801.71000		11/2/2015		191,801.71	16,513,279	1.000000000S 77.736574249	191,801.71	14,910,008	0	-1,603,271	-1,603,271
1,450.44000		11/9/2015		1,450.44	125,722	1.000000000S 77.736574249	1,450.44	112,752	0	-12,970	-12,970

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
1,100,000.00000		11/10/2015		1,100,000.00	95,614,298	1.000000000S 77.736574249	1,100,000.00	85,510,232	0	-10,104,066	-10,104,066
1,370,000.00000		11/20/2015		1,370,000.00	121,160,088	1.000000000S 77.736574249	1,370,000.00	106,499,107	0	-14,660,981	-14,660,981
1,241.63000		11/30/2015		1,241.63	110,913	1.000000000S 77.736574249	1,241.63	96,520	0	-14,393	-14,393
55,217.71000		11/30/2015		55,217.71	4,875,314	1.000000000S 77.736574249	55,217.71	4,292,436	0	-582,878	-582,878
67,803.25000		12/2/2015		67,803.25	6,086,449	1.000000000S 77.736574249	67,803.25	5,270,792	0	-815,657	-815,657
1,200,000.00000		12/8/2015		1,200,000.00	107,613,376	1.000000000S 77.736574249	1,200,000.00	93,283,889	0	-14,329,487	-14,329,487
479,833.36000		12/14/2015		479,833.36	41,838,537	1.000000000S 77.736574249	479,833.36	37,300,602	0	-4,537,935	-4,537,935
1,300,000.00000		12/14/2015		1,300,000.00	113,352,056	1.000000000S 77.736574249	1,300,000.00	101,057,547	0	-12,294,509	-12,294,509
920,000.00000		12/18/2015		920,000.00	80,272,386	1.000000000S 77.736574249	920,000.00	71,517,648	0	-8,754,738	-8,754,738
7,027.13000		12/21/2015		7,027.13	613,059	1.000000000S 77.736574249	7,027.13	546,265	0	-66,794	-66,794
69,609.63000		12/22/2015		69,609.63	6,058,273	1.000000000S 77.736574249	69,609.63	5,411,214	0	-647,059	-647,059
30,652.58000		12/24/2015		30,652.58	2,680,171	1.000000000S 77.736574249	30,652.58	2,382,827	0	-297,344	-297,344
31,897.52000		12/29/2015		31,897.52	2,787,126	1.000000000S 77.736574249	31,897.52	2,479,604	0	-307,522	-307,522
930.50000		12/31/2015		930.50	81,438	1.000000000S 77.736574249	930.50	72,334	0	-9,104	-9,104
64,476.82000		1/6/2016		64,476.82	5,481,018	1.000000000S 77.736574249	64,476.82	5,012,207	0	-468,811	-468,811

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
29,058.54000		1/14/2016		29,058.54	2,404,861	1.000000000S 77.736574249	29,058.54	2,258,911	0	-145,950	-145,950
306,365.43000		1/20/2016		306,365.43	24,967,386	1.000000000S 77.736574249	306,365.43	23,815,799	0	-1,151,587	-1,151,587
453,323.95000		1/25/2016		453,323.95	37,747,169	1.000000000S 77.736574249	453,323.95	35,239,851	0	-2,507,318	-2,507,318
54,860.74000		1/28/2016		54,860.74	4,588,058	1.000000000S 77.736574249	54,860.74	4,264,686	0	-323,372	-323,372
778.74000		1/29/2016		778.74	66,688	1.000000000S 77.736574249	778.74	60,537	0	-6,151	-6,151
9,624.24000		2/2/2016		9,624.24	825,300	1.000000000S 77.736574249	9,624.24	748,155	0	-77,145	-77,145
45,449.01000		2/3/2016		45,449.01	3,852,337	1.000000000S 77.736574249	45,449.01	3,533,050	0	-319,287	-319,287
900,000.00000		2/19/2016		900,000.00	73,080,576	1.000000000S 77.736574249	900,000.00	69,962,917	0	-3,117,659	-3,117,659
549.31000		2/29/2016		549.31	44,286	1.000000000S 77.736574249	549.31	42,701	0	-1,585	-1,585
549.31000		2/29/2016		549.31	7	1.000000000S 77.736574249	549.31	42,701	0	42,694	42,694
300,000.00000		3/11/2016		300,000.00	25,334,694	1.000000000S 77.736574249	300,000.00	23,320,972	0	-2,013,722	-2,013,722
870,000.00000		3/18/2016		870,000.00	73,945,274	1.000000000S 77.736574249	870,000.00	67,630,820	0	-6,314,454	-6,314,454
670.89000		3/31/2016		670.89	58,005	1.000000000S 77.736574249	670.89	52,153	0	-5,852	-5,852
670.89000		3/31/2016		670.89	8	1.000000000S 77.736574249	670.89	52,153	0	52,145	52,145
49,152.02000		4/1/2016		49,152.02	4,249,676	1.000000000S 77.736574249	49,152.02	3,820,910	0	-428,766	-428,766

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
0.11000		4/4/2016		0.11	9	1.000000000S 77.736574249	0.11	9	0	0	0
118,557.70000		4/4/2016		118,557.70	10,179,618	1.000000000S 77.736574249	118,557.70	9,216,269	0	-963,349	-963,349
54,704.79000		4/7/2016		54,704.79	4,550,661	1.000000000S 77.736574249	54,704.79	4,252,563	0	-298,098	-298,098
1,000,000.00000		4/13/2016		1,000,000.00	82,840,523	1.000000000S 77.736574249	1,000,000.00	77,736,574	0	-5,103,949	-5,103,949
279,833.36000		4/18/2016		279,833.36	23,441,485	1.000000000S 77.736574249	279,833.36	21,753,287	0	-1,688,198	-1,688,198
2,500,000.00000		4/21/2016		2,500,000.00	213,220,853	1.000000000S 77.736574249	2,500,000.00	194,341,436	0	-18,879,417	-18,879,417
9,845.91000		4/22/2016		9,845.91	837,399	1.000000000S 77.736574249	9,845.91	765,387	0	-72,012	-72,012
71,738.60000		4/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000S 77.736574249	71,738.60	5,576,713	0	-472,315	-472,315
651.99000		4/29/2016		651.99	8	1.000000000S 77.736574249	651.99	50,683	0	50,675	50,675
651.99000		4/29/2016		651.99	53,237	1.000000000S 77.736574249	651.99	50,683	0	-2,554	-2,554
3,199.32000		5/6/2016		3,199.32	256,662	1.000000000S 77.736574249	3,199.32	248,704	0	-7,958	-7,958
37,851.41000		5/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000S 77.736574249	37,851.41	2,942,439	0	-60,327	-60,327
52,780.08000		5/13/2016		52,780.08	4,214,171	1.000000000S 77.736574249	52,780.08	4,102,943	0	-111,228	-111,228
1,000,000.00000		5/18/2016		1,000,000.00	79,969,300	1.000000000S 77.736574249	1,000,000.00	77,736,574	0	-2,232,726	-2,232,726
28,390.46000		5/26/2016		28,390.46	2,250,076	1.000000000S 77.736574249	28,390.46	2,206,977	0	-43,099	-43,099

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
487.18000		5/31/2016		487.18	39,143	1.000000000S 77.736574249	487.18	37,872	0	-1,271	-1,271
77,920.52000		6/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000S 77.736574249	77,920.52	6,057,274	0	-59,482	-59,482
435,877.61000		6/24/2016		435,877.61	34,923,776	1.000000000S 77.736574249	435,877.61	33,883,632	0	-1,040,144	-1,040,144
193,723.40000		6/27/2016		193,723.40	14,830,685	1.000000000S 77.736574249	193,723.40	15,059,393	0	228,708	228,708
51,500.28000		6/28/2016		51,500.28	3,847,670	1.000000000S 77.736574249	51,500.28	4,003,455	0	155,785	155,785
370.39000		6/30/2016		370.39	28,294	1.000000000S 77.736574249	370.39	28,793	0	499	499
41,200.23000		6/30/2016		41,200.23	3,144,683	1.000000000S 77.736574249	41,200.23	3,202,765	0	58,082	58,082
28,419.86000		7/6/2016		28,419.86	2,155,687	1.000000000S 77.736574249	28,419.86	2,209,263	0	53,576	53,576
975,728.88000		7/8/2016		975,728.88	73,727,142	1.000000000S 77.736574249	975,728.88	75,849,821	0	2,122,679	2,122,679
10,303.13000		7/19/2016		10,303.13	827,218	1.000000000S 77.736574249	10,303.13	800,930	0	-26,288	-26,288
85,548.05000		7/26/2016		85,548.05	6,769,315	1.000000000S 77.736574249	85,548.05	6,650,212	0	-119,103	-119,103
49,430.39000		7/27/2016		49,430.39	3,887,241	1.000000000S 77.736574249	49,430.39	3,842,549	0	-44,692	-44,692
966.37000		7/29/2016		966.37	75,274	1.000000000S 77.736574249	966.37	75,122	0	-152	-152
279,833.36000		8/18/2016		279,833.36	21,425,498	1.000000000S 77.736574249	279,833.36	21,753,287	0	327,789	327,789
900,000.00000		8/23/2016		900,000.00	68,935,762	1.000000000S 77.736574249	900,000.00	69,962,917	0	1,027,155	1,027,155

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
2,905.89000		8/31/2016		2,905.89	224,400	1.000000000S 77.736574249	2,905.89	225,894	0	1,494	1,494
-9,598,636.48000		10/15/2014		-9,598,636.48	-896,719,529	1.000000000S 77.736574249	-9,598,636.48	-746,165,117	0	150,554,412	150,554,412
-2,000,000.00000		10/15/2014		-2,000,000.00	-186,843,106	1.000000000S 77.736574249	-2,000,000.00	-155,473,148	0	31,369,958	31,369,958
-124,452.66000		10/16/2014		-124,452.66	-11,611,456	1.000000000S 77.736574249	-124,452.66	-9,674,523	0	1,936,933	1,936,933
-95,422.92000		10/17/2014		-95,422.92	-8,874,101	1.000000000S 77.736574249	-95,422.92	-7,417,851	0	1,456,250	1,456,250
-212,367.10000		10/20/2014		-212,367.10	-19,830,814	1.000000000S 77.736574249	-212,367.10	-16,508,691	0	3,322,123	3,322,123
-96,073.00000		10/21/2014		-96,073.00	-9,020,412	1.000000000S 77.736574249	-96,073.00	-7,468,386	0	1,552,026	1,552,026
-180,163.29000		10/22/2014		-180,163.29	-16,932,785	1.000000000S 77.736574249	-180,163.29	-14,005,277	0	2,927,508	2,927,508
-134,048.72000		10/22/2014		-134,048.72	-12,598,672	1.000000000S 77.736574249	-134,048.72	-10,420,488	0	2,178,184	2,178,184
-11,302.59000		10/22/2014		-11,302.59	-1,062,283	1.000000000S 77.736574249	-11,302.59	-878,625	0	183,658	183,658
-107,152.67000		10/23/2014		-107,152.67	-10,114,159	1.000000000S 77.736574249	-107,152.67	-8,329,681	0	1,784,478	1,784,478
-31,285.75000		10/24/2014		-31,285.75	-2,965,041	1.000000000S 77.736574249	-31,285.75	-2,432,047	0	532,994	532,994
-132,121.93000		10/28/2014		-132,121.93	-12,520,174	1.000000000S 77.736574249	-132,121.93	-10,270,706	0	2,249,468	2,249,468
-482,451.36000		10/29/2014		-482,451.36	-46,100,869	1.000000000S 77.736574249	-482,451.36	-37,504,116	0	8,596,753	8,596,753
-290,633.73000		10/30/2014		-290,633.73	-27,973,317	1.000000000S 77.736574249	-290,633.73	-22,592,871	0	5,380,446	5,380,446

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-237,376.05000		11/5/2014		-237,376.05	-23,468,631	1.000000000S 77.736574249	-237,376.05	-18,452,801	0	5,015,830	5,015,830
-60,273.52000		11/6/2014		-60,273.52	-5,930,648	1.000000000S 77.736574249	-60,273.52	-4,685,457	0	1,245,191	1,245,191
-911,057.13000		11/7/2014		-911,057.13	-89,780,968	1.000000000S 77.736574249	-911,057.13	-70,822,460	0	18,958,508	18,958,508
-395,964.91000		11/10/2014		-395,964.91	-39,200,790	1.000000000S 77.736574249	-395,964.91	-30,780,956	0	8,419,834	8,419,834
-614,649.22000		11/12/2014		-614,649.22	-61,634,256	1.000000000S 77.736574249	-614,649.22	-47,780,725	0	13,853,531	13,853,531
-70,444.68000		11/12/2014		-70,444.68	-7,063,875	1.000000000S 77.736574249	-70,444.68	-5,476,128	0	1,587,747	1,587,747
-54,603.48000		11/13/2014		-54,603.48	-5,490,877	1.000000000S 77.736574249	-54,603.48	-4,244,687	0	1,246,190	1,246,190
-319,964.21000		11/17/2014		-319,964.21	-32,542,269	1.000000000S 77.736574249	-319,964.21	-24,872,922	0	7,669,347	7,669,347
-20,035.87000		11/18/2014		-20,035.87	-2,032,868	1.000000000S 77.736574249	-20,035.87	-1,557,520	0	475,348	475,348
-213,850.66000		11/19/2014		-213,850.66	-21,776,026	1.000000000S 77.736574249	-213,850.66	-16,624,018	0	5,152,008	5,152,008
-9,364.59000		11/20/2014		-9,364.59	-950,919	1.000000000S 77.736574249	-9,364.59	-727,971	0	222,948	222,948
-2,545,581.34000		11/21/2014		-2,545,581.34	-259,289,652	1.000000000S 77.736574249	-2,545,581.34	-197,884,773	0	61,404,879	61,404,879
-89,212.14000		11/25/2014		-89,212.14	-9,098,869	1.000000000S 77.736574249	-89,212.14	-6,935,046	0	2,163,823	2,163,823
-603,479.44000		11/26/2014		-603,479.44	-60,728,438	1.000000000S 77.736574249	-603,479.44	-46,912,424	0	13,816,014	13,816,014
-86,787.10000		11/28/2014		-86,787.10	-8,741,712	1.000000000S 77.736574249	-86,787.10	-6,746,532	0	1,995,180	1,995,180

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-336,619.36000		12/1/2014		-336,619.36	-34,098,751	1.000000000S 77.736574249	-336,619.36	-26,167,636	0	7,931,115	7,931,115
-93,678.58000		12/2/2014		-93,678.58	-9,411,623	1.000000000S 77.736574249	-93,678.58	-7,282,252	0	2,129,371	2,129,371
-214,564.97000		12/3/2014		-214,564.97	-21,617,415	1.000000000S 77.736574249	-214,564.97	-16,679,546	0	4,937,869	4,937,869
-435,539.26000		12/4/2014		-435,539.26	-43,903,822	1.000000000S 77.736574249	-435,539.26	-33,857,330	0	10,046,492	10,046,492
-301,627.51000		12/9/2014		-301,627.51	-30,314,256	1.000000000S 77.736574249	-301,627.51	-23,447,489	0	6,866,767	6,866,767
-128,649.45000		12/10/2014		-128,649.45	-12,782,326	1.000000000S 77.736574249	-128,649.45	-10,000,768	0	2,781,558	2,781,558
-701,988.29000		12/11/2014		-701,988.29	-69,264,315	1.000000000S 77.736574249	-701,988.29	-54,570,165	0	14,694,150	14,694,150
-69,226.87000		12/11/2014		-69,226.87	-6,830,529	1.000000000S 77.736574249	-69,226.87	-5,381,460	0	1,449,069	1,449,069
-233,220.13000		12/12/2014		-233,220.13	-22,988,872	1.000000000S 77.736574249	-233,220.13	-18,129,734	0	4,859,138	4,859,138
-1,012,066.41000		12/15/2014		-1,012,066.41	-98,967,724	1.000000000S 77.736574249	-1,012,066.41	-78,674,576	0	20,293,148	20,293,148
-882,994.13000		12/15/2014		-882,994.13	-86,346,033	1.000000000S 77.736574249	-882,994.13	-68,640,939	0	17,705,094	17,705,094
-667,933.59000		12/15/2014		-667,933.59	-65,315,741	1.000000000S 77.736574249	-667,933.59	-51,922,869	0	13,392,872	13,392,872
-230,255.10000		12/16/2014		-230,255.10	-22,377,237	1.000000000S 77.736574249	-230,255.10	-17,899,243	0	4,477,994	4,477,994
-67,739.36000		12/17/2014		-67,739.36	-6,523,402	1.000000000S 77.736574249	-67,739.36	-5,265,826	0	1,257,576	1,257,576
-244,669.86000		12/19/2014		-244,669.86	-23,723,117	1.000000000S 77.736574249	-244,669.86	-19,019,797	0	4,703,320	4,703,320

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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	1.000000000S 77.736574249	-148,648.91	-11,555,457	0	2,912,465	2,912,465
-151,043.46000		12/24/2014		-151,043.46	-14,765,543	1.000000000S 77.736574249	-151,043.46	-11,741,601	0	3,023,942	3,023,942
-105,843.81000		1/5/2015		-105,843.81	-10,336,129	1.000000000S 77.736574249	-105,843.81	-8,227,935	0	2,108,194	2,108,194
-204,027.32000		1/7/2015		-204,027.32	-19,651,794	1.000000000S 77.736574249	-204,027.32	-15,860,385	0	3,791,409	3,791,409
-92,171.03000		1/8/2015		-92,171.03	-8,853,375	1.000000000S 77.736574249	-92,171.03	-7,165,060	0	1,688,315	1,688,315
-686,560.80000		1/9/2015		-686,560.80	-66,622,818	1.000000000S 77.736574249	-686,560.80	-53,370,885	0	13,251,933	13,251,933
-296,399.69000		1/13/2015		-296,399.69	-28,690,461	1.000000000S 77.736574249	-296,399.69	-23,041,097	0	5,649,364	5,649,364
-20,527.98000		1/14/2015		-20,527.98	-1,983,598	1.000000000S 77.736574249	-20,527.98	-1,595,775	0	387,823	387,823
-39,405.57000		1/15/2015		-39,405.57	-3,758,292	1.000000000S 77.736574249	-39,405.57	-3,063,254	0	695,038	695,038
-39,335.92000		1/21/2015		-39,335.92	-3,807,263	1.000000000S 77.736574249	-39,335.92	-3,057,840	0	749,423	749,423
-144,341.08000		1/22/2015		-144,341.08	-13,851,088	1.000000000S 77.736574249	-144,341.08	-11,220,581	0	2,630,507	2,630,507
-140,447.93000		1/22/2015		-140,447.93	-13,477,498	1.000000000S 77.736574249	-140,447.93	-10,917,941	0	2,559,557	2,559,557
-131,846.04000		1/22/2015		-131,846.04	-12,652,054	1.000000000S 77.736574249	-131,846.04	-10,249,259	0	2,402,795	2,402,795
-11,116.87000		1/22/2015		-11,116.87	-1,066,784	1.000000000S 77.736574249	-11,116.87	-864,187	0	202,597	202,597
-9,303.87000		1/28/2015		-9,303.87	-869,334	1.000000000S 77.736574249	-9,303.87	-723,251	0	146,083	146,083

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米ドルです。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-258,206.95000		2/5/2015		-258,206.95	-23,515,972	1.0000000000 ^S 77.736574249	-258,206.95	-20,072,124	0	3,443,848	3,443,848
-128,192.28000		2/9/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.0000000000 ^S 77.736574249	-128,192.28	-9,965,229	0	1,947,022	1,947,022
-76,498.09000		2/10/2015		-76,498.09	-7,094,696	1.0000000000 ^S 77.736574249	-76,498.09	-5,946,699	0	1,147,997	1,147,997
-643,025.87000		2/12/2015		-643,025.87	-59,704,371	1.0000000000 ^S 77.736574249	-643,025.87	-49,986,628	0	9,717,743	9,717,743
-195,720.57000		2/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.0000000000 ^S 77.736574249	-195,720.57	-15,214,647	0	2,955,670	2,955,670
-12,078.57000		2/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.0000000000 ^S 77.736574249	-12,078.57	-938,947	0	181,011	181,011
-203,751.45000		2/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.0000000000 ^S 77.736574249	-203,751.45	-15,838,940	0	3,110,141	3,110,141
-16,686.40000		2/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.0000000000 ^S 77.736574249	-16,686.40	-1,297,144	0	257,569	257,569
-164,421.91000		3/2/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.0000000000 ^S 77.736574249	-164,421.91	-12,781,596	0	2,603,996	2,603,996
-12,405.71000		3/3/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.0000000000 ^S 77.736574249	-12,405.71	-964,377	0	195,496	195,496
-125,474.92000		3/6/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.0000000000 ^S 77.736574249	-125,474.92	-9,753,990	0	1,970,160	1,970,160
-152,618.80000		3/9/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.0000000000 ^S 77.736574249	-152,618.80	-11,864,063	0	2,431,636	2,431,636
-708,611.63000		3/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.0000000000 ^S 77.736574249	-708,611.63	-55,085,041	0	10,522,190	10,522,190
-27,978.64000		3/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.0000000000 ^S 77.736574249	-27,978.64	-2,174,964	0	415,455	415,455
-174,287.44000		3/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.0000000000 ^S 77.736574249	-174,287.44	-13,548,509	0	2,737,326	2,737,326

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-7,763.28000		3/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000S 77.736574249	-7,763.28	-603,491	0	117,493	117,493
-302,844.98000		3/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000S 77.736574249	-302,844.98	-23,542,131	0	4,721,717	4,721,717
-97,995.40000		3/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000S 77.736574249	-97,995.40	-7,617,827	0	1,630,488	1,630,488
-172,798.05000		3/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000S 77.736574249	-172,798.05	-13,432,728	0	2,774,183	2,774,183
-975,466.76000		3/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000S 77.736574249	-975,466.76	-75,829,444	0	15,125,178	15,125,178
-256,508.24000		3/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000S 77.736574249	-256,508.24	-19,940,072	0	3,754,322	3,754,322
-189,563.24000		3/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000S 77.736574249	-189,563.24	-14,735,997	0	2,641,301	2,641,301
-206,250.64000		4/2/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000S 77.736574249	-206,250.64	-16,033,218	0	2,765,724	2,765,724
-90,318.63000		4/7/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000S 77.736574249	-90,318.63	-7,021,061	0	1,173,620	1,173,620
-74,243.21000		4/8/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000S 77.736574249	-74,243.21	-5,771,413	0	1,064,238	1,064,238
-78,171.43000		4/9/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000S 77.736574249	-78,171.43	-6,076,779	0	1,142,111	1,142,111
-705,086.17000		4/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000S 77.736574249	-705,086.17	-54,810,983	0	10,297,720	10,297,720
-37,651.50000		4/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000S 77.736574249	-37,651.50	-2,926,899	0	549,896	549,896
-246,307.80000		4/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000S 77.736574249	-246,307.80	-19,147,125	0	3,286,638	3,286,638
-57,294.63000		4/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000S 77.736574249	-57,294.63	-4,453,888	0	766,236	766,236

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-39,422.26000		4/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000S 77.736574249	-39,422.26	-3,064,551	0	582,071	582,071
-167,462.13000		4/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000S 77.736574249	-167,462.13	-13,017,932	0	2,411,428	2,411,428
-11,204.33000		4/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000S 77.736574249	-11,204.33	-870,986	0	161,341	161,341
-58,785.17000		4/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000S 77.736574249	-58,785.17	-4,569,758	0	898,407	898,407
-203,446.05000		4/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000S 77.736574249	-203,446.05	-15,815,199	0	3,095,070	3,095,070
-19,719.18000		4/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000S 77.736574249	-19,719.18	-1,532,902	0	302,987	302,987
-746,896.35000		4/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000S 77.736574249	-746,896.35	-58,061,164	0	11,937,562	11,937,562
-47,545.85000		4/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000S 77.736574249	-47,545.85	-3,696,051	0	859,992	859,992
-35,878.86000		5/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000S 77.736574249	-35,878.86	-2,789,100	0	606,844	606,844
-59,220.06000		5/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000S 77.736574249	-59,220.06	-4,603,565	0	1,018,110	1,018,110
-684,441.51000		5/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000S 77.736574249	-684,441.51	-53,206,138	0	12,255,390	12,255,390
-157,020.19000		5/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000S 77.736574249	-157,020.19	-12,206,212	0	2,811,553	2,811,553
-45,251.01000		5/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000S 77.736574249	-45,251.01	-3,517,658	0	846,858	846,858
-518,763.75000		5/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000S 77.736574249	-518,763.75	-40,326,917	0	9,197,168	9,197,168
-6,306.57000		5/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000S 77.736574249	-6,306.57	-490,251	0	111,609	111,609

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-52,113.71000		5/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000S 77.736574249	-52,113.71	-4,051,141	0	901,466	901,466
-393,354.22000		5/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000S 77.736574249	-393,354.22	-30,578,010	0	6,754,975	6,754,975
-245,742.67000		6/1/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000S 77.736574249	-245,742.67	-19,103,193	0	4,239,539	4,239,539
-5,170.70000		6/2/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000S 77.736574249	-5,170.70	-401,953	0	88,284	88,284
-78,821.02000		6/3/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000S 77.736574249	-78,821.02	-6,127,276	0	1,450,904	1,450,904
-113,860.14000		6/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000S 77.736574249	-113,860.14	-8,851,097	0	2,017,909	2,017,909
-666,844.90000		6/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000S 77.736574249	-666,844.90	-51,838,238	0	11,585,335	11,585,335
-110,710.67000		6/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000S 77.736574249	-110,710.67	-8,606,268	0	1,923,416	1,923,416
-54,834.71000		6/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000S 77.736574249	-54,834.71	-4,262,663	0	972,034	972,034
-83,284.46000		6/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000S 77.736574249	-83,284.46	-6,474,249	0	1,472,135	1,472,135
-479,833.36000		6/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000S 77.736574249	-479,833.36	-37,300,602	0	8,719,503	8,719,503
-17,695.85000		6/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000S 77.736574249	-17,695.85	-1,375,615	0	321,568	321,568
-470,587.90000		6/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000S 77.736574249	-470,587.90	-36,581,891	0	8,244,555	8,244,555
-156,011.32000		6/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000S 77.736574249	-156,011.32	-12,127,786	0	2,887,042	2,887,042
-49,769.29000		6/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000S 77.736574249	-49,769.29	-3,868,894	0	869,467	869,467

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-106,347.76000		6/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000S 77.736574249	-106,347.76	-8,267,111	0	1,911,811	1,911,811
-13,612.05000		6/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000S 77.736574249	-13,612.05	-1,058,154	0	243,226	243,226
-255,184.50000		6/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000S 77.736574249	-255,184.50	-19,837,169	0	4,338,708	4,338,708
-321,067.80000		6/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000S 77.736574249	-321,067.80	-24,958,711	0	5,177,761	5,177,761
-64,733.44000		7/1/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000S 77.736574249	-64,733.44	-5,032,156	0	1,056,008	1,056,008
-28,970.18000		7/6/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000S 77.736574249	-28,970.18	-2,252,043	0	420,703	420,703
-19,343.07000		7/8/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000S 77.736574249	-19,343.07	-1,503,664	0	251,709	251,709
-676,268.27000		7/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000S 77.736574249	-676,268.27	-52,570,779	0	8,370,558	8,370,558
-68,449.88000		7/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000S 77.736574249	-68,449.88	-5,321,059	0	847,243	847,243
-275,119.99000		7/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000S 77.736574249	-275,119.99	-21,386,886	0	3,656,225	3,656,225
-93,052.47000		7/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000S 77.736574249	-93,052.47	-7,233,580	0	1,292,412	1,292,412
-73,784.97000		7/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000S 77.736574249	-73,784.97	-5,735,791	0	1,024,804	1,024,804
-110,427.24000		7/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000S 77.736574249	-110,427.24	-8,584,235	0	1,588,007	1,588,007
-164,563.52000		7/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000S 77.736574249	-164,563.52	-12,792,604	0	2,269,336	2,269,336
-87,873.33000		7/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000S 77.736574249	-87,873.33	-6,830,972	0	1,079,940	1,079,940

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-13,601.15000		7/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000S 77.736574249	-13,601.15	-1,057,307	0	164,629	164,629
-59,933.50000		8/5/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000S 77.736574249	-59,933.50	-4,659,025	0	851,110	851,110
-143,187.55000		8/6/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000S 77.736574249	-143,187.55	-11,130,910	0	2,014,077	2,014,077
-158,035.75000		8/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000S 77.736574249	-158,035.75	-12,285,158	0	2,244,014	2,244,014
-669,741.07000		8/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000S 77.736574249	-669,741.07	-52,063,376	0	9,598,050	9,598,050
-284,337.22000		8/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000S 77.736574249	-284,337.22	-22,103,401	0	4,074,833	4,074,833
-7,892,527.01000		8/12/2015		-7,892,527.01	-718,905,956	1.000000000S 77.736574249	-7,892,527.01	-613,538,012	0	105,367,944	105,367,944
-156,845.94000		8/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000S 77.736574249	-156,845.94	-12,192,666	0	2,127,693	2,127,693
-53,128.21000		8/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000S 77.736574249	-53,128.21	-4,130,005	0	733,114	733,114
-162,199.09000		8/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000S 77.736574249	-162,199.09	-12,608,802	0	2,256,570	2,256,570
-21,061.93000		8/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000S 77.736574249	-21,061.93	-1,637,282	0	283,879	283,879
-265,076.96000		8/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000S 77.736574249	-265,076.96	-20,606,175	0	3,519,899	3,519,899
-19,404.32000		8/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000S 77.736574249	-19,404.32	-1,508,425	0	-1,508,212	-1,508,212
-196,668.41000		8/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000S 77.736574249	-196,668.41	-15,288,328	0	1,512,561	1,512,561
-462,149.98000		8/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000S 77.736574249	-462,149.98	-35,925,956	0	3,833,656	3,833,656

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-32,107.10000		8/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000S 77.736574249	-32,107.10	-2,495,896	0	222,927	222,927
-86,093.85000		9/1/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000S 77.736574249	-86,093.85	-6,692,641	0	704,035	704,035
-93,737.05000		9/2/2015		-93,737.05	-7,905,601	1.000000000S 77.736574249	-93,737.05	-7,286,797	0	618,804	618,804
-4,157.48000		9/3/2015		-4,157.48	-349,983	1.000000000S 77.736574249	-4,157.48	-323,188	0	26,795	26,795
-102,367.87000		9/4/2015		-102,367.87	-8,650,619	1.000000000S 77.736574249	-102,367.87	-7,957,728	0	692,891	692,891
-642,283.89000		9/9/2015		-642,283.89	-53,850,984	1.000000000S 77.736574249	-642,283.89	-49,928,949	0	3,922,035	3,922,035
-476,290.57000		9/10/2015		-476,290.57	-40,505,866	1.000000000S 77.736574249	-476,290.57	-37,025,197	0	3,480,669	3,480,669
-107,114.37000		9/11/2015		-107,114.37	-9,136,362	1.000000000S 77.736574249	-107,114.37	-8,326,704	0	809,658	809,658
-575,423.39000		9/14/2015		-575,423.39	-48,988,118	1.000000000S 77.736574249	-575,423.39	-44,731,443	0	4,256,675	4,256,675
-92,596.64000		9/14/2015		-92,596.64	-7,883,126	1.000000000S 77.736574249	-92,596.64	-7,198,146	0	684,980	684,980
-636,341.83000		9/15/2015		-636,341.83	-54,620,063	1.000000000S 77.736574249	-636,341.83	-49,467,034	0	5,153,029	5,153,029
-57,680.52000		9/16/2015		-57,680.52	-4,915,496	1.000000000S 77.736574249	-57,680.52	-4,483,886	0	431,610	431,610
-148,138.07000		9/17/2015		-148,138.07	-12,842,800	1.000000000S 77.736574249	-148,138.07	-11,515,746	0	1,327,054	1,327,054
-888,355.94000		9/18/2015		-888,355.94	-76,774,291	1.000000000S 77.736574249	-888,355.94	-69,057,747	0	7,716,544	7,716,544
-252,646.81000		9/24/2015		-252,646.81	-21,364,671	1.000000000S 77.736574249	-252,646.81	-19,639,898	0	1,724,773	1,724,773

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-49,056.91000		9/25/2015		-49,056.91	-4,093,695	1.000000000S 77.736574249	-49,056.91	-3,813,516	0	280,179	280,179
-72,142.91000		9/28/2015		-72,142.91	-6,115,979	1.000000000S 77.736574249	-72,142.91	-5,608,143	0	507,836	507,836
-70,823.93000		9/30/2015		-70,823.93	-5,954,410	1.000000000S 77.736574249	-70,823.93	-5,505,610	0	448,800	448,800
-198,025.63000		10/1/2015		-198,025.63	-16,654,940	1.000000000S 77.736574249	-198,025.63	-15,393,834	0	1,261,106	1,261,106
-122,307.91000		10/6/2015		-122,307.91	-10,416,695	1.000000000S 77.736574249	-122,307.91	-9,507,798	0	908,897	908,897
-39,456.54000		10/6/2015		-39,456.54	-3,360,426	1.000000000S 77.736574249	-39,456.54	-3,067,216	0	293,210	293,210
-17,998.66000		10/7/2015		-17,998.66	-1,543,637	1.000000000S 77.736574249	-17,998.66	-1,399,154	0	144,483	144,483
-94,044.65000		10/8/2015		-94,044.65	-8,145,767	1.000000000S 77.736574249	-94,044.65	-7,310,709	0	835,058	835,058
-413,942.78000		10/9/2015		-413,942.78	-35,732,854	1.000000000S 77.736574249	-413,942.78	-32,178,494	0	3,554,360	3,554,360
-18,029.52000		10/9/2015		-18,029.52	-1,556,365	1.000000000S 77.736574249	-18,029.52	-1,401,553	0	154,812	154,812
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324	1.000000000S 77.736574249	-201,846.72	-15,690,873	0	1,788,451	1,788,451
-106,109.09000		10/15/2015		-106,109.09	-9,188,731	1.000000000S 77.736574249	-106,109.09	-8,248,557	0	940,174	940,174
-13,046.14000		10/16/2015		-13,046.14	-1,131,560	1.000000000S 77.736574249	-13,046.14	-1,014,162	0	117,398	117,398
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340	1.000000000S 77.736574249	-938,332.24	-72,942,734	0	8,267,606	8,267,606
-52,217.18000		10/26/2015		-52,217.18	-4,570,998	1.000000000S 77.736574249	-52,217.18	-4,059,185	0	511,813	511,813

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268	1.000000000S 77.736574249	-156,124.38	-12,136,574	0	1,568,694	1,568,694
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000S 77.736574249	-221,516.12	-17,219,904	0	1,777,554	1,777,554
-22,603.85000		11/5/2015		-22,603.85	-1,966,401	1.000000000S 77.736574249	-22,603.85	-1,757,146	0	209,255	209,255
-28,494.89000		11/6/2015		-28,494.89	-2,474,770	1.000000000S 77.736574249	-28,494.89	-2,215,095	0	259,675	259,675
-33,113.93000		11/10/2015		-33,113.93	-2,878,332	1.000000000S 77.736574249	-33,113.93	-2,574,163	0	304,169	304,169
-908,189.06000		11/12/2015		-908,189.06	-78,762,965	1.000000000S 77.736574249	-908,189.06	-70,599,506	0	8,163,459	8,163,459
-377,515.60000		11/12/2015		-377,515.60	-32,740,152	1.000000000S 77.736574249	-377,515.60	-29,346,769	0	3,393,383	3,393,383
-6,155.13000		11/13/2015		-6,155.13	-537,849	1.000000000S 77.736574249	-6,155.13	-478,479	0	59,370	59,370
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000S 77.736574249	-156,394.49	-12,157,572	0	1,479,960	1,479,960
-16,749.47000		11/18/2015		-16,749.47	-1,472,174	1.000000000S 77.736574249	-16,749.47	-1,302,046	0	170,128	170,128
-535,263.52000		11/19/2015		-535,263.52	-46,835,996	1.000000000S 77.736574249	-535,263.52	-41,609,552	0	5,226,444	5,226,444
-171,111.94000		11/20/2015		-171,111.94	-15,132,801	1.000000000S 77.736574249	-171,111.94	-13,301,656	0	1,831,145	1,831,145
-74,491.46000		11/24/2015		-74,491.46	-6,589,055	1.000000000S 77.736574249	-74,491.46	-5,790,711	0	798,344	798,344
-907,253.22000		11/25/2015		-907,253.22	-80,284,748	1.000000000S 77.736574249	-907,253.22	-70,526,757	0	9,757,991	9,757,991
-124,050.79000		11/27/2015		-124,050.79	-10,988,000	1.000000000S 77.736574249	-124,050.79	-9,643,283	0	1,344,717	1,344,717

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-125,483.80000		12/1/2015		-125,483.80	-11,209,303	1.000000000S 77.736574249	-125,483.80	-9,754,681	0	1,454,622	1,454,622
-29,511.79000		12/3/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000S 77.736574249	-29,511.79	-2,294,145	0	372,295	372,295
-33,063.02000		12/4/2015		-33,063.02	-2,969,898	1.000000000S 77.736574249	-33,063.02	-2,570,206	0	399,692	399,692
-33,111.98000		12/8/2015		-33,111.98	-2,969,410	1.000000000S 77.736574249	-33,111.98	-2,574,012	0	395,398	395,398
-329,209.04000		12/9/2015		-329,209.04	-29,234,099	1.000000000S 77.736574249	-329,209.04	-25,591,583	0	3,642,516	3,642,516
-29,648.06000		12/10/2015		-29,648.06	-2,614,894	1.000000000S 77.736574249	-29,648.06	-2,304,739	0	310,155	310,155
-327,000.00000		12/11/2015		-327,000.00	-28,998,504	1.000000000S 77.736574249	-327,000.00	-25,419,860	0	3,578,644	3,578,644
-92,475.65000		12/11/2015		-92,475.65	-8,200,781	1.000000000S 77.736574249	-92,475.65	-7,188,740	0	1,012,041	1,012,041
-57,766.60000		12/11/2015		-57,766.60	-5,122,768	1.000000000S 77.736574249	-57,766.60	-4,490,578	0	632,190	632,190
-34,992.57000		12/14/2015		-34,992.57	-3,051,138	1.000000000S 77.736574249	-34,992.57	-2,720,203	0	330,935	330,935
-288,079.45000		12/15/2015		-288,079.45	-25,176,774	1.000000000S 77.736574249	-288,079.45	-22,394,310	0	2,782,464	2,782,464
-109,269.69000		12/16/2015		-109,269.69	-9,536,047	1.000000000S 77.736574249	-109,269.69	-8,494,251	0	1,041,796	1,041,796
-26,796.21000		12/18/2015		-26,796.21	-2,338,039	1.000000000S 77.736574249	-26,796.21	-2,083,046	0	254,993	254,993
-35,901.50000		12/30/2015		-35,901.50	-3,154,307	1.000000000S 77.736574249	-35,901.50	-2,790,860	0	363,447	363,447
-191,729.95000		1/4/2016		-191,729.95	-16,780,325	1.000000000S 77.736574249	-191,729.95	-14,904,429	0	1,875,896	1,875,896

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-223,008.99000		1/5/2016		-223,008.99	-19,064,056	1.000000000S 77.736574249	-223,008.99	-17,335,955	0	1,728,101	1,728,101
-17,213.36000		1/7/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000S 77.736574249	-17,213.36	-1,338,108	0	104,456	104,456
-379,405.26000		1/12/2016		-379,405.26	-31,131,953	1.000000000S 77.736574249	-379,405.26	-29,493,665	0	1,638,288	1,638,288
-189,599.29000		1/15/2016		-189,599.29	-15,584,866	1.000000000S 77.736574249	-189,599.29	-14,738,799	0	846,067	846,067
-8,880.25000		1/19/2016		-8,880.25	-716,821	1.000000000S 77.736574249	-8,880.25	-690,320	0	26,501	26,501
-90,489.83000		1/21/2016		-90,489.83	-7,198,238	1.000000000S 77.736574249	-90,489.83	-7,034,369	0	163,869	163,869
-57,779.34000		1/21/2016		-57,779.34	-4,596,201	1.000000000S 77.736574249	-57,779.34	-4,491,568	0	104,633	104,633
-7,629.83000		1/21/2016		-7,629.83	-606,934	1.000000000S 77.736574249	-7,629.83	-593,117	0	13,817	13,817
-121,619.56000		1/22/2016		-121,619.56	-9,910,282	1.000000000S 77.736574249	-121,619.56	-9,454,288	0	455,994	455,994
-214,100.94000		2/1/2016		-214,100.94	-18,334,604	1.000000000S 77.736574249	-214,100.94	-16,643,474	0	1,691,130	1,691,130
-21,646.66000		2/4/2016		-21,646.66	-1,815,370	1.000000000S 77.736574249	-21,646.66	-1,682,737	0	132,633	132,633
-14,653.90000		2/5/2016		-14,653.90	-1,240,675	1.000000000S 77.736574249	-14,653.90	-1,139,144	0	101,531	101,531
-30,116.40000		2/10/2016		-30,116.40	-2,445,030	1.000000000S 77.736574249	-30,116.40	-2,341,146	0	103,884	103,884
-381,805.81000		2/12/2016		-381,805.81	-30,235,477	1.000000000S 77.736574249	-381,805.81	-29,680,276	0	555,201	555,201
-152,354.76000		2/12/2016		-152,354.76	-12,065,083	1.000000000S 77.736574249	-152,354.76	-11,843,537	0	221,546	221,546

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-16,916.50000		2/17/2016		-16,916.50	-1,364,954	1.000000000S 77.736574249	-16,916.50	-1,315,031	0	49,923	49,923
-114,575.44000		2/22/2016		-114,575.44	-9,163,101	1.000000000S 77.736574249	-114,575.44	-8,906,702	0	256,399	256,399
-37,349.25000		2/23/2016		-37,349.25	-3,051,565	1.000000000S 77.736574249	-37,349.25	-2,903,403	0	148,162	148,162
-123,804.34000		3/2/2016		-123,804.34	-10,057,811	1.000000000S 77.736574249	-123,804.34	-9,624,125	0	433,686	433,686
-27,289.30000		3/3/2016		-27,289.30	-2,257,397	1.000000000S 77.736574249	-27,289.30	-2,121,377	0	136,020	136,020
-10,054.65000		3/7/2016		-10,054.65	-847,732	1.000000000S 77.736574249	-10,054.65	-781,614	0	66,118	66,118
-211,885.31000		3/9/2016		-211,885.31	-17,733,243	1.000000000S 77.736574249	-211,885.31	-16,471,238	0	1,262,005	1,262,005
-377,078.03000		3/11/2016		-377,078.03	-31,843,855	1.000000000S 77.736574249	-377,078.03	-29,312,754	0	2,531,101	2,531,101
-74,706.21000		3/14/2016		-74,706.21	-6,403,880	1.000000000S 77.736574249	-74,706.21	-5,807,405	0	596,475	596,475
-73,687.89000		3/15/2016		-73,687.89	-6,289,651	1.000000000S 77.736574249	-73,687.89	-5,728,244	0	561,407	561,407
-45,075.31000		3/16/2016		-45,075.31	-3,796,491	1.000000000S 77.736574249	-45,075.31	-3,504,000	0	292,491	292,491
-29,125.30000		3/18/2016		-29,125.30	-2,475,492	1.000000000S 77.736574249	-29,125.30	-2,264,101	0	211,391	211,391
-97,821.68000		3/22/2016		-97,821.68	-8,292,500	1.000000000S 77.736574249	-97,821.68	-7,604,322	0	688,178	688,178
-112,039.68000		3/23/2016		-112,039.68	-9,552,811	1.000000000S 77.736574249	-112,039.68	-8,709,581	0	843,230	843,230
-159,202.44000		3/24/2016		-159,202.44	-13,507,411	1.000000000S 77.736574249	-159,202.44	-12,375,852	0	1,131,559	1,131,559

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-32,177.14000		3/31/2016		-32,177.14	-2,784,601	1.000000000S 77.736574249	-32,177.14	-2,501,341	0	283,260	283,260
-64,762.22000		4/5/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000S 77.736574249	-64,762.22	-5,034,393	0	451,226	451,226
-26,208.62000		4/6/2016		-26,208.62	-2,182,406	1.000000000S 77.736574249	-26,208.62	-2,037,368	0	145,038	145,038
-373,765.27000		4/11/2016		-373,765.27	-30,674,974	1.000000000S 77.736574249	-373,765.27	-29,055,232	0	1,619,742	1,619,742
-204,881.37000		4/11/2016		-204,881.37	-16,814,646	1.000000000S 77.736574249	-204,881.37	-15,926,776	0	887,870	887,870
-43,019.52000		4/12/2016		-43,019.52	-3,527,545	1.000000000S 77.736574249	-43,019.52	-3,344,190	0	183,355	183,355
-33,801.18000		4/13/2016		-33,801.18	-2,800,107	1.000000000S 77.736574249	-33,801.18	-2,627,588	0	172,519	172,519
-141,797.35000		4/14/2016		-141,797.35	-11,838,108	1.000000000S 77.736574249	-141,797.35	-11,022,840	0	815,268	815,268
-3,319.09000		4/18/2016		-3,319.09	-278,038	1.000000000S 77.736574249	-3,319.09	-258,015	0	20,023	20,023
-83,104.57000		4/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000S 77.736574249	-83,104.57	-6,460,265	0	539,571	539,571
-7,007.13000		4/19/2016		-7,007.13	-590,205	1.000000000S 77.736574249	-7,007.13	-544,710	0	45,495	45,495
-32,699.55000		4/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000S 77.736574249	-32,699.55	-2,541,951	0	250,131	250,131
-2,677,613.47000		4/21/2016		-2,677,613.47	-228,369,211	1.000000000S 77.736574249	-2,677,613.47	-208,148,498	0	20,220,713	20,220,713
-92,321.29000		4/21/2016		-92,321.29	-7,873,930	1.000000000S 77.736574249	-92,321.29	-7,176,741	0	697,189	697,189
-51,467.98000		4/26/2016		-51,467.98	-4,411,808	1.000000000S 77.736574249	-51,467.98	-4,000,944	0	410,864	410,864

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-15,428.24000		5/9/2016		-15,428.24	-1,209,910	1.000000000S 77.736574249	-15,428.24	-1,199,339	0	10,571	10,571
-102,314.26000		5/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000S 77.736574249	-102,314.26	-7,953,560	0	269,045	269,045
-352,627.83000		5/12/2016		-352,627.83	-28,284,357	1.000000000S 77.736574249	-352,627.83	-27,412,079	0	872,278	872,278
-32,453.42000		5/17/2016		-32,453.42	-2,578,702	1.000000000S 77.736574249	-32,453.42	-2,522,818	0	55,884	55,884
-184,519.95000		5/18/2016		-184,519.95	-14,755,931	1.000000000S 77.736574249	-184,519.95	-14,343,949	0	411,982	411,982
-346,026.04000		5/23/2016		-346,026.04	-27,596,972	1.000000000S 77.736574249	-346,026.04	-26,898,879	0	698,093	698,093
-349,425.52000		6/10/2016		-349,425.52	-27,668,680	1.000000000S 77.736574249	-349,425.52	-27,163,143	0	505,537	505,537
-205,061.01000		6/14/2016		-205,061.01	-16,138,898	1.000000000S 77.736574249	-205,061.01	-15,940,740	0	198,158	198,158
-27,132.00000		6/17/2016		-27,132.00	-2,060,548	1.000000000S 77.736574249	-27,132.00	-2,109,149	0	-48,601	-48,601
-3,725.24000		7/7/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000S 77.736574249	-3,725.24	-289,587	0	-8,031	-8,031
-359,882.81000		7/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000S 77.736574249	-359,882.81	-27,976,057	0	-655,014	-655,014
-11,042.19000		7/11/2016		-11,042.19	-838,284	1.000000000S 77.736574249	-11,042.19	-858,382	0	-20,098	-20,098
-123,264.71000		7/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000S 77.736574249	-123,264.71	-9,582,176	0	-43,710	-43,710
-253,623.43000		7/14/2016		-253,623.43	-20,172,228	1.000000000S 77.736574249	-253,623.43	-19,715,817	0	456,411	456,411
-78,638.63000		7/14/2016		-78,638.63	-6,254,613	1.000000000S 77.736574249	-78,638.63	-6,113,098	0	141,515	141,515

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-6,630.58000		7/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000S 77.736574249	-6,630.58	-515,439	0	11,932	11,932
-105,691.38000		7/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000S 77.736574249	-105,691.38	-8,216,086	0	204,861	204,861
-26,928.63000		7/22/2016		-26,928.63	-2,148,021	1.000000000S 77.736574249	-26,928.63	-2,093,339	0	54,682	54,682
-11,865.10000		7/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000S 77.736574249	-11,865.10	-922,352	0	12,111	12,111
-64,818.19000		8/2/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000S 77.736574249	-64,818.19	-5,038,744	0	-24,343	-24,343
-19,853.51000		8/2/2016		-19,853.51	-1,535,888	1.000000000S 77.736574249	-19,853.51	-1,543,344	0	-7,456	-7,456
-181,375.34000		8/3/2016		-181,375.34	-13,938,155	1.000000000S 77.736574249	-181,375.34	-14,099,498	0	-161,343	-161,343
-25,260.07000		8/4/2016		-25,260.07	-1,938,997	1.000000000S 77.736574249	-25,260.07	-1,963,631	0	-24,634	-24,634
-356,084.08000		8/12/2016		-356,084.08	-27,843,105	1.000000000S 77.736574249	-356,084.08	-27,680,757	0	162,348	162,348
-42,406.06000		8/12/2016		-42,406.06	-3,315,836	1.000000000S 77.736574249	-42,406.06	-3,296,502	0	19,334	19,334
-33,369.43000		8/16/2016		-33,369.43	-2,591,016	1.000000000S 77.736574249	-33,369.43	-2,594,025	0	-3,009	-3,009
-146,047.78000		8/17/2016		-146,047.78	-11,265,304	1.000000000S 77.736574249	-146,047.78	-11,353,254	0	-87,950	-87,950
-12,365.22000		8/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000S 77.736574249	-12,365.22	-961,230	0	-14,484	-14,484
-25,656.87000		8/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000S 77.736574249	-25,656.87	-1,994,477	0	-21,678	-21,678
-62,280.99000		8/22/2016		-62,280.99	-4,755,276	1.000000000S 77.736574249	-62,280.99	-4,841,511	0	-86,235	-86,235

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-115,979.16000		8/23/2016		-115,979.16	-8,883,458	1.000000000S 77.736574249	-115,979.16	-9,015,823	0	-132,365	-132,365
-45,244.15000		8/24/2016		-45,244.15	-3,466,822	1.000000000S 77.736574249	-45,244.15	-3,517,125	0	-50,303	-50,303
-118,911.22000		8/25/2016		-118,911.22	-9,101,467	1.000000000S 77.736574249	-118,911.22	-9,243,751	0	-142,284	-142,284
700,824.81000 0.00000	合計 -----			700,825	66,414,387		700,825	54,479,709	0	-11,934,678	-11,934,678
68,547.40000	BRAZILIAN REAL BRL	5/14/2013		68,547.40	3,453,934	1.000000000S 0.031264079	68,547.40	2,192,529	0	-1,261,405	-1,261,405
1,056,403.20000		5/14/2013		1,056,403.20	53,229,538	1.000000000S 0.031264079	1,056,403.20	33,789,679	0	-19,439,859	-19,439,859
90,499.50000		6/11/2013		90,499.50	4,158,091	1.000000000S 0.031264079	90,499.50	2,894,680	0	-1,263,411	-1,263,411
184,874.70000		6/11/2013		184,874.70	8,494,255	1.000000000S 0.031264079	184,874.70	5,913,326	0	-2,580,929	-2,580,929
3,892,793.65000		6/11/2013		3,892,793.65	178,858,332	1.000000000S 0.031264079	3,892,793.65	124,513,300	0	-54,345,032	-54,345,032
32,593,600.00000		6/11/2013		32,593,600.00	1,497,545,840	1.000000000S 0.031264079	32,593,600.00	1,042,525,513	0	-455,020,327	-455,020,327
369,451,791.10000		6/11/2013		369,451,791.10	16,974,835,330	1.000000000S 0.031264079	369,451,791.10	11,817,133,366	0	-5,157,701,964	-5,157,701,964
-632,326.40000		5/14/2013		-632,326.40	-31,861,359	1.000000000S 0.031264079	-632,326.40	-20,225,333	0	11,636,026	11,636,026
-353,472,791.10000		6/11/2013		-353,472,791.10	-16,240,664,051	1.000000000S 0.031264079	-353,472,791.10	-11,306,035,630	0	4,934,628,421	4,934,628,421
-32,593,600.00000		6/11/2013		-32,593,600.00	-1,497,545,840	1.000000000S 0.031264079	-32,593,600.00	-1,042,525,513	0	455,020,327	455,020,327
-4,965,000.00000		6/11/2013		-4,965,000.00	-228,121,935	1.000000000S 0.031264079	-4,965,000.00	-158,808,452	0	69,313,483	69,313,483

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-4,950,000.00000		6/11/2013		-4,950,000.00	-227,432,745	1.000000000S 0.031264079	-4,950,000.00	-158,328,669	0	69,104,076	69,104,076
-4,561,792.05000		6/11/2013		-4,561,792.05	-209,596,139	1.000000000S 0.031264079	-4,561,792.05	-145,911,608	0	63,684,531	63,684,531
-4,089,000.00000		6/11/2013		-4,089,000.00	-187,873,231	1.000000000S 0.031264079	-4,089,000.00	-130,789,076	0	57,084,155	57,084,155
-1,975,000.00000		6/11/2013		-1,975,000.00	-90,743,368	1.000000000S 0.031264079	-1,975,000.00	-63,171,539	0	27,571,829	27,571,829
-99,000.00000		6/11/2013		-99,000.00	-4,548,655	1.000000000S 0.031264079	-99,000.00	-3,166,573	0	1,382,082	1,382,082
0.00000	合計 -----			0	2,187,997		0	0	0	-2,187,997	-2,187,997
50,398.44	BRITISH POUND GBP	8/18/2016		50,398.44	6,577,696	1.000000000S 135.468819497	50,398.44	6,827,417	0	249,721	249,721
50.00	CANADIAN DOLLAR CAD	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000S 0.012684778	50.00	3,942	0	-728	-728
65,055.05000	EURO EUR	8/18/2016		65,055.05	7,356,921	1.000000000S 115.200731246	65,055.05	7,494,389	0	137,468	137,468
218,166.67000	UNITED STATES DOLLAR USD	3/7/2016		218,166.67	24,828,458	1.000000000S 0.009667907	218,166.67	22,566,070	0	-2,262,388	-2,262,388
2,507,645.88000		3/7/2016		2,507,645.88	285,382,644	1.000000000S 0.009667907	2,507,645.88	259,378,362	0	-26,004,282	-26,004,282
235,625.00000		3/10/2016		235,625.00	26,600,885	1.000000000S 0.009667907	235,625.00	24,371,873	0	-2,229,012	-2,229,012
1,970,224.89000		3/11/2016		1,970,224.89	223,423,506	1.000000000S 0.009667907	1,970,224.89	203,790,220	0	-19,633,286	-19,633,286
2,348,579.10000		3/11/2016		2,348,579.10	266,328,875	1.000000000S 0.009667907	2,348,579.10	242,925,289	0	-23,403,586	-23,403,586
2,878,849.79000		3/11/2016		2,878,849.79	326,461,572	1.000000000S 0.009667907	2,878,849.79	297,773,840	0	-28,687,732	-28,687,732

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米ドルです。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年 8月31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											
3,398,240.37000		3/11/2016		3,398,240.37	385,360,465	1.000000000 ^S 0.009667907	3,398,240.37	351,497,007	0	-33,863,458	-33,863,458
408,375.00000		3/15/2016		408,375.00	46,389,360	1.000000000 ^S 0.009667907	408,375.00	42,240,270	0	-4,149,090	-4,149,090
588,000.00000		3/15/2016		588,000.00	66,793,863	1.000000000 ^S 0.009667907	588,000.00	60,819,782	0	-5,974,081	-5,974,081
121,000.00000		3/17/2016		121,000.00	13,752,860	1.000000000 ^S 0.009667907	121,000.00	12,515,635	0	-1,237,225	-1,237,225
525,000.00000		3/17/2016		525,000.00	59,671,500	1.000000000 ^S 0.009667907	525,000.00	54,303,377	0	-5,368,123	-5,368,123
150,377.30000		3/18/2016		150,377.30	16,739,250	1.000000000 ^S 0.009667907	150,377.30	15,554,277	0	-1,184,973	-1,184,973
92,841.37000		3/24/2016		92,841.37	10,459,508	1.000000000 ^S 0.009667907	92,841.37	9,603,047	0	-856,461	-856,461
551,000.00000		3/25/2016		551,000.00	62,070,149	1.000000000 ^S 0.009667907	551,000.00	56,992,687	0	-5,077,462	-5,077,462
41,400.00000		3/27/2016		41,400.00	4,663,710	1.000000000 ^S 0.009667907	41,400.00	4,282,209	0	-381,501	-381,501
434,218.75000		3/28/2016		434,218.75	49,177,446	1.000000000 ^S 0.009667907	434,218.75	44,913,418	0	-4,264,028	-4,264,028
543,150.00000		3/28/2016		543,150.00	61,514,455	1.000000000 ^S 0.009667907	543,150.00	56,180,722	0	-5,333,733	-5,333,733
263,958.33000		3/31/2016		263,958.33	29,683,434	1.000000000 ^S 0.009667907	263,958.33	27,302,531	0	-2,380,903	-2,380,903
15,698.36000		4/1/2016		15,698.36	1,764,417	1.000000000 ^S 0.009667907	15,698.36	1,623,760	0	-140,657	-140,657
2,607,332.00000		4/5/2016		2,607,332.00	290,078,724	1.000000000 ^S 0.009667907	2,607,332.00	269,689,396	0	-20,389,328	-20,389,328
341,978.39000		4/7/2016		341,978.39	37,619,332	1.000000000 ^S 0.009667907	341,978.39	35,372,536	0	-2,246,796	-2,246,796

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
20,927.08000		4/8/2016		20,927.08	2,258,137	1.000000000S 0.009667907	20,927.08	2,164,593	0	-93,544	-93,544
661,500.00000		4/8/2016		661,500.00	71,379,159	1.000000000S 0.009667907	661,500.00	68,422,255	0	-2,956,904	-2,956,904
6,356.16000		4/11/2016		6,356.16	689,103	1.000000000S 0.009667907	6,356.16	657,449	0	-31,654	-31,654
6,388.05000		4/11/2016		6,388.05	692,560	1.000000000S 0.009667907	6,388.05	660,748	0	-31,812	-31,812
6,668.64000		4/11/2016		6,668.64	722,981	1.000000000S 0.009667907	6,668.64	689,771	0	-33,210	-33,210
6,862.48000		4/11/2016		6,862.48	743,996	1.000000000S 0.009667907	6,862.48	709,821	0	-34,175	-34,175
47,058.82000		4/11/2016		47,058.82	5,101,882	1.000000000S 0.009667907	47,058.82	4,867,529	0	-234,353	-234,353
55,531.88000		4/11/2016		55,531.88	6,020,489	1.000000000S 0.009667907	55,531.88	5,743,940	0	-276,549	-276,549
92,811.98000		4/11/2016		92,811.98	10,062,211	1.000000000S 0.009667907	92,811.98	9,600,008	0	-462,203	-462,203
98,713.79000		4/11/2016		98,713.79	10,702,055	1.000000000S 0.009667907	98,713.79	10,210,461	0	-491,594	-491,594
133,223.56000		4/11/2016		133,223.56	14,443,432	1.000000000S 0.009667907	133,223.56	13,779,979	0	-663,453	-663,453
148,908.46000		4/11/2016		148,908.46	16,143,911	1.000000000S 0.009667907	148,908.46	15,402,347	0	-741,564	-741,564
173,704.45000		4/11/2016		173,704.45	18,832,168	1.000000000S 0.009667907	173,704.45	17,967,120	0	-865,048	-865,048
200,947.63000		4/11/2016		200,947.63	21,785,737	1.000000000S 0.009667907	200,947.63	20,785,019	0	-1,000,718	-1,000,718
341,931.71000		4/11/2016		341,931.71	37,070,526	1.000000000S 0.009667907	341,931.71	35,367,708	0	-1,702,818	-1,702,818

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
601,230.84000		4/11/2016		601,230.84	65,182,441	1.000000000S 0.009667907	601,230.84	62,188,314	0	-2,994,127	-2,994,127
1,265,579.38000		4/11/2016		1,265,579.38	137,207,787	1.000000000S 0.009667907	1,265,579.38	130,905,208	0	-6,302,579	-6,302,579
3,284,212.22000		4/11/2016		3,284,212.22	356,057,864	1.000000000S 0.009667907	3,284,212.22	339,702,504	0	-16,355,360	-16,355,360
4,014,405.35000		4/11/2016		4,014,405.35	435,221,751	1.000000000S 0.009667907	4,014,405.35	415,230,034	0	-19,991,717	-19,991,717
6,399,976.39000		4/11/2016		6,399,976.39	693,853,432	1.000000000S 0.009667907	6,399,976.39	661,981,584	0	-31,871,848	-31,871,848
211,162.25000		4/18/2016		211,162.25	22,960,727	1.000000000S 0.009667907	211,162.25	21,841,568	0	-1,119,159	-1,119,159
550,000.00000		4/18/2016		550,000.00	59,804,249	1.000000000S 0.009667907	550,000.00	56,889,252	0	-2,914,997	-2,914,997
819,177.81000		4/18/2016		819,177.81	89,073,297	1.000000000S 0.009667907	819,177.81	84,731,660	0	-4,341,637	-4,341,637
1,186,397.09000		4/18/2016		1,186,397.09	129,002,885	1.000000000S 0.009667907	1,186,397.09	122,714,988	0	-6,287,897	-6,287,897
1,227,073.51000		4/18/2016		1,227,073.51	133,425,835	1.000000000S 0.009667907	1,227,073.51	126,922,354	0	-6,503,481	-6,503,481
1,613,815.45000		4/18/2016		1,613,815.45	175,478,219	1.000000000S 0.009667907	1,613,815.45	166,925,008	0	-8,553,211	-8,553,211
1,734,449.70000		4/18/2016		1,734,449.70	188,595,384	1.000000000S 0.009667907	1,734,449.70	179,402,812	0	-9,192,572	-9,192,572
1,870,148.58000		4/18/2016		1,870,148.58	203,350,602	1.000000000S 0.009667907	1,870,148.58	193,438,826	0	-9,911,776	-9,911,776
1,884,696.84000		4/18/2016		1,884,696.84	204,932,507	1.000000000S 0.009667907	1,884,696.84	194,943,625	0	-9,988,882	-9,988,882
2,657,433.65000		4/18/2016		2,657,433.65	288,956,042	1.000000000S 0.009667907	2,657,433.65	274,871,660	0	-14,084,382	-14,084,382

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
2,852,415.62000		4/18/2016		2,852,415.62	310,157,406	1.000000000S 0.009667907	2,852,415.62	295,039,621	0	-15,117,785	-15,117,785
3,012,663.64000		4/18/2016		3,012,663.64	327,581,974	1.000000000S 0.009667907	3,012,663.64	311,614,876	0	-15,967,098	-15,967,098
4,357,207.34000		4/18/2016		4,357,207.34	473,780,930	1.000000000S 0.009667907	4,357,207.34	450,687,759	0	-23,093,171	-23,093,171
4,398,062.67000		4/18/2016		4,398,062.67	478,223,334	1.000000000S 0.009667907	4,398,062.67	454,913,630	0	-23,309,704	-23,309,704
15,375,952.15000		4/18/2016		15,375,952.15	1,671,904,122	1.000000000S 0.009667907	15,375,952.15	1,590,411,673	0	-81,492,449	-81,492,449
50,270,895.78000		4/18/2016		50,270,895.78	5,466,205,737	1.000000000S 0.009667907	50,270,895.78	5,199,770,310	0	-266,435,427	-266,435,427
76,194,574.86000		4/18/2016		76,194,574.86	8,285,016,922	1.000000000S 0.009667907	76,194,574.86	7,881,186,162	0	-403,830,760	-403,830,760
84,546,932.70000		4/18/2016		84,546,932.70	9,193,210,532	1.000000000S 0.009667907	84,546,932.70	8,745,112,329	0	-448,098,203	-448,098,203
84,670,037.60000		4/18/2016		84,670,037.60	9,206,596,343	1.000000000S 0.009667907	84,670,037.60	8,757,845,685	0	-448,750,658	-448,750,658
282,425.00000		4/21/2016		282,425.00	30,847,871	1.000000000S 0.009667907	282,425.00	29,212,631	0	-1,635,240	-1,635,240
412,162.50000		4/22/2016		412,162.50	45,115,309	1.000000000S 0.009667907	412,162.50	42,632,030	0	-2,483,279	-2,483,279
59,250.00000		4/23/2016		59,250.00	6,604,894	1.000000000S 0.009667907	59,250.00	6,128,524	0	-476,370	-476,370
33,541.72000		4/26/2016		33,541.72	3,720,951	1.000000000S 0.009667907	33,541.72	3,469,388	0	-251,563	-251,563
102,673.08000		4/27/2016		102,673.08	11,413,653	1.000000000S 0.009667907	102,673.08	10,619,990	0	-793,663	-793,663
288,405.00000		4/28/2016		288,405.00	32,090,826	1.000000000S 0.009667907	288,405.00	29,831,172	0	-2,259,654	-2,259,654

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
575,000.00000		5/7/2016		575,000.00	61,329,500	1.000000000S 0.009667907	575,000.00	59,475,127	0	-1,854,373	-1,854,373
59,841.38000		5/10/2016		59,841.38	6,484,412	1.000000000S 0.009667907	59,841.38	6,189,693	0	-294,719	-294,719
5,313.29000		5/12/2016		5,313.29	577,050	1.000000000S 0.009667907	5,313.29	549,580	0	-27,470	-27,470
9,801.52000		5/12/2016		9,801.52	1,064,494	1.000000000S 0.009667907	9,801.52	1,013,820	0	-50,674	-50,674
48,245.45000		5/12/2016		48,245.45	5,239,697	1.000000000S 0.009667907	48,245.45	4,990,268	0	-249,429	-249,429
123,965.08000		5/12/2016		123,965.08	13,463,228	1.000000000S 0.009667907	123,965.08	12,822,329	0	-640,899	-640,899
1,178,722.21000		5/12/2016		1,178,722.21	128,015,128	1.000000000S 0.009667907	1,178,722.21	121,921,137	0	-6,093,991	-6,093,991
1,241,567.26000		5/12/2016		1,241,567.26	134,840,415	1.000000000S 0.009667907	1,241,567.26	128,421,515	0	-6,418,900	-6,418,900
1,417,278.22000		5/12/2016		1,417,278.22	153,923,505	1.000000000S 0.009667907	1,417,278.22	146,596,178	0	-7,327,327	-7,327,327
2,313,610.63000		5/12/2016		2,313,610.63	251,269,688	1.000000000S 0.009667907	2,313,610.63	239,308,325	0	-11,961,363	-11,961,363
4,922,379.65000		5/12/2016		4,922,379.65	534,595,054	1.000000000S 0.009667907	4,922,379.65	509,146,359	0	-25,448,695	-25,448,695
5,619,210.93000		5/12/2016		5,619,210.93	610,274,417	1.000000000S 0.009667907	5,619,210.93	581,223,105	0	-29,051,312	-29,051,312
29,058.54000		5/17/2016		29,058.54	3,162,296	1.000000000S 0.009667907	29,058.54	3,005,670	0	-156,626	-156,626
416,926.42000		5/19/2016		416,926.42	45,693,051	1.000000000S 0.009667907	416,926.42	43,124,786	0	-2,568,265	-2,568,265
8,843.34000		5/20/2016		8,843.34	972,104	1.000000000S 0.009667907	8,843.34	914,711	0	-57,393	-57,393

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
164,396.98000		5/27/2016		164,396.98	18,030,239	1.000000000S 0.009667907	164,396.98	17,004,402	0	-1,025,837	-1,025,837
116,245.20000		6/3/2016		116,245.20	12,620,160	1.000000000S 0.009667907	116,245.20	12,023,823	0	-596,337	-596,337
45,263.96000		6/10/2016		45,263.96	4,819,028	1.000000000S 0.009667907	45,263.96	4,681,878	0	-137,150	-137,150
394,428.56000		6/10/2016		394,428.56	41,992,837	1.000000000S 0.009667907	394,428.56	40,797,720	0	-1,195,117	-1,195,117
2,009,036.98000		6/10/2016		2,009,036.98	213,892,126	1.000000000S 0.009667907	2,009,036.98	207,804,748	0	-6,087,378	-6,087,378
302,585.37000		6/15/2016		302,585.37	32,049,841	1.000000000S 0.009667907	302,585.37	31,297,919	0	-751,922	-751,922
375,147.50000		6/15/2016		375,147.50	39,735,622	1.000000000S 0.009667907	375,147.50	38,803,383	0	-932,239	-932,239
389,531.25000		6/15/2016		389,531.25	41,259,148	1.000000000S 0.009667907	389,531.25	40,291,166	0	-967,982	-967,982
526,250.00000		6/15/2016		526,250.00	55,740,398	1.000000000S 0.009667907	526,250.00	54,432,671	0	-1,307,727	-1,307,727
698,250.00000		6/15/2016		698,250.00	73,958,637	1.000000000S 0.009667907	698,250.00	72,223,492	0	-1,735,145	-1,735,145
1,365,000.00000		6/15/2016		1,365,000.00	144,580,794	1.000000000S 0.009667907	1,365,000.00	141,188,781	0	-3,392,013	-3,392,013
139,473.24000		6/24/2016		139,473.24	14,743,716	1.000000000S 0.009667907	139,473.24	14,426,415	0	-317,301	-317,301
709,841.82000		6/27/2016		709,841.82	72,524,538	1.000000000S 0.009667907	709,841.82	73,422,492	0	897,954	897,954
195,833.33000		6/28/2016		195,833.33	19,914,291	1.000000000S 0.009667907	195,833.33	20,256,021	0	341,730	341,730
29,058.54000		6/29/2016		29,058.54	2,986,782	1.000000000S 0.009667907	29,058.54	3,005,670	0	18,888	18,888

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
195,833.33000		6/29/2016		195,833.33	19,914,291	1.000000000S 0.009667907	195,833.33	20,256,021	0	341,730	341,730
105,342.70000		6/30/2016		105,342.70	10,812,901	1.000000000S 0.009667907	105,342.70	10,896,123	0	83,222	83,222
2,687.78000		7/11/2016		2,687.78	270,243	1.000000000S 0.009667907	2,687.78	278,011	0	7,768	7,768
96,149.75000		7/11/2016		96,149.75	9,667,377	1.000000000S 0.009667907	96,149.75	9,945,250	0	277,873	277,873
192,130.14000		7/11/2016		192,130.14	19,317,726	1.000000000S 0.009667907	192,130.14	19,872,982	0	555,256	555,256
4,924,474.08000		7/11/2016		4,924,474.08	495,131,267	1.000000000S 0.009667907	4,924,474.08	509,362,997	0	14,231,730	14,231,730
16,353,434.85000		7/11/2016		16,353,434.85	1,644,256,176	1.000000000S 0.009667907	16,353,434.85	1,691,517,600	0	47,261,424	47,261,424
41,843.75000		7/15/2016		41,843.75	4,408,449	1.000000000S 0.009667907	41,843.75	4,328,108	0	-80,341	-80,341
50,237.98000		7/21/2016		50,237.98	5,361,648	1.000000000S 0.009667907	50,237.98	5,196,366	0	-165,282	-165,282
21,177.13000		7/25/2016		21,177.13	2,250,388	1.000000000S 0.009667907	21,177.13	2,190,457	0	-59,931	-59,931
235,000.00000		7/28/2016		235,000.00	24,827,751	1.000000000S 0.009667907	235,000.00	24,307,226	0	-520,525	-520,525
311,519.33000		7/28/2016		311,519.33	32,912,019	1.000000000S 0.009667907	311,519.33	32,222,003	0	-690,016	-690,016
42,619.18000		7/29/2016		42,619.18	4,467,982	1.000000000S 0.009667907	42,619.18	4,408,315	0	-59,667	-59,667
58,693.33000		8/2/2016		58,693.33	6,008,436	1.000000000S 0.009667907	58,693.33	6,070,945	0	62,509	62,509
3,560,000.00000		8/2/2016		3,560,000.00	364,437,195	1.000000000S 0.009667907	3,560,000.00	368,228,615	0	3,791,420	3,791,420

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
88,333.33000		8/4/2016		88,333.33	8,947,724	1.000000000S 0.009667907	88,333.33	9,136,758	0	189,034	189,034
6,555,000.00000		8/4/2016		6,555,000.00	663,988,697	1.000000000S 0.009667907	6,555,000.00	678,016,452	0	14,027,755	14,027,755
77,083.33000		8/9/2016		77,083.33	7,903,740	1.000000000S 0.009667907	77,083.33	7,973,115	0	69,375	69,375
5,462,500.00000		8/9/2016		5,462,500.00	560,097,457	1.000000000S 0.009667907	5,462,500.00	565,013,710	0	4,916,253	4,916,253
171,111.11000		8/10/2016		171,111.11	17,435,367	1.000000000S 0.009667907	171,111.11	17,698,878	0	263,511	263,511
26,687.50000		8/11/2016		26,687.50	2,702,510	1.000000000S 0.009667907	26,687.50	2,760,422	0	57,912	57,912
64,203.33000		8/11/2016		64,203.33	6,501,550	1.000000000S 0.009667907	64,203.33	6,640,872	0	139,322	139,322
3,248,250.00000		8/11/2016		3,248,250.00	328,934,044	1.000000000S 0.009667907	3,248,250.00	335,982,752	0	7,048,708	7,048,708
3,327,720.00000		8/11/2016		3,327,720.00	336,981,574	1.000000000S 0.009667907	3,327,720.00	344,202,732	0	7,221,158	7,221,158
4,862,000.00000		8/11/2016		4,862,000.00	492,350,442	1.000000000S 0.009667907	4,862,000.00	502,900,990	0	10,550,548	10,550,548
3,101.17000		8/12/2016		3,101.17	314,226	1.000000000S 0.009667907	3,101.17	320,770	0	6,544	6,544
3,728.53000		8/12/2016		3,728.53	377,793	1.000000000S 0.009667907	3,728.53	385,661	0	7,868	7,868
3,900.74000		8/12/2016		3,900.74	395,242	1.000000000S 0.009667907	3,900.74	403,473	0	8,231	8,231
3,959.12000		8/12/2016		3,959.12	401,158	1.000000000S 0.009667907	3,959.12	409,512	0	8,354	8,354
64,461.67000		8/12/2016		64,461.67	6,531,578	1.000000000S 0.009667907	64,461.67	6,667,593	0	136,015	136,015

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
135,569.52000		8/12/2016		135,569.52	13,736,581	1.000000000S 0.009667907	135,569.52	14,022,634	0	286,053	286,053
939,307.54000		8/12/2016		939,307.54	95,175,333	1.000000000S 0.009667907	939,307.54	97,157,279	0	1,981,946	1,981,946
1,806,958.73000		8/12/2016		1,806,958.73	183,090,087	1.000000000S 0.009667907	1,806,958.73	186,902,784	0	3,812,697	3,812,697
3,063,097.79000		8/12/2016		3,063,097.79	310,368,373	1.000000000S 0.009667907	3,063,097.79	316,831,532	0	6,463,159	6,463,159
4,250,983.65000		8/12/2016		4,250,983.65	430,730,904	1.000000000S 0.009667907	4,250,983.65	439,700,511	0	8,969,607	8,969,607
30,567.22000		8/26/2016		30,567.22	3,073,075	1.000000000S 0.009667907	30,567.22	3,161,721	0	88,646	88,646
-60,833,880.49000		6/20/2016		-60,833,880.49	-6,344,061,078	1.000000000S 0.009667907	-60,833,880.49	-6,292,352,677	0	51,708,401	51,708,401
-52,690,077.84000		6/20/2016		-52,690,077.84	-5,494,784,639	1.000000000S 0.009667907	-52,690,077.84	-5,449,998,416	0	44,786,223	44,786,223
-48,437,929.35000		6/20/2016		-48,437,929.35	-5,051,349,344	1.000000000S 0.009667907	-48,437,929.35	-5,010,177,420	0	41,171,924	41,171,924
-3,940,516.96000		6/20/2016		-3,940,516.96	-410,936,802	1.000000000S 0.009667907	-3,940,516.96	-407,587,388	0	3,349,414	3,349,414
-2,698,114.18000		6/20/2016		-2,698,114.18	-281,372,831	1.000000000S 0.009667907	-2,698,114.18	-279,079,451	0	2,293,380	2,293,380
-2,657,433.65000		6/20/2016		-2,657,433.65	-277,130,462	1.000000000S 0.009667907	-2,657,433.65	-274,871,660	0	2,258,802	2,258,802
-1,884,696.84000		6/20/2016		-1,884,696.84	-196,545,605	1.000000000S 0.009667907	-1,884,696.84	-194,943,625	0	1,601,980	1,601,980
-1,351,270.85000		6/20/2016		-1,351,270.85	-140,917,277	1.000000000S 0.009667907	-1,351,270.85	-139,768,706	0	1,148,571	1,148,571
-1,265,772.52000		6/20/2016		-1,265,772.52	-132,001,084	1.000000000S 0.009667907	-1,265,772.52	-130,925,186	0	1,075,898	1,075,898

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-1,227,243.90000		6/20/2016		-1,227,243.90	-127,983,127	1.000000000S 0.009667907	-1,227,243.90	-126,939,978	0	1,043,149	1,043,149
-976,000.00000		6/20/2016		-976,000.00	-101,782,158	1.000000000S 0.009667907	-976,000.00	-100,952,564	0	829,594	829,594
-529,330.11000		6/20/2016		-529,330.11	-55,201,189	1.000000000S 0.009667907	-529,330.11	-54,751,262	0	449,927	449,927
-272,221.97000		6/20/2016		-272,221.97	-28,388,667	1.000000000S 0.009667907	-272,221.97	-28,157,281	0	231,386	231,386
-210,571.81000		6/20/2016		-210,571.81	-21,959,481	1.000000000S 0.009667907	-210,571.81	-21,780,496	0	178,985	178,985
-70,731.88000		6/20/2016		-70,731.88	-7,376,274	1.000000000S 0.009667907	-70,731.88	-7,316,152	0	60,122	60,122
-176,408.29000		6/21/2016		-176,408.29	-18,418,789	1.000000000S 0.009667907	-176,408.29	-18,246,792	0	171,997	171,997
-159,918.83000		6/22/2016		-159,918.83	-16,717,115	1.000000000S 0.009667907	-159,918.83	-16,541,205	0	175,910	175,910
-11,542.80000		6/28/2016		-11,542.80	-1,173,787	1.000000000S 0.009667907	-11,542.80	-1,193,930	0	-20,143	-20,143
-2,193.14000		6/30/2016		-2,193.14	-225,115	1.000000000S 0.009667907	-2,193.14	-226,847	0	-1,732	-1,732
-91,753.37000		7/1/2016		-91,753.37	-9,412,978	1.000000000S 0.009667907	-91,753.37	-9,490,510	0	-77,532	-77,532
-146,965.29000		7/5/2016		-146,965.29	-15,069,087	1.000000000S 0.009667907	-146,965.29	-15,201,355	0	-132,268	-132,268
-261,581.71000		7/6/2016		-261,581.71	-26,564,931	1.000000000S 0.009667907	-261,581.71	-27,056,705	0	-491,774	-491,774
-23,474.72000		7/7/2016		-23,474.72	-2,367,543	1.000000000S 0.009667907	-23,474.72	-2,428,108	0	-60,565	-60,565
-762,949.05000		7/11/2016		-762,949.05	-76,710,715	1.000000000S 0.009667907	-762,949.05	-78,915,638	0	-2,204,923	-2,204,923

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-656,883.32000		7/11/2016		-656,883.32	-66,046,336	1.000000000S 0.009667907	-656,883.32	-67,944,729	0	-1,898,393	-1,898,393
-92,090.39000		7/11/2016		-92,090.39	-9,259,229	1.000000000S 0.009667907	-92,090.39	-9,525,370	0	-266,141	-266,141
-68,995.92000		7/11/2016		-68,995.92	-6,937,195	1.000000000S 0.009667907	-68,995.92	-7,136,593	0	-199,398	-199,398
-2,081.50000		7/11/2016		-2,081.50	-209,284	1.000000000S 0.009667907	-2,081.50	-215,300	0	-6,016	-6,016
-323,955.54000		7/12/2016		-323,955.54	-33,242,698	1.000000000S 0.009667907	-323,955.54	-33,508,343	0	-265,645	-265,645
-242,340.33000		7/14/2016		-242,340.33	-25,265,191	1.000000000S 0.009667907	-242,340.33	-25,066,473	0	198,718	198,718
-33,165.66000		7/14/2016		-33,165.66	-3,457,686	1.000000000S 0.009667907	-33,165.66	-3,430,490	0	27,196	27,196
-20,433.42000		7/14/2016		-20,433.42	-2,130,286	1.000000000S 0.009667907	-20,433.42	-2,113,531	0	16,755	16,755
-438,258.13000		7/15/2016		-438,258.13	-46,172,688	1.000000000S 0.009667907	-438,258.13	-45,331,231	0	841,457	841,457
-217,245.65000		7/19/2016		-217,245.65	-22,998,710	1.000000000S 0.009667907	-217,245.65	-22,470,805	0	527,905	527,905
-559,400.97000		7/20/2016		-559,400.97	-59,506,279	1.000000000S 0.009667907	-559,400.97	-57,861,642	0	1,644,637	1,644,637
-325,708.67000		7/20/2016		-325,708.67	-34,647,260	1.000000000S 0.009667907	-325,708.67	-33,689,678	0	957,582	957,582
-143,057.85000		7/22/2016		-143,057.85	-15,212,057	1.000000000S 0.009667907	-143,057.85	-14,797,189	0	414,868	414,868
-124,920.12000		7/26/2016		-124,920.12	-13,252,151	1.000000000S 0.009667907	-124,920.12	-12,921,113	0	331,038	331,038
-12,721.19000		7/27/2016		-12,721.19	-1,331,209	1.000000000S 0.009667907	-12,721.19	-1,315,816	0	15,393	15,393

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-513,911.38000		8/1/2016		-513,911.38	-52,668,210	1.000000000S 0.009667907	-513,911.38	-53,156,426	0	-488,216	-488,216
-193,888.67000		8/2/2016		-193,888.67	-19,848,383	1.000000000S 0.009667907	-193,888.67	-20,054,875	0	-206,492	-206,492
-32,777.66000		8/3/2016		-32,777.66	-3,309,724	1.000000000S 0.009667907	-32,777.66	-3,390,357	0	-80,633	-80,633
-82,605.05000		8/4/2016		-82,605.05	-8,367,478	1.000000000S 0.009667907	-82,605.05	-8,544,254	0	-176,776	-176,776
-46,979.19000		8/5/2016		-46,979.19	-4,749,361	1.000000000S 0.009667907	-46,979.19	-4,859,293	0	-109,932	-109,932
-11,947.01000		8/8/2016		-11,947.01	-1,217,102	1.000000000S 0.009667907	-11,947.01	-1,235,739	0	-18,637	-18,637
-605,726.14000		8/9/2016		-605,726.14	-62,108,132	1.000000000S 0.009667907	-605,726.14	-62,653,286	0	-545,154	-545,154
-3,048,393.00000		8/10/2016		-3,048,393.00	-310,616,012	1.000000000S 0.009667907	-3,048,393.00	-315,310,542	0	-4,694,530	-4,694,530
-93,500.00000		8/10/2016		-93,500.00	-9,527,183	1.000000000S 0.009667907	-93,500.00	-9,671,173	0	-143,990	-143,990
-60,231.48000		8/10/2016		-60,231.48	-6,137,287	1.000000000S 0.009667907	-60,231.48	-6,230,043	0	-92,756	-92,756
-45,191.67000		8/10/2016		-45,191.67	-4,604,805	1.000000000S 0.009667907	-45,191.67	-4,674,401	0	-69,596	-69,596
-626,918.31000		8/12/2016		-626,918.31	-63,522,496	1.000000000S 0.009667907	-626,918.31	-64,845,298	0	-1,322,802	-1,322,802
-11,733.04000		8/12/2016		-11,733.04	-1,188,850	1.000000000S 0.009667907	-11,733.04	-1,213,607	0	-24,757	-24,757
-220.93000		8/12/2016		-220.93	-22,386	1.000000000S 0.009667907	-220.93	-22,852	0	-466	-466
-209,197.56000		8/16/2016		-209,197.56	-21,109,079	1.000000000S 0.009667907	-209,197.56	-21,638,350	0	-529,271	-529,271

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-108,321.12000		8/17/2016		-108,321.12	-10,881,398	1.000000000S 0.009667907	-108,321.12	-11,204,195	0	-322,797	-322,797
-95,443,051.40000		8/18/2016		-95,443,051.40	-9,572,460,618	1.000000000S 0.009667907	-95,443,051.40	-9,872,152,411	0	-299,691,793	-299,691,793
-63,220,371.82000		8/18/2016		-63,220,371.82	-6,340,687,045	1.000000000S 0.009667907	-63,220,371.82	-6,539,199,417	0	-198,512,372	-198,512,372
-48,587,497.66000		8/18/2016		-48,587,497.66	-4,873,082,965	1.000000000S 0.009667907	-48,587,497.66	-5,025,648,019	0	-152,565,054	-152,565,054
-10,062,248.00000		8/18/2016		-10,062,248.00	-1,009,193,140	1.000000000S 0.009667907	-10,062,248.00	-1,040,788,663	0	-31,595,523	-31,595,523
-8,121,038.00000		8/18/2016		-8,121,038.00	-814,499,487	1.000000000S 0.009667907	-8,121,038.00	-839,999,599	0	-25,500,112	-25,500,112
-5,693,687.72000		8/18/2016		-5,693,687.72	-571,048,397	1.000000000S 0.009667907	-5,693,687.72	-588,926,613	0	-17,878,216	-17,878,216
-3,270,000.00000		8/18/2016		-3,270,000.00	-327,964,642	1.000000000S 0.009667907	-3,270,000.00	-338,232,463	0	-10,267,821	-10,267,821
-2,966,869.54000		8/18/2016		-2,966,869.54	-297,562,174	1.000000000S 0.009667907	-2,966,869.54	-306,878,163	0	-9,315,989	-9,315,989
-2,881,191.46000		8/18/2016		-2,881,191.46	-288,969,091	1.000000000S 0.009667907	-2,881,191.46	-298,016,050	0	-9,046,959	-9,046,959
-1,710,485.40000		8/18/2016		-1,710,485.40	-171,553,129	1.000000000S 0.009667907	-1,710,485.40	-176,924,064	0	-5,370,935	-5,370,935
-1,635,377.25000		8/18/2016		-1,635,377.25	-164,020,157	1.000000000S 0.009667907	-1,635,377.25	-169,155,253	0	-5,135,096	-5,135,096
-1,530,896.32000		8/18/2016		-1,530,896.32	-153,541,243	1.000000000S 0.009667907	-1,530,896.32	-158,348,267	0	-4,807,024	-4,807,024
-1,317,552.21000		8/18/2016		-1,317,552.21	-132,143,896	1.000000000S 0.009667907	-1,317,552.21	-136,281,018	0	-4,137,122	-4,137,122
-1,301,561.17000		8/18/2016		-1,301,561.17	-130,540,075	1.000000000S 0.009667907	-1,301,561.17	-134,626,985	0	-4,086,910	-4,086,910

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-1,248,065.68000		8/18/2016		-1,248,065.68	-125,174,744	1.000000000S 0.009667907	-1,248,065.68	-129,093,679	0	-3,918,935	-3,918,935
-1,107,208.00000		8/18/2016		-1,107,208.00	-111,047,424	1.000000000S 0.009667907	-1,107,208.00	-114,524,064	0	-3,476,640	-3,476,640
-1,103,749.50000		8/18/2016		-1,103,749.50	-110,700,554	1.000000000S 0.009667907	-1,103,749.50	-114,166,334	0	-3,465,780	-3,465,780
-967,918.16000		8/18/2016		-967,918.16	-97,077,350	1.000000000S 0.009667907	-967,918.16	-100,116,619	0	-3,039,269	-3,039,269
-738,098.77000		8/18/2016		-738,098.77	-74,027,614	1.000000000S 0.009667907	-738,098.77	-76,345,249	0	-2,317,635	-2,317,635
-363,006.76000		8/18/2016		-363,006.76	-36,407,762	1.000000000S 0.009667907	-363,006.76	-37,547,606	0	-1,139,844	-1,139,844
-207,882.61000		8/18/2016		-207,882.61	-20,849,586	1.000000000S 0.009667907	-207,882.61	-21,502,339	0	-652,753	-652,753
-105,087.18000		8/18/2016		-105,087.18	-10,539,718	1.000000000S 0.009667907	-105,087.18	-10,869,693	0	-329,975	-329,975
-450,217.02000		8/19/2016		-450,217.02	-45,095,989	1.000000000S 0.009667907	-450,217.02	-46,568,199	0	-1,472,210	-1,472,210
-215,537.86000		8/22/2016		-215,537.86	-21,588,271	1.000000000S 0.009667907	-215,537.86	-22,294,159	0	-705,888	-705,888
-414,169.25000		8/23/2016		-414,169.25	-41,539,104	1.000000000S 0.009667907	-414,169.25	-42,839,598	0	-1,300,494	-1,300,494
-203,287.15000		8/25/2016		-203,287.15	-20,443,573	1.000000000S 0.009667907	-203,287.15	-21,027,007	0	-583,434	-583,434
-95,298.83000		8/30/2016		-95,298.83	-9,734,299	1.000000000S 0.009667907	-95,298.83	-9,857,235	0	-122,936	-122,936

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米ドルです。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
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 2016年8月31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											
-98,238.03000		8/31/2016		-98,238.03	-10,097,396	1.0000000000 ^S 0.009667907	-98,238.03	-10,161,251	0	-63,855	-63,855
19,534,955.70000 0.00000	合計 -----			19,534,956	4,745,234,420		19,534,956	2,020,598,224	0	-2,724,636,196	-2,724,636,196
20,351,284.00000	非グループ化の有価証券小計			20,351,284	4,827,776,091		20,351,284	2,089,403,681	0	-2,738,372,410	-2,738,372,410
20,351,284.00000	外貨建現金勘定合計			20,351,284	4,827,776,091		20,351,284	2,089,403,681	0	-2,738,372,410	-2,738,372,410
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
279,833.36000	AUD FORWARD 18 OCT FAU18OCT	8/9/2016		279,833.36	21,975,743	1.0000000000 ^F 77.480465431	279,833.36	21,681,619	0	-294,124	-294,124
3,000,000.00000	EUR FORWARD 18 OCT FEU18OCT	8/9/2016		3,000,000.00	340,657,067	1.0000000000 ^F 115.199051866	3,000,000.00	345,597,156	0	4,940,089	4,940,089
-86,023,480.31000		8/9/2016		-86,023,480.31	-9,812,976,514	1.0000000000 ^F 115.199051866	-86,023,480.31	-9,909,823,370	0	-96,846,856	-96,846,856
-43,792,246.65000		8/9/2016		-43,792,246.65	-4,995,163,945	1.0000000000 ^F 115.199051866	-43,792,246.65	-5,044,825,293	0	-49,661,348	-49,661,348
-6,354,341.18000		8/9/2016		-6,354,341.18	-724,814,635	1.0000000000 ^F 115.199051866	-6,354,341.18	-732,014,079	0	-7,199,444	-7,199,444
-5,131,760.00000		8/9/2016		-5,131,760.00	-585,385,930	1.0000000000 ^F 115.199051866	-5,131,760.00	-591,173,886	0	-5,787,956	-5,787,956
-1,973,150.63000		8/9/2016		-1,973,150.63	-225,361,886	1.0000000000 ^F 115.199051866	-1,973,150.63	-227,305,082	0	-1,943,196	-1,943,196
-1,473,976.79000		8/9/2016		-1,473,976.79	-168,129,207	1.0000000000 ^F 115.199051866	-1,473,976.79	-169,800,729	0	-1,671,522	-1,671,522
-691,866.98000		8/9/2016		-691,866.98	-79,020,594	1.0000000000 ^F 115.199051866	-691,866.98	-79,702,420	0	-681,826	-681,826
-142,440,822.54000 0.00000	合計 -----			-142,440,823	-16,250,195,644		-142,440,823	-16,409,047,703	0	-158,852,059	-158,852,059
591,072.34	GBP FORWARD 18 OCT FGB18OCT	8/9/2016		591,072.34	79,020,593	1.0000000000 ^F 135.328563543	591,072.34	79,988,971	0	968,378	968,378

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米ドルです。

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 2016年8月31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											
1,685,702.05		8/9/2016		1,685,702.05	225,361,884	1.000000000F 135.328563543	1,685,702.05	228,123,637	0	2,761,753	2,761,753
-48,608,620.50		8/9/2016		-48,608,620.50	-6,491,021,291	1.000000000F 135.328563543	-48,608,620.50	-6,578,134,788	0	-87,113,497	-87,113,497
-41,758,759.30		8/9/2016		-41,758,759.30	-5,576,186,809	1.000000000F 135.328563543	-41,758,759.30	-5,651,152,911	0	-74,966,102	-74,966,102
-1,070,000.00		8/19/2016		-1,070,000.00	-140,029,828	1.000000000F 135.328563543	-1,070,000.00	-144,801,563	0	-4,771,735	-4,771,735
-89,160,605.41000 0.00000	合計 -----			-89,160,605	-11,902,855,451		-89,160,605	-12,065,976,654	0	-163,121,203	-163,121,203
738,098.77000	USD FORWARD 18 OCT FUS18OCT	8/9/2016		738,098.77	75,335,159	1.000000000F 0.009688187	738,098.77	76,185,438	0	850,279	850,279
1,639,725.48000		8/9/2016		1,639,725.48	168,129,206	1.000000000F 0.009688187	1,639,725.48	169,249,982	0	1,120,776	1,120,776
5,709,134.32000		8/9/2016		5,709,134.32	585,385,928	1.000000000F 0.009688187	5,709,134.32	589,288,204	0	3,902,276	3,902,276
7,068,950.39000		8/9/2016		7,068,950.39	724,814,631	1.000000000F 0.009688187	7,068,950.39	729,646,361	0	4,831,730	4,831,730
48,716,684.79000		8/9/2016		48,716,684.79	4,995,163,917	1.000000000F 0.009688187	48,716,684.79	5,028,462,476	0	33,298,559	33,298,559
54,383,267.41000		8/9/2016		54,383,267.41	5,576,186,807	1.000000000F 0.009688187	54,383,267.41	5,613,358,558	0	37,171,751	37,171,751
63,305,436.91000		8/9/2016		63,305,436.91	6,491,021,208	1.000000000F 0.009688187	63,305,436.91	6,534,291,391	0	43,270,183	43,270,183
95,703,702.55000		8/9/2016		95,703,702.55	9,812,976,472	1.000000000F 0.009688187	95,703,702.55	9,878,391,339	0	65,414,867	65,414,867
1,398,062.00000		8/19/2016		1,398,062.00	140,029,828	1.000000000F 0.009688187	1,398,062.00	144,305,844	0	4,276,016	4,276,016
-3,337,548.00000		8/9/2016		-3,337,548.00	-340,657,067	1.000000000F 0.009688187	-3,337,548.00	-344,496,654	0	-3,839,587	-3,839,587

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米ドルです。

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 2016年8月31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											
-1,374,175.88000		8/9/2016		-1,374,175.88	-140,259,383	1.000000000 ^F 0.009688187	-1,374,175.88	-141,840,355	0	-1,580,972	-1,580,972
-213,882.23000		8/9/2016		-213,882.23	-21,975,743	1.000000000 ^F 0.009688187	-213,882.23	-22,076,600	0	-100,857	-100,857
273,737,456.51000 0.00000	合計 -----			273,737,457	28,066,150,963		273,737,457	28,254,765,984	0	188,615,021	188,615,021
42,415,861.92000	非グループ化の有価証券小計			42,415,862	-64,924,389		42,415,862	-198,576,754	0	-133,652,365	-133,652,365
42,415,861.92000	先物（ポジション）合計			42,415,862	-64,924,389		42,415,862	-198,576,754	0	-133,652,365	-133,652,365
725,007,486.92000	クラスに割当てられていない資産合計			740,375,697	71,883,632,595		766,869,316	68,205,335,684	2,989,527,216	-6,667,824,129	-3,678,296,913
1,382,014,061.42000	ポートフォリオ合計			1,397,382,271	43,452,579,366		1,423,875,891	39,663,170,868	2,989,527,216	-6,778,935,716	-3,789,408,500

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米ドルです。

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（平成28年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約38億円）
発行済株式総数 1,002,080株

（２）事業の内容及び営業の状況

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

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

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

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

管理会社は、平成28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	75	6,588,755,740.00米ドル

（３）その他

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

[次へ](#)

5 管理会社の経理の概況

- a. 管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. 管理会社の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c. 管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、平成28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＝101.12円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016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	1,899,536,172.00	192,081,098
1.2	売買目的で保有される金融資産	51,327,462.00	5,190,233
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	51,327,462.00	5,190,233
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	11,888,375.00	1,202,152
1.4.1	持分証券	11,888,375.00	1,202,152
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）	3,195,536,480.00	323,132,649
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	3,195,536,480.00	323,132,649
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	1,343,232.00	135,828
1.9.1	有形固定資産	1,343,232.00	135,828
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	3,743,860.00	378,579
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	3,743,860.00	378,579
1.12	税金資産	124,840.00	12,624
1.12.1	現行税金資産	124,840.00	12,624
1.12.2	繰延税金資産	0.00	0
1.13	その他の資産	21,344,120.00	2,158,317
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	5,184,844,541.00	524,291,480

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016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	43,298,019.00	4,378,296
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	43,298,019.00	4,378,296
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	4,949,902,146.00	500,534,105
2.4.1	金融機関からの預金	1,525,457,379.00	154,254,250
2.4.2	金融機関以外からの預金	3,424,444,767.00	346,279,855
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	274,539.00	27,761
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務	274,539.00	27,761
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	11,045,467.00	1,116,918
2.9.1	現行税金負債	11,045,467.00	1,116,918
2.9.2	繰延税金負債	0.00	0
2.10	その他の負債	15,048,412.00	1,521,695
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	5,019,568,583.00	507,578,775

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016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	3,753,369
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	3,753,369
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：	3,388,782.00	342,674
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	3,388,782.00	342,674
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）	110,531,939.00	11,176,990
3.6	＜自己株式＞		
3.7	当期利益	14,237,268.00	1,439,673
3.8	＜中間配当＞		
3.10	資本合計	165,275,958.00	16,712,705
3.11	負債および資本合計	5,184,844,541.00	524,291,480

(2) 損益の状況

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

損益計算書

2016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（＋／－）	39,434,012.00	3,987,567
5.2	利息収益	12,948,861.00	1,309,389
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	2,800.00	283
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）	6,627,225.00	670,145
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。）	6,318,836.00	638,961
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）（－）	3,570,906.00	361,090
5.3.1	中央銀行からの預金	2,427,476.00	245,466
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）	86,859.00	8,783
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	1,056,571.00	106,840
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（＋）	1,540,573.00	155,783
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	1,540,573.00	155,783
5.6	受取手数料（＋）	50,949,549.00	5,152,018
5.7	（支払手数料）（－）	24,944,611.00	2,522,399
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（＋／－）	2,533,259.00	256,163
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	2,533,259.00	256,163
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（＋）	650,711.00	65,800

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	673,424.00	68,097
5.16	一般管理費（－）	22,071,208.00	2,231,841
5.16.1	従業員費用（－）	9,275,931.00	937,982
5.16.2	一般管理費用（－）	12,795,277.00	1,293,858
5.17	減価償却（＋／－）	1,091,868.00	110,410
5.17.1	有形固定資産	190,017.00	19,215
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	901,851.00	91,195
5.18	引当金（＋／－）	(2,237,832.00)	(226,290)
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（＋／－）	18,508,768.00	1,871,607
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,271,500.00	431,934
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	14,237,268.00	1,439,673
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（＋／－）	14,237,268.00	1,439,673

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

③ 管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

(iii) 資本金の額（平成28年6月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約38億円）

発行済株式総数 1,002,080株（一株37.04米ドルの記名式額面株式）

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(後略)

<訂正後>

(前略)

(iii) 資本金の額（平成28年9月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約38億円）

発行済株式総数 1,002,080株（一株37.04米ドルの記名式額面株式）

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、平成28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=101.12円）による。

(後略)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(前略)

(A) 日本

平成28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28年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

5 運用状況

(2) 投資資産

<訂正前>

① 投資有価証券の主要銘柄

(平成28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	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	24,000,000.00	121.42	2,914,034,551.00	104.00	2,495,940,811.00	3.59
2	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	英国	社債	6.125	2022/12/15	22,800,000.00	90.64	2,066,481,644.00	107.61	2,453,431,565.00	3.52
3	NIPPON LIFE INSURANCE	日本	社債	5.000 (2022年10月以降変動金利)	2042/10/18	22,000,000.00	91.59	2,015,012,741.00	110.72	2,435,935,900.00	3.50
4	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	23,000,000.00	100.22	2,304,989,890.00	105.60	2,428,728,928.00	3.49
5	SOMPO JAPAN INSURANCE	日本	社債	5.325 (2023年3月以降変動金利)	2073/3/28	20,400,000.00	97.47	1,988,297,347.00	113.12	2,307,665,543.00	3.31
6	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	19,000,000.00	111.72	2,122,593,322.00	113.10	2,148,926,044.00	3.09
7	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.375	2025/9/28	19,850,000.00	114.43	2,271,381,455.00	104.59	2,076,060,349.00	2.98
8	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.000 (2022年3月以降変動金利)	2072/3/15	16,800,000.00	92.82	1,559,349,257.00	122.36	2,055,667,234.00	2.95
9	LB BADEN-WUERTTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	16,500,000.00	139.33	2,299,021,395.00	120.78	1,992,868,830.00	2.86
10	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	116.63	1,877,746,168.00	2.70
11	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	133.82	1,873,451,684.00	2.69
12	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	18,150,000.00	110.91	2,012,951,380.00	101.51	1,842,364,262.00	2.65
13	AMERICAN EXPRESS	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	102.33	1,721,249,846.00	2.47
14	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	109.21	1,561,678,911.00	2.24
15	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	3.950	2025/4/21	14,300,000.00	115.63	1,653,496,060.00	104.70	1,497,213,901.00	2.15
16	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	118.13	1,441,145,120.00	2.07
17	WELLS FARGO CAP	米国	社債	5.950	2036/12/15	12,610,000.00	79.66	1,004,488,714.00	109.00	1,374,513,608.00	1.97
18	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/3/9	12,600,000.00	113.37	1,428,400,135.00	108.37	1,365,454,501.00	1.96
19	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	137.15	1,330,330,749.00	1.91

	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	
20	SOCIETE GENERALE	フランス	社債	2.500 (2021年9月以降変動金利)	2026/9/16	11,500,000.00	136.29	1,567,283,607.00	114.33	1,314,837,026.00	1.89
21	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	12,050,000.00	93.99	1,132,541,587.00	107.10	1,290,577,993.00	1.85
22	BBVA BANCOMER SA TEXAS	メキシコ	社債	7.250	2020/4/22	11,370,000.00	105.67	1,201,507,199.00	112.28	1,276,572,651.00	1.83
23	DAI-ICHI MUTUAL	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	2049/10/29	11,310,000.00	115.34	1,304,483,900.00	112.16	1,268,478,548.00	1.82
24	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	12,500,000.00	120.09	1,501,103,453.00	95.73	1,196,584,050.00	1.72
25	RABOBANK NEDERLAND	オランダ	社債	5.500 (2020年6月以降変動金利)	永久債	10,900,000.00	137.11	1,494,505,414.00	109.05	1,188,643,844.00	1.71
26	LLOYDS TSB BANK	英国	社債	7.625	2025/4/22	7,050,000.00	173.81	1,225,382,729.00	166.55	1,174,185,321.00	1.69
27	ASR NEDERLAND NV	オランダ	社債	5.125 (2025年9月以降変動金利)	2045/9/29	9,900,000.00	131.74	1,304,198,011.00	115.97	1,148,105,912.00	1.65
28	ZURICH FINANCE (UK) PLC	英国	社債	6.625 (2022年10月以降変動金利)	永久債	7,340,000.00	169.11	1,241,250,971.00	148.13	1,087,245,132.00	1.56
29	NATIONAL CAPITAL TRUST	米国	社債	5.620 (2018年12月以降変動金利)	永久債	7,376,000.00	120.78	890,898,589.00	139.16	1,026,411,442.00	1.47
30	FUKOKU MUTUAL	日本	社債	5.000 (2025年7月以降変動金利)	2049/12/29	9,400,000.00	124.04	1,166,022,935.00	108.24	1,017,500,735.00	1.46

② 投資不動産物件

該当事項なし。（平成28年6月末日現在）

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（平成28年6月末日現在）

<訂正後>

① 投資有価証券の主要銘柄

(平成28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	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	24,000,000	121.42	2,914,034,551	103.79	2,490,924,552	3.69
2	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	英国	社債	6.125	2022/12/15	22,800,000	90.64	2,066,481,644	107.52	2,451,343,719	3.64
3	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	19,000,000	111.72	2,122,593,322	113.71	2,160,479,741	3.20
4	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.375	2025/9/28	19,850,000	114.43	2,271,381,455	104.33	2,070,956,345	3.07
5	MITSUI SUMITOMO INSURANCE	日本	社債	7.000 (2022年3月以降変動金利)	2072/3/15	16,800,000	92.82	1,559,349,257	121.78	2,045,891,734	3.03
6	LB BADEN-WUERTTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	16,500,000	139.33	2,299,021,395	121.94	2,012,077,825	2.98
7	SOMPO JAPAN NIPPONKOA	日本	社債	5.325 (2023年3月以降変動金利)	2073/3/28	17,200,000	97.47	1,676,407,567	113.44	1,951,187,064	2.89
8	ABN AMRO BANK NV	オランダ	社債	2.875 (2020年6月以降変動金利)	2025/6/30	16,100,000	139.50	2,245,873,831	119.49	1,923,834,478	2.85
9	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	18,150,000	110.91	2,012,951,380	103.12	1,871,612,861	2.78
10	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.950	2027/4/23	17,000,000	110.46	1,877,815,006	105.22	1,788,712,586	2.65
11	NN GROUP NV	オランダ	社債	4.500 (2026年1月以降変動金利)	永久債	14,300,000	143.45	2,051,282,311	114.66	1,639,633,261	2.43
12	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年3月以降変動金利)	永久債	11,600,000	181.91	2,110,132,576	139.73	1,620,919,374	2.40
13	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	3.950	2025/4/21	14,300,000	115.63	1,653,496,060	105.02	1,501,842,589	2.23
14	WELLS FARGO CAPITAL X	米国	社債	5.950	2036/12/15	12,610,000	79.66	1,004,488,714	110.90	1,398,415,337	2.07
15	UBS GROUP FUNDING	ジャージー	社債	4.125	2025/9/24	12,900,000	106.17	1,369,579,481	106.56	1,374,560,598	2.04
16	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/3/9	12,600,000	113.37	1,428,400,135	108.73	1,370,039,534	2.03
17	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	141.61	1,373,574,896	138.44	1,342,820,539	1.99
18	SOCIETE GENERALE	フランス	社債	2.500 (2021年9月以降変動金利)	2026/9/16	11,500,000	136.29	1,567,283,607	116.70	1,342,090,842	1.99
19	ERSTE GROUP BANK AG	オーストリア	社債	5.500 (2020年5月以降変動金利)	2025/5/26	12,800,000	104.45	1,336,944,885	104.66	1,339,692,272	1.99
20	DISCOVER BANK	米国	社債	4.250	2026/3/13	12,250,000	108.96	1,334,720,444	108.12	1,324,515,125	1.96
21	BBVA BANCOMER SA TEXAS	メキシコ	社債	7.250	2020/4/22	11,370,000	105.67	1,201,507,199	111.67	1,269,676,199	1.88
22	LLOYDS BANK PLC	英国	社債	7.625	2025/4/22	7,050,000	173.81	1,225,382,729	174.43	1,229,733,416	1.82

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格（円）		時価（円）		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
23	COOPERATIEVE RABOBANK UA	オランダ	社債	5.500 (2020年6月 以降変動金利)	永久債	10,900,000	137.11	1,494,505,414	112.61	1,227,400,518	1.82
24	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	12,500,000	120.09	1,501,103,453	97.58	1,219,749,613	1.81
25	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	10,700,000	100.22	1,072,321,384	105.52	1,129,033,155	1.67
26	ZURICH FINANCE (UK) PLC	英国	社債	6.625 (2022年10月 以降変動金利)	永久債	7,340,000	169.11	1,241,250,971	151.95	1,115,290,307	1.65
27	FUKOKU MUTUAL LIFE INSUR	日本	社債	5.000% (2025年7月 以降変動金利)	永久債	9,400,000	124.04	1,166,022,935	110.02	1,034,201,070	1.53
28	NATIONAL CAPITAL TRUST	米国	社債	5.620 (2018年12月 以降変動金利)	永久債	7,376,000	120.78	890,898,589	138.53	1,021,783,838	1.52
29	SYNCHRONY FINANCIAL	米国	社債	3.700	2026/8/4	9,900,000	101.98	1,009,601,692	100.66	996,578,536	1.48
30	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年6月 以降変動金利)	2043/6/15	9,000,000	93.99	845,881,683	108.88	979,939,432	1.45

② 投資不動産物件

該当事項なし。（平成28年9月末日現在）

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（平成28年9月末日現在）