

【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29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 鈴木 惣太

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦

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

【電話番号】 03(6212)8316

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

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】 米ドル建 米ドルヘッジクラス：
20億アメリカ合衆国ドル(約2,240億円)を上限とする。
豪ドル建 豪ドルヘッジクラス：
20億オーストラリアドル(約1,723億6,000万円)を上限とする。
(注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびオーストラリア
ドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2017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=112.00円および1豪ドル=86.18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、2017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。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するため、また、その他一部情報の時点を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

２【訂正の内容】

(１) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容＊と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 第１ ５ ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(１) 投資状況	１ ファンドの運用状況	(１) 投資状況	更新
	(３) 運用実績		(２) 運用実績	追加 または 更新
	(４) 販売及び買戻しの実績	２ 販売及び買戻しの実績		追加
第３ １ ファンドの経理状況 財務諸表		３ ファンドの経理状況		追加
第三部 第１ １ 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(１) 資本金の額	４ 管理会社の概況	(１) 資本金の額	更新
	２ 事業の内容及び営業の概況		(２) 事業の内容及び営業の状況	更新
３ 管理会社の経理状況		５ 管理会社の経理の概況		追加
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

（2017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	9,855,743,015	19.17
	英国	9,378,523,666	18.24
	オランダ	6,518,603,116	12.68
	フランス	5,658,725,075	11.00
	オーストリア	2,888,306,088	5.62
	日本	2,783,491,106	5.41
	スウェーデン	2,308,805,162	4.49
	カナダ	2,205,431,564	4.29
	ジャージー	1,955,194,583	3.80
	スペイン	1,647,978,019	3.20
	ノルウェー	1,109,321,244	2.16
	バーミューダ	1,055,988,936	2.05
	ドイツ	920,956,011	1.79
	アイルランド	852,182,404	1.66
	ケイマン諸島	542,597,033	1.06
	ベルギー	369,403,728	0.72
小計		50,051,250,750	97.33
現金・その他の資産 （負債控除後）		1,372,402,373	2.67
合計（純資産総額）		51,423,653,123	100.00

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）およびオーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、2017年9月29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＝112.73円および１豪ドル＝88.47円）による。以下、米ドルおよび豪ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

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

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

(２) 運用実績

純資産の推移

2017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
2016年10月末日	156,520,958.70	17,644,608	0.009711	1.0947
11月末日	143,803,206.46	16,210,935	0.009451	1.0654
12月末日	137,891,444.82	15,544,503	0.009515	1.0726
2017年１月末日	133,108,994.30	15,005,377	0.009521	1.0733
２月末日	133,400,589.53	15,038,248	0.009601	1.0823
３月末日	128,485,720.53	14,484,195	0.009591	1.0812
４月末日	127,922,716.58	14,420,728	0.009676	1.0908
５月末日	125,544,295.66	14,152,608	0.009755	1.0997
６月末日	123,114,507.57	13,878,698	0.009723	1.0961
７月末日	123,052,064.59	13,871,659	0.009788	1.1034
８月末日	119,275,755.98	13,445,956	0.009793	1.1040
９月末日	110,806,706.04	12,491,240	0.009727	1.0965

< 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
2016年10月末日	54,113,277.02	4,787,402	0.009066	0.8021
11月末日	52,038,906.06	4,603,882	0.008802	0.7787
12月末日	51,672,671.10	4,571,481	0.008855	0.7834
2017年1月末日	50,945,289.34	4,507,130	0.008847	0.7827
2月末日	49,818,239.77	4,407,420	0.008905	0.7878
3月末日	47,677,686.48	4,218,045	0.008889	0.7864
4月末日	41,571,149.60	3,677,800	0.008956	0.7923
5月末日	40,425,250.03	3,576,422	0.009022	0.7982
6月末日	40,184,850.70	3,555,154	0.008977	0.7942
7月末日	39,774,921.78	3,518,887	0.009019	0.7979
8月末日	38,549,134.19	3,410,442	0.009006	0.7968
9月末日	37,456,869.55	3,313,809	0.008929	0.7899

< 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～2017年9月29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る。以下同じ。

分配の推移

2017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
2016年10月１日～2017年９月末日	0.000540	0.060874

< 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
2016年10月１日～2017年９月末日	0.000720	0.063698

< 参考情報 >

分配の推移（2017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
第5会計年度(2016年３月１日～2017年２月28日)	0.000540
2017年５月	0.000045
2017年６月	0.000045
2017年７月	0.000045
2017年８月	0.000045
2017年９月	0.000045
直近1年間累計	0.000540
設定来累計	0.002520

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
第5会計年度(2016年３月１日～2017年２月28日)	0.000720
2017年５月	0.000060
2017年６月	0.000060
2017年７月	0.000060
2017年８月	0.000060
2017年９月	0.000060
直近1年間累計	0.000720
設定来累計	0.004000

収益率の推移

2017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）
2016年10月１日～2017年９月末日	5.08%

（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）
2016年10月１日～2017年９月末日	5.67%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝上記期間末の１口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b＝上記期間の直前の日の１口当たり純資産価格

<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、2017年については2017年9月末日における課税前分配金再投資換算１口当たり純資産価格

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

（注2）2012年は12月13日（運用開始日）から12月末日までの収益率である。2017年は1月1日から9月末日までの収益率である。

（注3）ファンドおよび各クラスに、ベンチマークはない。

２ 販売及び買戻しの実績

2017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2017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
2016年10月１日～ 2017年９月末日	452,462,266 (452,462,266)	5,301,745,790 (5,301,745,790)	11,391,822,900 (11,391,822,900)

<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
2016年10月１日～ 2017年９月末日	331,925,259 (331,925,259)	2,063,012,845 (2,063,012,845)	4,195,085,223 (4,195,085,223)

（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

2017年 8 月31日現在

	円
資産	
現金	2,083,177,238
銀行預金 - 基準通貨	527,929,191
銀行預金 - 外国通貨	1,555,248,047
ブローカーが保有する現金	(145,415,146)
ブローカーが保有する現金 - 米ドル	(145,415,146)
有価証券（取得原価）	47,529,648,455
債券（取得原価）	47,529,648,455
未実現評価損益	2,540,161,159
未実現時価評価損益	2,588,195,909
未実現通貨運用損益	(52,716,045)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(33,450)
未実現通貨繰延損益	4,714,745
未収収益	869,074,362
現金に係る未収利息	612,372
債券に係る未収利息	868,461,990
資本証券	178,946,897
受益証券販売未収金	178,946,897
資産合計：	53,055,592,965

2017年 8 月31日現在

		円
負債		
資本証券		99,763,804
受益証券買戻未払金		99,763,804
未払費用		89,609,543
未払監査費用		1,117,588
未払報告書作成費用		95,999
未払投資顧問報酬		55,275,752
未払受託報酬		911,082
未払管理報酬		11,445,704
未払代行協会員報酬		1,436,566
未払販売報酬		17,037,707
未払副管理報酬		2,289,145
負債合計：		189,373,347
資本		
ファンド受益証券		57,142,273,250
発行済ファンド受益証券（額面価額）		71,700,786,164,667
米ドル建 米ドルヘッジ	41,093,998,630,579	
ブラジル・レアル	9,436,067,897	
米ドル	2,562,868,562	
豪ドル	3,366,007,785	
ユーロ	24,647,754	
日本円	20,799,557,770	
資源国通貨バスケット	89,097,375	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,565,870,286,798	
メキシコ・ペソ	690,056,179	
トルコ・リラ	1,140,453,294	
ロシア・ルーブル	2,808,490,674	

2017年 8 月31日現在

円

受益証券額面超過額	(71,643,643,891,417)
-----------	----------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(41,086,645,592,162)
-------------	----------------------

ブラジル・レアル	3,698,443,103
----------	---------------

米ドル	(382,313,562)
-----	---------------

豪ドル	(930,959,785)
-----	---------------

ユーロ	(1,275,754)
-----	-------------

日本円	3,058,598,230
-----	---------------

資源国通貨バスケット	41,053,625
------------	------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,263,700,465)
-------------	----------------------

メキシコ・ペソ	6,532,321
---------	-----------

トルコ・リラ	(429,064,794)
--------	---------------

ロシア・ルーブル	(795,612,174)
----------	---------------

分配金支払額	(46,877,364,818)
--------	------------------

配当金支払額	(46,877,364,818)
--------	------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(6,105,270,297)
-------------	-----------------

ブラジル・レアル	(14,631,516,495)
----------	------------------

米ドル	(2,221,908,524)
-----	-----------------

豪ドル	(3,841,285,082)
-----	-----------------

ユーロ	(14,893,597)
-----	--------------

日本円	(16,079,723,897)
-----	------------------

資源国通貨バスケット	(275,526,484)
------------	---------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(2,744,511,189)
-------------	-----------------

メキシコ・ペソ	(249,626,856)
---------	---------------

トルコ・リラ	(92,870,743)
--------	--------------

ロシア・ルーブル	(620,231,654)
----------	---------------

2017年 8 月31日現在

		円
利益剰余金		39,844,221,709
利益剰余金		39,844,221,709
米ドル建 米ドルヘッジ	29,541,533,957	
ブラジル・リアル	18,769,282,863	
米ドル	9,760,974,755	
豪ドル	14,203,146,391	
ユーロ	52,131,403	
日本円	31,237,878,291	
資源国通貨バスケット	603,379,251	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	3,619,470,228	
メキシコ・ペソ	133,630,061	
トルコ・リラ	14,162,124	
ロシア・ルーブル	223,715,091	
中間純利益		2,757,089,477
資本合計：		52,866,219,618
負債および資本合計		53,055,592,965
純資産額合計		52,866,219,618
発行済受益証券総数		16,463,458,931.72900口
受益証券 1 口当たり純資産額合計		3.211125

損益計算書

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2017年３月１日から2017年８月31日までの期間

円

収益

実現損益	2,245,053,085
------	---------------

為替取引に係る実現利益	7,658,640,827
-------------	---------------

ブラジル・レアル	1,328,262,866
----------	---------------

豪ドル	496,050,852
-----	-------------

ユーロ	4,254,044
-----	-----------

日本円	1,600,293,744
-----	---------------

資源国通貨バスケット	14,806,291
------------	------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	524,147,067
-------------	-------------

メキシコ・ペソ	118,114,860
---------	-------------

トルコ・リラ	23,734,056
--------	------------

ロシア・ルーブル	272,250,685
----------	-------------

為替取引に係る実現損失	(7,046,852,468)
-------------	-----------------

ブラジル・レアル	(938,586,390)
----------	---------------

豪ドル	(291,454,853)
-----	---------------

ユーロ	(1,759,706)
-----	-------------

日本円	(543,297,880)
-----	---------------

資源国通貨バスケット	(11,849,696)
------------	--------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(352,777,305)
-------------	---------------

メキシコ・ペソ	(39,678,881)
---------	--------------

トルコ・リラ	(12,489,076)
--------	--------------

ロシア・ルーブル	(189,200,053)
----------	---------------

市場に係る実現利益	888,263,643
-----------	-------------

市場に係る実現損失	(118,938,204)
-----------	---------------

2017年3月1日から2017年8月31日までの期間

円

通貨に係る実現利益		4,089,319,694
米ドル建 米ドルヘッジ	12,198,710	
ブラジル・レアル	2	
豪ドル	1	
ユーロ	3	
日本円	2	
資源国通貨バスケット	4	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	4,730,329	
メキシコ・ペソ	3	
トルコ・リラ	3	
ロシア・ルーブル	2	
通貨に係る実現損失		(3,225,380,407)
米ドル建 米ドルヘッジ	(10,617,896)	
ユーロ	(2)	
資源国通貨バスケット	(8)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(2,287,331)	
メキシコ・ペソ	(2)	
トルコ・リラ	(3)	
ロシア・ルーブル	(4)	
受取利息		1,225,894,679
現金に係る受取利息		2,787,982
債券に係る受取利息		1,223,106,697
未実現評価損益		(433,835,842)
未実現時価評価損益		1,079,344,701
未実現通貨運用損益		(1,512,194,675)
ブラジル・レアル	(241,616,538)	
豪ドル	(78,890,064)	
ユーロ	530,570	
日本円	(889,035,122)	
資源国通貨バスケット	(217,574)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(71,365,004)	
メキシコ・ペソ	(11,056,925)	
トルコ・リラ	11,815,560	
ロシア・ルーブル	(1,691,642)	

2017年３月１日から2017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	(5,198,080)
-------------------	-------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(208,630)
-------------	-----------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(99,807)
-------------	----------

未実現通貨繰延損益	4,212,212
-----------	-----------

収益合計：	3,037,111,922
-------	---------------

2017年３月１日から2017年８月31日までの期間

円

費用

費用 - 報酬		278,566,225
監査費用		1,159,932
報告書作成費用		1,261,762
投資顧問報酬		172,078,006
米ドル建 米ドルヘッジ	56,162,705	
ブラジル・レアル	16,239,577	
米ドル	11,572,063	
豪ドル	9,745,596	
ユーロ	76,535	
日本円	56,967,926	
資源国通貨バスケット	214,715	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	14,544,731	
メキシコ・ペソ	1,257,456	
トルコ・リラ	493,763	
ロシア・ルーブル	4,802,939	
受託報酬		2,835,529
現金支出費用		480,583
未払管理報酬		35,402,775
代行協会員報酬		4,415,775
米ドル建 米ドルヘッジ	3,523,387	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	912,461	
販売報酬		52,371,043
米ドル建 米ドルヘッジ	41,787,301	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	10,821,867	
副保管報酬		1,377,678
ケイマン諸島年間報酬		102,571
副管理報酬		7,080,571
税金支払額		935,096
その他の税金支払額		935,096

2017年３月１日から2017年８月31日までの期間

円

費用	
支払利息	521,124
当座借越利息	120,277
支払利息	400,847
費用合計：	280,022,445
投資純利益	2,757,089,477

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
38,581,290.95000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/29/2017	AUD	38,581,290.95	3,347,971,958	1.000000000F 87.079258060	38,581,290.95	3,359,630,191	0	11,658,233	11,658,233
39,843,107.06000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	8/3/2017	AUD	39,843,107.06	3,487,654,356	1.000000000F 87.237426252	39,843,107.06	3,475,810,114	0	-11,844,242	-11,844,242
-935,000.00000		8/9/2017	AUD	-935,000.00	-80,900,495	1.000000000F 87.237426252	-935,000.00	-81,566,994	0	-666,499	-666,499
-38,908,107.06000		8/29/2017	AUD	-38,908,107.06	-3,365,965,530	1.000000000F 87.237426252	-38,908,107.06	-3,394,243,120	0	-28,277,590	-28,277,590
0.00000	合計 -----			0	40,788,331		0	0	0	-40,788,331	-40,788,331
0.00000											
-30,681,000.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2017	AUD	-30,681,000.00	-3,347,971,940	1.000000000F 0.009103694	-30,681,000.00	-3,370,170,395	0	-22,198,455	-22,198,455
735,358.80000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/9/2017	AUD	735,358.80	80,900,495	1.000000000F 0.009090697	735,358.80	80,891,355	0	-9,140	-9,140
30,951,399.17000		8/29/2017	AUD	30,951,399.17	3,365,965,501	1.000000000F 0.009090697	30,951,399.17	3,404,733,341	0	38,767,840	38,767,840
-31,566,100.00000		8/3/2017	AUD	-31,566,100.00	-3,487,654,349	1.000000000F 0.009090697	-31,566,100.00	-3,472,352,010	0	15,302,339	15,302,339
120,657.97000	合計 -----			120,658	-40,788,353		120,658	13,272,686	0	54,061,039	54,061,039
0.00000											
8,020,948.92000	非グループ化の有価証券小計			8,020,949	-4		8,020,949	2,732,482	0	2,732,486	2,732,486
8,020,948.92000	先物（ポジション）合計			8,020,949	-4		8,020,949	2,732,482	0	2,732,486	2,732,486
8,020,948.92000	豪ドルクラス受益証券合計			8,020,949	-4		8,020,949	2,732,482	0	2,732,486	2,732,486

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
21,961,983.12000	AUD FORWARD 10 NOV FAU10NOV	8/29/2017	AUH	21,961,983.12	1,905,796,872	1.000000000F 86.926974127	21,961,983.12	1,909,088,738	0	3,291,866	3,291,866
17,134,902.40000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/3/2017	AUH	17,134,902.40	1,499,898,512	1.000000000F 87.079258060	17,134,902.40	1,492,094,588	0	-7,803,924	-7,803,924
23,724,972.21000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	6/29/2017	AUH	23,724,972.21	2,051,211,156	1.000000000F 87.237426252	23,724,972.21	2,069,705,513	0	18,494,357	18,494,357
-884,000.00000		8/9/2017	AUH	-884,000.00	-76,487,741	1.000000000F 87.237426252	-884,000.00	-77,117,885	0	-630,144	-630,144
-535,000.00000		8/17/2017	AUH	-535,000.00	-46,546,849	1.000000000F 87.237426252	-535,000.00	-46,672,023	0	-125,174	-125,174
-22,305,972.21000		8/29/2017	AUH	-22,305,972.21	-1,929,704,079	1.000000000F 87.237426252	-22,305,972.21	-1,945,915,606	0	-16,211,527	-16,211,527
0.00000	合計 -----			0	-1,527,513		0	-1	0	1,527,512	1,527,512
0.00000											
-17,457,800.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	AUH	-17,457,800.00	-1,905,796,860	1.000000000F 0.009116149	-17,457,800.00	-1,915,041,099	0	-9,244,239	-9,244,239
-13,570,500.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017	AUH	-13,570,500.00	-1,499,898,520	1.000000000F 0.009103694	-13,570,500.00	-1,490,658,627	0	9,239,893	9,239,893
695,248.32000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/9/2017	AUH	695,248.32	76,487,740	1.000000000F 0.009090697	695,248.32	76,479,099	0	-8,641	-8,641
423,441.80000		8/17/2017	AUH	423,441.80	46,546,848	1.000000000F 0.009090697	423,441.80	46,579,685	0	32,837	32,837
17,744,400.89000		8/29/2017	AUH	17,744,400.89	1,929,704,079	1.000000000F 0.009090697	17,744,400.89	1,951,929,636	0	22,225,557	22,225,557

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券</u>											
<u>先物 (ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-18,141,300.00000		6/29/2017		-18,141,300.00	-2,051,211,160	1.0000000000F	-18,141,300.00	-1,995,589,557	0	55,621,603	55,621,603
			AUH			0.009090697					
721,791.01000	合計 -----			721,791	1,527,507		721,791	79,398,863	0	77,871,356	77,871,356
0.00000											
8,790,376.53000	非グループ化の有価証券小計			8,790,377	-2		8,790,377	74,882,462	0	74,882,464	74,882,464
8,790,376.53000	先物 (ポジション) 合計			8,790,377	-2		8,790,377	74,882,462	0	74,882,464	74,882,464
8,790,376.53000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			8,790,377	-2		8,790,377	74,882,462	0	74,882,464	74,882,464

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
278,661.52000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/29/2017		278,661.52	24,181,434	1.000000000F 87.079258060	278,661.52	24,265,638	0	84,204	84,204
299,018.00000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	8/3/2017	BKH	299,018.00	26,174,450	1.000000000F 87.237426252	299,018.00	26,085,561	0	-88,889	-88,889
-17,000.00000		8/21/2017	BKH	-17,000.00	-1,467,476	1.000000000F 87.237426252	-17,000.00	-1,483,036	0	-15,560	-15,560
-282,018.00000		8/29/2017	BKH	-282,018.00	-24,397,560	1.000000000F 87.237426252	-282,018.00	-24,602,524	0	-204,964	-204,964
0.00000	合計 -----			0	309,414		0	1	0	-309,413	-309,413
0.00000											
706,017.60000	BRL FORWARD 11 OCT FBR11OCT	8/29/2017	BKH	706,017.60	24,244,335	1.000000000F 0.028823642	706,017.60	24,494,392	0	250,057	250,057
743,581.72000	BRL FORWARD 11 SEP FBR11SEP	8/3/2017	BKH	743,581.72	26,229,811	1.000000000F 0.028652634	743,581.72	25,951,601	0	-278,210	-278,210
-44,000.00000		8/21/2017	BKH	-44,000.00	-1,516,470	1.000000000F 0.028652634	-44,000.00	-1,535,635	0	-19,165	-19,165
-699,581.72000		8/29/2017	BKH	-699,581.72	-23,977,160	1.000000000F 0.028652634	-699,581.72	-24,415,965	0	-438,805	-438,805
0.00000	合計 -----			0	736,181		0	1	0	-736,180	-736,180
0.00000											
-221,600.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2017	BKH	-221,600.00	-24,395,044	1.000000000F 0.009103694	-221,600.00	-24,341,767	0	53,277	53,277
-221,600.00000		8/29/2017	BKH	-221,600.00	-24,181,434	1.000000000F 0.009103694	-221,600.00	-24,341,767	0	-160,333	-160,333
-221,600.00000		8/29/2017	BKH	-221,600.00	-24,244,335	1.000000000F 0.009103694	-221,600.00	-24,341,767	0	-97,432	-97,432
-664,800.00000	合計 -----			-664,800	-72,820,813		-664,800	-73,025,301	0	-204,488	-204,488
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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
13,493.41000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/21/2017		13,493.41	1,467,476	1.000000000F 0.009090697	13,493.41	1,484,310	0	16,834	16,834
13,943.91000		8/21/2017	BKH	13,943.91	1,516,470	1.000000000F 0.009090697	13,943.91	1,533,866	0	17,396	17,396
14,004.01000		8/21/2017	BKH	14,004.01	1,523,006	1.000000000F 0.009090697	14,004.01	1,540,477	0	17,471	17,471
220,479.58000		8/29/2017	BKH	220,479.58	23,977,160	1.000000000F 0.009090697	220,479.58	24,253,320	0	276,160	276,160
224,345.32000		8/29/2017	BKH	224,345.32	24,397,560	1.000000000F 0.009090697	224,345.32	24,678,561	0	281,001	281,001
227,202.79000		8/29/2017	BKH	227,202.79	24,708,310	1.000000000F 0.009090697	227,202.79	24,992,890	0	284,580	284,580
-236,900.00000		8/3/2017	BKH	-236,900.00	-26,174,451	1.000000000F 0.009090697	-236,900.00	-26,059,608	0	114,843	114,843
-236,900.00000		8/3/2017	BKH	-236,900.00	-26,229,811	1.000000000F 0.009090697	-236,900.00	-26,059,608	0	170,203	170,203
-236,900.00000		8/3/2017	BKH	-236,900.00	-25,956,239	1.000000000F 0.009090697	-236,900.00	-26,059,608	0	-103,369	-103,369
2,769.02000 0.00000	合計 -----			2,769	-770,519		2,769	304,600	0	1,075,119	1,075,119
2,912,821.20000	ZAR FORWARD 11 OCT FZA11OCT	8/29/2017	BKH	2,912,821.20	24,395,044	1.000000000F 0.119122571	2,912,821.20	24,452,303	0	57,259	57,259
3,157,403.20000	ZAR FORWARD 11 SEP FZA11SEP	8/3/2017	BKH	3,157,403.20	25,956,239	1.000000000F 0.118369190	3,157,403.20	26,674,198	0	717,959	717,959
-185,000.00000		8/21/2017	BKH	-185,000.00	-1,523,006	1.000000000F 0.118369190	-185,000.00	-1,562,907	0	-39,901	-39,901

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-2,972,403.20000		8/29/2017		-2,972,403.20	-24,708,310	1.0000000000 ^F 0.118369190	-2,972,403.20	-25,111,291	0	-402,981	-402,981
			BKH								
0.00000	合計 -----			0	-275,077		0	0	0	275,077	275,077
0.00000											
3,235,469.34000	非グループ化の有価証券小計			3,235,469	-1		3,235,469	491,634	0	491,635	491,635
3,235,469.34000	先物（ポジション）合計			3,235,469	-1		3,235,469	491,634	0	491,635	491,635
3,235,469.34000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			3,235,469	-1		3,235,469	491,634	0	491,635	491,635

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
86,642,802.74000	BRL FORWARD 10 NOV FBR10NOV	8/29/2017	BRH	86,642,802.74	2,975,275,820	1.000000000F 0.028986182	86,642,802.74	2,989,107,111	0	13,831,291	13,831,291
69,636,535.21000	BRL FORWARD 11 OCT FBR11OCT	8/3/2017	BRH	69,636,535.21	2,456,425,536	1.000000000F 0.028823642	69,636,535.21	2,415,951,989	0	-40,473,547	-40,473,547
92,057,061.00000	BRL FORWARD 11 SEP FBR11SEP	6/29/2017	BRH	92,057,061.00	3,145,492,119	1.000000000F 0.028652634	92,057,061.00	3,212,865,561	0	67,373,442	67,373,442
-3,516,000.00000		8/8/2017	BRH	-3,516,000.00	-123,533,932	1.000000000F 0.028652634	-3,516,000.00	-122,711,231	0	822,701	822,701
-88,541,061.00000		8/29/2017	BRH	-88,541,061.00	-3,034,617,961	1.000000000F 0.028652634	-88,541,061.00	-3,090,154,329	0	-55,536,368	-55,536,368
0.00000	合計 -----			0	-12,659,774		0	1	0	12,659,775	12,659,775
0.00000											
-27,081,800.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	BRH	-27,081,800.00	-2,975,275,838	1.000000000F 0.009116149	-27,081,800.00	-2,970,750,039	0	4,525,799	4,525,799
-22,078,100.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017	BRH	-22,078,100.00	-2,456,425,541	1.000000000F 0.009103694	-22,078,100.00	-2,425,180,372	0	31,245,169	31,245,169
1,115,128.45000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/8/2017	BRH	1,115,128.45	123,533,932	1.000000000F 0.009090697	1,115,128.45	122,666,991	0	-866,941	-866,941
27,904,526.00000		8/29/2017	BRH	27,904,526.00	3,034,617,961	1.000000000F 0.009090697	27,904,526.00	3,069,569,473	0	34,951,512	34,951,512
-27,545,500.00000		6/29/2017	BRH	-27,545,500.00	-3,145,492,147	1.000000000F 0.009090697	-27,545,500.00	-3,030,075,692	0	115,416,455	115,416,455
1,474,154.45000	合計 -----			1,474,154	12,659,746		1,474,154	162,160,772	0	149,501,026	149,501,026
0.00000											
108,593,592.40000	非グループ化の有価証券小計			108,593,592	-51		108,593,592	171,289,462	0	171,289,513	171,289,513
108,593,592.40000	先物（ポジション）合計			108,593,592	-51		108,593,592	171,289,462	0	171,289,513	171,289,513
108,593,592.40000	ブラジル・リアルクラス受益証券合計			108,593,592	-51		108,593,592	171,289,462	0	171,289,513	171,289,513

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>ユーロクラス受益証券</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
101,544.63000	EUR FORWARD 10 NOV FEU10NOV	8/29/2017	EUH	101,544.63	13,280,289	1.000000000F 130.911419704	101,544.63	13,293,352	0	13,063	13,063
130,156.59000	EUR FORWARD 11 OCT FEU11OCT	8/3/2017		130,156.59	17,017,482	1.000000000F 130.888030787	130,156.59	17,035,940	0	18,458	18,458
4,329.08000		8/9/2017	EUH	4,329.08	559,229	1.000000000F 130.888030787	4,329.08	566,625	0	7,396	7,396
134,485.67000	合計 -----			134,486	17,576,711		134,486	17,602,565	0	25,854	25,854
0.00000											
103,316.71000	EUR FORWARD 11 SEP FEU11SEP	6/29/2017	EUH	103,316.71	13,291,800	1.000000000F 130.859478512	103,316.71	13,519,971	0	228,171	228,171
-103,316.71000		8/29/2017		-103,316.71	-13,565,642	1.000000000F 130.859478512	-103,316.71	-13,519,971	0	45,671	45,671
0.00000	合計 -----			0	-273,842		0	0	0	273,842	273,842
0.00000											
-123,000.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	EUH	-123,000.00	-13,280,289	1.000000000F 0.009116149	-123,000.00	-13,492,539	0	-212,250	-212,250
-154,600.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017		-154,600.00	-17,017,482	1.000000000F 0.009103694	-154,600.00	-16,982,117	0	35,365	35,365
-5,100.00000		8/9/2017	EUH	-5,100.00	-559,229	1.000000000F 0.009103694	-5,100.00	-560,212	0	-983	-983
-159,700.00000	合計 -----			-159,700	-17,576,711		-159,700	-17,542,329	0	34,382	34,382
0.00000											
124,741.50000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2017	EUH	124,741.50	13,565,642	1.000000000F 0.009090697	124,741.50	13,721,885	0	156,243	156,243
-118,200.00000		6/29/2017		-118,200.00	-13,291,799	1.000000000F 0.009090697	-118,200.00	-13,002,303	0	289,496	289,496
6,541.50000	合計 -----			6,542	273,843		6,542	719,582	0	445,739	445,739
0.00000											
-40,128.20000	非グループ化の有価証券小計			-40,128	1		-40,128	580,631	0	580,630	580,630
-40,128.20000	先物(ポジション)合計			-40,128	1		-40,128	580,631	0	580,630	580,630
-40,128.20000	ユーロクラス受益証券合計			-40,128	1		-40,128	580,631	0	580,630	580,630

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-17,715,200.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	JPH	-17,715,200.00	-1,914,348,819	1.000000000F 0.009116149	-17,715,200.00	-1,943,276,706	0	-28,927,887	-28,927,887
-168,338,500.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017	JPH	-168,338,500.00	-18,580,866,963	1.000000000F 0.009103694	-168,338,500.00	-18,491,230,044	0	89,636,919	89,636,919
2,029,764.53000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/18/2017	JPH	2,029,764.53	220,676,001	1.000000000F 0.009090697	2,029,764.53	223,279,307	0	2,603,306	2,603,306
18,714,467.57000		8/29/2017	JPH	18,714,467.57	2,028,283,362	1.000000000F 0.009090697	18,714,467.57	2,058,639,461	0	30,356,099	30,356,099
-20,097,400.00000		6/29/2017	JPH	-20,097,400.00	-2,248,959,355	1.000000000F 0.009090697	-20,097,400.00	-2,210,765,577	0	38,193,778	38,193,778
646,832.10000 0.00000	合計 -----			646,832	8		646,832	71,153,191	0	71,153,183	71,153,183
-185,406,867.90000	非グループ化の有価証券小計			-185,406,868	-20,495,215,774		-185,406,868	-20,363,353,559	0	131,862,215	131,862,215
-185,406,867.90000	先物（ポジション）合計			-185,406,868	-20,495,215,774		-185,406,868	-20,363,353,559	0	131,862,215	131,862,215
-185,406,867.90000	日本円クラス受益証券合計			-185,406,868	-20,495,215,774		-185,406,868	-20,363,353,559	0	131,862,215	131,862,215

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>メキシコ・ペソクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
28,386,870.40	MXN FORWARD 10 NOV FMX10NOV	8/29/2017		28,386,870.40	172,524,158	1.000000000F 0.164324005	28,386,870.40	172,749,383	0	225,225	225,225
49,682,201.80	MXN FORWARD 11 OCT FMX11OCT	8/3/2017	MXH	49,682,201.80	306,184,941	1.000000000F 0.163359940	49,682,201.80	304,127,204	0	-2,057,737	-2,057,737
5,371,870.90		8/8/2017	MXH	5,371,870.90	33,175,405	1.000000000F 0.163359940	5,371,870.90	32,883,649	0	-291,756	-291,756
55,054,072.70000 0.00000	合計 -----			55,054,073	339,360,346		55,054,073	337,010,853	0	-2,349,493	-2,349,493
30,677,737.09	MXN FORWARD 11 SEP FMX11SEP	6/29/2017	MXH	30,677,737.09	192,008,292	1.000000000F 0.162311977	30,677,737.09	189,004,765	0	-3,003,527	-3,003,527
-1,624,000.00		8/22/2017	MXH	-1,624,000.00	-10,058,213	1.000000000F 0.162311977	-1,624,000.00	-10,005,423	0	52,790	52,790
-29,053,737.09		8/29/2017	MXH	-29,053,737.09	-176,524,518	1.000000000F 0.162311977	-29,053,737.09	-178,999,342	0	-2,474,824	-2,474,824
0.00000 0.00000	合計 -----			0	5,425,561		0	0	0	-5,425,561	-5,425,561
-1,571,200.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	MXH	-1,571,200.00	-172,524,159	1.000000000F 0.009116149	-1,571,200.00	-172,353,480	0	170,679	170,679
-2,756,600.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017	MXH	-2,756,600.00	-306,184,943	1.000000000F 0.009103694	-2,756,600.00	-302,800,160	0	3,384,783	3,384,783
-296,600.00000		8/8/2017	MXH	-296,600.00	-33,175,405	1.000000000F 0.009103694	-296,600.00	-32,580,181	0	595,224	595,224
-3,053,200.00000 0.00000	合計 -----			-3,053,200	-339,360,348		-3,053,200	-335,380,341	0	3,980,007	3,980,007

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>メキシコ・ペソクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
91,901.99000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/22/2017		91,901.99	10,058,213	1.000000000F 0.009090697	91,901.99	10,109,455	0	51,242	51,242
1,623,213.55000		8/29/2017	MXH	1,623,213.55	176,524,518	1.000000000F 0.009090697	1,623,213.55	178,557,656	0	2,033,138	2,033,138
-1,701,700.00000		6/29/2017	MXH	-1,701,700.00	-192,008,294	1.000000000F 0.009090697	-1,701,700.00	-187,191,367	0	4,816,927	4,816,927
13,415.54000	合計 -----		MXH	13,416	-5,425,563		13,416	1,475,744	0	6,901,307	6,901,307
0.00000											
78,829,958.64000	非グループ化の有価証券小計			78,829,959	-5		78,829,959	3,502,159	0	3,502,164	3,502,164
78,829,958.64000	先物（ポジション）合計			78,829,959	-5		78,829,959	3,502,159	0	3,502,164	3,502,164
78,829,958.64000	メキシコ・ペソクラス受益証券合計			78,829,959	-5		78,829,959	3,502,159	0	3,502,164	3,502,164

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>ロシア・ルーブルクラス受益証券</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
360,475,745.00	RUB FORWARD 10 NOV FRU10NOV	8/29/2017		360,475,745.00	666,821,718	1.000000000F 0.536510365	360,475,745.00	671,889,620	0	5,067,902	5,067,902
553,141,533.00	RUB FORWARD 11 OCT FRU11OCT	8/3/2017	RUH	553,141,533.00	1,011,485,661	1.000000000F 0.532847631	553,141,533.00	1,038,085,751	0	26,600,090	26,600,090
386,198,344.80	RUB FORWARD 11 SEP FRU11SEP	6/29/2017	RUH	386,198,344.80	736,456,134	1.000000000F 0.529051542	386,198,344.80	729,982,458	0	-6,473,676	-6,473,676
-9,703,000.00		8/18/2017	RUH	-9,703,000.00	-17,707,145	1.000000000F 0.529051542	-9,703,000.00	-18,340,368	0	-633,223	-633,223
-10,332,000.00		8/22/2017	RUH	-10,332,000.00	-19,093,047	1.000000000F 0.529051542	-10,332,000.00	-19,529,288	0	-436,241	-436,241
-366,163,344.80		8/29/2017	RUH	-366,163,344.80	-678,138,176	1.000000000F 0.529051542	-366,163,344.80	-692,112,801	0	-13,974,625	-13,974,625
0.00000	合計 -----			0	21,517,766		0	1	0	-21,517,765	-21,517,765
0.00000											
-6,072,500.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	RUH	-6,072,500.00	-666,821,719	1.000000000F 0.009116149	-6,072,500.00	-666,125,576	0	696,143	696,143
-8,999,000.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017	RUH	-8,999,000.00	-1,011,485,662	1.000000000F 0.009103694	-8,999,000.00	-988,499,833	0	22,985,829	22,985,829
162,741.94000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/18/2017	RUH	162,741.94	17,707,145	1.000000000F 0.009090697	162,741.94	17,902,031	0	194,886	194,886
174,453.36000		8/22/2017	RUH	174,453.36	19,093,047	1.000000000F 0.009090697	174,453.36	19,190,317	0	97,270	97,270
6,235,751.78000		8/29/2017	RUH	6,235,751.78	678,138,176	1.000000000F 0.009090697	6,235,751.78	685,948,699	0	7,810,523	7,810,523
-6,436,800.00000		6/29/2017	RUH	-6,436,800.00	-736,456,137	1.000000000F 0.009090697	-6,436,800.00	-708,064,519	0	28,391,618	28,391,618
136,147.08000	合計 -----			136,147	-21,517,769		136,147	14,976,528	0	36,494,297	36,494,297
0.00000											
898,681,925.08000	非グループ化の有価証券小計			898,681,925	-5		898,681,925	70,326,491	0	70,326,496	70,326,496
898,681,925.08000	先物(ポジション)合計			898,681,925	-5		898,681,925	70,326,491	0	70,326,496	70,326,496
898,681,925.08000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			898,681,925	-5		898,681,925	70,326,491	0	70,326,496	70,326,496

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
3,172,619.76	TRY FORWARD 10 NOV FTR10NOV	8/29/2017	TRH	3,172,619.76	100,253,529	1.000000000F 0.032124047	3,172,619.76	98,761,522	0	-1,492,007	-1,492,007
1,134,168.00		8/30/2017	TRH	1,134,168.00	36,247,333	1.000000000F 0.032124047	1,134,168.00	35,305,888	0	-941,445	-941,445
4,306,787.76000 0.00000	合計 -----			4,306,788	136,500,862		4,306,788	134,067,410	0	-2,433,452	-2,433,452
6,698,766.10	TRY FORWARD 11 OCT FTR11OCT	8/3/2017	TRH	6,698,766.10	208,341,731	1.000000000F 0.031814791	6,698,766.10	210,555,087	0	2,213,356	2,213,356
954,768.50		8/9/2017	TRH	954,768.50	29,678,728	1.000000000F 0.031814791	954,768.50	30,010,208	0	331,480	331,480
328,368.53		8/14/2017	TRH	328,368.53	10,200,758	1.000000000F 0.031814791	328,368.53	10,321,254	0	120,496	120,496
1,180,250.17		8/16/2017	TRH	1,180,250.17	37,108,832	1.000000000F 0.031814791	1,180,250.17	37,097,530	0	-11,302	-11,302
3,037,122.30		8/21/2017	TRH	3,037,122.30	94,501,777	1.000000000F 0.031814791	3,037,122.30	95,462,588	0	960,811	960,811
615,525.00		8/23/2017	TRH	615,525.00	19,229,506	1.000000000F 0.031814791	615,525.00	19,347,133	0	117,627	117,627
3,160,929.60		8/29/2017	TRH	3,160,929.60	99,884,124	1.000000000F 0.031814791	3,160,929.60	99,354,090	0	-530,034	-530,034
15,975,730.20000 0.00000	合計 -----			15,975,730	498,945,456		15,975,730	502,147,890	0	3,202,434	3,202,434
2,908,604.80	TRY FORWARD 11 SEP FTR11SEP	6/29/2017	TRH	2,908,604.80	93,084,209	1.000000000F 0.031485757	2,908,604.80	92,378,430	0	-705,779	-705,779
494,195.70		7/28/2017	TRH	494,195.70	15,541,295	1.000000000F 0.031485757	494,195.70	15,695,849	0	154,554	154,554
-3,402,800.50		8/29/2017	TRH	-3,402,800.50	-107,085,293	1.000000000F 0.031485757	-3,402,800.50	-108,074,279	0	-988,986	-988,986
0.00000 0.00000	合計 -----			0	1,540,211		0	0	0	-1,540,211	-1,540,211

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-902,800.00000	USD FORWARD 10 NOV FUS10NOV	8/29/2017	TRH	-902,800.00	-100,253,529	1.000000000F 0.009116149	-902,800.00	-99,033,046	0	1,220,483	1,220,483
-322,500.00000		8/30/2017	TRH	-322,500.00	-36,247,333	1.000000000F 0.009116149	-322,500.00	-35,376,780	0	870,553	870,553
-1,225,300.00000 0.00000	合計 -----			-1,225,300	-136,500,862		-1,225,300	-134,409,826	0	2,091,036	2,091,036
-1,855,100.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/3/2017	TRH	-1,855,100.00	-208,341,733	1.000000000F 0.009103694	-1,855,100.00	-203,774,424	0	4,567,309	4,567,309
-265,000.00000		8/9/2017	TRH	-265,000.00	-29,678,728	1.000000000F 0.009103694	-265,000.00	-29,109,063	0	569,665	569,665
-91,700.00000		8/14/2017	TRH	-91,700.00	-10,200,758	1.000000000F 0.009103694	-91,700.00	-10,072,834	0	127,924	127,924
-329,700.00000		8/16/2017	TRH	-329,700.00	-37,108,832	1.000000000F 0.009103694	-329,700.00	-36,216,068	0	892,764	892,764
-857,000.00000		8/21/2017	TRH	-857,000.00	-94,501,777	1.000000000F 0.009103694	-857,000.00	-94,137,611	0	364,166	364,166
-174,000.00000		8/23/2017	TRH	-174,000.00	-19,229,506	1.000000000F 0.009103694	-174,000.00	-19,113,120	0	116,386	116,386
-908,000.00000		8/29/2017	TRH	-908,000.00	-99,884,125	1.000000000F 0.009103694	-908,000.00	-99,739,732	0	144,393	144,393
-4,480,500.00000 0.00000	合計 -----			-4,480,500	-498,945,459		-4,480,500	-492,162,852	0	6,782,607	6,782,607
984,692.10000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2017	TRH	984,692.10	107,085,293	1.000000000F 0.009090697	984,692.10	108,318,658	0	1,233,365	1,233,365
-812,800.00000		6/29/2017	TRH	-812,800.00	-93,084,210	1.000000000F 0.009090697	-812,800.00	-89,410,086	0	3,674,124	3,674,124

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-138,500.00000		7/28/2017		-138,500.00	-15,541,295	1.0000000000F 0.009090697	-138,500.00	-15,235,355	0	305,940	305,940
			TRH								
33,392.10000	合計 -----			33,392	-1,540,212		33,392	3,673,217	0	5,213,429	5,213,429
0.00000											
14,610,110.06000	非グループ化の有価証券小計			14,610,110	-4		14,610,110	13,315,839	0	13,315,843	13,315,843
14,610,110.06000	先物 (ポジション) 合計			14,610,110	-4		14,610,110	13,315,839	0	13,315,843	13,315,843
14,610,110.06000	トルコ・リラクラス受益証券合計			14,610,110	-4		14,610,110	13,315,839	0	13,315,843	13,315,843

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
527,929,191.00000	JPY CASH	8/31/2017		527,929,191	527,929,191	1.0000000000	527,929,191	527,929,191	0	0	0
	CASHJPY					1.0000000000					
527,929,191.00000	基準通貨現金小計			527,929,191	527,929,191		527,929,191	527,929,191	0	0	0
527,929,191.00000	現金合計			527,929,191	527,929,191		527,929,191	527,929,191	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
1,480,000.00000	ASR NEDERLAND NV	9/22/2015		1,474,387.96	194,971,016	116.515998840 ^C	1,724,436.78	225,643,129	32,718,972	-2,046,859	30,672,113
	FRN 09292045					130.850334005					
	BNLD12AD XS1293505639										
7,000,000.00	AXA SA	5/24/2013		7,542,089.20	1,273,355,865	112.044998169 ^C	7,843,149.87	1,112,298,362	42,695,766	-203,753,269	-161,057,503
	FRN PERP/CALL					141.817813004					
	BFRA10DI XS1134541561										
2,300,000.00000	BARCLAYS PLC	11/4/2015		2,288,431.00	302,209,165	103.905998230 ^C	2,389,837.96	312,711,095	13,269,134	-2,767,204	10,501,930
	FRN 11112025					130.850334005					
	BGBR22F0 XS1319647068										
5,800,000.00000	BBVA SUB CAP UNI	2/9/2015		6,103,236.00	823,557,868	105.013000488 ^C	6,090,754.03	796,977,199	-1,633,270	-24,947,399	-26,580,669
	FRN 04112024					130.850334005					
	BESPO25A XS1055241373										
5,400,000.00000	CAIXABANK	7/5/2017		5,398,542.00	692,790,840	101.955001831 ^C	5,505,570.10	720,405,686	14,004,662	13,610,184	27,614,846
	FRN 07142028					130.850334005					
	BESPO26G XS1645495349										
4,250,000.00	CYBG PLC	6/19/2017		4,268,395.50	605,890,009	101.792999268 ^C	4,326,202.47	613,532,573	8,198,058	-555,494	7,642,564
	FRN 06222025					141.817813004					
	BGBR22JQ XS1637124741										
6,910,000.00000	DAI - ICHI MUTUAL	10/23/2014		7,095,133.09	796,992,374	107.726997375 ^C	7,443,935.52	819,279,554	38,389,196	-16,102,016	22,287,180
	FRN PERP/CALL					0.009085953					
	BJPN303K US23380YAC12										
3,900,000.00000	DNB BANK ASA	2/20/2017		3,893,799.00	467,819,516	102.105003357 ^C	3,982,095.13	521,058,478	11,553,578	41,685,384	53,238,962
	FRN 03012027					130.850334005					
	BNOR0242 XS1571331955										

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
4,000,000.00000	ELM BV FOR HELVE FRN 09292047 BNLD12E4 XS1587893451	3/30/2017		3,969,760.00	474,287,805	104.819999695 ^C 130.850334005	4,192,799.99	548,629,279	29,184,857	45,156,617	74,341,474
12,800,000.00000	ERSTE GROUP FRN 05262025 BAUT0161 XS1143333109	9/22/2016		13,264,000.00	1,336,944,885	106.134002686 ^C 0.009085953	13,585,152.34	1,495,181,886	35,346,027	122,890,974	158,237,001
9,400,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN3042 XS1262602532	7/22/2015		9,400,000.00	1,166,022,935	106.832000732 ^C 0.009085953	10,042,208.07	1,105,245,434	70,681,421	-131,458,922	-60,777,501
3,570,000.00000	GENERALI FINANCE FRN PERP/CALL BNLD1280 XS1140860534	11/14/2014		3,621,802.45	506,724,899	105.916999817 ^C 130.850334005	3,781,236.89	494,776,110	20,862,050	-32,810,839	-11,948,789
6,100,000.00	HISCOX LTD FRN 11242045 BBMU003B XS1323450236	11/17/2015		6,066,500.00	1,061,449,735	114.741996765 ^C 141.817813004	6,999,261.80	992,620,001	132,282,239	-201,111,972	-68,829,733
5,950,000.00000	HSBC HOLDINGS FRN PERP/CALL BGBR22CP XS1111123987	4/8/2015		6,255,463.85	805,448,653	107.988998413 ^C 130.850334005	6,425,345.41	840,758,592	22,229,058	13,080,881	35,309,939
11,000,000.00000	MANULIFE FIN COR FRN 02242032 BCAN10DG US56501RAE62	2/21/2017		11,000,000.00	1,250,150,018	102.058998108 ^C 0.009085953	11,226,489.79	1,235,587,482	24,927,467	-39,490,002	-14,562,535
2,000,000.00000	MAPFRE FRN 03312047 BESPO267 ES0224244089	3/22/2017		2,000,000.00	239,987,727	111.670997620 ^C 130.850334005	2,233,419.95	292,243,747	30,543,079	21,712,941	52,256,020
4,000,000.00000	NATIONWIDE BLDG FRN 07252029 BGBR22KO XS1651453729	7/18/2017		3,980,120.00	515,419,741	100.828002930 ^C 130.850334005	4,033,120.12	527,735,114	6,935,083	5,380,290	12,315,373
1,670,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		1,663,536.63	239,555,347	108.694000244 ^C 130.850334005	1,815,189.80	237,518,192	19,843,868	-21,881,023	-2,037,155

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
8,400,000.00000	NORDEA BANK AB FRN PERP/CALL BSWE0367 XS1202090947	4/9/2015		8,385,645.57	1,008,741,521	102.871002197 ^C 0.009085953	8,641,164.18	951,046,542	28,122,379	-85,817,358	-57,694,979
4,000,000.00000	PRINCIPAL FINL FRN 05152055 BUSA9BM4 US74251VAL62	6/13/2017		4,140,000.00	455,193,010	103.613998413 ^C 0.009085953	4,144,559.94	456,150,272	501,867	455,396	957,263
6,800,000.00000	RABOBANK FRN PERP/CALL BNLD128M XS1171914515	4/8/2015		7,201,540.00	932,352,002	106.867996216 ^C 130.850334005	7,267,023.74	950,892,484	8,568,570	9,971,912	18,540,482
9,500,000.00000	RAIFFEISEN BK IN FRN 02212025 BAUT0164 XS1034950672	3/15/2017		10,021,230.00	1,209,423,191	106.819000244 ^C 130.850334005	10,147,805.02	1,327,843,677	16,562,384	101,858,102	118,420,486
2,900,000.00000	ROYAL BK SCOTLND FRN 03082023 BGBR22J6 XS1575979148	3/1/2017		2,900,000.00	348,476,257	104.369003296 ^C 130.850334005	3,026,701.10	396,044,849	16,578,881	30,989,712	47,568,593
5,200,000.00000	SKANDINAV ENSKIL FRN PERP/CALL BSWE0370 XS1584880352	3/17/2017		5,201,300.00	587,824,917	104.264999390 ^C 0.009085953	5,421,779.97	596,721,111	24,266,026	-15,369,832	8,896,194
7,150,000.00000	SNS BANK FRN 11052025 BNLD12DR XS1315151388	2/23/2017		7,524,660.00	897,477,872	108.319999695 ^C 130.850334005	7,744,879.98	1,013,420,132	28,815,858	87,126,402	115,942,260
3,100,000.00	SOCIETY LLOYD'S FRN 02072047 BGBR22IX XS1558089261	1/31/2017		3,120,415.00	441,946,272	111.218002319 ^C 141.817813004	3,447,758.07	488,953,510	46,423,079	584,159	47,007,238
4,400,000.00000	SWEDBANK AB FRN PERP/CALL BSWE0364 XS1190655776	3/24/2015		4,407,382.22	528,508,290	103.362998962 ^C 0.009085953	4,547,971.95	500,549,800	15,473,306	-43,431,797	-27,958,491
1,800,000.00000	SWEDBANK AB FRN PERP/CALL BSWE036W XS1535953134	12/9/2016		1,800,000.00	207,333,000	106.019996643 ^C 0.009085953	1,908,359.94	210,034,098	11,926,095	-9,224,997	2,701,098

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
8,600,000.00000	TORONTO DOM BANK FRN 09152031 BCAN10D1 US891160MJ94	9/8/2016		8,568,685.25	881,835,890	100.415000916 ^C 0.009085953	8,635,690.08	950,444,062	7,374,552	61,233,621	68,608,173
2,550,000.00	TSB BANK ING FRN 05062026 BGBR22GV XS1061206337	8/3/2016		2,592,177.00	349,880,616	110.271003723 ^C 141.817813004	2,811,910.59	398,779,011	31,162,138	17,736,257	48,898,395
3,000,000.00000	VONOVIA BV FRN PERP/CALL BNLD12BW XS1117300837	7/11/2016		3,090,000.00	342,824,315	108.547996521 ^C 130.850334005	3,256,439.90	426,106,248	21,778,716	61,503,217	83,281,933
2,500,000.00000	XLIT LTD FRN 06292047 BCYM05AV XS1633784183	6/22/2017		2,476,350.00	307,631,031	99.399002075 ^C 130.850334005	2,484,975.05	325,159,816	1,128,591	16,400,194	17,528,785
167,430,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			170,714,582	21,253,026,582		177,127,226	21,884,347,525	810,713,687	-179,392,740	631,320,947
変動利率											
2,000,000.00000	AVIVA PLC FRN 07052043 BGBR2263 XS0951553592	9/11/2013		2,091,333.33	278,625,891	121.816001892 ^C 130.850334005	2,436,320.04	318,793,291	45,141,626	-4,974,226	40,167,400
5,330,000.00	HSBC BANK FUND FRN 04292049 BJEY000C XS0189704140	4/25/2013		5,409,950.00	831,036,313	111.005996704 ^C 141.817813004	5,916,619.62	839,082,055	71,854,778	-63,809,036	8,045,742
9,000,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		9,207,099.97	845,881,683	108.809997559 ^C 0.009085953	9,792,899.78	1,077,806,564	64,473,128	167,451,753	231,924,881
6,830,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		6,895,051.31	665,689,749	108.956001282 ^C 0.009085953	7,441,694.89	819,032,950	60,163,593	93,179,608	153,343,201
7,340,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	5/3/2012		7,878,833.00	1,241,250,971	119.636001587 ^C 141.817813004	8,781,282.52	1,245,342,282	127,983,417	-123,892,106	4,091,311
30,500,000.00000	変動利率小計			31,482,268	3,862,484,607		34,368,817	4,300,057,142	369,616,542	67,955,993	437,572,535

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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）
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>社債</u>											
<u>ミディアム・ターム・ノート</u>											
10,450,000.00000	ABN AMRO BANK NV FRN 06302025 BNLD129W XS1253955469	6/23/2015		10,487,756.31	1,457,725,562	106.261001587 ^C 130.850334005	11,104,274.67	1,452,998,049	80,671,633	-85,399,146	-4,727,513
4,350,000.00000	BANK OF NY MELLO 3 % 10302028 BUSA9AYT US06406GAA94	10/24/2016		4,345,215.00	453,184,215	98.887001038 ^C 0.009085953	4,301,584.55	473,432,401	-4,801,968	25,050,154	20,248,186
12,490,000.00000	BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		12,480,758.43	1,385,221,088	103.788002014 ^C 0.009085953	12,963,121.45	1,426,721,165	53,088,875	-11,588,798	41,500,077
6,300,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249	6/9/2015		6,276,123.00	877,808,169	110.614997864 ^C 130.850334005	6,968,744.87	911,862,593	90,629,802	-56,575,378	34,054,424
7,050,000.00	LLOYDS TSB BANK 7.625 % 04222025 BGBR223F XS0503834821	1/10/2013		8,398,515.74	1,225,382,729	136.649002075 ^C 141.817813004	9,633,754.65	1,366,238,015	175,178,880	-34,323,594	140,855,286
3,000,000.00	PGH CAPITAL PLC 4.125 % 07202022 BIRL02A6 XS1551285007	1/16/2017		3,004,354.00	413,621,563	107.389999390 ^C 141.817813004	3,221,699.98	456,894,446	30,823,532	12,449,351	43,272,883
4,400,000.00000	SANTANDER ISSUAN 3.125 % 01192027 BESPO263 XS1548444816	1/4/2017		4,352,920.00	534,762,433	107.035003662 ^C 130.850334005	4,709,540.16	616,244,903	46,663,867	34,818,603	81,482,470
48,040,000.00000	ミディアム・ターム・ノート小計			49,345,642	6,347,705,759		52,902,720	6,704,391,572	472,254,621	-115,568,808	356,685,813
<u>私募債</u>											
13,170,000.00000	BNP PARIBAS 4.375 % 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97	10/1/2015		12,778,178.57	1,507,007,242	104.693000793 ^C 0.009085953	13,788,068.20	1,517,514,806	111,148,455	-100,640,891	10,507,564
12,470,000.00000	ING BANK NV 5.8 % 09252023 BNLD122U US449786AY82	9/16/2013		13,400,852.67	1,393,091,512	114.231002808 ^C 0.009085953	14,244,606.05	1,567,761,362	92,863,498	81,806,352	174,669,850

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
私募債											
10,700,000.00000	SANTANDER UK PLC 5 % 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		10,700,860.65	1,072,321,384	109.064002991 ^C 0.009085953	11,669,848.32	1,284,383,523	106,646,784	105,415,354	212,062,138
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64	8/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	102.434997559 ^C 0.009085953	6,094,882.35	670,802,761	19,770,117	56,815,998	76,586,115
42,290,000.00000	私募債小計			42,795,144	4,566,636,783		45,797,405	5,040,462,452	330,428,854	143,396,813	473,825,667
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	103.300003052 ^C 0.009085953	14,771,900.44	1,625,795,383	71,691,262	-99,391,939	-27,700,677
3,450,000.00000	BARCLAYS PLC 4.836 % 05092028 BGBR22JI US06738EAW57	5/2/2017		3,450,000.00	386,848,497	103.888999939 ^C 0.009085953	3,584,170.50	394,473,810	14,766,805	-7,141,492	7,625,313
3,140,000.00000	BEAZLEY RE LTD 5.875 % 11042026 BIRL02A3 XS1508669790	10/28/2016		3,140,000.00	330,987,399	106.947998047 ^C 0.009085953	3,358,167.14	369,599,880	24,011,476	14,601,005	38,612,481
1,030,000.00000	CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71	5/5/2016		1,581,977.00	169,137,062	156.585998535 ^C 0.009085953	1,612,835.78	177,508,709	3,396,318	4,975,329	8,371,647
12,600,000.00000	CITIGROUP INC 4.6 % 03092026 BUSA9ACG US172967KJ96	3/1/2016		12,575,052.00	1,428,400,135	106.949996948 ^C 0.009085953	13,475,699.62	1,483,135,519	99,125,278	-44,389,894	54,735,384
12,500,000.00000	CRED AGRICOLE SA 4.375 % 03172025 BFRA10ER USF2R125AC99	3/10/2015		12,521,276.79	1,517,726,329	104.454002380 ^C 0.009085953	13,056,750.30	1,437,025,956	58,934,215	-139,634,588	-80,700,373
4,820,000.00	GOLDMAN SACHS GP 5.5% 10122021 BUSA4203 XS0270349003	4/18/2012		4,853,269.60	679,412,153	116.023002625 ^C 141.817813004	5,592,308.73	793,088,993	104,808,913	8,867,928	113,676,841

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
650,000.00	GOLDMAN SACHS GP 6.875 % 01182038 BUSA96MS XS0340470490	4/25/2013		797,758.00	122,545,655	149.962005615 ^C 141.817813004	974,753.04	138,237,344	25,101,049	-9,409,360	15,691,689
3,000,000.00000	JPMORGAN CHASE 3.625 % 12012027 BUSA9B3I US46625HRX07	11/10/2016		2,994,810.00	318,842,453	101.052001953 ^C 0.009085953	3,031,560.06	333,653,504	4,044,712	10,766,340	14,811,052
5,400,000.00000	MANUF & TRADERS 3.4 % 08172027 BUSA9BUB US55279HAQ39	8/14/2017		5,398,164.00	590,937,001	101.640998840 ^C 0.009085953	5,488,613.94	604,076,858	9,954,920	3,184,936	13,139,856
2,000,000.00000	METLIFE INC 6.4% 12152036 BUSA5773 US59156RAP38	6/13/2017		2,305,000.00	253,434,756	115.561996460 ^C 0.009085953	2,311,239.93	254,375,070	686,767	253,547	940,314
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	3/20/2014		1,795,572.00	183,857,592	107.319999695 ^C 0.009085953	1,931,759.99	212,609,508	14,988,851	13,763,065	28,751,916
13,490,000.00000	MORGAN STANLEY 3.95 % 04232027 BUSA99DZ US61761JZN26	4/20/2015		13,962,689.60	1,490,101,437	102.165000916 ^C 0.009085953	13,782,058.62	1,516,853,392	-19,880,246	46,632,200	26,751,954
12,900,000.00000	UBS GROUP FUND IN 4.125 % 09242025 BJEY000Y USG91703AB73	8/4/2016		13,539,173.00	1,369,579,481	106.113998413 ^C 0.009085953	13,688,705.80	1,506,578,979	16,457,580	120,541,918	136,999,498
12,610,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95 % 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		12,746,280.00	1,004,488,714	113.841003418 ^C 0.009085953	14,355,350.53	1,579,949,900	177,094,305	398,366,881	575,461,186
103,690,000.00000	公募債小計			105,781,539	11,499,794,724		111,015,874	12,426,962,805	605,182,205	321,985,876	927,168,081
391,950,000.00000	社債合計			400,119,175	47,529,648,455		421,212,042	50,356,221,496	2,588,195,909	238,377,134	2,826,573,043
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
92,034.26000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	11/4/2014		92,034.26	9,146,850	1.000000000 ^S 87.294088999	92,034.26	8,034,047	0	-1,112,803	-1,112,803

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
1,642,127.35000		11/12/2014		1,642,127.35	164,665,136	1.000000000 ^S 87.294088999	1,642,127.35	143,348,011	0	-21,317,125	-21,317,125
2,700,000.00000		11/21/2014		2,700,000.00	275,018,538	1.000000000 ^S 87.294088999	2,700,000.00	235,694,040	0	-39,324,498	-39,324,498
2,200,000.00000		11/24/2014		2,200,000.00	224,592,650	1.000000000 ^S 87.294088999	2,200,000.00	192,046,996	0	-32,545,654	-32,545,654
1,775.32000		11/28/2014		1,775.32	179,836	1.000000000 ^S 87.294088999	1,775.32	154,975	0	-24,861	-24,861
25,737.85000		12/5/2014		25,737.85	2,588,276	1.000000000 ^S 87.294088999	25,737.85	2,246,762	0	-341,514	-341,514
1,200,271.26000		12/10/2014		1,200,271.26	119,256,313	1.000000000 ^S 87.294088999	1,200,271.26	104,776,586	0	-14,479,727	-14,479,727
1,159,803.53000		12/15/2014		1,159,803.53	113,414,608	1.000000000 ^S 87.294088999	1,159,803.53	101,243,993	0	-12,170,615	-12,170,615
58,528.71000		12/18/2014		58,528.71	5,610,975	1.000000000 ^S 87.294088999	58,528.71	5,109,210	0	-501,765	-501,765
24,573.92000		12/29/2014		24,573.92	2,401,342	1.000000000 ^S 87.294088999	24,573.92	2,145,158	0	-256,184	-256,184
485,468.43000		12/30/2014		485,468.43	47,691,683	1.000000000 ^S 87.294088999	485,468.43	42,378,524	0	-5,313,159	-5,313,159
1,564.21000		12/31/2014		1,564.21	153,474	1.000000000 ^S 87.294088999	1,564.21	136,546	0	-16,928	-16,928
1,300,000.00000		1/12/2015		1,300,000.00	126,516,938	1.000000000 ^S 87.294088999	1,300,000.00	113,482,316	0	-13,034,622	-13,034,622
207,747.74000		1/27/2015		207,747.74	19,495,459	1.000000000 ^S 87.294088999	207,747.74	18,135,150	0	-1,360,309	-1,360,309
696,374.06000		1/29/2015		696,374.06	65,271,775	1.000000000 ^S 87.294088999	696,374.06	60,789,339	0	-4,482,436	-4,482,436
1,406.23000		1/30/2015		1,406.23	128,636	1.000000000 ^S 87.294088999	1,406.23	122,756	0	-5,880	-5,880

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
206,582.45000		1/30/2015		206,582.45	18,993,836	1.000000000 ^S 87.294088999	206,582.45	18,033,427	0	-960,409	-960,409
54,791.29000		2/2/2015		54,791.29	5,012,081	1.000000000 ^S 87.294088999	54,791.29	4,782,956	0	-229,125	-229,125
253,877.80000		2/3/2015		253,877.80	23,278,426	1.000000000 ^S 87.294088999	253,877.80	22,162,031	0	-1,116,395	-1,116,395
205,542.23000		2/4/2015		205,542.23	18,576,235	1.000000000 ^S 87.294088999	205,542.23	17,942,622	0	-633,613	-633,613
115,628.17000		2/13/2015		115,628.17	10,612,693	1.000000000 ^S 87.294088999	115,628.17	10,093,656	0	-519,037	-519,037
29,412.99000		2/17/2015		29,412.99	2,709,706	1.000000000 ^S 87.294088999	29,412.99	2,567,580	0	-142,126	-142,126
667,933.59000		2/17/2015		667,933.59	61,534,158	1.000000000 ^S 87.294088999	667,933.59	58,306,654	0	-3,227,504	-3,227,504
326,807.08000		2/19/2015		326,807.08	30,343,940	1.000000000 ^S 87.294088999	326,807.08	28,528,326	0	-1,815,614	-1,815,614
2,192,063.20000		2/24/2015		2,192,063.20	203,418,105	1.000000000 ^S 87.294088999	2,192,063.20	191,354,160	0	-12,063,945	-12,063,945
53,434.29000		2/26/2015		53,434.29	5,009,829	1.000000000 ^S 87.294088999	53,434.29	4,664,498	0	-345,331	-345,331
2,003.28000		2/27/2015		2,003.28	187,455	1.000000000 ^S 87.294088999	2,003.28	174,875	0	-12,580	-12,580
61,389.07000		2/27/2015		61,389.07	5,734,296	1.000000000 ^S 87.294088999	61,389.07	5,358,903	0	-375,393	-375,393
8,272.79000		3/4/2015		8,272.79	774,772	1.000000000 ^S 87.294088999	8,272.79	722,166	0	-52,606	-52,606
73,974.98000		3/5/2015		73,974.98	6,922,876	1.000000000 ^S 87.294088999	73,974.98	6,457,578	0	-465,298	-465,298
6,525.72000		3/10/2015		6,525.72	610,308	1.000000000 ^S 87.294088999	6,525.72	569,657	0	-40,651	-40,651

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
30,000.03000		3/12/2015		30,000.03	2,763,346	1.000000000 ^S 87.294088999	30,000.03	2,618,825	0	-144,521	-144,521
169,508.06000		3/16/2015		169,508.06	15,673,421	1.000000000 ^S 87.294088999	169,508.06	14,797,052	0	-876,369	-876,369
494,617.75000		3/18/2015		494,617.75	45,673,172	1.000000000 ^S 87.294088999	494,617.75	43,177,206	0	-2,495,966	-2,495,966
493,314.13000		3/19/2015		493,314.13	45,648,649	1.000000000 ^S 87.294088999	493,314.13	43,063,408	0	-2,585,241	-2,585,241
60,525.11000		3/20/2015		60,525.11	5,576,441	1.000000000 ^S 87.294088999	60,525.11	5,283,484	0	-292,957	-292,957
637,230.13000		3/24/2015		637,230.13	59,886,633	1.000000000 ^S 87.294088999	637,230.13	55,626,424	0	-4,260,209	-4,260,209
3,884.02000		3/31/2015		3,884.02	355,841	1.000000000 ^S 87.294088999	3,884.02	339,052	0	-16,789	-16,789
281,169.60000		4/1/2015		281,169.60	25,759,832	1.000000000 ^S 87.294088999	281,169.60	24,544,444	0	-1,215,388	-1,215,388
52,665.13000		4/10/2015		52,665.13	4,878,576	1.000000000 ^S 87.294088999	52,665.13	4,597,355	0	-281,221	-281,221
94,219.67000		4/16/2015		94,219.67	8,562,177	1.000000000 ^S 87.294088999	94,219.67	8,224,820	0	-337,357	-337,357
185,609.77000		4/16/2015		185,609.77	16,867,218	1.000000000 ^S 87.294088999	185,609.77	16,202,636	0	-664,582	-664,582
979,482.42000		4/16/2015		979,482.42	89,010,097	1.000000000 ^S 87.294088999	979,482.42	85,503,026	0	-3,507,071	-3,507,071
1,084,907.81000		4/16/2015		1,084,907.81	98,590,590	1.000000000 ^S 87.294088999	1,084,907.81	94,706,039	0	-3,884,551	-3,884,551
95,260.21000		4/22/2015		95,260.21	8,815,560	1.000000000 ^S 87.294088999	95,260.21	8,315,653	0	-499,907	-499,907
1,200,000.00000		4/27/2015		1,200,000.00	111,722,034	1.000000000 ^S 87.294088999	1,200,000.00	104,752,907	0	-6,969,127	-6,969,127

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
1,624.58000		4/30/2015		1,624.58	153,344	1.000000000 ^S 87.294088999	1,624.58	141,816	0	-11,528	-11,528
97,398.84000		5/7/2015		97,398.84	9,322,518	1.000000000 ^S 87.294088999	97,398.84	8,502,343	0	-820,175	-820,175
1,200,000.00000		5/12/2015		1,200,000.00	113,914,267	1.000000000 ^S 87.294088999	1,200,000.00	104,752,907	0	-9,161,360	-9,161,360
1,204.66000		5/18/2015		1,204.66	115,742	1.000000000 ^S 87.294088999	1,204.66	105,160	0	-10,582	-10,582
102,958.65000		5/21/2015		102,958.65	9,829,791	1.000000000 ^S 87.294088999	102,958.65	8,987,682	0	-842,109	-842,109
240,337.15000		5/27/2015		240,337.15	22,898,966	1.000000000 ^S 87.294088999	240,337.15	20,980,013	0	-1,918,953	-1,918,953
1,040.35000		5/29/2015		1,040.35	98,821	1.000000000 ^S 87.294088999	1,040.35	90,816	0	-8,005	-8,005
58,140.06000		6/4/2015		58,140.06	5,632,409	1.000000000 ^S 87.294088999	58,140.06	5,075,284	0	-557,125	-557,125
463,495.15000		6/5/2015		463,495.15	44,299,139	1.000000000 ^S 87.294088999	463,495.15	40,460,387	0	-3,838,752	-3,838,752
86,583.78000		6/9/2015		86,583.78	8,282,560	1.000000000 ^S 87.294088999	86,583.78	7,558,252	0	-724,308	-724,308
1,000,000.00000		6/11/2015		1,000,000.00	95,109,932	1.000000000 ^S 87.294088999	1,000,000.00	87,294,089	0	-7,815,843	-7,815,843
950,000.00000		6/23/2015		950,000.00	90,927,877	1.000000000 ^S 87.294088999	950,000.00	82,929,385	0	-7,998,492	-7,998,492
742.88000		6/30/2015		742.88	69,868	1.000000000 ^S 87.294088999	742.88	64,849	0	-5,019	-5,019
87,175.55000		7/2/2015		87,175.55	8,216,800	1.000000000 ^S 87.294088999	87,175.55	7,609,910	0	-606,890	-606,890
1,500,000.00000		7/8/2015		1,500,000.00	136,124,157	1.000000000 ^S 87.294088999	1,500,000.00	130,941,133	0	-5,183,024	-5,183,024

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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）
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
5,077.27000		7/9/2015		5,077.27	457,130	1.000000000 ^S 87.294088999	5,077.27	443,216	0	-13,914	-13,914
100,237.08000		7/17/2015		100,237.08	9,227,204	1.000000000 ^S 87.294088999	100,237.08	8,750,105	0	-477,099	-477,099
945.93000		7/31/2015		945.93	86,063	1.000000000 ^S 87.294088999	945.93	82,574	0	-3,489	-3,489
88,380.65000		7/31/2015		88,380.65	7,994,358	1.000000000 ^S 87.294088999	88,380.65	7,715,108	0	-279,250	-279,250
1,940,000.00000		8/7/2015		1,940,000.00	177,758,540	1.000000000 ^S 87.294088999	1,940,000.00	169,350,533	0	-8,408,007	-8,408,007
7,650,000.00000		8/11/2015		7,650,000.00	704,316,836	1.000000000 ^S 87.294088999	7,650,000.00	667,799,781	0	-36,517,055	-36,517,055
479,833.36000		8/13/2015		479,833.36	43,809,780	1.000000000 ^S 87.294088999	479,833.36	41,886,616	0	-1,923,164	-1,923,164
75,403.65000		8/18/2015		75,403.65	6,920,738	1.000000000 ^S 87.294088999	75,403.65	6,582,293	0	-338,445	-338,445
1,260,000.00000		8/25/2015		1,260,000.00	107,638,641	1.000000000 ^S 87.294088999	1,260,000.00	109,990,552	0	2,351,911	2,351,911
20,000.03000		8/28/2015		20,000.03	1,724,493	1.000000000 ^S 87.294088999	20,000.03	1,745,884	0	21,391	21,391
1,123.56000		8/31/2015		1,123.56	96,530	1.000000000 ^S 87.294088999	1,123.56	98,080	0	1,550	1,550
1,500,000.00000		9/8/2015		1,500,000.00	124,005,422	1.000000000 ^S 87.294088999	1,500,000.00	130,941,133	0	6,935,711	6,935,711
1,500,000.00000		9/14/2015		1,500,000.00	127,701,060	1.000000000 ^S 87.294088999	1,500,000.00	130,941,133	0	3,240,073	3,240,073
1,200,000.00000		9/17/2015		1,200,000.00	104,033,759	1.000000000 ^S 87.294088999	1,200,000.00	104,752,907	0	719,148	719,148
4,580.00000		9/29/2015		4,580.00	384,148	1.000000000 ^S 87.294088999	4,580.00	399,807	0	15,659	15,659

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
1,050.33000		9/30/2015		1,050.33	88,338	1.000000000 ^S 87.294088999	1,050.33	91,688	0	3,350	3,350
41,308.36000		10/2/2015		41,308.36	3,484,596	1.000000000 ^S 87.294088999	41,308.36	3,605,976	0	121,380	121,380
1,200,000.00000		10/7/2015		1,200,000.00	102,916,819	1.000000000 ^S 87.294088999	1,200,000.00	104,752,907	0	1,836,088	1,836,088
479,833.36000		10/14/2015		479,833.36	41,980,363	1.000000000 ^S 87.294088999	479,833.36	41,886,616	0	-93,747	-93,747
34,504.30000		10/19/2015		34,504.30	2,988,523	1.000000000 ^S 87.294088999	34,504.30	3,012,021	0	23,498	23,498
1,500,000.00000		10/21/2015		1,500,000.00	130,659,384	1.000000000 ^S 87.294088999	1,500,000.00	130,941,133	0	281,749	281,749
146,966.97000		10/23/2015		146,966.97	12,774,602	1.000000000 ^S 87.294088999	146,966.97	12,829,348	0	54,746	54,746
33,373.73000		10/28/2015		33,373.73	2,903,788	1.000000000 ^S 87.294088999	33,373.73	2,913,329	0	9,541	9,541
1,210.89000		10/30/2015		1,210.89	104,252	1.000000000 ^S 87.294088999	1,210.89	105,704	0	1,452	1,452
191,801.71000		11/2/2015		191,801.71	16,513,279	1.000000000 ^S 87.294088999	191,801.71	16,743,156	0	229,877	229,877
1,450.44000		11/9/2015		1,450.44	125,722	1.000000000 ^S 87.294088999	1,450.44	126,615	0	893	893
1,100,000.00000		11/10/2015		1,100,000.00	95,614,298	1.000000000 ^S 87.294088999	1,100,000.00	96,023,498	0	409,200	409,200
1,370,000.00000		11/20/2015		1,370,000.00	121,160,088	1.000000000 ^S 87.294088999	1,370,000.00	119,592,902	0	-1,567,186	-1,567,186
1,241.63000		11/30/2015		1,241.63	110,913	1.000000000 ^S 87.294088999	1,241.63	108,387	0	-2,526	-2,526
55,217.71000		11/30/2015		55,217.71	4,875,314	1.000000000 ^S 87.294088999	55,217.71	4,820,180	0	-55,134	-55,134

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
67,803.25000		12/2/2015		67,803.25	6,086,449	1.000000000 ^S 87.294088999	67,803.25	5,918,823	0	-167,626	-167,626
1,200,000.00000		12/8/2015		1,200,000.00	107,613,376	1.000000000 ^S 87.294088999	1,200,000.00	104,752,907	0	-2,860,469	-2,860,469
479,833.36000		12/14/2015		479,833.36	41,838,537	1.000000000 ^S 87.294088999	479,833.36	41,886,616	0	48,079	48,079
1,300,000.00000		12/14/2015		1,300,000.00	113,352,056	1.000000000 ^S 87.294088999	1,300,000.00	113,482,316	0	130,260	130,260
920,000.00000		12/18/2015		920,000.00	80,272,386	1.000000000 ^S 87.294088999	920,000.00	80,310,562	0	38,176	38,176
7,027.13000		12/21/2015		7,027.13	613,059	1.000000000 ^S 87.294088999	7,027.13	613,427	0	368	368
69,609.63000		12/22/2015		69,609.63	6,058,273	1.000000000 ^S 87.294088999	69,609.63	6,076,509	0	18,236	18,236
30,652.58000		12/24/2015		30,652.58	2,680,171	1.000000000 ^S 87.294088999	30,652.58	2,675,789	0	-4,382	-4,382
31,897.52000		12/29/2015		31,897.52	2,787,126	1.000000000 ^S 87.294088999	31,897.52	2,784,465	0	-2,661	-2,661
930.50000		12/31/2015		930.50	81,438	1.000000000 ^S 87.294088999	930.50	81,227	0	-211	-211
64,476.82000		1/6/2016		64,476.82	5,481,018	1.000000000 ^S 87.294088999	64,476.82	5,628,445	0	147,427	147,427
29,058.54000		1/14/2016		29,058.54	2,404,861	1.000000000 ^S 87.294088999	29,058.54	2,536,639	0	131,778	131,778
306,365.43000		1/20/2016		306,365.43	24,967,386	1.000000000 ^S 87.294088999	306,365.43	26,743,891	0	1,776,505	1,776,505
453,323.95000		1/25/2016		453,323.95	37,747,169	1.000000000 ^S 87.294088999	453,323.95	39,572,501	0	1,825,332	1,825,332
54,860.74000		1/28/2016		54,860.74	4,588,058	1.000000000 ^S 87.294088999	54,860.74	4,789,018	0	200,960	200,960

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
778.74000		1/29/2016		778.74	66,688	1.000000000 ^S 87.294088999	778.74	67,979	0	1,291	1,291
9,624.24000		2/2/2016		9,624.24	825,300	1.000000000 ^S 87.294088999	9,624.24	840,139	0	14,839	14,839
45,449.01000		2/3/2016		45,449.01	3,852,337	1.000000000 ^S 87.294088999	45,449.01	3,967,430	0	115,093	115,093
900,000.00000		2/19/2016		900,000.00	73,080,576	1.000000000 ^S 87.294088999	900,000.00	78,564,680	0	5,484,104	5,484,104
549.31000		2/29/2016		549.31	44,286	1.000000000 ^S 87.294088999	549.31	47,952	0	3,666	3,666
549.31000		2/29/2016		549.31	7	1.000000000 ^S 87.294088999	549.31	47,952	0	47,945	47,945
300,000.00000		3/11/2016		300,000.00	25,334,694	1.000000000 ^S 87.294088999	300,000.00	26,188,227	0	853,533	853,533
870,000.00000		3/18/2016		870,000.00	73,945,274	1.000000000 ^S 87.294088999	870,000.00	75,945,857	0	2,000,583	2,000,583
670.89000		3/31/2016		670.89	58,005	1.000000000 ^S 87.294088999	670.89	58,565	0	560	560
670.89000		3/31/2016		670.89	8	1.000000000 ^S 87.294088999	670.89	58,565	0	58,557	58,557
49,152.02000		4/1/2016		49,152.02	4,249,676	1.000000000 ^S 87.294088999	49,152.02	4,290,681	0	41,005	41,005
0.11000		4/4/2016		0.11	9	1.000000000 ^S 87.294088999	0.11	10	0	1	1
118,557.70000		4/4/2016		118,557.70	10,179,618	1.000000000 ^S 87.294088999	118,557.70	10,349,386	0	169,768	169,768
54,704.79000		4/7/2016		54,704.79	4,550,661	1.000000000 ^S 87.294088999	54,704.79	4,775,405	0	224,744	224,744
1,000,000.00000		4/13/2016		1,000,000.00	82,840,523	1.000000000 ^S 87.294088999	1,000,000.00	87,294,089	0	4,453,566	4,453,566

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
279,833.36000		4/18/2016		279,833.36	23,441,485	1.000000000 ^S 87.294088999	279,833.36	24,427,798	0	986,313	986,313
2,500,000.00000		4/21/2016		2,500,000.00	213,220,853	1.000000000 ^S 87.294088999	2,500,000.00	218,235,222	0	5,014,369	5,014,369
9,845.91000		4/22/2016		9,845.91	837,399	1.000000000 ^S 87.294088999	9,845.91	859,490	0	22,091	22,091
71,738.60000		4/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000 ^S 87.294088999	71,738.60	6,262,356	0	213,328	213,328
651.99000		4/29/2016		651.99	8	1.000000000 ^S 87.294088999	651.99	56,915	0	56,907	56,907
651.99000		4/29/2016		651.99	53,237	1.000000000 ^S 87.294088999	651.99	56,915	0	3,678	3,678
3,199.32000		5/6/2016		3,199.32	256,662	1.000000000 ^S 87.294088999	3,199.32	279,282	0	22,620	22,620
37,851.41000		5/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000 ^S 87.294088999	37,851.41	3,304,204	0	301,438	301,438
52,780.08000		5/13/2016		52,780.08	4,214,171	1.000000000 ^S 87.294088999	52,780.08	4,607,389	0	393,218	393,218
1,000,000.00000		5/18/2016		1,000,000.00	79,969,300	1.000000000 ^S 87.294088999	1,000,000.00	87,294,089	0	7,324,789	7,324,789
28,390.46000		5/26/2016		28,390.46	2,250,076	1.000000000 ^S 87.294088999	28,390.46	2,478,319	0	228,243	228,243
487.18000		5/31/2016		487.18	39,143	1.000000000 ^S 87.294088999	487.18	42,528	0	3,385	3,385
77,920.52000		6/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000 ^S 87.294088999	77,920.52	6,802,001	0	685,245	685,245
435,877.61000		6/24/2016		435,877.61	34,923,776	1.000000000 ^S 87.294088999	435,877.61	38,049,539	0	3,125,763	3,125,763
193,723.40000		6/27/2016		193,723.40	14,830,685	1.000000000 ^S 87.294088999	193,723.40	16,910,908	0	2,080,223	2,080,223

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
51,500.28000		6/28/2016		51,500.28	3,847,670	1.000000000 ^S 87.294088999	51,500.28	4,495,670	0	648,000	648,000
370.39000		6/30/2016		370.39	28,294	1.000000000 ^S 87.294088999	370.39	32,333	0	4,039	4,039
41,200.23000		6/30/2016		41,200.23	3,144,683	1.000000000 ^S 87.294088999	41,200.23	3,596,537	0	451,854	451,854
28,419.86000		7/6/2016		28,419.86	2,155,687	1.000000000 ^S 87.294088999	28,419.86	2,480,886	0	325,199	325,199
975,728.88000		7/8/2016		975,728.88	73,727,142	1.000000000 ^S 87.294088999	975,728.88	85,175,364	0	11,448,222	11,448,222
10,303.13000		7/19/2016		10,303.13	827,218	1.000000000 ^S 87.294088999	10,303.13	899,402	0	72,184	72,184
85,548.05000		7/26/2016		85,548.05	6,769,315	1.000000000 ^S 87.294088999	85,548.05	7,467,839	0	698,524	698,524
49,430.39000		7/27/2016		49,430.39	3,887,241	1.000000000 ^S 87.294088999	49,430.39	4,314,981	0	427,740	427,740
966.37000		7/29/2016		966.37	75,274	1.000000000 ^S 87.294088999	966.37	84,358	0	9,084	9,084
279,833.36000		8/18/2016		279,833.36	21,425,498	1.000000000 ^S 87.294088999	279,833.36	24,427,798	0	3,002,300	3,002,300
900,000.00000		8/23/2016		900,000.00	68,935,762	1.000000000 ^S 87.294088999	900,000.00	78,564,680	0	9,628,918	9,628,918
312.44000		8/31/2016		312.44	24,288	1.000000000 ^S 87.294088999	312.44	27,274	0	2,986	2,986
2,905.89000		8/31/2016		2,905.89	224,400	1.000000000 ^S 87.294088999	2,905.89	253,667	0	29,267	29,267
244,354.19000		9/6/2016		244,354.19	19,161,904	1.000000000 ^S 87.294088999	244,354.19	21,330,676	0	2,168,772	2,168,772
1,000,000.00000		9/8/2016		1,000,000.00	78,053,406	1.000000000 ^S 87.294088999	1,000,000.00	87,294,089	0	9,240,683	9,240,683

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
397,132.94000		9/14/2016		397,132.94	30,405,336	1.000000000 ^S 87.294088999	397,132.94	34,667,358	0	4,262,022	4,262,022
74,453.68000		9/20/2016		74,453.68	5,728,229	1.000000000 ^S 87.294088999	74,453.68	6,499,366	0	771,137	771,137
109,580.94000		9/26/2016		109,580.94	8,438,525	1.000000000 ^S 87.294088999	109,580.94	9,565,768	0	1,127,243	1,127,243
57,901.38000		9/27/2016		57,901.38	4,441,152	1.000000000 ^S 87.294088999	57,901.38	5,054,448	0	613,296	613,296
38,744.71000		9/28/2016		38,744.71	2,976,084	1.000000000 ^S 87.294088999	38,744.71	3,382,184	0	406,100	406,100
205,508.38000		9/29/2016		205,508.38	15,834,834	1.000000000 ^S 87.294088999	205,508.38	17,939,667	0	2,104,833	2,104,833
556.44000		9/30/2016		556.44	43,120	1.000000000 ^S 87.294088999	556.44	48,574	0	5,454	5,454
96,868.26000		9/30/2016		96,868.26	7,548,319	1.000000000 ^S 87.294088999	96,868.26	8,456,027	0	907,708	907,708
10,705.70000		10/4/2016		10,705.70	833,355	1.000000000 ^S 87.294088999	10,705.70	934,544	0	101,189	101,189
145,292.56000		10/4/2016		145,292.56	11,309,888	1.000000000 ^S 87.294088999	145,292.56	12,683,182	0	1,373,294	1,373,294
279,833.36000		10/18/2016		279,833.36	22,177,198	1.000000000 ^S 87.294088999	279,833.36	24,427,798	0	2,250,600	2,250,600
83,301.08000		10/27/2016		83,301.08	6,668,666	1.000000000 ^S 87.294088999	83,301.08	7,271,692	0	603,026	603,026
833.18000		10/31/2016		833.18	66,625	1.000000000 ^S 87.294088999	833.18	72,732	0	6,107	6,107
74,583.53000		10/31/2016		74,583.53	5,960,068	1.000000000 ^S 87.294088999	74,583.53	6,510,701	0	550,633	550,633
142,255.95000		11/2/2016		142,255.95	11,375,416	1.000000000 ^S 87.294088999	142,255.95	12,418,104	0	1,042,688	1,042,688

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
134,756.68000		11/4/2016		134,756.68	10,678,599	1.000000000 ^S 87.294088999	134,756.68	11,763,462	0	1,084,863	1,084,863
849.50000		11/30/2016		849.50	71,518	1.000000000 ^S 87.294088999	849.50	74,156	0	2,638	2,638
885,465.77000		12/13/2016		885,465.77	76,650,084	1.000000000 ^S 87.294088999	885,465.77	77,295,928	0	645,844	645,844
279,833.36000		12/15/2016		279,833.36	24,213,667	1.000000000 ^S 87.294088999	279,833.36	24,427,798	0	214,131	214,131
829.17000		12/21/2016		829.17	70,900	1.000000000 ^S 87.294088999	829.17	72,382	0	1,482	1,482
464.62000		12/30/2016		464.62	39,240	1.000000000 ^S 87.294088999	464.62	40,559	0	1,319	1,319
1,226,556.69000		1/5/2017		1,226,556.69	104,711,557	1.000000000 ^S 87.294088999	1,226,556.69	107,071,149	0	2,359,592	2,359,592
282,384.02000		1/27/2017		282,384.02	24,408,543	1.000000000 ^S 87.294088999	282,384.02	24,650,456	0	241,913	241,913
1,199,688.72000		1/27/2017		1,199,688.72	103,697,984	1.000000000 ^S 87.294088999	1,199,688.72	104,725,734	0	1,027,750	1,027,750
587.10000		1/31/2017		587.10	50,174	1.000000000 ^S 87.294088999	587.10	51,250	0	1,076	1,076
277,517.50000		2/15/2017		277,517.50	24,213,142	1.000000000 ^S 87.294088999	277,517.50	24,225,637	0	12,495	12,495
786,360.14000		2/15/2017		786,360.14	68,609,185	1.000000000 ^S 87.294088999	786,360.14	68,644,592	0	35,407	35,407
63,860.76000		2/27/2017		63,860.76	5,510,685	1.000000000 ^S 87.294088999	63,860.76	5,574,667	0	63,982	63,982
598.25000		2/28/2017		598.25	51,463	1.000000000 ^S 87.294088999	598.25	52,224	0	761	761
702,000.00000		3/10/2017		702,000.00	60,452,566	1.000000000 ^S 87.294088999	702,000.00	61,280,450	0	827,884	827,884

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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）
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
1,412,000.00000		3/16/2017		1,412,000.00	122,935,970	1.000000000 ^S 87.294088999	1,412,000.00	123,259,254	0	323,284	323,284
62,745.10000		3/27/2017		62,745.10	5,307,406	1.000000000 ^S 87.294088999	62,745.10	5,477,276	0	169,870	169,870
470.71000		3/31/2017		470.71	40,012	1.000000000 ^S 87.294088999	470.71	41,090	0	1,078	1,078
89,505.17000		3/31/2017		89,505.17	7,644,438	1.000000000 ^S 87.294088999	89,505.17	7,813,272	0	168,834	168,834
766,000.00000		4/7/2017		766,000.00	64,145,110	1.000000000 ^S 87.294088999	766,000.00	66,867,272	0	2,722,162	2,722,162
279,833.36000		4/18/2017		279,833.36	23,068,187	1.000000000 ^S 87.294088999	279,833.36	24,427,798	0	1,359,611	1,359,611
1,068,505.95000		4/18/2017		1,068,505.95	88,082,762	1.000000000 ^S 87.294088999	1,068,505.95	93,274,253	0	5,191,491	5,191,491
1,125,804.00000		4/18/2017		1,125,804.00	92,806,152	1.000000000 ^S 87.294088999	1,125,804.00	98,276,035	0	5,469,883	5,469,883
106,547.89000		4/27/2017		106,547.89	8,885,757	1.000000000 ^S 87.294088999	106,547.89	9,301,001	0	415,244	415,244
978.41000		4/28/2017		978.41	81,563	1.000000000 ^S 87.294088999	978.41	85,409	0	3,846	3,846
5,940,000.00000		4/28/2017		5,940,000.00	492,026,980	1.000000000 ^S 87.294088999	5,940,000.00	518,526,889	0	26,499,909	26,499,909
1,390,000.00000		5/5/2017		1,390,000.00	115,907,314	1.000000000 ^S 87.294088999	1,390,000.00	121,338,784	0	5,431,470	5,431,470
1,344,823.25000		5/26/2017		1,344,823.25	112,415,381	1.000000000 ^S 87.294088999	1,344,823.25	117,395,120	0	4,979,739	4,979,739
895.60000		5/31/2017		895.60	73,730	1.000000000 ^S 87.294088999	895.60	78,181	0	4,451	4,451
4,843.12000		6/2/2017		4,843.12	397,848	1.000000000 ^S 87.294088999	4,843.12	422,776	0	24,928	24,928

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
7,078.68000		6/13/2017		7,078.68	586,390	1.000000000 ^S 87.294088999	7,078.68	617,927	0	31,537	31,537
275,955.42000		6/14/2017		275,955.42	22,875,822	1.000000000 ^S 87.294088999	275,955.42	24,089,277	0	1,213,455	1,213,455
320,000.00000		6/14/2017		320,000.00	3,860	1.000000000 ^S 87.294088999	320,000.00	27,934,108	0	27,930,248	27,930,248
270,000.00000		6/16/2017		270,000.00	22,642,776	1.000000000 ^S 87.294088999	270,000.00	23,569,404	0	926,628	926,628
701,045.96000		6/28/2017		701,045.96	59,720,715	1.000000000 ^S 87.294088999	701,045.96	61,197,168	0	1,476,453	1,476,453
1,125,804.00000		6/28/2017		1,125,804.00	95,905,011	1.000000000 ^S 87.294088999	1,125,804.00	98,276,035	0	2,371,024	2,371,024
1,347,714.81000		6/28/2017		1,347,714.81	114,809,152	1.000000000 ^S 87.294088999	1,347,714.81	117,647,537	0	2,838,385	2,838,385
1,390,000.00000		6/28/2017		1,390,000.00	118,411,344	1.000000000 ^S 87.294088999	1,390,000.00	121,338,784	0	2,927,440	2,927,440
754.51000		6/30/2017		754.51	65,028	1.000000000 ^S 87.294088999	754.51	65,864	0	836	836
1,264,000.00000		7/18/2017		1,264,000.00	111,466,230	1.000000000 ^S 87.294088999	1,264,000.00	110,339,728	0	-1,126,502	-1,126,502
118,871.82000		7/25/2017		118,871.82	10,477,503	1.000000000 ^S 87.294088999	118,871.82	10,376,807	0	-100,696	-100,696
604.28000		7/31/2017		604.28	53,306	1.000000000 ^S 87.294088999	604.28	52,750	0	-556	-556
1,203,000.00000		8/17/2017		1,203,000.00	105,081,064	1.000000000 ^S 87.294088999	1,203,000.00	105,014,789	0	-66,275	-66,275
772,000.00000		8/30/2017		772,000.00	66,991,892	1.000000000 ^S 87.294088999	772,000.00	67,391,037	0	399,145	399,145
-4,666,632.57000		10/15/2014		-4,666,632.57	-435,964,063	1.000000000 ^S 87.294088999	-4,666,632.57	-407,369,439	0	28,594,624	28,594,624

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-2,000,000.00000		10/15/2014		-2,000,000.00	-186,843,106	1.000000000 ^S 87.294088999	-2,000,000.00	-174,588,178	0	12,254,928	12,254,928
-124,452.66000		10/16/2014		-124,452.66	-11,611,456	1.000000000 ^S 87.294088999	-124,452.66	-10,863,982	0	747,474	747,474
-95,422.92000		10/17/2014		-95,422.92	-8,874,101	1.000000000 ^S 87.294088999	-95,422.92	-8,329,857	0	544,244	544,244
-212,367.10000		10/20/2014		-212,367.10	-19,830,814	1.000000000 ^S 87.294088999	-212,367.10	-18,538,393	0	1,292,421	1,292,421
-96,073.00000		10/21/2014		-96,073.00	-9,020,412	1.000000000 ^S 87.294088999	-96,073.00	-8,386,605	0	633,807	633,807
-180,163.29000		10/22/2014		-180,163.29	-16,932,785	1.000000000 ^S 87.294088999	-180,163.29	-15,727,190	0	1,205,595	1,205,595
-134,048.72000		10/22/2014		-134,048.72	-12,598,672	1.000000000 ^S 87.294088999	-134,048.72	-11,701,661	0	897,011	897,011
-11,302.59000		10/22/2014		-11,302.59	-1,062,283	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,302.59	-986,649	0	75,634	75,634
-107,152.67000		10/23/2014		-107,152.67	-10,114,159	1.000000000 ^S 87.294088999	-107,152.67	-9,353,795	0	760,364	760,364
-31,285.75000		10/24/2014		-31,285.75	-2,965,041	1.000000000 ^S 87.294088999	-31,285.75	-2,731,061	0	233,980	233,980
-132,121.93000		10/28/2014		-132,121.93	-12,520,174	1.000000000 ^S 87.294088999	-132,121.93	-11,533,464	0	986,710	986,710
-482,451.36000		10/29/2014		-482,451.36	-46,100,869	1.000000000 ^S 87.294088999	-482,451.36	-42,115,152	0	3,985,717	3,985,717
-290,633.73000		10/30/2014		-290,633.73	-27,973,317	1.000000000 ^S 87.294088999	-290,633.73	-25,370,607	0	2,602,710	2,602,710
-237,376.05000		11/5/2014		-237,376.05	-23,468,631	1.000000000 ^S 87.294088999	-237,376.05	-20,721,526	0	2,747,105	2,747,105
-60,273.52000		11/6/2014		-60,273.52	-5,930,648	1.000000000 ^S 87.294088999	-60,273.52	-5,261,522	0	669,126	669,126

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-911,057.13000		11/7/2014		-911,057.13	-89,780,968	1.000000000 ^S 87.294088999	-911,057.13	-79,529,902	0	10,251,066	10,251,066
-395,964.91000		11/10/2014		-395,964.91	-39,200,790	1.000000000 ^S 87.294088999	-395,964.91	-34,565,396	0	4,635,394	4,635,394
-614,649.22000		11/12/2014		-614,649.22	-61,634,256	1.000000000 ^S 87.294088999	-614,649.22	-53,655,244	0	7,979,012	7,979,012
-70,444.68000		11/12/2014		-70,444.68	-7,063,875	1.000000000 ^S 87.294088999	-70,444.68	-6,149,404	0	914,471	914,471
-54,603.48000		11/13/2014		-54,603.48	-5,490,877	1.000000000 ^S 87.294088999	-54,603.48	-4,766,561	0	724,316	724,316
-319,964.21000		11/17/2014		-319,964.21	-32,542,269	1.000000000 ^S 87.294088999	-319,964.21	-27,930,984	0	4,611,285	4,611,285
-20,035.87000		11/18/2014		-20,035.87	-2,032,868	1.000000000 ^S 87.294088999	-20,035.87	-1,749,013	0	283,855	283,855
-213,850.66000		11/19/2014		-213,850.66	-21,776,026	1.000000000 ^S 87.294088999	-213,850.66	-18,667,899	0	3,108,127	3,108,127
-9,364.59000		11/20/2014		-9,364.59	-950,919	1.000000000 ^S 87.294088999	-9,364.59	-817,473	0	133,446	133,446
-2,545,581.34000		11/21/2014		-2,545,581.34	-259,289,652	1.000000000 ^S 87.294088999	-2,545,581.34	-222,214,204	0	37,075,448	37,075,448
-89,212.14000		11/25/2014		-89,212.14	-9,098,869	1.000000000 ^S 87.294088999	-89,212.14	-7,787,692	0	1,311,177	1,311,177
-603,479.44000		11/26/2014		-603,479.44	-60,728,438	1.000000000 ^S 87.294088999	-603,479.44	-52,680,188	0	8,048,250	8,048,250
-86,787.10000		11/28/2014		-86,787.10	-8,741,712	1.000000000 ^S 87.294088999	-86,787.10	-7,576,001	0	1,165,711	1,165,711
-336,619.36000		12/1/2014		-336,619.36	-34,098,751	1.000000000 ^S 87.294088999	-336,619.36	-29,384,880	0	4,713,871	4,713,871
-93,678.58000		12/2/2014		-93,678.58	-9,411,623	1.000000000 ^S 87.294088999	-93,678.58	-8,177,586	0	1,234,037	1,234,037

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-214,564.97000		12/3/2014		-214,564.97	-21,617,415	1.000000000 ^S 87.294088999	-214,564.97	-18,730,254	0	2,887,161	2,887,161
-435,539.26000		12/4/2014		-435,539.26	-43,903,822	1.000000000 ^S 87.294088999	-435,539.26	-38,020,003	0	5,883,819	5,883,819
-301,627.51000		12/9/2014		-301,627.51	-30,314,256	1.000000000 ^S 87.294088999	-301,627.51	-26,330,299	0	3,983,957	3,983,957
-128,649.45000		12/10/2014		-128,649.45	-12,782,326	1.000000000 ^S 87.294088999	-128,649.45	-11,230,337	0	1,551,989	1,551,989
-701,988.29000		12/11/2014		-701,988.29	-69,264,315	1.000000000 ^S 87.294088999	-701,988.29	-61,279,428	0	7,984,887	7,984,887
-69,226.87000		12/11/2014		-69,226.87	-6,830,529	1.000000000 ^S 87.294088999	-69,226.87	-6,043,097	0	787,432	787,432
-233,220.13000		12/12/2014		-233,220.13	-22,988,872	1.000000000 ^S 87.294088999	-233,220.13	-20,358,739	0	2,630,133	2,630,133
-1,012,066.41000		12/15/2014		-1,012,066.41	-98,967,724	1.000000000 ^S 87.294088999	-1,012,066.41	-88,347,415	0	10,620,309	10,620,309
-882,994.13000		12/15/2014		-882,994.13	-86,346,033	1.000000000 ^S 87.294088999	-882,994.13	-77,080,168	0	9,265,865	9,265,865
-667,933.59000		12/15/2014		-667,933.59	-65,315,741	1.000000000 ^S 87.294088999	-667,933.59	-58,306,654	0	7,009,087	7,009,087
-230,255.10000		12/16/2014		-230,255.10	-22,377,237	1.000000000 ^S 87.294088999	-230,255.10	-20,099,909	0	2,277,328	2,277,328
-67,739.36000		12/17/2014		-67,739.36	-6,523,402	1.000000000 ^S 87.294088999	-67,739.36	-5,913,246	0	610,156	610,156
-244,669.86000		12/19/2014		-244,669.86	-23,723,117	1.000000000 ^S 87.294088999	-244,669.86	-21,358,233	0	2,364,884	2,364,884
-148,648.91000		12/22/2014		-148,648.91	-14,467,922	1.000000000 ^S 87.294088999	-148,648.91	-12,976,171	0	1,491,751	1,491,751
-151,043.46000		12/24/2014		-151,043.46	-14,765,543	1.000000000 ^S 87.294088999	-151,043.46	-13,185,201	0	1,580,342	1,580,342

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-105,843.81000		1/5/2015		-105,843.81	-10,336,129	1.000000000 ^S 87.294088999	-105,843.81	-9,239,539	0	1,096,590	1,096,590
-204,027.32000		1/7/2015		-204,027.32	-19,651,794	1.000000000 ^S 87.294088999	-204,027.32	-17,810,379	0	1,841,415	1,841,415
-92,171.03000		1/8/2015		-92,171.03	-8,853,375	1.000000000 ^S 87.294088999	-92,171.03	-8,045,986	0	807,389	807,389
-686,560.80000		1/9/2015		-686,560.80	-66,622,818	1.000000000 ^S 87.294088999	-686,560.80	-59,932,700	0	6,690,118	6,690,118
-296,399.69000		1/13/2015		-296,399.69	-28,690,461	1.000000000 ^S 87.294088999	-296,399.69	-25,873,941	0	2,816,520	2,816,520
-20,527.98000		1/14/2015		-20,527.98	-1,983,598	1.000000000 ^S 87.294088999	-20,527.98	-1,791,971	0	191,627	191,627
-39,405.57000		1/15/2015		-39,405.57	-3,758,292	1.000000000 ^S 87.294088999	-39,405.57	-3,439,873	0	318,419	318,419
-39,335.92000		1/21/2015		-39,335.92	-3,807,263	1.000000000 ^S 87.294088999	-39,335.92	-3,433,793	0	373,470	373,470
-144,341.08000		1/22/2015		-144,341.08	-13,851,088	1.000000000 ^S 87.294088999	-144,341.08	-12,600,123	0	1,250,965	1,250,965
-140,447.93000		1/22/2015		-140,447.93	-13,477,498	1.000000000 ^S 87.294088999	-140,447.93	-12,260,274	0	1,217,224	1,217,224
-131,846.04000		1/22/2015		-131,846.04	-12,652,054	1.000000000 ^S 87.294088999	-131,846.04	-11,509,380	0	1,142,674	1,142,674
-11,116.87000		1/22/2015		-11,116.87	-1,066,784	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,116.87	-970,437	0	96,347	96,347
-9,303.87000		1/28/2015		-9,303.87	-869,334	1.000000000 ^S 87.294088999	-9,303.87	-812,173	0	57,161	57,161
-258,206.95000		2/5/2015		-258,206.95	-23,515,972	1.000000000 ^S 87.294088999	-258,206.95	-22,539,940	0	976,032	976,032
-128,192.28000		2/9/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.000000000 ^S 87.294088999	-128,192.28	-11,190,428	0	721,823	721,823

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-76,498.09000		2/10/2015		-76,498.09	-7,094,696	1.000000000 ^S 87.294088999	-76,498.09	-6,677,831	0	416,865	416,865
-643,025.87000		2/12/2015		-643,025.87	-59,704,371	1.000000000 ^S 87.294088999	-643,025.87	-56,132,358	0	3,572,013	3,572,013
-195,720.57000		2/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.000000000 ^S 87.294088999	-195,720.57	-17,085,249	0	1,085,068	1,085,068
-12,078.57000		2/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.000000000 ^S 87.294088999	-12,078.57	-1,054,388	0	65,570	65,570
-203,751.45000		2/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000 ^S 87.294088999	-203,751.45	-17,786,297	0	1,162,784	1,162,784
-16,686.40000		2/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.000000000 ^S 87.294088999	-16,686.40	-1,456,624	0	98,089	98,089
-164,421.91000		3/2/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.000000000 ^S 87.294088999	-164,421.91	-14,353,061	0	1,032,531	1,032,531
-12,405.71000		3/3/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.000000000 ^S 87.294088999	-12,405.71	-1,082,945	0	76,928	76,928
-125,474.92000		3/6/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000 ^S 87.294088999	-125,474.92	-10,953,219	0	770,931	770,931
-152,618.80000		3/9/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.000000000 ^S 87.294088999	-152,618.80	-13,322,719	0	972,980	972,980
-708,611.63000		3/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.000000000 ^S 87.294088999	-708,611.63	-61,857,607	0	3,749,624	3,749,624
-27,978.64000		3/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.000000000 ^S 87.294088999	-27,978.64	-2,442,370	0	148,049	148,049
-174,287.44000		3/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.000000000 ^S 87.294088999	-174,287.44	-15,214,263	0	1,071,572	1,071,572
-7,763.28000		3/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000 ^S 87.294088999	-7,763.28	-677,688	0	43,296	43,296
-302,844.98000		3/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000 ^S 87.294088999	-302,844.98	-26,436,577	0	1,827,271	1,827,271

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日本円です。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-97,995.40000		3/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000 ^S 87.294088999	-97,995.40	-8,554,419	0	693,896	693,896
-172,798.05000		3/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000 ^S 87.294088999	-172,798.05	-15,084,248	0	1,122,663	1,122,663
-975,466.76000		3/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000 ^S 87.294088999	-975,466.76	-85,152,482	0	5,802,140	5,802,140
-256,508.24000		3/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000 ^S 87.294088999	-256,508.24	-22,391,653	0	1,302,741	1,302,741
-189,563.24000		3/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000 ^S 87.294088999	-189,563.24	-16,547,750	0	829,548	829,548
-206,250.64000		4/2/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000 ^S 87.294088999	-206,250.64	-18,004,462	0	794,480	794,480
-90,318.63000		4/7/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000 ^S 87.294088999	-90,318.63	-7,884,283	0	310,398	310,398
-74,243.21000		4/8/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000 ^S 87.294088999	-74,243.21	-6,480,993	0	354,658	354,658
-78,171.43000		4/9/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000 ^S 87.294088999	-78,171.43	-6,823,904	0	394,986	394,986
-705,086.17000		4/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000 ^S 87.294088999	-705,086.17	-61,549,855	0	3,558,848	3,558,848
-37,651.50000		4/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000 ^S 87.294088999	-37,651.50	-3,286,753	0	190,042	190,042
-246,307.80000		4/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000 ^S 87.294088999	-246,307.80	-21,501,215	0	932,548	932,548
-57,294.63000		4/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000 ^S 87.294088999	-57,294.63	-5,001,483	0	218,641	218,641
-39,422.26000		4/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000 ^S 87.294088999	-39,422.26	-3,441,330	0	205,292	205,292
-167,462.13000		4/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000 ^S 87.294088999	-167,462.13	-14,618,454	0	810,906	810,906

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-11,204.33000		4/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,204.33	-978,072	0	54,255	54,255
-58,785.17000		4/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000 ^S 87.294088999	-58,785.17	-5,131,598	0	336,567	336,567
-203,446.05000		4/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000 ^S 87.294088999	-203,446.05	-17,759,638	0	1,150,631	1,150,631
-19,719.18000		4/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000 ^S 87.294088999	-19,719.18	-1,721,368	0	114,521	114,521
-746,896.35000		4/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000 ^S 87.294088999	-746,896.35	-65,199,636	0	4,799,090	4,799,090
-47,545.85000		4/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000 ^S 87.294088999	-47,545.85	-4,150,472	0	405,571	405,571
-35,878.86000		5/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000 ^S 87.294088999	-35,878.86	-3,132,012	0	263,932	263,932
-59,220.06000		5/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000 ^S 87.294088999	-59,220.06	-5,169,561	0	452,114	452,114
-684,441.51000		5/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000 ^S 87.294088999	-684,441.51	-59,747,698	0	5,713,830	5,713,830
-157,020.19000		5/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000 ^S 87.294088999	-157,020.19	-13,706,934	0	1,310,831	1,310,831
-45,251.01000		5/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000 ^S 87.294088999	-45,251.01	-3,950,146	0	414,370	414,370
-518,763.75000		5/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000 ^S 87.294088999	-518,763.75	-45,285,009	0	4,239,076	4,239,076
-6,306.57000		5/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000 ^S 87.294088999	-6,306.57	-550,526	0	51,334	51,334
-52,113.71000		5/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000 ^S 87.294088999	-52,113.71	-4,549,219	0	403,388	403,388
-393,354.22000		5/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000 ^S 87.294088999	-393,354.22	-34,337,498	0	2,995,487	2,995,487

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-245,742.67000		6/1/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000 ^S 87.294088999	-245,742.67	-21,451,883	0	1,890,849	1,890,849
-5,170.70000		6/2/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000 ^S 87.294088999	-5,170.70	-451,372	0	38,865	38,865
-78,821.02000		6/3/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000 ^S 87.294088999	-78,821.02	-6,880,609	0	697,571	697,571
-113,860.14000		6/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000 ^S 87.294088999	-113,860.14	-9,939,317	0	929,689	929,689
-666,844.90000		6/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000 ^S 87.294088999	-666,844.90	-58,211,618	0	5,211,955	5,211,955
-110,710.67000		6/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000 ^S 87.294088999	-110,710.67	-9,664,387	0	865,297	865,297
-54,834.71000		6/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000 ^S 87.294088999	-54,834.71	-4,786,746	0	447,951	447,951
-83,284.46000		6/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000 ^S 87.294088999	-83,284.46	-7,270,241	0	676,143	676,143
-479,833.36000		6/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000 ^S 87.294088999	-479,833.36	-41,886,616	0	4,133,489	4,133,489
-17,695.85000		6/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,695.85	-1,544,743	0	152,440	152,440
-470,587.90000		6/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000 ^S 87.294088999	-470,587.90	-41,079,542	0	3,746,904	3,746,904
-156,011.32000		6/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000 ^S 87.294088999	-156,011.32	-13,618,866	0	1,395,962	1,395,962
-49,769.29000		6/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000 ^S 87.294088999	-49,769.29	-4,344,565	0	393,796	393,796
-106,347.76000		6/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000 ^S 87.294088999	-106,347.76	-9,283,531	0	895,391	895,391
-13,612.05000		6/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000 ^S 87.294088999	-13,612.05	-1,188,252	0	113,128	113,128

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-255,184.50000		6/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000 ^S 87.294088999	-255,184.50	-22,276,098	0	1,899,779	1,899,779
-321,067.80000		6/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000 ^S 87.294088999	-321,067.80	-28,027,321	0	2,109,151	2,109,151
-64,733.44000		7/1/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000 ^S 87.294088999	-64,733.44	-5,650,847	0	437,317	437,317
-28,970.18000		7/6/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000 ^S 87.294088999	-28,970.18	-2,528,925	0	143,821	143,821
-19,343.07000		7/8/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000 ^S 87.294088999	-19,343.07	-1,688,536	0	66,837	66,837
-676,268.27000		7/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000 ^S 87.294088999	-676,268.27	-59,034,223	0	1,907,114	1,907,114
-68,449.88000		7/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000 ^S 87.294088999	-68,449.88	-5,975,270	0	193,032	193,032
-275,119.99000		7/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000 ^S 87.294088999	-275,119.99	-24,016,349	0	1,026,762	1,026,762
-93,052.47000		7/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000 ^S 87.294088999	-93,052.47	-8,122,931	0	403,061	403,061
-73,784.97000		7/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000 ^S 87.294088999	-73,784.97	-6,440,992	0	319,603	319,603
-110,427.24000		7/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000 ^S 87.294088999	-110,427.24	-9,639,645	0	532,597	532,597
-164,563.52000		7/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000 ^S 87.294088999	-164,563.52	-14,365,423	0	696,517	696,517
-87,873.33000		7/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000 ^S 87.294088999	-87,873.33	-7,670,822	0	240,090	240,090
-13,601.15000		7/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000 ^S 87.294088999	-13,601.15	-1,187,300	0	34,636	34,636
-59,933.50000		8/5/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000 ^S 87.294088999	-59,933.50	-5,231,840	0	278,295	278,295

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-143,187.55000		8/6/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000 ^S 87.294088999	-143,187.55	-12,499,427	0	645,560	645,560
-158,035.75000		8/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000 ^S 87.294088999	-158,035.75	-13,795,587	0	733,585	733,585
-669,741.07000		8/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000 ^S 87.294088999	-669,741.07	-58,464,437	0	3,196,989	3,196,989
-284,337.22000		8/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000 ^S 87.294088999	-284,337.22	-24,820,959	0	1,357,275	1,357,275
-7,892,527.01000		8/12/2015		-7,892,527.01	-718,905,956	1.000000000 ^S 87.294088999	-7,892,527.01	-688,970,955	0	29,935,001	29,935,001
-156,845.94000		8/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000 ^S 87.294088999	-156,845.94	-13,691,723	0	628,636	628,636
-53,128.21000		8/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000 ^S 87.294088999	-53,128.21	-4,637,779	0	225,340	225,340
-162,199.09000		8/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000 ^S 87.294088999	-162,199.09	-14,159,022	0	706,350	706,350
-21,061.93000		8/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000 ^S 87.294088999	-21,061.93	-1,838,582	0	82,579	82,579
-265,076.96000		8/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000 ^S 87.294088999	-265,076.96	-23,139,652	0	986,422	986,422
-19,404.32000		8/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000 ^S 87.294088999	-19,404.32	-1,693,882	0	-1,693,669	-1,693,669
-196,668.41000		8/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000 ^S 87.294088999	-196,668.41	-17,167,990	0	-367,101	-367,101
-462,149.98000		8/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000 ^S 87.294088999	-462,149.98	-40,342,961	0	-583,349	-583,349
-32,107.10000		8/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000 ^S 87.294088999	-32,107.10	-2,802,760	0	-83,937	-83,937
-86,093.85000		9/1/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000 ^S 87.294088999	-86,093.85	-7,515,484	0	-118,808	-118,808

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-93,737.05000		9/2/2015		-93,737.05	-7,905,601	1.000000000 ^S 87.294088999	-93,737.05	-8,182,690	0	-277,089	-277,089
-4,157.48000		9/3/2015		-4,157.48	-349,983	1.000000000 ^S 87.294088999	-4,157.48	-362,923	0	-12,940	-12,940
-102,367.87000		9/4/2015		-102,367.87	-8,650,619	1.000000000 ^S 87.294088999	-102,367.87	-8,936,110	0	-285,491	-285,491
-642,283.89000		9/9/2015		-642,283.89	-53,850,984	1.000000000 ^S 87.294088999	-642,283.89	-56,067,587	0	-2,216,603	-2,216,603
-476,290.57000		9/10/2015		-476,290.57	-40,505,866	1.000000000 ^S 87.294088999	-476,290.57	-41,577,351	0	-1,071,485	-1,071,485
-107,114.37000		9/11/2015		-107,114.37	-9,136,362	1.000000000 ^S 87.294088999	-107,114.37	-9,350,451	0	-214,089	-214,089
-575,423.39000		9/14/2015		-575,423.39	-48,988,118	1.000000000 ^S 87.294088999	-575,423.39	-50,231,061	0	-1,242,943	-1,242,943
-92,596.64000		9/14/2015		-92,596.64	-7,883,126	1.000000000 ^S 87.294088999	-92,596.64	-8,083,139	0	-200,013	-200,013
-636,341.83000		9/15/2015		-636,341.83	-54,620,063	1.000000000 ^S 87.294088999	-636,341.83	-55,548,880	0	-928,817	-928,817
-57,680.52000		9/16/2015		-57,680.52	-4,915,496	1.000000000 ^S 87.294088999	-57,680.52	-5,035,168	0	-119,672	-119,672
-148,138.07000		9/17/2015		-148,138.07	-12,842,800	1.000000000 ^S 87.294088999	-148,138.07	-12,931,578	0	-88,778	-88,778
-888,355.94000		9/18/2015		-888,355.94	-76,774,291	1.000000000 ^S 87.294088999	-888,355.94	-77,548,222	0	-773,931	-773,931
-252,646.81000		9/24/2015		-252,646.81	-21,364,671	1.000000000 ^S 87.294088999	-252,646.81	-22,054,573	0	-689,902	-689,902
-49,056.91000		9/25/2015		-49,056.91	-4,093,695	1.000000000 ^S 87.294088999	-49,056.91	-4,282,378	0	-188,683	-188,683
-72,142.91000		9/28/2015		-72,142.91	-6,115,979	1.000000000 ^S 87.294088999	-72,142.91	-6,297,650	0	-181,671	-181,671

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-70,823.93000		9/30/2015		-70,823.93	-5,954,410	1.000000000 ^S 87.294088999	-70,823.93	-6,182,510	0	-228,100	-228,100
-198,025.63000		10/1/2015		-198,025.63	-16,654,940	1.000000000 ^S 87.294088999	-198,025.63	-17,286,467	0	-631,527	-631,527
-122,307.91000		10/6/2015		-122,307.91	-10,416,695	1.000000000 ^S 87.294088999	-122,307.91	-10,676,758	0	-260,063	-260,063
-39,456.54000		10/6/2015		-39,456.54	-3,360,426	1.000000000 ^S 87.294088999	-39,456.54	-3,444,323	0	-83,897	-83,897
-17,998.66000		10/7/2015		-17,998.66	-1,543,637	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,998.66	-1,571,177	0	-27,540	-27,540
-94,044.65000		10/8/2015		-94,044.65	-8,145,767	1.000000000 ^S 87.294088999	-94,044.65	-8,209,542	0	-63,775	-63,775
-413,942.78000		10/9/2015		-413,942.78	-35,732,854	1.000000000 ^S 87.294088999	-413,942.78	-36,134,758	0	-401,904	-401,904
-18,029.52000		10/9/2015		-18,029.52	-1,556,365	1.000000000 ^S 87.294088999	-18,029.52	-1,573,871	0	-17,506	-17,506
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324	1.000000000 ^S 87.294088999	-201,846.72	-17,620,026	0	-140,702	-140,702
-106,109.09000		10/15/2015		-106,109.09	-9,188,731	1.000000000 ^S 87.294088999	-106,109.09	-9,262,696	0	-73,965	-73,965
-13,046.14000		10/16/2015		-13,046.14	-1,131,560	1.000000000 ^S 87.294088999	-13,046.14	-1,138,851	0	-7,291	-7,291
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340	1.000000000 ^S 87.294088999	-938,332.24	-81,910,858	0	-700,518	-700,518
-52,217.18000		10/26/2015		-52,217.18	-4,570,998	1.000000000 ^S 87.294088999	-52,217.18	-4,558,251	0	12,747	12,747
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268	1.000000000 ^S 87.294088999	-156,124.38	-13,628,736	0	76,532	76,532
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000 ^S 87.294088999	-221,516.12	-19,337,048	0	-339,590	-339,590

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-22,603.85000		11/5/2015		-22,603.85	-1,966,401	1.000000000 ^S 87.294088999	-22,603.85	-1,973,182	0	-6,781	-6,781
-28,494.89000		11/6/2015		-28,494.89	-2,474,770	1.000000000 ^S 87.294088999	-28,494.89	-2,487,435	0	-12,665	-12,665
-33,113.93000		11/10/2015		-33,113.93	-2,878,332	1.000000000 ^S 87.294088999	-33,113.93	-2,890,650	0	-12,318	-12,318
-908,189.06000		11/12/2015		-908,189.06	-78,762,965	1.000000000 ^S 87.294088999	-908,189.06	-79,279,537	0	-516,572	-516,572
-377,515.60000		11/12/2015		-377,515.60	-32,740,152	1.000000000 ^S 87.294088999	-377,515.60	-32,954,880	0	-214,728	-214,728
-6,155.13000		11/13/2015		-6,155.13	-537,849	1.000000000 ^S 87.294088999	-6,155.13	-537,306	0	543	543
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000 ^S 87.294088999	-156,394.49	-13,652,315	0	-14,783	-14,783
-16,749.47000		11/18/2015		-16,749.47	-1,472,174	1.000000000 ^S 87.294088999	-16,749.47	-1,462,130	0	10,044	10,044
-535,263.52000		11/19/2015		-535,263.52	-46,835,996	1.000000000 ^S 87.294088999	-535,263.52	-46,725,341	0	110,655	110,655
-171,111.94000		11/20/2015		-171,111.94	-15,132,801	1.000000000 ^S 87.294088999	-171,111.94	-14,937,061	0	195,740	195,740
-74,491.46000		11/24/2015		-74,491.46	-6,589,055	1.000000000 ^S 87.294088999	-74,491.46	-6,502,664	0	86,391	86,391
-907,253.22000		11/25/2015		-907,253.22	-80,284,748	1.000000000 ^S 87.294088999	-907,253.22	-79,197,843	0	1,086,905	1,086,905
-124,050.79000		11/27/2015		-124,050.79	-10,988,000	1.000000000 ^S 87.294088999	-124,050.79	-10,828,901	0	159,099	159,099
-125,483.80000		12/1/2015		-125,483.80	-11,209,303	1.000000000 ^S 87.294088999	-125,483.80	-10,953,994	0	255,309	255,309
-29,511.79000		12/3/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000 ^S 87.294088999	-29,511.79	-2,576,205	0	90,235	90,235

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-33,063.02000		12/4/2015		-33,063.02	-2,969,898	1.000000000 ^S 87.294088999	-33,063.02	-2,886,206	0	83,692	83,692
-33,111.98000		12/8/2015		-33,111.98	-2,969,410	1.000000000 ^S 87.294088999	-33,111.98	-2,890,480	0	78,930	78,930
-329,209.04000		12/9/2015		-329,209.04	-29,234,099	1.000000000 ^S 87.294088999	-329,209.04	-28,738,003	0	496,096	496,096
-29,648.06000		12/10/2015		-29,648.06	-2,614,894	1.000000000 ^S 87.294088999	-29,648.06	-2,588,100	0	26,794	26,794
-327,000.00000		12/11/2015		-327,000.00	-28,998,504	1.000000000 ^S 87.294088999	-327,000.00	-28,545,167	0	453,337	453,337
-92,475.65000		12/11/2015		-92,475.65	-8,200,781	1.000000000 ^S 87.294088999	-92,475.65	-8,072,578	0	128,203	128,203
-57,766.60000		12/11/2015		-57,766.60	-5,122,768	1.000000000 ^S 87.294088999	-57,766.60	-5,042,683	0	80,085	80,085
-34,992.57000		12/14/2015		-34,992.57	-3,051,138	1.000000000 ^S 87.294088999	-34,992.57	-3,054,645	0	-3,507	-3,507
-288,079.45000		12/15/2015		-288,079.45	-25,176,774	1.000000000 ^S 87.294088999	-288,079.45	-25,147,633	0	29,141	29,141
-109,269.69000		12/16/2015		-109,269.69	-9,536,047	1.000000000 ^S 87.294088999	-109,269.69	-9,538,598	0	-2,551	-2,551
-26,796.21000		12/18/2015		-26,796.21	-2,338,039	1.000000000 ^S 87.294088999	-26,796.21	-2,339,151	0	-1,112	-1,112
-35,901.50000		12/30/2015		-35,901.50	-3,154,307	1.000000000 ^S 87.294088999	-35,901.50	-3,133,989	0	20,318	20,318
-191,729.95000		1/4/2016		-191,729.95	-16,780,325	1.000000000 ^S 87.294088999	-191,729.95	-16,736,891	0	43,434	43,434
-223,008.99000		1/5/2016		-223,008.99	-19,064,056	1.000000000 ^S 87.294088999	-223,008.99	-19,467,367	0	-403,311	-403,311
-17,213.36000		1/7/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,213.36	-1,502,625	0	-60,061	-60,061

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-379,405.26000		1/12/2016		-379,405.26	-31,131,953	1.000000000 ^S 87.294088999	-379,405.26	-33,119,837	0	-1,987,884	-1,987,884
-189,599.29000		1/15/2016		-189,599.29	-15,584,866	1.000000000 ^S 87.294088999	-189,599.29	-16,550,897	0	-966,031	-966,031
-8,880.25000		1/19/2016		-8,880.25	-716,821	1.000000000 ^S 87.294088999	-8,880.25	-775,193	0	-58,372	-58,372
-90,489.83000		1/21/2016		-90,489.83	-7,198,238	1.000000000 ^S 87.294088999	-90,489.83	-7,899,227	0	-700,989	-700,989
-57,779.34000		1/21/2016		-57,779.34	-4,596,201	1.000000000 ^S 87.294088999	-57,779.34	-5,043,795	0	-447,594	-447,594
-7,629.83000		1/21/2016		-7,629.83	-606,934	1.000000000 ^S 87.294088999	-7,629.83	-666,039	0	-59,105	-59,105
-121,619.56000		1/22/2016		-121,619.56	-9,910,282	1.000000000 ^S 87.294088999	-121,619.56	-10,616,669	0	-706,387	-706,387
-214,100.94000		2/1/2016		-214,100.94	-18,334,604	1.000000000 ^S 87.294088999	-214,100.94	-18,689,747	0	-355,143	-355,143
-21,646.66000		2/4/2016		-21,646.66	-1,815,370	1.000000000 ^S 87.294088999	-21,646.66	-1,889,625	0	-74,255	-74,255
-14,653.90000		2/5/2016		-14,653.90	-1,240,675	1.000000000 ^S 87.294088999	-14,653.90	-1,279,199	0	-38,524	-38,524
-30,116.40000		2/10/2016		-30,116.40	-2,445,030	1.000000000 ^S 87.294088999	-30,116.40	-2,628,984	0	-183,954	-183,954
-381,805.81000		2/12/2016		-381,805.81	-30,235,477	1.000000000 ^S 87.294088999	-381,805.81	-33,329,390	0	-3,093,913	-3,093,913
-152,354.76000		2/12/2016		-152,354.76	-12,065,083	1.000000000 ^S 87.294088999	-152,354.76	-13,299,670	0	-1,234,587	-1,234,587
-16,916.50000		2/17/2016		-16,916.50	-1,364,954	1.000000000 ^S 87.294088999	-16,916.50	-1,476,710	0	-111,756	-111,756
-114,575.44000		2/22/2016		-114,575.44	-9,163,101	1.000000000 ^S 87.294088999	-114,575.44	-10,001,759	0	-838,658	-838,658

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-37,349.25000		2/23/2016		-37,349.25	-3,051,565	1.000000000 ^S 87.294088999	-37,349.25	-3,260,369	0	-208,804	-208,804
-123,804.34000		3/2/2016		-123,804.34	-10,057,811	1.000000000 ^S 87.294088999	-123,804.34	-10,807,387	0	-749,576	-749,576
-27,289.30000		3/3/2016		-27,289.30	-2,257,397	1.000000000 ^S 87.294088999	-27,289.30	-2,382,195	0	-124,798	-124,798
-10,054.65000		3/7/2016		-10,054.65	-847,732	1.000000000 ^S 87.294088999	-10,054.65	-877,712	0	-29,980	-29,980
-211,885.31000		3/9/2016		-211,885.31	-17,733,243	1.000000000 ^S 87.294088999	-211,885.31	-18,496,335	0	-763,092	-763,092
-377,078.03000		3/11/2016		-377,078.03	-31,843,855	1.000000000 ^S 87.294088999	-377,078.03	-32,916,683	0	-1,072,828	-1,072,828
-74,706.21000		3/14/2016		-74,706.21	-6,403,880	1.000000000 ^S 87.294088999	-74,706.21	-6,521,411	0	-117,531	-117,531
-73,687.89000		3/15/2016		-73,687.89	-6,289,651	1.000000000 ^S 87.294088999	-73,687.89	-6,432,517	0	-142,866	-142,866
-45,075.31000		3/16/2016		-45,075.31	-3,796,491	1.000000000 ^S 87.294088999	-45,075.31	-3,934,808	0	-138,317	-138,317
-29,125.30000		3/18/2016		-29,125.30	-2,475,492	1.000000000 ^S 87.294088999	-29,125.30	-2,542,467	0	-66,975	-66,975
-97,821.68000		3/22/2016		-97,821.68	-8,292,500	1.000000000 ^S 87.294088999	-97,821.68	-8,539,254	0	-246,754	-246,754
-112,039.68000		3/23/2016		-112,039.68	-9,552,811	1.000000000 ^S 87.294088999	-112,039.68	-9,780,402	0	-227,591	-227,591
-159,202.44000		3/24/2016		-159,202.44	-13,507,411	1.000000000 ^S 87.294088999	-159,202.44	-13,897,432	0	-390,021	-390,021
-32,177.14000		3/31/2016		-32,177.14	-2,784,601	1.000000000 ^S 87.294088999	-32,177.14	-2,808,874	0	-24,273	-24,273
-64,762.22000		4/5/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000 ^S 87.294088999	-64,762.22	-5,653,359	0	-167,740	-167,740

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-26,208.62000		4/6/2016		-26,208.62	-2,182,406	1.000000000 ^S 87.294088999	-26,208.62	-2,287,858	0	-105,452	-105,452
-373,765.27000		4/11/2016		-373,765.27	-30,674,974	1.000000000 ^S 87.294088999	-373,765.27	-32,627,499	0	-1,952,525	-1,952,525
-204,881.37000		4/11/2016		-204,881.37	-16,814,646	1.000000000 ^S 87.294088999	-204,881.37	-17,884,933	0	-1,070,287	-1,070,287
-43,019.52000		4/12/2016		-43,019.52	-3,527,545	1.000000000 ^S 87.294088999	-43,019.52	-3,755,350	0	-227,805	-227,805
-33,801.18000		4/13/2016		-33,801.18	-2,800,107	1.000000000 ^S 87.294088999	-33,801.18	-2,950,643	0	-150,536	-150,536
-141,797.35000		4/14/2016		-141,797.35	-11,838,108	1.000000000 ^S 87.294088999	-141,797.35	-12,378,070	0	-539,962	-539,962
-3,319.09000		4/18/2016		-3,319.09	-278,038	1.000000000 ^S 87.294088999	-3,319.09	-289,737	0	-11,699	-11,699
-83,104.57000		4/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000 ^S 87.294088999	-83,104.57	-7,254,538	0	-254,702	-254,702
-7,007.13000		4/19/2016		-7,007.13	-590,205	1.000000000 ^S 87.294088999	-7,007.13	-611,681	0	-21,476	-21,476
-32,699.55000		4/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000 ^S 87.294088999	-32,699.55	-2,854,477	0	-62,395	-62,395
-2,677,613.47000		4/21/2016		-2,677,613.47	-228,369,211	1.000000000 ^S 87.294088999	-2,677,613.47	-233,739,829	0	-5,370,618	-5,370,618
-92,321.29000		4/21/2016		-92,321.29	-7,873,930	1.000000000 ^S 87.294088999	-92,321.29	-8,059,103	0	-185,173	-185,173
-51,467.98000		4/26/2016		-51,467.98	-4,411,808	1.000000000 ^S 87.294088999	-51,467.98	-4,492,850	0	-81,042	-81,042
-15,428.24000		5/9/2016		-15,428.24	-1,209,910	1.000000000 ^S 87.294088999	-15,428.24	-1,346,794	0	-136,884	-136,884
-102,314.26000		5/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000 ^S 87.294088999	-102,314.26	-8,931,430	0	-708,825	-708,825

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-352,627.83000		5/12/2016		-352,627.83	-28,284,357	1.000000000 ^S 87.294088999	-352,627.83	-30,782,325	0	-2,497,968	-2,497,968
-32,453.42000		5/17/2016		-32,453.42	-2,578,702	1.000000000 ^S 87.294088999	-32,453.42	-2,832,992	0	-254,290	-254,290
-184,519.95000		5/18/2016		-184,519.95	-14,755,931	1.000000000 ^S 87.294088999	-184,519.95	-16,107,501	0	-1,351,570	-1,351,570
-346,026.04000		5/23/2016		-346,026.04	-27,596,972	1.000000000 ^S 87.294088999	-346,026.04	-30,206,028	0	-2,609,056	-2,609,056
-349,425.52000		6/10/2016		-349,425.52	-27,668,680	1.000000000 ^S 87.294088999	-349,425.52	-30,502,782	0	-2,834,102	-2,834,102
-205,061.01000		6/14/2016		-205,061.01	-16,138,898	1.000000000 ^S 87.294088999	-205,061.01	-17,900,614	0	-1,761,716	-1,761,716
-27,132.00000		6/17/2016		-27,132.00	-2,060,548	1.000000000 ^S 87.294088999	-27,132.00	-2,368,463	0	-307,915	-307,915
-3,725.24000		7/7/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000 ^S 87.294088999	-3,725.24	-325,191	0	-43,635	-43,635
-359,882.81000		7/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000 ^S 87.294088999	-359,882.81	-31,415,642	0	-4,094,599	-4,094,599
-11,042.19000		7/11/2016		-11,042.19	-838,284	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,042.19	-963,918	0	-125,634	-125,634
-123,264.71000		7/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000 ^S 87.294088999	-123,264.71	-10,760,281	0	-1,221,815	-1,221,815
-253,623.43000		7/14/2016		-253,623.43	-20,172,228	1.000000000 ^S 87.294088999	-253,623.43	-22,139,826	0	-1,967,598	-1,967,598
-78,638.63000		7/14/2016		-78,638.63	-6,254,613	1.000000000 ^S 87.294088999	-78,638.63	-6,864,688	0	-610,075	-610,075
-6,630.58000		7/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000 ^S 87.294088999	-6,630.58	-578,810	0	-51,439	-51,439
-105,691.38000		7/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000 ^S 87.294088999	-105,691.38	-9,226,233	0	-805,286	-805,286

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-26,928.63000		7/22/2016		-26,928.63	-2,148,021	1.000000000 ^S 87.294088999	-26,928.63	-2,350,710	0	-202,689	-202,689
-11,865.10000		7/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,865.10	-1,035,753	0	-101,290	-101,290
-64,818.19000		8/2/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000 ^S 87.294088999	-64,818.19	-5,658,245	0	-643,844	-643,844
-19,853.51000		8/2/2016		-19,853.51	-1,535,888	1.000000000 ^S 87.294088999	-19,853.51	-1,733,094	0	-197,206	-197,206
-181,375.34000		8/3/2016		-181,375.34	-13,938,155	1.000000000 ^S 87.294088999	-181,375.34	-15,832,995	0	-1,894,840	-1,894,840
-25,260.07000		8/4/2016		-25,260.07	-1,938,997	1.000000000 ^S 87.294088999	-25,260.07	-2,205,055	0	-266,058	-266,058
-356,084.08000		8/12/2016		-356,084.08	-27,843,105	1.000000000 ^S 87.294088999	-356,084.08	-31,084,035	0	-3,240,930	-3,240,930
-42,406.06000		8/12/2016		-42,406.06	-3,315,836	1.000000000 ^S 87.294088999	-42,406.06	-3,701,798	0	-385,962	-385,962
-33,369.43000		8/16/2016		-33,369.43	-2,591,016	1.000000000 ^S 87.294088999	-33,369.43	-2,912,954	0	-321,938	-321,938
-146,047.78000		8/17/2016		-146,047.78	-11,265,304	1.000000000 ^S 87.294088999	-146,047.78	-12,749,108	0	-1,483,804	-1,483,804
-12,365.22000		8/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000 ^S 87.294088999	-12,365.22	-1,079,411	0	-132,665	-132,665
-25,656.87000		8/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000 ^S 87.294088999	-25,656.87	-2,239,693	0	-266,894	-266,894
-62,280.99000		8/22/2016		-62,280.99	-4,755,276	1.000000000 ^S 87.294088999	-62,280.99	-5,436,762	0	-681,486	-681,486
-115,979.16000		8/23/2016		-115,979.16	-8,883,458	1.000000000 ^S 87.294088999	-115,979.16	-10,124,295	0	-1,240,837	-1,240,837
-45,244.15000		8/24/2016		-45,244.15	-3,466,822	1.000000000 ^S 87.294088999	-45,244.15	-3,949,547	0	-482,725	-482,725

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-118,911.22000		8/25/2016		-118,911.22	-9,101,467	1.000000000 ^S 87.294088999	-118,911.22	-10,380,247	0	-1,278,780	-1,278,780
-18,695.42000		9/2/2016		-18,695.42	-1,456,164	1.000000000 ^S 87.294088999	-18,695.42	-1,632,000	0	-175,836	-175,836
-647,737.56000		9/8/2016		-647,737.56	-50,558,123	1.000000000 ^S 87.294088999	-647,737.56	-56,543,660	0	-5,985,537	-5,985,537
-349,412.93000		9/12/2016		-349,412.93	-27,165,953	1.000000000 ^S 87.294088999	-349,412.93	-30,501,683	0	-3,335,730	-3,335,730
-17,748.89000		9/15/2016		-17,748.89	-1,360,703	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,748.89	-1,549,373	0	-188,670	-188,670
-179,125.75000		9/21/2016		-179,125.75	-13,765,066	1.000000000 ^S 87.294088999	-179,125.75	-15,636,619	0	-1,871,553	-1,871,553
-355,570.37000		10/12/2016		-355,570.37	-27,813,188	1.000000000 ^S 87.294088999	-355,570.37	-31,039,192	0	-3,226,004	-3,226,004
-87,209.56000		10/14/2016		-87,209.56	-6,810,737	1.000000000 ^S 87.294088999	-87,209.56	-7,612,879	0	-802,142	-802,142
-49,550.92000		10/20/2016		-49,550.92	-3,937,169	1.000000000 ^S 87.294088999	-49,550.92	-4,325,502	0	-388,333	-388,333
-108,096.46000		10/26/2016		-108,096.46	-8,631,787	1.000000000 ^S 87.294088999	-108,096.46	-9,436,182	0	-804,395	-804,395
-6,022.62000		11/9/2016		-6,022.62	-486,973	1.000000000 ^S 87.294088999	-6,022.62	-525,739	0	-38,766	-38,766
-358,077.71000		11/14/2016		-358,077.71	-28,775,830	1.000000000 ^S 87.294088999	-358,077.71	-31,258,067	0	-2,482,237	-2,482,237
-105,736.37000		11/15/2016		-105,736.37	-8,633,411	1.000000000 ^S 87.294088999	-105,736.37	-9,230,160	0	-596,749	-596,749
-8,950.00000		11/16/2016		-8,950.00	-735,749	1.000000000 ^S 87.294088999	-8,950.00	-781,282	0	-45,533	-45,533
-43,039.27000		11/18/2016		-43,039.27	-3,517,706	1.000000000 ^S 87.294088999	-43,039.27	-3,757,074	0	-239,368	-239,368

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-29,290.91000		11/25/2016		-29,290.91	-2,456,555	1.000000000 ^S 87.294088999	-29,290.91	-2,556,923	0	-100,368	-100,368
-51,254.81000		11/30/2016		-51,254.81	-4,320,135	1.000000000 ^S 87.294088999	-51,254.81	-4,474,242	0	-154,107	-154,107
-156,086.08000		12/1/2016		-156,086.08	-13,140,616	1.000000000 ^S 87.294088999	-156,086.08	-13,625,392	0	-484,776	-484,776
-99,004.27000		12/2/2016		-99,004.27	-8,385,070	1.000000000 ^S 87.294088999	-99,004.27	-8,642,488	0	-257,418	-257,418
-241,950.12000		12/6/2016		-241,950.12	-20,677,187	1.000000000 ^S 87.294088999	-241,950.12	-21,120,815	0	-443,628	-443,628
-52,956.42000		12/7/2016		-52,956.42	-4,499,736	1.000000000 ^S 87.294088999	-52,956.42	-4,622,782	0	-123,046	-123,046
-352,726.96000		12/9/2016		-352,726.96	-29,973,125	1.000000000 ^S 87.294088999	-352,726.96	-30,790,979	0	-817,854	-817,854
-9,409.35000		12/12/2016		-9,409.35	-807,660	1.000000000 ^S 87.294088999	-9,409.35	-821,381	0	-13,721	-13,721
-242,673.60000		12/14/2016		-242,673.60	-20,968,061	1.000000000 ^S 87.294088999	-242,673.60	-21,183,971	0	-215,910	-215,910
-8,765.00000		12/16/2016		-8,765.00	-764,049	1.000000000 ^S 87.294088999	-8,765.00	-765,133	0	-1,084	-1,084
-63,041.53000		12/19/2016		-63,041.53	-5,432,127	1.000000000 ^S 87.294088999	-63,041.53	-5,503,153	0	-71,026	-71,026
-113,105.55000		12/22/2016		-113,105.55	-9,651,835	1.000000000 ^S 87.294088999	-113,105.55	-9,873,446	0	-221,611	-221,611
-202,488.26000		12/28/2016		-202,488.26	-17,117,239	1.000000000 ^S 87.294088999	-202,488.26	-17,676,028	0	-558,789	-558,789
-17,327.64000		12/29/2016		-17,327.64	-1,462,733	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,327.64	-1,512,601	0	-49,868	-49,868
-1,900.70000		12/30/2016		-1,900.70	-159,632	1.000000000 ^S 87.294088999	-1,900.70	-165,920	0	-6,288	-6,288

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-17,618.00000		1/4/2017		-17,618.00	-1,501,301	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,618.00	-1,537,947	0	-36,646	-36,646
-550,762.83000		1/5/2017		-550,762.83	-47,018,808	1.000000000 ^S 87.294088999	-550,762.83	-48,078,339	0	-1,059,531	-1,059,531
-46,205.35000		1/6/2017		-46,205.35	-3,920,910	1.000000000 ^S 87.294088999	-46,205.35	-4,033,454	0	-112,544	-112,544
-75,551.78000		1/11/2017		-75,551.78	-6,438,078	1.000000000 ^S 87.294088999	-75,551.78	-6,595,224	0	-157,146	-157,146
-349,599.06000		1/12/2017		-349,599.06	-30,063,342	1.000000000 ^S 87.294088999	-349,599.06	-30,517,931	0	-454,589	-454,589
-11,816.04000		1/12/2017		-11,816.04	-1,016,106	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,816.04	-1,031,470	0	-15,364	-15,364
-78,835.06000		1/18/2017		-78,835.06	-6,719,133	1.000000000 ^S 87.294088999	-78,835.06	-6,881,835	0	-162,702	-162,702
-11,222.99000		1/18/2017		-11,222.99	-956,538	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,222.99	-979,701	0	-23,163	-23,163
-6,647.14000		1/18/2017		-6,647.14	-566,537	1.000000000 ^S 87.294088999	-6,647.14	-580,256	0	-13,719	-13,719
-57,843.82000		1/20/2017		-57,843.82	-5,033,172	1.000000000 ^S 87.294088999	-57,843.82	-5,049,424	0	-16,252	-16,252
-59,564.39000		1/23/2017		-59,564.39	-5,172,781	1.000000000 ^S 87.294088999	-59,564.39	-5,199,619	0	-26,838	-26,838
-120,856.84000		1/24/2017		-120,856.84	-10,353,246	1.000000000 ^S 87.294088999	-120,856.84	-10,550,088	0	-196,842	-196,842
-105,955.38000		1/24/2017		-105,955.38	-9,076,707	1.000000000 ^S 87.294088999	-105,955.38	-9,249,278	0	-172,571	-172,571
-186,290.44000		1/27/2017		-186,290.44	-16,102,463	1.000000000 ^S 87.294088999	-186,290.44	-16,262,054	0	-159,591	-159,591
-72,198.29000		1/27/2017		-72,198.29	-6,240,633	1.000000000 ^S 87.294088999	-72,198.29	-6,302,484	0	-61,851	-61,851

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-66,189.39000		2/1/2017		-66,189.39	-5,656,632	1.000000000 ^S 87.294088999	-66,189.39	-5,777,943	0	-121,311	-121,311
-17,013.34000		2/2/2017		-17,013.34	-1,460,104	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,013.34	-1,485,164	0	-25,060	-25,060
-10,224.17000		2/7/2017		-10,224.17	-877,520	1.000000000 ^S 87.294088999	-10,224.17	-892,510	0	-14,990	-14,990
-177,969.53000		2/9/2017		-177,969.53	-15,213,556	1.000000000 ^S 87.294088999	-177,969.53	-15,535,688	0	-322,132	-322,132
-344,229.20000		2/10/2017		-344,229.20	-29,662,809	1.000000000 ^S 87.294088999	-344,229.20	-30,049,174	0	-386,365	-386,365
-152,291.16000		2/13/2017		-152,291.16	-13,270,154	1.000000000 ^S 87.294088999	-152,291.16	-13,294,118	0	-23,964	-23,964
-967,326.20000		2/15/2017		-967,326.20	-84,398,304	1.000000000 ^S 87.294088999	-967,326.20	-84,441,859	0	-43,555	-43,555
-71,449.49000		2/16/2017		-71,449.49	-6,292,028	1.000000000 ^S 87.294088999	-71,449.49	-6,237,118	0	54,910	54,910
-34,639.01000		2/23/2017		-34,639.01	-3,017,462	1.000000000 ^S 87.294088999	-34,639.01	-3,023,781	0	-6,319	-6,319
-52,248.31000		3/1/2017		-52,248.31	-4,494,545	1.000000000 ^S 87.294088999	-52,248.31	-4,560,969	0	-66,424	-66,424
-44,953.93000		3/3/2017		-44,953.93	-3,898,960	1.000000000 ^S 87.294088999	-44,953.93	-3,924,212	0	-25,252	-25,252
-185,905.53000		3/8/2017		-185,905.53	-16,102,616	1.000000000 ^S 87.294088999	-185,905.53	-16,228,454	0	-125,838	-125,838
-11,158.43000		3/9/2017		-11,158.43	-965,561	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,158.43	-974,065	0	-8,504	-8,504
-334,340.29000		3/10/2017		-334,340.29	-28,791,636	1.000000000 ^S 87.294088999	-334,340.29	-29,185,931	0	-394,295	-394,295
-189,359.17000		3/14/2017		-189,359.17	-16,457,305	1.000000000 ^S 87.294088999	-189,359.17	-16,529,936	0	-72,631	-72,631

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-201,782.17000		3/15/2017		-201,782.17	-17,521,607	1.000000000 ^S 87.294088999	-201,782.17	-17,614,391	0	-92,784	-92,784
-93,724.51000		3/16/2017		-93,724.51	-8,160,137	1.000000000 ^S 87.294088999	-93,724.51	-8,181,596	0	-21,459	-21,459
-951,148.84000		3/17/2017		-951,148.84	-82,485,587	1.000000000 ^S 87.294088999	-951,148.84	-83,029,671	0	-544,084	-544,084
-49,845.77000		3/21/2017		-49,845.77	-4,339,671	1.000000000 ^S 87.294088999	-49,845.77	-4,351,241	0	-11,570	-11,570
-97,972.14000		3/22/2017		-97,972.14	-8,458,699	1.000000000 ^S 87.294088999	-97,972.14	-8,552,389	0	-93,690	-93,690
-129,338.35000		3/24/2017		-129,338.35	-10,986,556	1.000000000 ^S 87.294088999	-129,338.35	-11,290,473	0	-303,917	-303,917
-35,149.28000		3/29/2017		-35,149.28	-2,959,437	1.000000000 ^S 87.294088999	-35,149.28	-3,068,324	0	-108,887	-108,887
-121,963.21000		4/3/2017		-121,963.21	-10,367,407	1.000000000 ^S 87.294088999	-121,963.21	-10,646,667	0	-279,260	-279,260
-17,011.29000		4/4/2017		-17,011.29	-1,434,849	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,011.29	-1,484,985	0	-50,136	-50,136
-99,836.86000		4/5/2017		-99,836.86	-8,339,503	1.000000000 ^S 87.294088999	-99,836.86	-8,715,168	0	-375,665	-375,665
-321,826.20000		4/11/2017		-321,826.20	-26,821,039	1.000000000 ^S 87.294088999	-321,826.20	-28,093,525	0	-1,272,486	-1,272,486
-2,535.89000		4/13/2017		-2,535.89	-208,025	1.000000000 ^S 87.294088999	-2,535.89	-221,368	0	-13,343	-13,343
-17,906.57000		4/24/2017		-17,906.57	-1,469,466	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,906.57	-1,563,138	0	-93,672	-93,672
-97,737.47000		4/26/2017		-97,737.47	-8,168,487	1.000000000 ^S 87.294088999	-97,737.47	-8,531,903	0	-363,416	-363,416
-72,720.60000		4/26/2017		-72,720.60	-6,077,682	1.000000000 ^S 87.294088999	-72,720.60	-6,348,079	0	-270,397	-270,397

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-6,131.59000		4/26/2017		-6,131.59	-512,453	1.000000000 ^S 87.294088999	-6,131.59	-535,252	0	-22,799	-22,799
-5,770,905.72000		5/2/2017		-5,770,905.72	-481,079,087	1.000000000 ^S 87.294088999	-5,770,905.72	-503,765,958	0	-22,686,871	-22,686,871
-757,937.72000		5/8/2017		-757,937.72	-63,229,524	1.000000000 ^S 87.294088999	-757,937.72	-66,163,483	0	-2,933,959	-2,933,959
-93,372.59000		5/11/2017		-93,372.59	-7,870,999	1.000000000 ^S 87.294088999	-93,372.59	-8,150,875	0	-279,876	-279,876
-277,865.98000		5/12/2017		-277,865.98	-23,283,752	1.000000000 ^S 87.294088999	-277,865.98	-24,256,058	0	-972,306	-972,306
-83,218.51000		5/12/2017		-83,218.51	-6,973,287	1.000000000 ^S 87.294088999	-83,218.51	-7,264,484	0	-291,197	-291,197
-87,633.54000		5/15/2017		-87,633.54	-7,339,187	1.000000000 ^S 87.294088999	-87,633.54	-7,649,890	0	-310,703	-310,703
-161,718.79000		5/16/2017		-161,718.79	-13,634,189	1.000000000 ^S 87.294088999	-161,718.79	-14,117,094	0	-482,905	-482,905
-51,805.98000		5/17/2017		-51,805.98	-4,351,820	1.000000000 ^S 87.294088999	-51,805.98	-4,522,356	0	-170,536	-170,536
-215,576.55000		5/19/2017		-215,576.55	-17,787,680	1.000000000 ^S 87.294088999	-215,576.55	-18,818,559	0	-1,030,879	-1,030,879
-339,293.20000		5/22/2017		-339,293.20	-28,164,073	1.000000000 ^S 87.294088999	-339,293.20	-29,618,291	0	-1,454,218	-1,454,218
-105,085.63000		5/24/2017		-105,085.63	-8,748,278	1.000000000 ^S 87.294088999	-105,085.63	-9,173,354	0	-425,076	-425,076
-35,824.15000		5/26/2017		-35,824.15	-2,994,583	1.000000000 ^S 87.294088999	-35,824.15	-3,127,237	0	-132,654	-132,654
-85,534.03000		6/1/2017		-85,534.03	-7,041,589	1.000000000 ^S 87.294088999	-85,534.03	-7,466,615	0	-425,026	-425,026
-184,424.56000		6/6/2017		-184,424.56	-15,242,969	1.000000000 ^S 87.294088999	-184,424.56	-16,099,174	0	-856,205	-856,205

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-268,856.14000		6/9/2017		-268,856.14	-22,316,945	1.000000000 ^S 87.294088999	-268,856.14	-23,469,552	0	-1,152,607	-1,152,607
-48,274.55000		6/16/2017		-48,274.55	-4,048,407	1.000000000 ^S 87.294088999	-48,274.55	-4,214,083	0	-165,676	-165,676
-28,558.93000		6/19/2017		-28,558.93	-2,409,398	1.000000000 ^S 87.294088999	-28,558.93	-2,493,026	0	-83,628	-83,628
-32,535.99000		6/22/2017		-32,535.99	-2,741,102	1.000000000 ^S 87.294088999	-32,535.99	-2,840,200	0	-99,098	-99,098
-36,028.00000		6/27/2017		-36,028.00	-3,046,343	1.000000000 ^S 87.294088999	-36,028.00	-3,145,031	0	-98,688	-98,688
-85,677.03000		6/28/2017		-85,677.03	-7,298,656	1.000000000 ^S 87.294088999	-85,677.03	-7,479,098	0	-180,442	-180,442
-50,207.38000		6/29/2017		-50,207.38	-4,284,996	1.000000000 ^S 87.294088999	-50,207.38	-4,382,807	0	-97,811	-97,811
-17,179.10000		6/30/2017		-17,179.10	-1,485,268	1.000000000 ^S 87.294088999	-17,179.10	-1,499,634	0	-14,366	-14,366
-24,916.13000		7/6/2017		-24,916.13	-2,139,501	1.000000000 ^S 87.294088999	-24,916.13	-2,175,031	0	-35,530	-35,530
-70,337.04000		7/7/2017		-70,337.04	-6,033,979	1.000000000 ^S 87.294088999	-70,337.04	-6,140,008	0	-106,029	-106,029
-268,122.83000		7/11/2017		-268,122.83	-23,253,058	1.000000000 ^S 87.294088999	-268,122.83	-23,405,538	0	-152,480	-152,480
-94,299.32000		7/12/2017		-94,299.32	-8,216,368	1.000000000 ^S 87.294088999	-94,299.32	-8,231,773	0	-15,405	-15,405
-48,129.04000		7/13/2017		-48,129.04	-4,176,056	1.000000000 ^S 87.294088999	-48,129.04	-4,201,381	0	-25,325	-25,325
-94,307.37000		7/14/2017		-94,307.37	-8,260,227	1.000000000 ^S 87.294088999	-94,307.37	-8,232,476	0	27,751	27,751
-224,064.11000		7/18/2017		-224,064.11	-19,759,163	1.000000000 ^S 87.294088999	-224,064.11	-19,559,472	0	199,691	199,691

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-62,985.03000		7/18/2017		-62,985.03	-5,554,354	1.000000000 ^S 87.294088999	-62,985.03	-5,498,221	0	56,133	56,133
-5,310.71000		7/18/2017		-5,310.71	-468,327	1.000000000 ^S 87.294088999	-5,310.71	-463,594	0	4,733	4,733
-84,652.73000		7/19/2017		-84,652.73	-7,503,258	1.000000000 ^S 87.294088999	-84,652.73	-7,389,683	0	113,575	113,575
-57,508.35000		7/24/2017		-57,508.35	-5,058,492	1.000000000 ^S 87.294088999	-57,508.35	-5,020,139	0	38,353	38,353
-34,173.40000		7/27/2017		-34,173.40	-3,033,016	1.000000000 ^S 87.294088999	-34,173.40	-2,983,136	0	49,880	49,880
-42,955.96000		7/28/2017		-42,955.96	-3,821,788	1.000000000 ^S 87.294088999	-42,955.96	-3,749,801	0	71,987	71,987
-34,563.35000		8/1/2017		-34,563.35	-3,048,960	1.000000000 ^S 87.294088999	-34,563.35	-3,017,176	0	31,784	31,784
-11,898.68000		8/2/2017		-11,898.68	-1,046,921	1.000000000 ^S 87.294088999	-11,898.68	-1,038,684	0	8,237	8,237
-251,943.26000		8/8/2017		-251,943.26	-22,077,618	1.000000000 ^S 87.294088999	-251,943.26	-21,993,157	0	84,461	84,461
-129,223.68000		8/8/2017		-129,223.68	-11,323,784	1.000000000 ^S 87.294088999	-129,223.68	-11,280,463	0	43,321	43,321
-26,983.86000		8/9/2017		-26,983.86	-2,360,030	1.000000000 ^S 87.294088999	-26,983.86	-2,355,531	0	4,499	4,499
-5,436.08000		8/10/2017		-5,436.08	-470,606	1.000000000 ^S 87.294088999	-5,436.08	-474,538	0	-3,932	-3,932
-261,862.81000		8/14/2017		-261,862.81	-22,503,263	1.000000000 ^S 87.294088999	-261,862.81	-22,859,075	0	-355,812	-355,812
-38,687.10000		8/14/2017		-38,687.10	-3,324,588	1.000000000 ^S 87.294088999	-38,687.10	-3,377,155	0	-52,567	-52,567
-234,673.89000		8/16/2017		-234,673.89	-20,287,202	1.000000000 ^S 87.294088999	-234,673.89	-20,485,643	0	-198,441	-198,441

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

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

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

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 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-151,106.11000		8/17/2017		-151,106.11	-13,198,995	1.000000000 ^S 87.294088999	-151,106.11	-13,190,670	0	8,325	8,325
-23,853.89000		8/18/2017		-23,853.89	-2,076,341	1.000000000 ^S 87.294088999	-23,853.89	-2,082,304	0	-5,963	-5,963
-128,055.35000		8/22/2017		-128,055.35	-11,058,464	1.000000000 ^S 87.294088999	-128,055.35	-11,178,475	0	-120,011	-120,011
-20,640.91000		8/23/2017		-20,640.91	-1,790,067	1.000000000 ^S 87.294088999	-20,640.91	-1,801,829	0	-11,762	-11,762
-47,297.81000		8/29/2017		-47,297.81	-4,106,488	1.000000000 ^S 87.294088999	-47,297.81	-4,128,819	0	-22,331	-22,331
-1,347,714.81000		8/30/2017		-1,347,714.81	-116,950,732	1.000000000 ^S 87.294088999	-1,347,714.81	-117,647,537	0	-696,805	-696,805
-1,203,000.00000		8/30/2017		-1,203,000.00	-104,392,806	1.000000000 ^S 87.294088999	-1,203,000.00	-105,014,789	0	-621,983	-621,983
-30,083.55000		8/30/2017		-30,083.55	-2,610,562	1.000000000 ^S 87.294088999	-30,083.55	-2,626,116	0	-15,554	-15,554
837,553.48000 0.00000	合計 -----			837,553	-57,374,570		837,553	73,113,474	0	130,488,044	130,488,044
68,547.40000	BRAZILIAN REAL BRL	5/14/2013		68,547.40	3,453,934	1.000000000 ^S 0.028588497	68,547.40	2,397,727	0	-1,056,207	-1,056,207
1,056,403.20000		5/14/2013		1,056,403.20	53,229,538	1.000000000 ^S 0.028588497	1,056,403.20	36,952,037	0	-16,277,501	-16,277,501
90,499.50000		6/11/2013		90,499.50	4,158,091	1.000000000 ^S 0.028588497	90,499.50	3,165,591	0	-992,500	-992,500
184,874.70000		6/11/2013		184,874.70	8,494,255	1.000000000 ^S 0.028588497	184,874.70	6,466,751	0	-2,027,504	-2,027,504
3,892,793.65000		6/11/2013		3,892,793.65	178,858,332	1.000000000 ^S 0.028588497	3,892,793.65	136,166,433	0	-42,691,899	-42,691,899
32,593,600.00000		6/11/2013		32,593,600.00	1,497,545,840	1.000000000 ^S 0.028588497	32,593,600.00	1,140,094,913	0	-357,450,927	-357,450,927

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
369,451,791.10000		6/11/2013		369,451,791.10	16,974,835,330	1.000000000 ^S 0.028588497	369,451,791.10	12,923,092,498	0	-4,051,742,832	-4,051,742,832
-632,326.40000		5/14/2013		-632,326.40	-31,861,359	1.000000000 ^S 0.028588497	-632,326.40	-22,118,211	0	9,743,148	9,743,148
-353,472,791.10000		6/11/2013		-353,472,791.10	-16,240,664,051	1.000000000 ^S 0.028588497	-353,472,791.10	-12,364,161,400	0	3,876,502,651	3,876,502,651
-32,593,600.00000		6/11/2013		-32,593,600.00	-1,497,545,840	1.000000000 ^S 0.028588497	-32,593,600.00	-1,140,094,913	0	357,450,927	357,450,927
-4,965,000.00000		6/11/2013		-4,965,000.00	-228,121,935	1.000000000 ^S 0.028588497	-4,965,000.00	-173,671,250	0	54,450,685	54,450,685
-4,950,000.00000		6/11/2013		-4,950,000.00	-227,432,745	1.000000000 ^S 0.028588497	-4,950,000.00	-173,146,563	0	54,286,182	54,286,182
-4,561,792.05000		6/11/2013		-4,561,792.05	-209,596,139	1.000000000 ^S 0.028588497	-4,561,792.05	-159,567,397	0	50,028,742	50,028,742
-4,089,000.00000		6/11/2013		-4,089,000.00	-187,873,231	1.000000000 ^S 0.028588497	-4,089,000.00	-143,029,555	0	44,843,676	44,843,676
-1,975,000.00000		6/11/2013		-1,975,000.00	-90,743,368	1.000000000 ^S 0.028588497	-1,975,000.00	-69,083,730	0	21,659,638	21,659,638
-99,000.00000		6/11/2013		-99,000.00	-4,548,655	1.000000000 ^S 0.028588497	-99,000.00	-3,462,931	0	1,085,724	1,085,724
0.00000	合計 -----			0	2,187,997		0	0	0	-2,187,997	-2,187,997
0.00000											
148,655.45	BRITISH POUND	8/30/2017		148,655.45	20,933,716	1.000000000 ^S 141.817813004	148,655.45	21,081,991	0	148,275	148,275
50.00	GBP										
50.00	CANADIAN DOLLAR	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000 ^S 0.011391514	50.00	4,389	0	-281	-281
	CAD										
526,270.70000	EURO	8/30/2017		526,270.70	68,827,129	1.000000000 ^S 130.850334005	526,270.70	68,862,697	0	35,568	35,568
	EUR										
262,189.77000	UNITED STATES DOLLAR	6/28/2017		262,189.77	29,421,624	1.000000000 ^S 0.009085953	262,189.77	28,856,606	0	-565,018	-565,018
	USD										

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
533,805.51000		6/28/2017		533,805.51	59,900,983	1.000000000 ^S 0.009085953	533,805.51	58,750,635	0	-1,150,348	-1,150,348
578,048.11000		6/28/2017		578,048.11	64,865,666	1.000000000 ^S 0.009085953	578,048.11	63,619,976	0	-1,245,690	-1,245,690
807,512.69000		6/28/2017		807,512.69	90,615,032	1.000000000 ^S 0.009085953	807,512.69	88,874,848	0	-1,740,184	-1,740,184
844,185.51000		6/28/2017		844,185.51	94,730,273	1.000000000 ^S 0.009085953	844,185.51	92,911,058	0	-1,819,215	-1,819,215
1,139,129.98000		6/28/2017		1,139,129.98	127,827,465	1.000000000 ^S 0.009085953	1,139,129.98	125,372,647	0	-2,454,818	-2,454,818
1,373,162.32000		6/28/2017		1,373,162.32	154,089,403	1.000000000 ^S 0.009085953	1,373,162.32	151,130,247	0	-2,959,156	-2,959,156
3,385,580.31000		6/28/2017		3,385,580.31	379,912,877	1.000000000 ^S 0.009085953	3,385,580.31	372,616,974	0	-7,295,903	-7,295,903
3,799,861.01000		6/28/2017		3,799,861.01	426,401,384	1.000000000 ^S 0.009085953	3,799,861.01	418,212,708	0	-8,188,676	-8,188,676
4,801,770.59000		6/28/2017		4,801,770.59	538,830,663	1.000000000 ^S 0.009085953	4,801,770.59	528,482,878	0	-10,347,785	-10,347,785
9,399,346.79000		6/28/2017		9,399,346.79	1,054,747,653	1.000000000 ^S 0.009085953	9,399,346.79	1,034,492,121	0	-20,255,532	-20,255,532
30,639,470.19000		6/28/2017		30,639,470.19	3,438,207,993	1.000000000 ^S 0.009085953	30,639,470.19	3,372,180,132	0	-66,027,861	-66,027,861
95,709,883.05000		6/28/2017		95,709,883.05	10,740,084,043	1.000000000 ^S 0.009085953	95,709,883.05	10,533,829,864	0	-206,254,179	-206,254,179
96,861.72000		6/29/2017		96,861.72	10,861,589	1.000000000 ^S 0.009085953	96,861.72	10,660,601	0	-200,988	-200,988
3,573.01000		6/30/2017		3,573.01	401,463	1.000000000 ^S 0.009085953	3,573.01	393,245	0	-8,218	-8,218
330,000.00000		6/30/2017		330,000.00	37,154,702	1.000000000 ^S 0.009085953	330,000.00	36,319,800	0	-834,902	-834,902

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
60,326.46000		7/5/2017		60,326.46	6,825,336	1.000000000 ^S 0.009085953	60,326.46	6,639,530	0	-185,806	-185,806
791,226.72000		7/5/2017		791,226.72	89,519,391	1.000000000 ^S 0.009085953	791,226.72	87,082,414	0	-2,436,977	-2,436,977
820,722.27000		7/5/2017		820,722.27	92,856,518	1.000000000 ^S 0.009085953	820,722.27	90,328,694	0	-2,527,824	-2,527,824
5,060,081.28000		7/5/2017		5,060,081.28	572,497,598	1.000000000 ^S 0.009085953	5,060,081.28	556,912,553	0	-15,585,045	-15,585,045
6,287,250.00000		7/5/2017		6,287,250.00	711,339,468	1.000000000 ^S 0.009085953	6,287,250.00	691,974,744	0	-19,364,724	-19,364,724
52.69000		7/6/2017		52.69	5,968	1.000000000 ^S 0.009085953	52.69	5,799	0	-169	-169
52.69000		7/6/2017		52.69	5,968	1.000000000 ^S 0.009085953	52.69	5,799	0	-169	-169
8,176.46000		7/11/2017		8,176.46	933,711	1.000000000 ^S 0.009085953	8,176.46	899,901	0	-33,810	-33,810
27,335.09000		7/11/2017		27,335.09	3,121,531	1.000000000 ^S 0.009085953	27,335.09	3,008,500	0	-113,031	-113,031
46,920.11000		7/11/2017		46,920.11	5,358,042	1.000000000 ^S 0.009085953	46,920.11	5,164,027	0	-194,015	-194,015
147,291.67000		7/11/2017		147,291.67	16,819,972	1.000000000 ^S 0.009085953	147,291.67	16,210,921	0	-609,051	-609,051
187,811.73000		7/11/2017		187,811.73	21,447,160	1.000000000 ^S 0.009085953	187,811.73	20,670,559	0	-776,601	-776,601
233,524.28000		7/11/2017		233,524.28	26,667,304	1.000000000 ^S 0.009085953	233,524.28	25,701,683	0	-965,621	-965,621
330,000.00000		7/11/2017		330,000.00	37,684,349	1.000000000 ^S 0.009085953	330,000.00	36,319,800	0	-1,364,549	-1,364,549
5,113,500.00000		7/11/2017		5,113,500.00	583,936,121	1.000000000 ^S 0.009085953	5,113,500.00	562,791,817	0	-21,144,304	-21,144,304

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
440,000.00000		7/13/2017		440,000.00	49,746,401	1.000000000 ^S 0.009085953	440,000.00	48,426,401	0	-1,320,000	-1,320,000
41,843.75000		7/15/2017		41,843.75	4,712,653	1.000000000 ^S 0.009085953	41,843.75	4,605,323	0	-107,330	-107,330
810,000.00000		7/17/2017		810,000.00	91,226,253	1.000000000 ^S 0.009085953	810,000.00	89,148,601	0	-2,077,652	-2,077,652
460,000.00000		7/19/2017		460,000.00	51,434,900	1.000000000 ^S 0.009085953	460,000.00	50,627,601	0	-807,299	-807,299
460,000.00000		7/20/2017		460,000.00	51,382,003	1.000000000 ^S 0.009085953	460,000.00	50,627,601	0	-754,402	-754,402
17,325.00000		7/21/2017		17,325.00	1,936,502	1.000000000 ^S 0.009085953	17,325.00	1,906,790	0	-29,712	-29,712
1,133,913.00000		7/21/2017		1,133,913.00	126,743,131	1.000000000 ^S 0.009085953	1,133,913.00	124,798,466	0	-1,944,665	-1,944,665
11,781.97000		7/24/2017		11,781.97	1,309,271	1.000000000 ^S 0.009085953	11,781.97	1,296,724	0	-12,547	-12,547
37,087.50000		7/24/2017		37,087.50	4,121,349	1.000000000 ^S 0.009085953	37,087.50	4,081,850	0	-39,499	-39,499
1,197,711.80000		7/24/2017		1,197,711.80	133,095,726	1.000000000 ^S 0.009085953	1,197,711.80	131,820,162	0	-1,275,564	-1,275,564
2,374,359.00000		7/24/2017		2,374,359.00	263,850,648	1.000000000 ^S 0.009085953	2,374,359.00	261,321,955	0	-2,528,693	-2,528,693
560,000.00000		7/25/2017		560,000.00	62,216,001	1.000000000 ^S 0.009085953	560,000.00	61,633,601	0	-582,400	-582,400
235,000.00000		7/28/2017		235,000.00	26,228,349	1.000000000 ^S 0.009085953	235,000.00	25,864,100	0	-364,249	-364,249
6,198.22000		7/31/2017		6,198.22	684,872	1.000000000 ^S 0.009085953	6,198.22	682,176	0	-2,696	-2,696
600,000.00000		7/31/2017		600,000.00	66,572,998	1.000000000 ^S 0.009085953	600,000.00	66,036,001	0	-536,997	-536,997

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
380,000.00000		8/2/2017		380,000.00	41,858,901	1.000000000 ^S 0.009085953	380,000.00	41,822,801	0	-36,100	-36,100
1,059,688.46000		8/3/2017		1,059,688.46	116,979,003	1.000000000 ^S 0.009085953	1,059,688.46	116,629,313	0	-349,690	-349,690
350,000.00000		8/7/2017		350,000.00	38,809,751	1.000000000 ^S 0.009085953	350,000.00	38,521,000	0	-288,751	-288,751
26,843.54000		8/8/2017		26,843.54	2,974,935	1.000000000 ^S 0.009085953	26,843.54	2,954,400	0	-20,535	-20,535
35,704.86000		8/8/2017		35,704.86	3,956,991	1.000000000 ^S 0.009085953	35,704.86	3,929,677	0	-27,314	-27,314
2,364,163.40000		8/8/2017		2,364,163.40	262,008,404	1.000000000 ^S 0.009085953	2,364,163.40	260,199,827	0	-1,808,577	-1,808,577
2,373,431.20000		8/8/2017		2,373,431.20	263,035,508	1.000000000 ^S 0.009085953	2,373,431.20	261,219,841	0	-1,815,667	-1,815,667
7,336.29000		8/14/2017		7,336.29	800,719	1.000000000 ^S 0.009085953	7,336.29	807,432	0	6,713	6,713
15,288.56000		8/14/2017		15,288.56	1,668,670	1.000000000 ^S 0.009085953	15,288.56	1,682,659	0	13,989	13,989
19,018.53000		8/14/2017		19,018.53	2,075,777	1.000000000 ^S 0.009085953	19,018.53	2,093,179	0	17,402	17,402
130,116.44000		8/14/2017		130,116.44	14,201,559	1.000000000 ^S 0.009085953	130,116.44	14,320,616	0	119,057	119,057
1,040,930.55000		8/14/2017		1,040,930.55	113,612,362	1.000000000 ^S 0.009085953	1,040,930.55	114,564,818	0	952,456	952,456
1,076,561.01000		8/14/2017		1,076,561.01	117,501,249	1.000000000 ^S 0.009085953	1,076,561.01	118,486,306	0	985,057	985,057
1,106,077.92000		8/14/2017		1,106,077.92	120,722,872	1.000000000 ^S 0.009085953	1,106,077.92	121,734,937	0	1,012,065	1,012,065
69,086.11000		8/17/2017		69,086.11	7,654,741	1.000000000 ^S 0.009085953	69,086.11	7,603,617	0	-51,124	-51,124

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
263,990.67000		8/17/2017		263,990.67	29,250,166	1.000000000 ^S 0.009085953	263,990.67	29,054,814	0	-195,352	-195,352
3,955,648.00000		8/17/2017		3,955,648.00	438,285,787	1.000000000 ^S 0.009085953	3,955,648.00	435,358,624	0	-2,927,163	-2,927,163
290,000.00000		8/18/2017		290,000.00	31,878,249	1.000000000 ^S 0.009085953	290,000.00	31,917,400	0	39,151	39,151
380,000.00000		8/18/2017		380,000.00	41,771,498	1.000000000 ^S 0.009085953	380,000.00	41,822,801	0	51,303	51,303
127,925.00000		8/19/2017		127,925.00	13,918,880	1.000000000 ^S 0.009085953	127,925.00	14,079,426	0	160,546	160,546
470,000.00000		8/22/2017		470,000.00	51,114,847	1.000000000 ^S 0.009085953	470,000.00	51,728,201	0	613,354	613,354
223,355.00000		8/24/2017		223,355.00	24,354,630	1.000000000 ^S 0.009085953	223,355.00	24,582,452	0	227,822	227,822
260,000.00000		8/24/2017		260,000.00	28,350,401	1.000000000 ^S 0.009085953	260,000.00	28,615,600	0	265,199	265,199
43,203.13000		8/25/2017		43,203.13	4,724,910	1.000000000 ^S 0.009085953	43,203.13	4,754,937	0	30,027	30,027
45,200.00000		8/25/2017		45,200.00	4,943,298	1.000000000 ^S 0.009085953	45,200.00	4,974,712	0	31,414	31,414
56,992.50000		8/25/2017		56,992.50	6,232,985	1.000000000 ^S 0.009085953	56,992.50	6,272,595	0	39,610	39,610
420,000.00000		8/25/2017		420,000.00	45,933,301	1.000000000 ^S 0.009085953	420,000.00	46,225,201	0	291,900	291,900
697,283.79000		8/25/2017		697,283.79	76,258,443	1.000000000 ^S 0.009085953	697,283.79	76,743,055	0	484,612	484,612
726,636.98000		8/25/2017		726,636.98	79,468,655	1.000000000 ^S 0.009085953	726,636.98	79,973,667	0	505,012	505,012
2,328,500.60000		8/25/2017		2,328,500.60	254,656,472	1.000000000 ^S 0.009085953	2,328,500.60	256,274,779	0	1,618,307	1,618,307

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
2,335,792.50000		8/25/2017		2,335,792.50	255,453,951	1.000000000 ^S 0.009085953	2,335,792.50	257,077,326	0	1,623,375	1,623,375
3,097,382.20000		8/25/2017		3,097,382.20	338,745,209	1.000000000 ^S 0.009085953	3,097,382.20	340,897,889	0	2,152,680	2,152,680
462,651.83000		8/30/2017		462,651.83	50,313,388	1.000000000 ^S 0.009085953	462,651.83	50,919,461	0	606,073	606,073
778,663.92000		8/30/2017		778,663.92	84,679,704	1.000000000 ^S 0.009085953	778,663.92	85,699,752	0	1,020,048	1,020,048
1,054,815.40000		8/30/2017		1,054,815.40	114,711,178	1.000000000 ^S 0.009085953	1,054,815.40	116,092,984	0	1,381,806	1,381,806
3,017,585.16000		8/30/2017		3,017,585.16	328,162,397	1.000000000 ^S 0.009085953	3,017,585.16	332,115,427	0	3,953,030	3,953,030
-109,987,198.79000		8/30/2017		-109,987,198.79	-11,961,108,257	1.000000000 ^S 0.009085953	-109,987,198.79	-12,105,191,254	0	-144,082,997	-144,082,997
-45,689,220.88000		8/30/2017		-45,689,220.88	-4,968,702,932	1.000000000 ^S 0.009085953	-45,689,220.88	-5,028,555,715	0	-59,852,783	-59,852,783
-20,495,723.01000		8/30/2017		-20,495,723.01	-2,228,909,950	1.000000000 ^S 0.009085953	-20,495,723.01	-2,255,759,303	0	-26,849,353	-26,849,353
-9,878,496.27000		8/30/2017		-9,878,496.27	-1,074,286,504	1.000000000 ^S 0.009085953	-9,878,496.27	-1,087,227,313	0	-12,940,809	-12,940,809
-5,538,402.23000		8/30/2017		-5,538,402.23	-602,301,262	1.000000000 ^S 0.009085953	-5,538,402.23	-609,556,557	0	-7,255,295	-7,255,295
-2,582,000.00000		8/30/2017		-2,582,000.00	-280,792,509	1.000000000 ^S 0.009085953	-2,582,000.00	-284,174,924	0	-3,382,415	-3,382,415
-2,535,000.00000		8/30/2017		-2,535,000.00	-275,681,259	1.000000000 ^S 0.009085953	-2,535,000.00	-279,002,104	0	-3,320,845	-3,320,845
-2,003,967.00000		8/30/2017		-2,003,967.00	-217,931,418	1.000000000 ^S 0.009085953	-2,003,967.00	-220,556,611	0	-2,625,193	-2,625,193
-1,093,096.00000		8/30/2017		-1,093,096.00	-118,874,194	1.000000000 ^S 0.009085953	-1,093,096.00	-120,306,147	0	-1,431,953	-1,431,953

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-823,076.18000		8/30/2017		-823,076.18	-89,509,537	1.000000000 ^S 0.009085953	-823,076.18	-90,587,766	0	-1,078,229	-1,078,229
-793,491.50000		8/30/2017		-793,491.50	-86,292,203	1.000000000 ^S 0.009085953	-793,491.50	-87,331,676	0	-1,039,473	-1,039,473
-744,825.60000		8/30/2017		-744,825.60	-80,999,787	1.000000000 ^S 0.009085953	-744,825.60	-81,975,507	0	-975,720	-975,720
-694,225.10000		8/30/2017		-694,225.10	-75,496,982	1.000000000 ^S 0.009085953	-694,225.10	-76,406,415	0	-909,433	-909,433
-592,307.74000		8/30/2017		-592,307.74	-64,413,469	1.000000000 ^S 0.009085953	-592,307.74	-65,189,391	0	-775,922	-775,922
-372,271.25000		8/30/2017		-372,271.25	-40,484,500	1.000000000 ^S 0.009085953	-372,271.25	-40,972,174	0	-487,674	-487,674
-70,183.74000		8/30/2017		-70,183.74	-7,632,482	1.000000000 ^S 0.009085953	-70,183.74	-7,724,423	0	-91,941	-91,941
-628,885.42000		8/31/2017		-628,885.42	-69,315,748	1.000000000 ^S 0.009085953	-628,885.42	-69,215,130	0	100,618	100,618
7,771,375.09000 0.00000	合計 -----			7,771,375	1,520,669,105		7,771,375	855,317,549	0	-665,351,556	-665,351,556
9,283,904.72000	非グループ化の有価証券小計			9,283,905	1,555,248,047		9,283,905	1,018,380,100	0	-536,867,947	-536,867,947
9,283,904.72000	外貨建現金勘定合計			9,283,905	1,555,248,047		9,283,905	1,018,380,100	0	-536,867,947	-536,867,947
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
845,000.00000	AUD FORWARD 25 OCT FAU25OCT	8/18/2017		845,000.00	73,552,288	1.000000000 ^F 87.006137935	845,000.00	73,520,187	0	-32,101	-32,101
1,390,000.00000		8/18/2017		1,390,000.00	120,991,337	1.000000000 ^F 87.006137935	1,390,000.00	120,938,532	0	-52,805	-52,805
-1,778,714.81000	FAU25OCT	8/16/2017		-1,778,714.81	-154,866,737	1.000000000 ^F 87.006137935	-1,778,714.81	-154,759,106	0	107,631	107,631

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-1,390,000.00000		8/16/2017		-1,390,000.00	-121,026,490	1.000000000F 87.006137935	-1,390,000.00	-120,938,532	0	87,958	87,958
-933,714.81000 0.00000	合計 -----			-933,715	-81,349,602		-933,715	-81,238,919	0	110,683	110,683
593,000.00000	EUR FORWARD 25 OCT FEU25OCT	8/22/2017		593,000.00	76,352,642	1.000000000F 130.900897941	593,000.00	77,624,232	0	1,271,590	1,271,590
618,000.00000		8/22/2017		618,000.00	79,571,556	1.000000000F 130.900897941	618,000.00	80,896,755	0	1,325,199	1,325,199
1,210,079.75000		8/22/2017		1,210,079.75	155,696,001	1.000000000F 130.900897941	1,210,079.75	158,400,526	0	2,704,525	2,704,525
-93,949,943.44000		8/16/2017		-93,949,943.44	-12,223,328,748	1.000000000F 130.900897941	-93,949,943.44	-12,298,131,958	0	-74,803,210	-74,803,210
-8,438,110.76000		8/16/2017		-8,438,110.76	-1,097,875,237	1.000000000F 130.900897941	-8,438,110.76	-1,104,556,275	0	-6,681,038	-6,681,038
-1,258,690.83000		8/16/2017		-1,258,690.83	-163,762,286	1.000000000F 130.900897941	-1,258,690.83	-164,763,760	0	-1,001,474	-1,001,474
-660,504.68000		8/16/2017		-660,504.68	-85,829,136	1.000000000F 130.900897941	-660,504.68	-86,460,656	0	-631,520	-631,520
-593,000.00000		8/16/2017		-593,000.00	-77,152,282	1.000000000F 130.900897941	-593,000.00	-77,624,232	0	-471,950	-471,950
-102,479,169.96000 0.00000	合計 -----			-102,479,170	-13,336,327,490		-102,479,170	-13,414,615,368	0	-78,287,878	-78,287,878
601,818.84	GBP FORWARD 25 OCT FGB25OCT	8/16/2017		601,818.84	85,829,136	1.000000000F 141.714478770	601,818.84	85,286,443	0	-542,693	-542,693
713,256.22		8/16/2017		713,256.22	101,721,916	1.000000000F 141.714478770	713,256.22	101,078,733	0	-643,183	-643,183
-41,143,130.95		8/16/2017		-41,143,130.95	-5,875,359,681	1.000000000F 141.714478770	-41,143,130.95	-5,830,577,358	0	44,782,323	44,782,323
-15,932,620.50		8/16/2017		-15,932,620.50	-2,275,242,545	1.000000000F 141.714478770	-15,932,620.50	-2,257,883,010	0	17,359,535	17,359,535

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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											
-4,305,349.99		8/16/2017		-4,305,349.99	-614,823,752	1.000000000F 141.714478770	-4,305,349.99	-610,130,430	0	4,693,322	4,693,322
-579,000.00		8/16/2017		-579,000.00	-82,683,539	1.000000000F 141.714478770	-579,000.00	-82,052,683	0	630,856	630,856
-60,645,026.38000 0.00000	合計 -----			-60,645,026	-8,660,558,465		-60,645,026	-8,594,278,305	0	66,280,160	66,280,160
372,271.25000	USD FORWARD 25 OCT	8/16/2017		372,271.25	41,097,703	1.000000000F 0.009109753	372,271.25	40,865,131	0	-232,572	-232,572
696,320.17000	FUS25OCT	8/16/2017		696,320.17	77,152,281	1.000000000F 0.009109753	696,320.17	76,436,778	0	-715,503	-715,503
746,241.26000		8/16/2017		746,241.26	82,683,539	1.000000000F 0.009109753	746,241.26	81,916,739	0	-766,800	-766,800
1,092,296.75000		8/16/2017		1,092,296.75	121,026,490	1.000000000F 0.009109753	1,092,296.75	119,904,102	0	-1,122,388	-1,122,388
1,397,714.10000		8/16/2017		1,397,714.10	154,866,735	1.000000000F 0.009109753	1,397,714.10	153,430,516	0	-1,436,219	-1,436,219
1,477,998.83000		8/16/2017		1,477,998.83	163,762,284	1.000000000F 0.009109753	1,477,998.83	162,243,568	0	-1,518,716	-1,518,716
5,548,950.33000		8/16/2017		5,548,950.33	614,823,748	1.000000000F 0.009109753	5,548,950.33	609,121,930	0	-5,701,818	-5,701,818
9,908,620.32000		8/16/2017		9,908,620.32	1,097,875,224	1.000000000F 0.009109753	9,908,620.32	1,087,693,631	0	-10,181,593	-10,181,593
20,534,678.27000		8/16/2017		20,534,678.27	2,275,242,543	1.000000000F 0.009109753	20,534,678.27	2,254,142,156	0	-21,100,387	-21,100,387
53,026,707.18000		8/16/2017		53,026,707.18	5,875,359,649	1.000000000F 0.009109753	53,026,707.18	5,820,872,111	0	-54,487,538	-54,487,538
110,318,842.09000		8/16/2017		110,318,842.09	12,223,328,730	1.000000000F 0.009109753	110,318,842.09	12,109,970,719	0	-113,358,011	-113,358,011
4,971,364.83000		8/17/2017		4,971,364.83	545,918,001	1.000000000F 0.009109753	4,971,364.83	545,718,949	0	-199,052	-199,052

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2017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）
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-919,276.71000		8/16/2017		-919,276.71	-101,721,915	1.000000000F 0.009109753	-919,276.71	-100,911,266	0	810,649	810,649
-1,099,014.62000		8/18/2017		-1,099,014.62	-120,991,338	1.000000000F 0.009109753	-1,099,014.62	-120,641,539	0	349,799	349,799
-668,159.24000		8/18/2017		-668,159.24	-73,552,288	1.000000000F 0.009109753	-668,159.24	-73,345,484	0	206,804	206,804
-729,011.96000		8/22/2017		-729,011.96	-79,571,556	1.000000000F 0.009109753	-729,011.96	-80,025,436	0	-453,880	-453,880
-699,559.73000		8/22/2017		-699,559.73	-76,352,642	1.000000000F 0.009109753	-699,559.73	-76,792,393	0	-439,751	-439,751
205,976,983.12000 0.00000	合計 -----			205,976,983	22,820,947,188		205,976,983	22,610,600,212	0	-210,346,976	-210,346,976
41,919,071.97000	非グループ化の有価証券小計			41,919,072	742,711,631		41,919,072	520,467,620	0	-222,244,011	-222,244,011
41,919,071.97000	先物（ポジション）合計			41,919,072	742,711,631		41,919,072	520,467,620	0	-222,244,011	-222,244,011
<u>証拠金勘定</u>											
<u>証拠金勘定</u>											
-290,000.00	USD MARGIN	8/18/2017		-290,000.00	-31,878,249	1.000000000S 0.009085953	-290,000.00	-31,917,400	0	-39,151	-39,151
-150,000.00	USD MAR	8/18/2017		-150,000.00	-16,488,749	1.000000000S 0.009085953	-150,000.00	-16,509,000	0	-20,251	-20,251
-470,000.00		8/22/2017		-470,000.00	-51,114,847	1.000000000S 0.009085953	-470,000.00	-51,728,201	0	-613,354	-613,354
-420,000.00		8/25/2017		-420,000.00	-45,933,301	1.000000000S 0.009085953	-420,000.00	-46,225,201	0	-291,900	-291,900
-1,330,000.00000 0.00000	合計 -----			-1,330,000	-145,415,146		-1,330,000	-146,379,802	0	-964,656	-964,656
-1,330,000.00000	証拠金勘定小計			-1,330,000	-145,415,146		-1,330,000	-146,379,802	0	-964,656	-964,656
-1,330,000.00000	証拠金勘定合計			-1,330,000	-145,415,146		-1,330,000	-146,379,802	0	-964,656	-964,656
969,752,167.69000	クラスに割当てられていない資産合計			977,921,342	50,210,122,178		999,014,210	52,276,618,605	2,588,195,909	-521,699,480	2,066,496,429
1,905,067,552.56000	ポートフォリオ合計			1,913,236,727	29,714,906,333		1,934,329,595	32,250,386,206	2,588,195,909	-52,716,034	2,535,479,875

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

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

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

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（2017年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約42億円）
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、()ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは()管理会社の行為に関係し、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、2017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	69	6,036,118,728.86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、2017年9月29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＝112.73円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2017年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	3,192,717,396	359,915,032
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,125,318,818	239,587,190
040	その他の要求払預金	1,067,398,578	120,327,842
050	売買目的で保有される金融資産	32,109,263	3,619,677
060	デリバティブ	32,109,263	3,619,677
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0	0
110	持分証券		
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
140	売却可能金融資産	1,419,712	160,044
150	持分証券	1,419,712	160,044
160	債務証券		
170	ローンおよび貸付金		
180	ローンおよび未収金	2,424,196,102	273,279,627
190	債務証券		
200	ローンおよび貸付金	2,424,196,102	273,279,627
210	満期保有目的投資有価証券	0	0
220	債務証券		
230	ローンおよび貸付金		
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	1,082,277	122,005
280	有形固定資産	1,082,277	122,005
290	投資不動産		
300	無形資産	3,093,491	348,729
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,093,491	348,729
330	税金資産	128,929	14,534
340	現行税金資産	128,929	14,534
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	25,112,793	2,830,965
370	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
380	資産合計	5,679,859,963	640,290,614

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2017年6月30日現在

(単位:米ドル)

負債

		米ドル	千円
010	売買目的で保有される金融負債	31,711,080	3,574,790
020	デリバティブ	31,711,080	3,574,790
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0	0
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	5,442,558,401	613,539,609
120	預金	5,442,558,401	613,539,609
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債		
150	デリバティブ・ヘッジ会計		
160	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
170	引当金	27,429	3,092
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金	27,429	3,092
240	税金負債	14,035,257	1,582,195
250	現行税金負債	14,035,257	1,582,195
260	繰延税金負債		
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	14,420,622	1,625,637
290	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
300	負債合計	5,502,752,789	620,325,322

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2017年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

		米ドル	千円
010	資本	37,117,969	4,184,309
020	払込資本	37,117,969	4,184,309
030	未払込請求資本		
040	株式発行差金		
050	資本を除く発行済みエクイティ商品	0	0
060	複合金融商品のエクイティ部分		
070	その他の発行済みエクイティ商品		
080	その他のエクイティ		
090	その他の累積包括利益	0	0
095	損益に再分類されることがない項目	0	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または (-)損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却 グループ		
124	子会社、合弁会社および関連会社への投資の その他の認識収益および費用の持分		
128	損益に再分類されることがある項目	0	0
130	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ 〔有効部分〕		
160	売却可能金融資産		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却 グループ		
180	子会社、合弁会社および関連会社への投資の その他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	4,686	528
200	再評価準備金	1,138,480	128,341
210	その他の準備金	124,372,931	14,020,561
220	子会社、合弁会社および関連会社への投資の準備金または 累積損失		
230	その他	124,372,931	14,020,561
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	14,473,107	1,631,553
260	(-)中間配当		
270	少数株主持分〔非支配持分〕	0	0
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	177,107,173	19,965,292
310	資本および負債合計	5,679,859,963	640,290,614

(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

2017年6月30日に終了した期間

(単位 : 米ドル)

		米ドル	千円
010	利息収益	22,701,007	2,559,085
020	売買目的で保有される金融資産	10,741,314	1,210,868
030	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
040	売却可能金融資産		
050	ローンおよび未収金	10,569,959	1,191,551
060	満期保有目的投資有価証券		
070	デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	1,389,735	156,665
085	負債に係る利息収益		
090	(支払利息)	6,082,742	685,708
100	(売買目的で保有される金融負債)	137,479	15,498
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	2,406,534	271,289
130	(デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	3,538,728	398,921
145	(資産に係る支払利息)		
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	750,101	84,559
170	売買目的で保有される金融資産		
180	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
190	売却可能金融資産	750,101	84,559
200	受取手数料	52,382,237	5,905,050
210	(支払手数料)	26,119,513	2,944,453
220	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負債の認識除外に係る利益または (-) 損失、純額	(47)	(5)
230	売却可能金融資産	(47)	(5)
240	ローンおよび未収金	0	0
250	満期保有目的投資有価証券	0	0
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (-) 損失、純額	2,136,055	240,797
290	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または (-) 損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または (-) 損失、純額		
310	為替差額〔利益または (-) 損失〕、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または (-) 損失、純額		
340	その他の事業収益	777,555	87,654
350	(その他の事業費用)	1,175,641	132,530
355	事業収益合計、純額	45,369,013	5,114,449

米ドル

千円

360	（管理費用）	24,912,497	2,808,386
370	（従業員費用）	10,246,298	1,155,065
380	（その他の管理費用）	14,666,199	1,653,321
390	（減価償却）	1,239,946	139,779
400	（有形固定資産）	178,145	20,082
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	1,061,801	119,697
430	（引当金または（－）引当金の戻入）	0	0
440	（コミットメントおよび保証）		
450	（その他の引当金）		
460	（損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	0	0
470	（取得原価で測定される金融資産）		
480	（売却可能金融資産）		
490	（ローンおよび未収金）		
500	（満期保有目的投資証券）		
510	（子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または（－）減損の戻入）		
520	（非金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	0	0
530	（有形固定資産）		
540	（投資不動産）		
550	（営業権）		
560	（その他の無形資産）		
570	（その他）		
580	損益認識されるマイナスの営業権		
590	子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または（－）損失の持分		
600	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される除却グループからの利益または（－）損失		
610	継続事業からの税引前利益または（－）損失	19,216,570	2,166,284
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	4,743,463	534,731
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	14,473,107	1,631,553
640	非継続事業からの税引後利益または（－）損失	0	0
650	非継続事業からの税引前利益または（－）損失		
660	（非継続事業に関する税金費用または（－）収入）		
670	当期利益または（－）損失	14,473,107	1,631,553
680	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
690	親会社株主に帰属する金額	14,473,107	1,631,553

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

() 資本金の額 (2017年 6 月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約42億円)

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

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

() 資本金の額 (2017年 9 月末日現在)

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル (約42億円)

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、2017年9月29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 = 112.73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

2017年 7 月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(A) 日本

2017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 >

投資有価証券の主要銘柄

（ 2017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	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/ 3 / 15	18,150,000.00	110.91	2,012,951,380.00	115.78	2,101,431,777.00	3.84
2	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	14,300,000.00	139.50	1,994,782,347.00	135.37	1,935,842,152.00	3.54
3	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.950	2027/ 4 / 23	17,000,000.00	110.46	1,877,815,006.00	113.42	1,928,189,806.00	3.53
4	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.375	2025/ 9 / 28	15,430,000.00	114.43	1,765,612,889.00	116.55	1,798,434,484.00	3.29
5	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/ 3 / 17	14,750,000.00	121.42	1,790,917,068.00	116.73	1,721,696,606.00	3.15
6	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	3.950	2025/ 4 / 21	14,300,000.00	115.63	1,653,496,060.00	113.86	1,628,214,203.00	2.98
7	WELLS FARGO CAPITAL X	米国	社債	5.950 (2036年12月以降変動金利)	2036/12/15	12,610,000.00	79.66	1,004,488,714.00	126.57	1,596,007,360.00	2.92
8	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/ 9 / 25	12,470,000.00	111.72	1,393,091,512.00	127.14	1,585,489,811.00	2.90
9	ERSTE GROUP BANK AG	オーストリア	社債	5.500	2025/ 5 / 26	12,800,000.00	104.45	1,336,944,885.00	119.48	1,529,332,907.00	2.80
10	UBS GROUP FUNDING SWITZE	ジャージー	社債	4.125	2025/ 9 / 24	12,900,000.00	106.17	1,369,579,481.00	117.84	1,520,104,463.00	2.78
11	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/ 3 / 9	12,600,000.00	113.37	1,428,400,135.00	117.97	1,486,367,113.00	2.72
12	LLOYDS BANK PLC	英国	社債	7.625	2025/ 4 / 22	7,050,000.00	173.81	1,225,382,729.00	196.66	1,386,455,468.00	2.54
13	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/ 7	10,700,000.00	100.22	1,072,321,384.00	120.70	1,291,507,290.00	2.36
14	RAIFFEISEN BANK INTL	オーストリア	社債	4.500 (2020年 2 月以降変動金利)	2025/ 2 / 21	9,500,000.00	127.31	1,209,423,191.00	135.38	1,286,097,653.00	2.35
15	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	174.58	1,281,403,369.00	2.34
16	MANULIFE FINANCIAL CORP	カナダ	社債	4.061 (2027年 2 月以降変動金利)	2032/ 2 / 24	11,000,000.00	113.65	1,250,150,018.00	113.34	1,246,700,589.00	2.28
17	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年 3 月以降変動金利)	永久債	7,000,000.00	181.91	1,273,355,865.00	160.67	1,124,724,406.00	2.06
18	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年 6 月以降変動金利)	2043/ 6 / 15	9,000,000.00	93.99	845,881,683.00	123.17	1,108,511,259.00	2.03
19	FUKOKU MUTUAL LIFE INSUR	日本	社債	5.000 (2025年 7 月以降変動金利)	永久債	9,400,000.00	124.04	1,166,022,935.00	117.41	1,103,680,662.00	2.02
20	COOPERATIEVE RABOBANK UA	オランダ	社債	5.500 (2020年 6 月以降変動金利)	永久債	7,550,000.00	137.11	1,035,184,943.00	135.91	1,026,124,525.00	1.88

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
21	HISCOX LTD	バー ミュー ダ	社債	6.125 (2025年11月 以降変動金 利)	2045/11/24	6,100,000.00	174.01	1,061,449,735.00	165.04	1,006,727,958.00	1.84
22	DE VOLKSBANK NV	オラン ダ	社債	3.750 (2020年11月 以降変動金 利)	2025/11/5	7,150,000.00	125.52	897,477,872.00	138.22	988,253,458.00	1.81
23	HSBC BNK CAO FND STERLING	ジャ ジー	社債	5.862 (2020年4月 以降変動金 利)	永久債	6,150,000.00	155.92	958,888,054.00	160.48	986,965,934.00	1.80
24	NORDEA BANK AB	ス ウェ デン	社債	5.250 (2021年9月 以降変動金 利)	永久債	8,400,000.00	120.09	1,008,741,521.00	114.31	960,218,261.00	1.76
25	TORONTO- DOMINION BANK	カナダ	社債	3.625 (2026年9月 以降変動金 利)	2031/9/15	8,600,000.00	102.54	881,835,890.00	111.23	956,613,768.00	1.75
26	LB BADEN- WUERTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	6,300,000.00	139.33	877,808,169.00	140.10	882,620,828.00	1.61
27	SOMPO JAPAN NIPPONKOA	日本	社債	5.325 (2023年3月 以降変動金 利)	2073/3/28	6,830,000.00	97.47	665,689,749.00	122.35	835,650,034.00	1.53
28	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月 以降変動金 利)	永久債	6,910,000.00	115.34	796,992,374.00	120.06	829,607,066.00	1.52
29	HSBC HOLDINGS PLC	英国	社債	5.250 (2022年9月 以降変動金 利)	永久債	5,950,000.00	135.37	805,448,653.00	137.40	817,505,086.00	1.49
30	GOLDMAN SACHS GROUP INC	米国	社債	5.500	2021/10/12	4,820,000.00	140.96	679,412,153.00	168.36	811,512,408.00	1.48

投資不動産物件

該当事項なし。(2017年6月末日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2017年6月末日現在)

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

(2017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	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/ 9 / 25	12,470,000	111.72	1,393,091,512	128.42	1,601,450,773	3.11
2	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.375	2025/ 9 / 28	13,170,000	114.43	1,507,007,242	117.36	1,545,575,404	3.01
3	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.950	2027/ 4 / 23	13,490,000	110.46	1,490,101,437	114.48	1,544,285,991	3.00
4	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	119.64	1,531,345,042	2.98
5	UBS GROUP FUNDING JERSEY	ジャージー	社債	4.125	2025/ 9 / 24	12,900,000	106.17	1,369,579,481	118.43	1,527,756,819	2.97
6	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/ 3 / 9	12,600,000	113.37	1,428,400,135	119.62	1,507,261,846	2.93
7	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/ 3 / 17	12,500,000	121.42	1,517,726,329	117.15	1,464,358,074	2.85
8	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/ 3 / 15	12,490,000	110.91	1,385,221,088	116.59	1,456,199,058	2.83
9	RAIFFEISEN BANK INTL	オーストリア	社債	4.500 (2020年 2 月以降変動金利)	2025/ 2 / 21	9,500,000	127.31	1,209,423,191	142.84	1,356,961,046	2.64
10	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	179.60	1,318,237,204	2.56
11	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/ 7	10,700,000	100.22	1,072,321,384	121.93	1,304,643,332	2.54
12	MANULIFE FINANCIAL CORP	カナダ	社債	4.061 (2027年 2 月以降変動金利)	2032/ 2 / 24	11,000,000	113.65	1,250,150,018	113.27	1,245,978,602	2.42
13	LLOYDS BANK PLC	英国	社債	7.625	2025/ 4 / 22	6,050,000	173.81	1,051,569,576	202.07	1,222,514,753	2.38
14	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年 3 月以降変動金利)	永久債	7,000,000	181.91	1,273,355,865	170.37	1,192,592,539	2.32
15	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	3.950	2025/ 4 / 21	9,820,000	115.63	1,135,477,714	115.86	1,137,720,948	2.21
16	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	119.22	1,120,624,204	2.18
17	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	122.84	1,105,579,639	2.15
18	HISCOX LTD	バーミューダ	社債	6.125 (2025年11月以降変動金利)	2045/11/24	6,100,000	174.01	1,061,449,735	173.11	1,055,988,936	2.05
19	DE VOLKSBANK NV	オランダ	社債	3.750 (2020年11月以降変動金利)	2025/11/ 5	7,150,000	125.52	897,477,872	143.93	1,029,084,371	2.00
20	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	8,400,000	120.09	1,008,741,521	115.84	973,023,556	1.89
21	COOPERATIEVE RABOBANK UA	オランダ	社債	5.500 (2020年 6 月以降変動金利)	永久債	6,800,000	137.11	932,352,002	142.66	970,113,037	1.89

	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	
22	TORONTO-DOMINION BANK	カナダ	社債	3.625 (2026年9月以降変動金利)	2031/9/15	8,600,000	102.54	881,835,890	111.56	959,452,962	1.87
23	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	6,700,000	139.50	934,618,303	140.98	944,576,869	1.84
24	LB BADEN-WUERTTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	6,300,000	139.33	877,808,169	146.18	920,956,011	1.79
25	HSBC HOLDINGS PLC	英国	社債	5.250 (2022年9月以降変動金利)	永久債	5,950,000	135.37	805,448,653	143.65	854,723,981	1.66
26	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	6,910,000	115.34	796,992,374	120.37	831,735,145	1.62
27	SOMPO JAPAN NIPPONKOA	日本	社債	5.325 (2023年3月以降変動金利)	2073/3/28	6,830,000	97.47	665,689,749	121.69	831,131,757	1.62
28	GOLDMAN SACHS GROUP INC	米国	社債	5.500	2021/10/12	4,820,000	140.96	679,412,153	172.39	830,924,890	1.62
29	WELLS FARGO CAPITAL X	米国	社債	5.950	2036/12/15	6,410,000	79.66	510,608,458	127.19	815,313,223	1.59
30	CAIXABANK SA	スペイン	社債	2.750 (2023年7月以降変動金利)	2028/7/14	5,400,000	128.29	692,790,840	135.16	729,847,582	1.42

投資不動産物件

該当事項なし。（2017年9月末日現在）

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（2017年9月末日現在）