

【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30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】	デュプティ・マネージング・ディレクター 小林 央明
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L-1150、アールン通り 287-289番 (287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三浦 健 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 同 大西 信治
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03 (6212) 8316
【届出の対象とした募集（売出）】	外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド (Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund)
【届出の対象とした募集（売出）】	外国投資信託受益証券の金額】 米ドル建 米ドルヘッジクラス： 20億アメリカ合衆国ドル（約2,210億8,000万円）を上限とする。 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス： 20億オーストラリアドル（約1,623億2,000万円）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、2018年6月29 日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ド ル＝110.54円および1豪ドル＝81.16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、2018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、さらに、信用リスクの管理に係る投資制限を追加するため、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

（2018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	10,622,329,064	29.49
	英国	5,270,192,354	14.63
	フランス	4,980,224,023	13.83
	オランダ	2,905,714,156	8.07
	カナダ	1,926,543,145	5.35
	日本	1,436,164,415	3.99
	ノルウェー	1,086,785,994	3.02
	スペイン	832,088,875	2.31
	ケイマン諸島	797,507,052	2.21
	アイルランド	762,119,658	2.12
	シンガポール	724,368,601	2.01
	ドイツ	711,544,418	1.98
	スウェーデン	585,373,025	1.63
	バーミューダ	558,845,672	1.55
	ベルギー	362,068,522	1.01
	ジャージー	338,949,018	0.94
	スイス	201,374,848	0.56
	イタリア	154,527,286	0.43
小計		34,256,720,126	95.11
現金・その他の資産 （負債控除後）		1,760,466,123	4.89
合計（純資産総額）		36,017,186,249	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、2018年9月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝113.57円および1豪ドル＝81.83円）による。以下、米ドルおよび豪ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

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

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

（２）運用実績**① 純資産の推移**

2018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
2017年10月末日	106,808,425.62	12,130,233	0.009774	1.1100
11月末日	103,802,133.21	11,788,808	0.009723	1.1042
12月末日	103,105,482.90	11,709,690	0.009717	1.1036
2018年１月末日	101,470,943.00	11,524,055	0.009650	1.0960
２月末日	99,587,865.51	11,310,194	0.009472	1.0757
３月末日	97,623,520.22	11,087,103	0.009379	1.0652
４月末日	94,858,962.75	10,773,132	0.009317	1.0581
５月末日	92,937,185.65	10,554,876	0.009182	1.0428
６月末日	94,733,135.29	10,758,842	0.009109	1.0345
７月末日	95,195,052.10	10,811,302	0.009152	1.0394
８月末日	95,646,305.12	10,862,551	0.009128	1.0367
９月末日	94,804,992.15	10,767,003	0.009053	1.0281

＜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
2017年10月末日	37,111,314.83	3,036,819	0.008959	0.7331
11月末日	36,658,211.02	2,999,741	0.008898	0.7281
12月末日	36,280,421.40	2,968,827	0.008875	0.7262
2018年1月末日	35,307,221.69	2,889,190	0.008786	0.7190
2月末日	34,575,193.93	2,829,288	0.008603	0.7040
3月末日	34,157,907.15	2,795,142	0.008498	0.6954
4月末日	33,250,431.62	2,720,883	0.008415	0.6886
5月末日	32,286,057.01	2,641,968	0.008268	0.6766
6月末日	31,471,424.72	2,575,307	0.008181	0.6695
7月末日	31,553,527.23	2,582,025	0.008197	0.6708
8月末日	31,592,625.10	2,585,225	0.008156	0.6674
9月末日	31,149,261.80	2,548,944	0.008070	0.6604

＜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～2018年9月末日）



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

（注2）ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではない。以下同じ。

② 分配の推移

2018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
2017年10月1日～2018年9月末日	0.000540	0.061328

<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
2017年10月1日～2018年9月末日	0.000720	0.058918

<参考情報>

分配の推移（2018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
第6会計年度（2017年3月1日～2018年2月28日）	0.000540
2018年5月	0.000045
2018年6月	0.000045
2018年7月	0.000045
2018年8月	0.000045
2018年9月	0.000045
直近1年間累計	0.000540
設定来累計	0.003060

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
第6会計年度（2017年3月1日～2018年2月28日）	0.000720
2018年5月	0.000060
2018年6月	0.000060
2018年7月	0.000060
2018年8月	0.000060
2018年9月	0.000060
直近1年間累計	0.000720
設定来累計	0.004720

③ 収益率の推移

2018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）
2017年10月1日～2018年9月末日	－1.38%

（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）
2017年10月1日～2018年9月末日	－1.56%

（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、2018年については2018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。2018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

2018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2018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
2017年10月1日～ 2018年9月末日	1,416,180,761 (1,416,180,761)	2,335,947,297 (2,335,947,297)	10,472,056,364 (10,472,056,364)

＜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
2017年10月1日～ 2018年9月末日	241,342,448 (241,342,448)	576,529,955 (576,529,955)	3,859,897,716 (3,859,897,716)

（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・トラストー

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2018年8月31日現在

	円
資産	
現金	960,105,924
銀行預金－基準通貨	246,452,171
銀行預金－外国通貨	713,653,753
ブローカーが保有する現金	203,548,451
ブローカーが保有する現金－米ドル	203,548,451
有価証券（取得原価）	34,667,165,332
債券（取得原価）	34,667,165,332
未実現評価損益	(505,969,422)
未実現時価評価損益	(317,560,031)
未実現通貨運用損益	(185,871,901)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(1,667,866)
未実現通貨繰延損益	(869,624)
未収収益	516,006,571
現金に係る未収利息	1,274,492
債券に係る未収利息	514,732,079
投資有価証券売却未収金	351,557,332
投資有価証券売却未収金	351,557,332
資本証券	33,524,859
受益証券販売未収金	33,524,859
資産合計：	36,225,939,047

2018年8月31日現在

		円
負債		
資本証券		66,302,130
受益証券買戻未払金		66,302,130
未払費用		65,222,897
未払監査費用		1,791,970
未払報告書作成費用		99,583
未払投資顧問報酬		38,821,206
未払投資顧問報酬－豪ドル	(5,396,805)	
未払受託報酬		630,653
未払管理報酬		7,927,241
未払代行協会員報酬		1,117,164
未払代行協会員報酬－豪ドル	(338,534)	
未払販売報酬		13,249,632
未払販売報酬－豪ドル	(4,015,011)	
未払副管理報酬		1,585,448
負債合計：		131,525,027
資本		
ファンド受益証券		46,803,453,654
発行済ファンド受益証券（額面価額）		71,689,653,485,020
米ドル建 米ドルヘッジ	41,092,502,016,072	
ブラジル・リアル	8,085,712,714	
米ドル	2,258,809,582	
豪ドル	2,749,093,338	
ユーロ	28,192,800	
日本円	13,993,451,995	
資源国通貨バスケット	70,210,710	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,565,511,588,395	
メキシコ・ペソ	708,592,086	
トルコ・リラ	1,888,174,057	
ロシア・ルーブル	1,857,643,271	

2018年8月31日現在

円

受益証券額面超過額	(71,642,850,031,366)
-----------	----------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(41,087,009,068,599)
ブラジル・レアル	4,451,798,286
米ドル	(528,684,582)
豪ドル	(896,045,338)
ユーロ	(320,800)
日本円	3,408,404,005
資源国通貨バスケット	47,640,290
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,210,220,714)
メキシコ・ペソ	4,496,414
トルコ・リラ	(694,725,557)
ロシア・ルーブル	(423,304,771)

分配金支払額	(50,972,752,336)
--------	------------------

配当金支払額	(50,972,752,336)
--------	------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(6,740,073,532)
ブラジル・レアル	(15,580,138,446)
米ドル	(2,439,147,669)
豪ドル	(4,114,600,604)
ユーロ	(16,522,624)
日本円	(17,348,741,555)
資源国通貨バスケット	(285,020,508)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(2,991,058,107)
メキシコ・ペソ	(321,421,833)
トルコ・リラ	(341,428,051)
ロシア・ルーブル	(794,599,407)

2018年8月31日現在

		円
利益剰余金		41,449,529,529
利益剰余金		41,449,529,529
米ドル建 米ドルヘッジ	30,880,876,008	
ブラジル・レアル	22,651,270,118	
米ドル	10,256,480,103	
豪ドル	15,047,440,170	
ユーロ	56,905,486	
日本円	34,266,080,217	
資源国通貨バスケット	636,078,088	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	4,371,315,399	
メキシコ・ペソ	194,997,831	
トルコ・リラ	(34,425,774)	
ロシア・ルーブル	863,715,412	
中間純利益		(1,185,816,827)
資本合計：		36,094,414,020
負債および資本合計		36,225,939,047
純資産額合計		36,094,414,020
発行済受益証券総数		14,355,053,130.05530口
受益証券1口当たり純資産額合計		2.514405

損益計算書

東京海上ストラテジック・トラストー

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2018年3月1日から2018年8月31日までの期間

円

収益

ディスカウント／プレミアム	1
ディスカウントの増加	1

実現損益

(1,543,766,755)

為替取引に係る実現利益	4,764,056,868
ブラジル・レアル	472,753,522
豪ドル	366,671,623
ユーロ	4,243,372
日本円	1,032,786,455
資源国通貨バスケット	9,193,219
豪ドル建 豪ドルヘッジ	371,447,621
メキシコ・ペソ	106,754,135
トルコ・リラ	199,756,701
ロシア・ルーブル	167,914,519

為替取引に係る実現損失	(6,143,712,248)
-------------	-----------------

ブラジル・レアル	(1,081,870,034)
豪ドル	(512,538,849)
ユーロ	(6,486,823)
日本円	(1,675,316,960)
資源国通貨バスケット	(16,057,234)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(522,837,358)
メキシコ・ペソ	(105,767,328)
トルコ・リラ	(358,190,716)
ロシア・ルーブル	(227,322,576)

市場に係る実現利益	225,204,436
-----------	-------------

市場に係る実現損失	(141,773,204)
-----------	---------------

2018年3月1日から2018年8月31日までの期間

円

通貨に係る実現利益 571,236,921

米ドル建 米ドルヘッジ 5,449,467

ブラジル・レアル 1

豪ドル 2

ユーロ 1

日本円 1

資源国通貨バスケット 5

豪ドル建 豪ドルヘッジ 999,836

メキシコ・ペソ 1

トルコ・リラ 2

通貨に係る実現損失 (818,779,528)

米ドル建 米ドルヘッジ (4,430,412)

ブラジル・レアル (4)

豪ドル (1)

ユーロ (3)

日本円 (2)

資源国通貨バスケット (5)

豪ドル建 豪ドルヘッジ (1,596,226)

メキシコ・ペソ (1)

ロシア・ルーブル (1)

受取利息 841,329,061

現金に係る受取利息 9,261,941

債券に係る受取利息 832,067,120

未実現評価損益 (276,877,382)

未実現時価評価損益 (1,149,083,866)

未実現通貨運用損益 855,434,005

ブラジル・レアル (230,034,537)

豪ドル (50,833,366)

ユーロ 133,510

日本円 (104,178,698)

資源国通貨バスケット (3,127,132)

豪ドル建 豪ドルヘッジ (53,457,001)

メキシコ・ペソ 7,982,408

トルコ・リラ (194,067,864)

ロシア・ルーブル (97,350,663)

2018年3月1日から2018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	(1,739,142)
-------------------	-------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(170,776)
-------------	-----------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(53,545)
-------------	----------

未実現通貨繰延損益	18,511,621
-----------	------------

収益合計：	(979,315,075)
-------	---------------

2018年3月1日から2018年8月31日までの期間

円

費用

費用一報酬		195,900,038
監査費用		1,052,728
報告書作成費用		96,528
弁護士費用		33,680
投資顧問報酬		119,749,225
米ドル建 米ドルヘッジ	41,773,887	
ブラジル・リアル	9,722,194	
米ドル	8,752,891	
豪ドル	6,790,796	
ユーロ	86,434	
日本円	35,747,481	
資源国通貨バスケット	162,034	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	10,768,669	
メキシコ・ペソ	1,250,822	
トルコ・リラ	2,179,318	
ロシア・ルーブル	2,514,699	
受託報酬		1,998,082
現金支出費用		344,124
未払管理報酬		24,342,832
代行協会員報酬		3,298,084
米ドル建 米ドルヘッジ	2,605,875	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	692,209	
販売報酬		39,115,372
米ドル建 米ドルヘッジ	30,905,728	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	8,209,644	
副保管報酬		1,000,826
副管理報酬		4,868,557
源泉徴収税費用		7,299,860
源泉徴収税		7,299,860
税金支払額		3,067,278
その他の税金支払額		3,067,278

2018年3月1日から2018年8月31日までの期間

	円
支払利息	234,576
当座借越利息	61,648
支払利息	172,928
費用合計：	206,501,752
投資純利益	(1,185,816,827)

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
31,769,645.99000	AUD FORWARD 12 SEP FAU12SEP	07/10/2018	AUD	31,769,645.99	2,637,880,572	1.000000000F 80.123730269	31,769,645.99	2,545,502,546	0	-92,378,026	-92,378,026
-348,000.00000		08/07/2018		-348,000.00	-28,729,229	1.000000000F 80.123730269	-348,000.00	-27,883,058	0	846,171	846,171
31,421,645.99000	合計 -----			31,421,646	2,609,151,343		31,421,646	2,517,619,488	0	-91,531,855	-91,531,855
0.00000											
258,309.96000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	08/07/2018	AUD	258,309.96	28,729,229	1.000000000F 0.009025940	258,309.96	28,618,621	0	-110,608	-110,608
-23,718,900.00000		07/10/2018		-23,718,900.00	-2,637,880,583	1.000000000F 0.009025940	-23,718,900.00	-2,627,859,259	0	10,021,324	10,021,324
-23,460,590.04000	合計 -----			-23,460,590	-2,609,151,354		-23,460,590	-2,599,240,638	0	9,910,716	9,910,716
0.00000											
7,961,055.95000	非グループ化の有価証券小計			7,961,056	-11		7,961,056	-81,621,150	0	-81,621,139	-81,621,139
7,961,055.95000	先物（ポジション）合計			7,961,056	-11		7,961,056	-81,621,150	0	-81,621,139	-81,621,139
7,961,055.95000	豪ドルクラス受益証券合計			7,961,056	-11		7,961,056	-81,621,150	0	-81,621,139	-81,621,139

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
31,088,951.10000	AUD FORWARD 12 SEP FAU12SEP	07/10/2018		31,088,951.10	2,581,361,471	1.000000000F 80.123730269	31,088,951.10	2,490,962,732	0	-90,398,739	-90,398,739
-979,000.00000		07/26/2018	AUH	-979,000.00	-80,340,032	1.000000000F 80.123730269	-979,000.00	-78,441,132	0	1,898,900	1,898,900
-490,000.00000		08/16/2018	AUH	-490,000.00	-39,469,969	1.000000000F 80.123730269	-490,000.00	-39,260,628	0	209,341	209,341
-528,000.00000		08/28/2018	AUH	-528,000.00	-43,109,725	1.000000000F 80.123730269	-528,000.00	-42,305,330	0	804,395	804,395
29,091,951.10000	合計 -----			29,091,951	2,418,441,745		29,091,951	2,330,955,642	0	-87,486,103	-87,486,103
0.00000											
723,392.89000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	07/26/2018		723,392.89	80,340,031	1.000000000F 0.009025940	723,392.89	80,145,989	0	-194,042	-194,042
356,403.95000		08/16/2018	AUH	356,403.95	39,469,969	1.000000000F 0.009025940	356,403.95	39,486,630	0	16,661	16,661
387,834.48000		08/28/2018	AUH	387,834.48	43,109,724	1.000000000F 0.009025940	387,834.48	42,968,874	0	-140,850	-140,850
-23,210,700.00000		07/10/2018	AUH	-23,210,700.00	-2,581,361,482	1.000000000F 0.009025940	-23,210,700.00	-2,571,554,874	0	9,806,608	9,806,608
-21,743,068.68000	合計 -----			-21,743,069	-2,418,441,758		-21,743,069	-2,408,953,381	0	9,488,377	9,488,377
0.00000											
7,348,882.42000	非グループ化の有価証券小計			7,348,882	-13		7,348,882	-77,997,739	0	-77,997,726	-77,997,726
7,348,882.42000	先物（ポジション）合計			7,348,882	-13		7,348,882	-77,997,739	0	-77,997,726	-77,997,726
7,348,882.42000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			7,348,882	-13		7,348,882	-77,997,739	0	-77,997,726	-77,997,726

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
資源国通貨バスケットクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
231,586.28000	AUD FORWARD 12 SEP FAU12SEP	07/10/2018		231,586.28	19,228,950	1.000000000F 80.123730269	231,586.28	18,555,557	0	-673,393	-673,393
-23,000.00000		07/20/2018	BKH	-23,000.00	-1,905,027	1.000000000F 80.123730269	-23,000.00	-1,842,846	0	62,181	62,181
-17,000.00000		08/29/2018	BKH	-17,000.00	-1,383,926	1.000000000F 80.123730269	-17,000.00	-1,362,103	0	21,823	21,823
191,586.28000 0.00000	合計 -----			191,586	15,939,997		191,586	15,350,608	0	-589,389	-589,389
667,463.16000	BRL FORWARD 12 SEP FBR12SEP	07/10/2018		667,463.16	19,345,662	1.000000000F 0.037236939	667,463.16	17,924,759	0	-1,420,903	-1,420,903
-65,000.00000		07/20/2018	BKH	-65,000.00	-1,914,026	1.000000000F 0.037236939	-65,000.00	-1,745,578	0	168,448	168,448
-53,000.00000		08/29/2018	BKH	-53,000.00	-1,432,484	1.000000000F 0.037236939	-53,000.00	-1,423,318	0	9,166	9,166
549,463.16000 0.00000	合計 -----			549,463	15,999,152		549,463	14,755,863	0	-1,243,289	-1,243,289
16,999.89000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	07/20/2018		16,999.89	1,901,184	1.000000000F 0.009025940	16,999.89	1,883,448	0	-17,736	-17,736
17,034.26000		07/20/2018	BKH	17,034.26	1,905,027	1.000000000F 0.009025940	17,034.26	1,887,256	0	-17,771	-17,771
17,114.72000		07/20/2018	BKH	17,114.72	1,914,026	1.000000000F 0.009025940	17,114.72	1,896,170	0	-17,856	-17,856
12,391.33000		08/29/2018	BKH	12,391.33	1,383,926	1.000000000F 0.009025940	12,391.33	1,372,858	0	-11,068	-11,068
12,808.97000		08/29/2018	BKH	12,808.97	1,430,570	1.000000000F 0.009025940	12,808.97	1,419,129	0	-11,441	-11,441
12,826.10000		08/29/2018	BKH	12,826.10	1,432,484	1.000000000F 0.009025940	12,826.10	1,421,027	0	-11,457	-11,457
-172,900.00000		07/10/2018	BKH	-172,900.00	-19,389,399	1.000000000F 0.009025940	-172,900.00	-19,155,900	0	233,499	233,499

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
資源国通貨バスケットクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
-172,900.00000		07/10/2018		-172,900.00	-19,228,950	1.0000000000 ^F 0.009025940	-172,900.00	-19,155,900	0	73,050	73,050
-172,900.00000		07/10/2018	BKH	-172,900.00	-19,345,662	1.0000000000 ^F 0.009025940	-172,900.00	-19,155,900	0	189,762	189,762
-429,524.73000	合計 -----			-429,525	-47,996,794		-429,525	-47,587,812	0	408,982	408,982
0.00000											
2,328,790.10000	ZAR FORWARD 12 SEP	07/10/2018		2,328,790.10	19,389,399	1.0000000000 ^F 0.132461889	2,328,790.10	17,580,831	0	-1,808,568	-1,808,568
	FZA12SEP		BKH								
-230,000.00000		07/20/2018		-230,000.00	-1,901,184	1.0000000000 ^F 0.132461889	-230,000.00	-1,736,348	0	164,836	164,836
			BKH								
-185,000.00000		08/29/2018		-185,000.00	-1,430,570	1.0000000000 ^F 0.132461889	-185,000.00	-1,396,628	0	33,942	33,942
			BKH								
1,913,790.10000	合計 -----			1,913,790	16,057,645		1,913,790	14,447,855	0	-1,609,790	-1,609,790
0.00000											
2,225,314.81000	非グループ化の有価証券小計			2,225,315	0		2,225,315	-3,033,486	0	-3,033,486	-3,033,486
2,225,314.81000	先物（ポジション）合計			2,225,315	0		2,225,315	-3,033,486	0	-3,033,486	-3,033,486
2,225,314.81000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			2,225,315	0		2,225,315	-3,033,486	0	-3,033,486	-3,033,486

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。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
115,221,358.80000	BRL FORWARD 12 SEP FBRI2SEP	07/10/2018	BRH	115,221,358.80	3,339,560,231	1.000000000F 0.037236939	115,221,358.80	3,094,275,789	0	-245,284,442	-245,284,442
-784,000.00000		08/07/2018	BRH	-784,000.00	-23,419,136	1.000000000F 0.037236939	-784,000.00	-21,054,362	0	2,364,774	2,364,774
-2,099,000.00000		08/16/2018	BRH	-2,099,000.00	-59,741,412	1.000000000F 0.037236939	-2,099,000.00	-56,368,758	0	3,372,654	3,372,654
112,338,358.80000	合計 -----			112,338,359	3,256,399,683		112,338,359	3,016,852,669	0	-239,547,014	-239,547,014
0.00000											
210,565.90000	USD FORWARD 12 SEP FUSI2SEP	08/07/2018	BRH	210,565.90	23,419,136	1.000000000F 0.009025940	210,565.90	23,328,972	0	-90,164	-90,164
539,450.01000		08/16/2018	BRH	539,450.01	59,741,411	1.000000000F 0.009025940	539,450.01	59,766,629	0	25,218	25,218
-29,847,000.00000		07/10/2018	BRH	-29,847,000.00	-3,339,560,235	1.000000000F 0.009025940	-29,847,000.00	-3,306,802,394	0	32,757,841	32,757,841
-29,096,984.09000	合計 -----			-29,096,984	-3,256,399,688		-29,096,984	-3,223,706,793	0	32,692,895	32,692,895
0.00000											
83,241,374.71000	非グループ化の有価証券小計			83,241,375	-5		83,241,375	-206,854,124	0	-206,854,119	-206,854,119
83,241,374.71000	先物（ポジション）合計			83,241,375	-5		83,241,375	-206,854,124	0	-206,854,119	-206,854,119
83,241,374.71000	ブラジル・リアルクラス受益証券合計			83,241,375	-5		83,241,375	-206,854,124	0	-206,854,119	-206,854,119

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
ユーロクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
253,611.80000	EUR FORWARD 12 SEP FEU12SEP	07/10/2018	EUH	253,611.80	33,068,600	1.000000000 ^F 129.021004103	253,611.80	32,721,249	0	-347,351	-347,351
-298,600.00000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	07/10/2018		-298,600.00	-33,068,600	1.000000000 ^F 0.009025940	-298,600.00	-33,082,427	0	-13,827	-13,827
-44,988.20000	非グループ化の有価証券小計			-44,988	0		-44,988	-361,178	0	-361,178	-361,178
-44,988.20000	先物（ポジション）合計			-44,988	0		-44,988	-361,178	0	-361,178	-361,178
-44,988.20000	ユーロクラス受益証券合計			-44,988	0		-44,988	-361,178	0	-361,178	-361,178

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
1,849,990.10000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	07/23/2018		1,849,990.10	205,471,000	1.0000000000 ^F 0.009025940	1,849,990.10	204,963,705	0	-507,295	-507,295
1,080,517.87000		07/31/2018	JPH	1,080,517.87	119,931,001	1.0000000000 ^F 0.009025940	1,080,517.87	119,712,503	0	-218,498	-218,498
1,188,682.48000		08/07/2018	JPH	1,188,682.48	131,939,000	1.0000000000 ^F 0.009025940	1,188,682.48	131,696,253	0	-242,747	-242,747
-117,479,300.00000		07/10/2018	JPH	-117,479,300.00	-13,014,826,821	1.0000000000 ^F 0.009025940	-117,479,300.00	-13,015,741,297	0	-914,476	-914,476
-113,360,109.55000	合計 -----			-113,360,110	-12,557,485,820		-113,360,110	-12,559,368,836	0	-1,883,016	-1,883,016
0.00000											
-113,360,109.55000	非グループ化の有価証券小計			-113,360,110	-12,557,485,820		-113,360,110	-12,559,368,836	0	-1,883,016	-1,883,016
-113,360,109.55000	先物（ポジション）合計			-113,360,110	-12,557,485,820		-113,360,110	-12,559,368,836	0	-1,883,016	-1,883,016
-113,360,109.55000	日本円クラス受益証券合計			-113,360,110	-12,557,485,820		-113,360,110	-12,559,368,836	0	-1,883,016	-1,883,016

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
メキシコ・ペソクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
82,976,698.00	MXN FORWARD 12 SEP FMX12SEP	07/10/2018		82,976,698.00	484,534,452	1.000000000F 0.172913062	82,976,698.00	479,875,245	0	-4,659,207	-4,659,207
-1,513,000.00		07/23/2018	MXH	-1,513,000.00	-8,758,481	1.000000000F 0.172913062	-1,513,000.00	-8,750,062	0	8,419	8,419
-1,651,000.00		08/07/2018	MXH	-1,651,000.00	-9,887,472	1.000000000F 0.172913062	-1,651,000.00	-9,548,151	0	339,321	339,321
79,812,698.00000	合計 -----			79,812,698	465,888,499		79,812,698	461,577,032	0	-4,311,467	-4,311,467
0.00000											
78,621.91000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	07/23/2018		78,621.91	8,758,481	1.000000000F 0.009025940	78,621.91	8,710,662	0	-47,819	-47,819
88,900.14000		08/07/2018	MXH	88,900.14	9,887,472	1.000000000F 0.009025940	88,900.14	9,849,405	0	-38,067	-38,067
-4,314,400.00000		07/10/2018	MXH	-4,314,400.00	-484,534,457	1.000000000F 0.009025940	-4,314,400.00	-478,000,075	0	6,534,382	6,534,382
-4,146,877.95000	合計 -----			-4,146,878	-465,888,504		-4,146,878	-459,440,008	0	6,448,496	6,448,496
0.00000											
75,665,820.05000	非グループ化の有価証券小計			75,665,820	-5		75,665,820	2,137,024	0	2,137,029	2,137,029
75,665,820.05000	先物（ポジション）合計			75,665,820	-5		75,665,820	2,137,024	0	2,137,029	2,137,029
75,665,820.05000	メキシコ・ペソクラス受益証券合計			75,665,820	-5		75,665,820	2,137,024	0	2,137,029	2,137,029

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
ロシア・ルーブルクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
557,514,405.00	RUB FORWARD 12 SEP FRU12SEP	07/10/2018		557,514,405.00	998,144,274	1.000000000F 0.608704511	557,514,405.00	915,903,193	0	-82,241,081	-82,241,081
-7,162,000.00		08/07/2018	RUH	-7,162,000.00	-12,502,864	1.000000000F 0.608704511	-7,162,000.00	-11,765,972	0	736,892	736,892
-12,558,000.00		08/09/2018	RUH	-12,558,000.00	-20,933,782	1.000000000F 0.608704511	-12,558,000.00	-20,630,700	0	303,082	303,082
537,794,405.00000	合計 -----		RUH	537,794,405	964,707,628		537,794,405	883,506,521	0	-81,201,107	-81,201,107
0.00000											
112,415.63000	USD FORWARD 12 SEP FUS12SEP	08/07/2018		112,415.63	12,502,864	1.000000000F 0.009025940	112,415.63	12,454,728	0	-48,136	-48,136
188,737.09000		08/09/2018	RUH	188,737.09	20,933,782	1.000000000F 0.009025940	188,737.09	20,910,519	0	-23,263	-23,263
-8,913,100.00000		07/10/2018	RUH	-8,913,100.00	-998,144,277	1.000000000F 0.009025940	-8,913,100.00	-987,498,255	0	10,646,022	10,646,022
-8,611,947.28000	合計 -----		RUH	-8,611,947	-964,707,631		-8,611,947	-954,133,008	0	10,574,623	10,574,623
0.00000											
529,182,457.72000	非グループ化の有価証券小計			529,182,458	-3		529,182,458	-70,626,487	0	-70,626,484	-70,626,484
529,182,457.72000	先物（ポジション）合計			529,182,458	-3		529,182,458	-70,626,487	0	-70,626,484	-70,626,484
529,182,457.72000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			529,182,458	-3		529,182,458	-70,626,487	0	-70,626,484	-70,626,484

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
31,096,010.76	TRY FORWARD 12 SEP FTRI2SEP	07/10/2018		31,096,010.76	735,070,650	1.000000000F 0.060210198	31,096,010.76	516,457,540	0	-218,613,110	-218,613,110
-841,000.00		08/07/2018	TRH	-841,000.00	-17,513,483	1.000000000F 0.060210198	-841,000.00	-13,967,734	0	3,545,749	3,545,749
-1,403,000.00		08/28/2018	TRH	-1,403,000.00	-24,776,843	1.000000000F 0.060210198	-1,403,000.00	-23,301,700	0	1,475,143	1,475,143
28,852,010.760000	合計 -----			28,852,011	692,780,324		28,852,011	479,188,106	0	-213,592,218	-213,592,218
157,467.05000	USD FORWARD 12 SEP FUSI2SEP	08/07/2018		157,467.05	17,513,483	1.000000000F 0.009025940	157,467.05	17,446,055	0	-67,428	-67,428
222,903.63000		08/28/2018	TRH	222,903.63	24,776,843	1.000000000F 0.009025940	222,903.63	24,695,891	0	-80,952	-80,952
-6,434,900.00000		07/10/2018	TRH	-6,434,900.00	-735,070,652	1.000000000F 0.009025940	-6,434,900.00	-712,934,055	0	22,136,597	22,136,597
-6,054,529.32000	合計 -----			-6,054,529	-692,780,326		-6,054,529	-670,792,109	0	21,988,217	21,988,217
22,797,481.44000	非グループ化の有価証券小計			22,797,481	-2		22,797,481	-191,604,003	0	-191,604,001	-191,604,001
22,797,481.44000	先物（ポジション）合計			22,797,481	-2		22,797,481	-191,604,003	0	-191,604,001	-191,604,001
22,797,481.44000	トルコ・リラクラス受益証券合計			22,797,481	-2		22,797,481	-191,604,003	0	-191,604,001	-191,604,001

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
246,452,171.00000	JPY CASH	08/31/2018		246,452,171	246,452,171	1.000000000	246,452,171	246,452,171	0	0	0
	CASHJPY					1.000000000					
246,452,171.00000	基準通貨現金小計			246,452,171	246,452,171		246,452,171	246,452,171	0	0	0
246,452,171.00000	現金合計			246,452,171	246,452,171		246,452,171	246,452,171	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
3,800,000.00000	ABN AMRO BANK NV FRN 03272028 BNLD12GQ XS1586330604	08/14/2018		3,761,180.00	416,569,479	98.922996521 ^C 0.009018352	3,759,073.87	416,824,922	-233,538	488,981	255,443
7,000,000.00	AXA SA FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561	05/24/2013		7,542,089.20	1,273,355,865	107.899002075 ^C 144.122778740	7,552,930.15	1,088,549,280	1,562,427	-186,369,012	-184,806,585
6,350,000.00000	BANK OF MONTREAL FRN 12152032 BCAN10EN US06368BGS16	12/07/2017		6,350,000.00	715,867,225	94.337997437 ^C 0.009018352	5,990,462.84	664,252,497	-39,867,280	-11,747,448	-51,614,728
1,100,000.00000	CAIXABANK FRN 07142028 BESPO26G XS1645495349	07/05/2017		1,099,703.00	141,124,060	101.646003723 ^C 129.014697500	1,118,106.04	144,252,113	2,374,263	753,790	3,128,053
2,000,000.00000	CRDT AGR ASSR FRN 01292048 BFRA10L9 FR0013312154	01/22/2018		2,007,829.00	272,543,704	92.005996704 ^C 129.014697500	1,840,119.93	237,402,517	-21,636,934	-13,504,253	-35,141,187
4,250,000.00	CYBG PLC FRN 06222025 BGBR22JQ XS1637124741	06/19/2017		4,268,395.50	605,890,009	98.403999329 ^C 144.122778740	4,182,169.97	602,745,957	-12,427,063	9,283,011	-3,144,052
6,910,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		7,095,133.09	796,992,374	102.124000549 ^C 0.009018352	7,056,768.44	782,489,798	-4,254,065	-10,248,511	-14,502,576
5,500,000.00000	DBS GROUP HLDGS FRN 04112028 BSGP00AP XS1802465846	04/04/2018		5,484,490.00	718,652,173	99.887001038 ^C 129.014697500	5,493,785.06	708,779,017	1,199,199	-11,072,355	-9,873,156

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
5,000,000.00000	DNB BANK ASA FRN PERP/CALL BNOR023W XS1207306652	09/21/2017		5,175,000.00	581,799,360	100.411003113 ^C 0.009018352	5,020,550.16	556,703,725	-17,126,172	-7,969,463	-25,095,635
3,900,000.00000	DNB BANK ASA FRN 03012027 BNOR0242 XS1571331955	02/20/2017		3,893,799.00	467,819,516	100.255996704 ^C 129.014697500	3,909,983.87	504,445,386	2,088,086	34,537,784	36,625,870
4,000,000.00000	ELM BV FOR HELVE FRN 09292047 BNLD12E4 XS1587893451	03/30/2017		3,969,760.00	474,287,805	102.028999329 ^C 129.014697500	4,081,159.97	526,529,619	14,372,234	37,869,581	52,241,815
4,300,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN3042 XS1262602532	07/22/2015		4,300,000.00	533,393,470	99.997001648 ^C 0.009018352	4,299,871.07	476,791,222	-14,296	-56,587,952	-56,602,248
3,520,000.00	HISCOX LTD FRN 11242045 BBMU003B XS1323450236	11/17/2015		3,500,668.85	612,508,699	109.535003662 ^C 144.122778740	3,855,632.13	555,684,416	51,158,294	-107,982,577	-56,824,283
1,850,000.00000	ING GROEP NV FRN PERP/CALL BNLD12D6 XS1497755360	01/26/2018		2,030,375.00	220,468,273	101.958000183 ^C 0.009018352	1,886,223.00	209,153,846	-15,984,295	4,669,868	-11,314,427
5,100,000.00000	JPMORGAN CHASE FRN 07232029 BUSA9CGJ US46647PAV85	07/16/2018		5,100,000.00	573,188,984	100.584999084 ^C 0.009018352	5,129,834.95	568,821,771	3,308,249	-7,675,462	-4,367,213
2,800,000.00000	KBC GROUP NV FRN 09182029 BBEL017K BE0002290592	09/11/2017		2,792,664.00	364,426,803	97.918998718 ^C 129.014697500	2,741,731.96	353,723,720	-6,570,981	-4,132,102	-10,703,083
4,310,000.00000	MANULIFE FIN COR FRN 02242032 BCAN10DG US56501RAE62	02/21/2017		4,310,000.00	489,831,507	95.558998108 ^C 0.009018352	4,118,592.82	456,690,182	-21,224,186	-11,917,139	-33,141,325
2,000,000.00000	MAPFRE FRN 03312047 BESP0267 ES0224244089	03/22/2017		2,000,000.00	239,987,727	104.594001770 ^C 129.014697500	2,091,880.04	269,883,270	11,853,875	18,041,668	29,895,543

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
1,670,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		1,663,536.63	239,555,347	105.552001953 ^C 129.014697500	1,762,718.43	227,416,585	12,795,910	-24,934,672	-12,138,762
2,000,000.00	PHOENIX GROUP FRN PERP/CALL BCYM05B9 XS1802140894	04/19/2018		2,000,000.00	305,382,036	90.945999146 ^C 144.122778740	1,818,919.98	262,147,802	-26,097,755	-17,136,479	-43,234,234
4,000,000.00000	PRINCIPAL FINL FRN 05152055 BUSA9BM4 US74251VAL62	06/13/2017		4,140,000.00	455,193,010	100.500000000 ^C 0.009018352	4,020,000.00	445,757,717	-13,306,201	3,870,908	-9,435,293
5,000,000.00000	RABOBANK FRN PERP/CALL BNLD128M XS1171914515	04/08/2015		5,295,250.00	685,552,943	106.695999146 ^C 129.014697500	5,334,799.96	688,267,603	5,102,526	-2,387,866	2,714,660
5,500,000.00000	ROYAL BK SCOTLND FRN 05182029 BGBR22MB US780097BG51	05/15/2018		5,500,000.00	606,759,968	100.450996399 ^C 0.009018352	5,524,804.80	612,618,004	2,750,481	3,107,555	5,858,036
3,400,000.00000	SKANDINAV ENSKIL FRN PERP/CALL BSWE0370 XS1584880352	03/17/2017		3,400,850.00	384,347,061	96.928001404 ^C 0.009018352	3,295,552.05	365,427,303	-11,675,964	-7,243,794	-18,919,758
1,800,000.00000	SWEDBANK AB FRN PERP/CALL BSWE036W XS1535953134	12/09/2016		1,800,000.00	207,333,000	100.892997742 ^C 0.009018352	1,816,073.96	201,375,369	1,782,361	-7,739,992	-5,957,631
7,400,000.00000	TORONTO DOM BANK FRN 09152031 BCAN10D1 US891160MJ94	09/08/2016		7,373,054.75	758,789,022	95.040000916 ^C 0.009018352	7,032,960.07	779,849,807	-37,711,400	58,772,185	21,060,785
2,000,000.00000	UBS GROUP FUNDIN FRN PERP/CALL BCHE0123 CH0400441280	01/24/2018		2,000,000.00	218,359,992	86.511001587 ^C 0.009018352	1,730,220.03	191,855,456	-29,914,553	3,410,017	-26,504,536
1,950,000.00000	VOYA FINANCIAL FRN 05152053 BUSA9C3E US45685EAG17	01/19/2018		2,084,062.50	230,570,254	100.375000000 ^C 0.009018352	1,957,312.50	217,036,605	-14,054,674	521,025	-13,533,649

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
1,950,000.00000	VOYA FINANCIAL FRN 01232048 BUSA9C3G US929089AE08	01/18/2018		1,950,000.00	216,362,245	88.7500000000 ^C 0.009018352	1,730,625.00	191,900,361	-24,325,398	-136,487	-24,461,885
2,500,000.00000	XLIT LTD FRN 06292047 BCYM05AV XS1633784183	06/22/2017		2,476,350.00	307,631,031	99.662002563 ^C 129.014697500	2,491,550.06	321,446,578	1,961,032	11,854,515	13,815,547
112,860,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			114,364,191	14,114,542,942		112,644,413	13,628,822,448	-184,115,818	-301,604,676	-485,720,494
変動利率											
2,000,000.00000	AVIVA PLC FRN 07052043 BGBR2263 XS0951553592	09/11/2013		2,091,333.33	278,625,891	117.776000977 ^C 129.014697500	2,355,520.02	303,896,703	34,083,966	-8,813,154	25,270,812
2,500,000.00000	HARTFORD FINL FRN 02122047 BUSA9C0P US416515BC76	12/04/2017		2,393,750.00	269,823,503	93.3898000000 ^C 0.009018352	2,334,745.00	258,888,209	-6,542,770	-4,392,524	-10,935,294
9,000,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		9,207,099.97	845,881,683	104.636001587 ^C 0.009018352	9,417,240.14	1,044,230,713	23,301,394	175,047,636	198,349,030
1,290,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	03/22/2013		1,302,286.41	125,730,568	103.959999084 ^C 0.009018352	1,341,083.99	148,706,104	4,302,070	18,673,466	22,975,536
4,070,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	05/03/2012		4,368,780.70	688,268,590	113.127998352 ^C 144.122778740	4,604,309.53	663,585,884	33,945,070	-58,627,776	-24,682,706
18,860,000.00000	変動利率小計			19,363,250	2,208,330,235		20,052,899	2,419,307,613	89,089,730	121,887,648	210,977,378
ミディアム・ターム・ノート											
5,800,000.00000	BANK OF IRELAND 1.375 % 08292023 BIRLO2AR XS1872038218	08/22/2018		5,791,995.00	742,053,230	99.522003174 ^C 129.014697500	5,772,276.18	744,708,466	-2,544,017	5,199,253	2,655,236
4,350,000.00000	BANK OF NY MELLO 3 % 10302028 BUSA9AYT US06406GAA94	10/24/2016		4,345,215.00	453,184,215	92.808998108 ^C 0.009018352	4,037,191.42	447,663,988	-34,155,196	28,634,969	-5,520,227

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 2018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											
ミディアム・ターム・ノート											
12,490,000.00000	BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		12,480,758.43	1,385,221,088	98.719001770 ^C 0.009018352	12,330,003.32	1,367,212,471	-16,716,481	-1,292,136	-18,008,617
4,980,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249	06/09/2015		4,961,125.80	693,886,457	108.323997498 ^C 129.014697500	5,394,535.08	695,974,311	55,916,167	-53,828,313	2,087,854
4,050,000.00000	PRUDENTIAL PLC 4.875 % PERP/CALL BGBR22KO XS1700429480	10/17/2017		4,050,000.00	454,956,754	90.922996521 ^C 0.009018352	3,682,381.36	408,320,873	-40,763,395	-5,872,487	-46,635,882
3,000,000.00000	SANTANDER ISSUAN 3.125 % 01192027 BESPO263 XS1548444816	01/04/2017		2,967,900.00	364,610,750	102.000999451 ^C 129.014697500	3,060,029.98	394,788,843	11,886,122	18,291,971	30,178,093
34,670,000.00000	ミディアム・ターム・ノート小計			34,596,994	4,093,912,494		34,276,417	4,058,668,952	-26,376,800	-8,866,743	-35,243,543
私募債											
7,650,000.00000	BNP PARIBAS 4.375 % 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97	10/01/2015		7,422,404.41	875,368,671	98.959999084 ^C 0.009018352	7,570,439.93	839,448,264	16,414,919	-52,335,326	-35,920,407
6,670,000.00000	ING BANK NV 5.8 % 09252023 BNLD122U US449786AY82	09/16/2013		7,167,897.94	745,141,972	106.585998535 ^C 0.009018352	7,109,286.10	788,313,220	-6,499,174	49,670,422	43,171,248
1,500,000.00000	INTESA SANPAOLO 5.017 % 06262024 BITA036V US46115HAT41	01/18/2018		1,545,690.00	171,502,030	90.617996216 ^C 0.009018352	1,359,269.94	150,722,653	-20,671,189	-108,188	-20,779,377
10,700,000.00000	SANTANDER UK PLC 5 % 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		10,700,860.65	1,072,321,384	101.753997803 ^C 0.009018352	10,887,677.76	1,207,280,195	20,715,217	114,243,595	134,958,812
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64	08/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	96.857002258 ^C 0.009018352	5,762,991.63	639,029,352	-16,883,391	61,696,098	44,812,707
32,470,000.00000	私募債小計			32,752,105	3,458,550,702		32,689,665	3,624,793,684	-6,923,618	173,166,601	166,242,983

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
9,820,000.00000	BANK OF AMER CRP 3.95 % 04212025 BUSA99D5 US06051GFP90	04/16/2015		9,696,746.64	1,135,477,714	98.378997803 ^C 0.009018352	9,660,817.58	1,071,239,799	-3,983,993	-60,253,921	-64,237,914
2,600,000.00000	CHUBB INA HLDGS 2.5 % 03152038 BUSA9C6V XS1785813251	03/01/2018		2,599,974.00	339,008,298	102.257003784 ^C 129.014697500	2,658,682.10	343,009,067	7,574,208	-3,573,439	4,000,769
1,030,000.00000	CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71	05/05/2016		1,581,977.00	169,137,062	144.203002930 ^C 0.009018352	1,485,290.93	164,696,491	-10,721,035	6,280,464	-4,440,571
12,600,000.00000	CITIGROUP INC 4.6 % 03092026 BUSA9ACG US172967KJ96	03/01/2016		12,575,052.00	1,428,400,135	101.116996765 ^C 0.009018352	12,740,741.59	1,412,757,186	18,372,491	-34,015,440	-15,642,949
12,500,000.00000	CRED AGRICOLE SA 4.375 % 03172025 BFRA10ER USF2R125AC99	03/10/2015		12,521,276.79	1,517,726,329	98.694999695 ^C 0.009018352	12,336,874.96	1,367,974,433	-20,447,397	-129,304,499	-149,751,896
5,100,000.00000	DIGITAL REALTY 4.45 % 07152028 BUSA9CDX US25389JAT34	06/14/2018		5,092,452.00	561,519,214	101.258003235 ^C 0.009018352	5,164,158.16	572,627,700	7,951,138	3,157,348	11,108,486
6,850,000.00000	GOLDMAN SACHS GP 6.345% 02152034 BUSA2420 US38143VAA70	10/20/2017		8,575,466.00	956,007,199	117.641998291 ^C 0.009018352	8,058,476.88	893,564,244	-57,326,340	-5,116,615	-62,442,955
650,000.00	GOLDMAN SACHS GP 6.875 % 01182038 BUSA96MS XS0340470490	04/25/2013		797,758.00	122,545,655	141.531997681 ^C 144.122778740	919,957.98	132,586,901	17,611,801	-7,570,555	10,041,246
3,200,000.00000	HSBC HOLDINGS 4.375 % 11232026 BGBR22ID US404280BH13	06/14/2018		3,152,128.00	347,569,390	99.586997986 ^C 0.009018352	3,186,783.94	353,366,550	3,842,824	1,954,337	5,797,161
3,000,000.00000	JPMORGAN CHASE 3.625 % 12012027 BUSA9B3I US46625HRX07	11/10/2016		2,994,810.00	318,842,453	95.113998413 ^C 0.009018352	2,853,419.95	316,401,484	-15,678,036	13,237,067	-2,440,969

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
5,400,000.00000	MANUF & TRADERS 3.4 % 08172027 BUSA9BUB US55279HAQ39	08/14/2017		5,398,164.00	590,937,001	97.313003540 ^C 0.009018352	5,254,902.19	582,689,852	-15,885,586	7,638,437	-8,247,149
2,950,000.00000	MERRILL LYNCH 7.75 % 05142038 BUSA8579 US59023VAA89	10/20/2017		4,374,083.00	496,152,228	135.973999023 ^C 0.009018352	4,011,232.97	444,785,585	-40,234,627	-11,132,016	-51,366,643
2,000,000.00000	METLIFE INC 6.4% 12152036 BUSA5773 US59156RAP38	06/13/2017		2,305,000.00	253,434,756	107.052001953 ^C 0.009018352	2,141,040.04	237,409,234	-18,180,701	2,155,179	-16,025,522
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	03/20/2014		1,795,572.00	183,857,592	101.803001404 ^C 0.009018352	1,832,454.03	203,191,672	4,089,664	15,244,417	19,334,081
10,140,000.00000	MORGAN STANLEY 3.95 % 04232027 BUSA99DZ US61761JZN26	04/20/2015		10,495,305.60	1,120,061,421	96.436996460 ^C 0.009018352	9,778,711.44	1,084,312,460	-79,459,546	43,710,585	-35,748,961
3,450,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.1 % 06102023 BGBR22LA US780097AY76	01/12/2018		3,791,377.50	422,037,198	105.005996704 ^C 0.009018352	3,622,706.89	401,703,869	-18,703,042	-1,630,288	-20,333,330
3,000,000.00000	UBS GROUP FUNDIN 4.125 % 09242025 BJEY000Y USG91703AB73	08/04/2016		3,148,644.88	318,506,856	100.468002319 ^C 0.009018352	3,014,040.07	334,211,846	-14,925,655	30,630,645	15,704,990
6,410,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95 % 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		6,479,274.77	510,608,458	107.675003052 ^C 0.009018352	6,901,967.70	765,324,717	46,870,307	207,845,953	254,716,260
92,500,000.00000	公募債小計			97,375,062	10,791,828,959		95,622,259	10,681,853,090	-189,233,525	79,257,659	-109,975,866
291,360,000.00000	社債合計			298,451,602	34,667,165,332		295,285,654	34,413,445,787	-317,560,031	63,840,489	-253,719,542

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
543,671.41000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	01/12/2015		543,671.41	52,910,494	1.000000000\$ 80.192031997	543,671.41	43,598,115	0	-9,312,379	-9,312,379
207,747.74000		01/27/2015		207,747.74	19,495,459	1.000000000\$ 80.192031997	207,747.74	16,659,713	0	-2,835,746	-2,835,746
696,374.06000		01/29/2015		696,374.06	65,271,775	1.000000000\$ 80.192031997	696,374.06	55,843,651	0	-9,428,124	-9,428,124
1,406.23000		01/30/2015		1,406.23	128,636	1.000000000\$ 80.192031997	1,406.23	112,768	0	-15,868	-15,868
206,582.45000		01/30/2015		206,582.45	18,993,836	1.000000000\$ 80.192031997	206,582.45	16,566,266	0	-2,427,570	-2,427,570
54,791.29000		02/02/2015		54,791.29	5,012,081	1.000000000\$ 80.192031997	54,791.29	4,393,825	0	-618,256	-618,256
253,877.80000		02/03/2015		253,877.80	23,278,426	1.000000000\$ 80.192031997	253,877.80	20,358,977	0	-2,919,449	-2,919,449
205,542.23000		02/04/2015		205,542.23	18,576,235	1.000000000\$ 80.192031997	205,542.23	16,482,849	0	-2,093,386	-2,093,386
115,628.17000		02/13/2015		115,628.17	10,612,693	1.000000000\$ 80.192031997	115,628.17	9,272,458	0	-1,340,235	-1,340,235
29,412.99000		02/17/2015		29,412.99	2,709,706	1.000000000\$ 80.192031997	29,412.99	2,358,687	0	-351,019	-351,019
667,933.59000		02/17/2015		667,933.59	61,534,158	1.000000000\$ 80.192031997	667,933.59	53,562,952	0	-7,971,206	-7,971,206
326,807.08000		02/19/2015		326,807.08	30,343,940	1.000000000\$ 80.192031997	326,807.08	26,207,324	0	-4,136,616	-4,136,616
2,192,063.20000		02/24/2015		2,192,063.20	203,418,105	1.000000000\$ 80.192031997	2,192,063.20	175,786,002	0	-27,632,103	-27,632,103
53,434.29000		02/26/2015		53,434.29	5,009,829	1.000000000\$ 80.192031997	53,434.29	4,285,004	0	-724,825	-724,825
2,003.28000		02/27/2015		2,003.28	187,455	1.000000000\$ 80.192031997	2,003.28	160,647	0	-26,808	-26,808

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
61,389.07000		02/27/2015		61,389.07	5,734,296	1.000000000 ^S 80.192031997	61,389.07	4,922,914	0	-811,382	-811,382
8,272.79000		03/04/2015		8,272.79	774,772	1.000000000 ^S 80.192031997	8,272.79	663,412	0	-111,360	-111,360
73,974.98000		03/05/2015		73,974.98	6,922,876	1.000000000 ^S 80.192031997	73,974.98	5,932,204	0	-990,672	-990,672
6,525.72000		03/10/2015		6,525.72	610,308	1.000000000 ^S 80.192031997	6,525.72	523,311	0	-86,997	-86,997
30,000.03000		03/12/2015		30,000.03	2,763,346	1.000000000 ^S 80.192031997	30,000.03	2,405,763	0	-357,583	-357,583
169,508.06000		03/16/2015		169,508.06	15,673,421	1.000000000 ^S 80.192031997	169,508.06	13,593,196	0	-2,080,225	-2,080,225
494,617.75000		03/18/2015		494,617.75	45,673,172	1.000000000 ^S 80.192031997	494,617.75	39,664,402	0	-6,008,770	-6,008,770
493,314.13000		03/19/2015		493,314.13	45,648,649	1.000000000 ^S 80.192031997	493,314.13	39,559,862	0	-6,088,787	-6,088,787
60,525.11000		03/20/2015		60,525.11	5,576,441	1.000000000 ^S 80.192031997	60,525.11	4,853,632	0	-722,809	-722,809
637,230.13000		03/24/2015		637,230.13	59,886,633	1.000000000 ^S 80.192031997	637,230.13	51,100,779	0	-8,785,854	-8,785,854
3,884.02000		03/31/2015		3,884.02	355,841	1.000000000 ^S 80.192031997	3,884.02	311,467	0	-44,374	-44,374
281,169.60000		04/01/2015		281,169.60	25,759,832	1.000000000 ^S 80.192031997	281,169.60	22,547,562	0	-3,212,270	-3,212,270
52,665.13000		04/10/2015		52,665.13	4,878,576	1.000000000 ^S 80.192031997	52,665.13	4,223,324	0	-655,252	-655,252
94,219.67000		04/16/2015		94,219.67	8,562,177	1.000000000 ^S 80.192031997	94,219.67	7,555,667	0	-1,006,510	-1,006,510
185,609.77000		04/16/2015		185,609.77	16,867,218	1.000000000 ^S 80.192031997	185,609.77	14,884,425	0	-1,982,793	-1,982,793

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
979,482.42000		04/16/2015		979,482.42	89,010,097	1.000000000 ^S 80.192031997	979,482.42	78,546,686	0	-10,463,411	-10,463,411
1,084,907.81000		04/16/2015		1,084,907.81	98,590,590	1.000000000 ^S 80.192031997	1,084,907.81	87,000,962	0	-11,589,628	-11,589,628
95,260.21000		04/22/2015		95,260.21	8,815,560	1.000000000 ^S 80.192031997	95,260.21	7,639,110	0	-1,176,450	-1,176,450
1,200,000.00000		04/27/2015		1,200,000.00	111,722,034	1.000000000 ^S 80.192031997	1,200,000.00	96,230,438	0	-15,491,596	-15,491,596
1,624.58000		04/30/2015		1,624.58	153,344	1.000000000 ^S 80.192031997	1,624.58	130,278	0	-23,066	-23,066
97,398.84000		05/07/2015		97,398.84	9,322,518	1.000000000 ^S 80.192031997	97,398.84	7,810,611	0	-1,511,907	-1,511,907
1,200,000.00000		05/12/2015		1,200,000.00	113,914,267	1.000000000 ^S 80.192031997	1,200,000.00	96,230,438	0	-17,683,829	-17,683,829
1,204.66000		05/18/2015		1,204.66	115,742	1.000000000 ^S 80.192031997	1,204.66	96,604	0	-19,138	-19,138
102,958.65000		05/21/2015		102,958.65	9,829,791	1.000000000 ^S 80.192031997	102,958.65	8,256,463	0	-1,573,328	-1,573,328
240,337.15000		05/27/2015		240,337.15	22,898,966	1.000000000 ^S 80.192031997	240,337.15	19,273,124	0	-3,625,842	-3,625,842
1,040.35000		05/29/2015		1,040.35	98,821	1.000000000 ^S 80.192031997	1,040.35	83,428	0	-15,393	-15,393
58,140.06000		06/04/2015		58,140.06	5,632,409	1.000000000 ^S 80.192031997	58,140.06	4,662,370	0	-970,039	-970,039
463,495.15000		06/05/2015		463,495.15	44,299,139	1.000000000 ^S 80.192031997	463,495.15	37,168,618	0	-7,130,521	-7,130,521
86,583.78000		06/09/2015		86,583.78	8,282,560	1.000000000 ^S 80.192031997	86,583.78	6,943,329	0	-1,339,231	-1,339,231
1,000,000.00000		06/11/2015		1,000,000.00	95,109,932	1.000000000 ^S 80.192031997	1,000,000.00	80,192,032	0	-14,917,900	-14,917,900

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
950,000.00000		06/23/2015		950,000.00	90,927,877	1.000000000 ^S 80.192031997	950,000.00	76,182,430	0	-14,745,447	-14,745,447
742.88000		06/30/2015		742.88	69,868	1.000000000 ^S 80.192031997	742.88	59,573	0	-10,295	-10,295
87,175.55000		07/02/2015		87,175.55	8,216,800	1.000000000 ^S 80.192031997	87,175.55	6,990,784	0	-1,226,016	-1,226,016
1,500,000.00000		07/08/2015		1,500,000.00	136,124,157	1.000000000 ^S 80.192031997	1,500,000.00	120,288,048	0	-15,836,109	-15,836,109
5,077.27000		07/09/2015		5,077.27	457,130	1.000000000 ^S 80.192031997	5,077.27	407,157	0	-49,973	-49,973
100,237.08000		07/17/2015		100,237.08	9,227,204	1.000000000 ^S 80.192031997	100,237.08	8,038,215	0	-1,188,989	-1,188,989
945.93000		07/31/2015		945.93	86,063	1.000000000 ^S 80.192031997	945.93	75,856	0	-10,207	-10,207
88,380.65000		07/31/2015		88,380.65	7,994,358	1.000000000 ^S 80.192031997	88,380.65	7,087,424	0	-906,934	-906,934
1,940,000.00000		08/07/2015		1,940,000.00	177,758,540	1.000000000 ^S 80.192031997	1,940,000.00	155,572,542	0	-22,185,998	-22,185,998
7,650,000.00000		08/11/2015		7,650,000.00	704,316,836	1.000000000 ^S 80.192031997	7,650,000.00	613,469,045	0	-90,847,791	-90,847,791
479,833.36000		08/13/2015		479,833.36	43,809,780	1.000000000 ^S 80.192031997	479,833.36	38,478,812	0	-5,330,968	-5,330,968
75,403.65000		08/18/2015		75,403.65	6,920,738	1.000000000 ^S 80.192031997	75,403.65	6,046,772	0	-873,966	-873,966
1,260,000.00000		08/25/2015		1,260,000.00	107,638,641	1.000000000 ^S 80.192031997	1,260,000.00	101,041,960	0	-6,596,681	-6,596,681
20,000.03000		08/28/2015		20,000.03	1,724,493	1.000000000 ^S 80.192031997	20,000.03	1,603,843	0	-120,650	-120,650
1,123.56000		08/31/2015		1,123.56	96,530	1.000000000 ^S 80.192031997	1,123.56	90,101	0	-6,429	-6,429

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,500,000.00000		09/08/2015		1,500,000.00	124,005,422	1.000000000 ^S 80.192031997	1,500,000.00	120,288,048	0	-3,717,374	-3,717,374
1,500,000.00000		09/14/2015		1,500,000.00	127,701,060	1.000000000 ^S 80.192031997	1,500,000.00	120,288,048	0	-7,413,012	-7,413,012
1,200,000.00000		09/17/2015		1,200,000.00	104,033,759	1.000000000 ^S 80.192031997	1,200,000.00	96,230,438	0	-7,803,321	-7,803,321
4,580.00000		09/29/2015		4,580.00	384,148	1.000000000 ^S 80.192031997	4,580.00	367,280	0	-16,868	-16,868
1,050.33000		09/30/2015		1,050.33	88,338	1.000000000 ^S 80.192031997	1,050.33	84,228	0	-4,110	-4,110
41,308.36000		10/02/2015		41,308.36	3,484,596	1.000000000 ^S 80.192031997	41,308.36	3,312,601	0	-171,995	-171,995
1,200,000.00000		10/07/2015		1,200,000.00	102,916,819	1.000000000 ^S 80.192031997	1,200,000.00	96,230,438	0	-6,686,381	-6,686,381
479,833.36000		10/14/2015		479,833.36	41,980,363	1.000000000 ^S 80.192031997	479,833.36	38,478,812	0	-3,501,551	-3,501,551
34,504.30000		10/19/2015		34,504.30	2,988,523	1.000000000 ^S 80.192031997	34,504.30	2,766,970	0	-221,553	-221,553
1,500,000.00000		10/21/2015		1,500,000.00	130,659,384	1.000000000 ^S 80.192031997	1,500,000.00	120,288,048	0	-10,371,336	-10,371,336
146,966.97000		10/23/2015		146,966.97	12,774,602	1.000000000 ^S 80.192031997	146,966.97	11,785,580	0	-989,022	-989,022
33,373.73000		10/28/2015		33,373.73	2,903,788	1.000000000 ^S 80.192031997	33,373.73	2,676,307	0	-227,481	-227,481
1,210.89000		10/30/2015		1,210.89	104,252	1.000000000 ^S 80.192031997	1,210.89	97,104	0	-7,148	-7,148
191,801.71000		11/02/2015		191,801.71	16,513,279	1.000000000 ^S 80.192031997	191,801.71	15,380,969	0	-1,132,310	-1,132,310
1,450.44000		11/09/2015		1,450.44	125,722	1.000000000 ^S 80.192031997	1,450.44	116,314	0	-9,408	-9,408

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,100,000.00000		11/10/2015		1,100,000.00	95,614,298	1.000000000\$ 80.192031997	1,100,000.00	88,211,235	0	-7,403,063	-7,403,063
1,370,000.00000		11/20/2015		1,370,000.00	121,160,088	1.000000000\$ 80.192031997	1,370,000.00	109,863,084	0	-11,297,004	-11,297,004
1,241.63000		11/30/2015		1,241.63	110,913	1.000000000\$ 80.192031997	1,241.63	99,569	0	-11,344	-11,344
55,217.71000		11/30/2015		55,217.71	4,875,314	1.000000000\$ 80.192031997	55,217.71	4,428,020	0	-447,294	-447,294
67,803.25000		12/02/2015		67,803.25	6,086,449	1.000000000\$ 80.192031997	67,803.25	5,437,280	0	-649,169	-649,169
1,200,000.00000		12/08/2015		1,200,000.00	107,613,376	1.000000000\$ 80.192031997	1,200,000.00	96,230,438	0	-11,382,938	-11,382,938
479,833.36000		12/14/2015		479,833.36	41,838,537	1.000000000\$ 80.192031997	479,833.36	38,478,812	0	-3,359,725	-3,359,725
1,300,000.00000		12/14/2015		1,300,000.00	113,352,056	1.000000000\$ 80.192031997	1,300,000.00	104,249,642	0	-9,102,414	-9,102,414
920,000.00000		12/18/2015		920,000.00	80,272,386	1.000000000\$ 80.192031997	920,000.00	73,776,669	0	-6,495,717	-6,495,717
7,027.13000		12/21/2015		7,027.13	613,059	1.000000000\$ 80.192031997	7,027.13	563,520	0	-49,539	-49,539
69,609.63000		12/22/2015		69,609.63	6,058,273	1.000000000\$ 80.192031997	69,609.63	5,582,138	0	-476,135	-476,135
30,652.58000		12/24/2015		30,652.58	2,680,171	1.000000000\$ 80.192031997	30,652.58	2,458,093	0	-222,078	-222,078
31,897.52000		12/29/2015		31,897.52	2,787,126	1.000000000\$ 80.192031997	31,897.52	2,557,927	0	-229,199	-229,199
930.50000		12/31/2015		930.50	81,438	1.000000000\$ 80.192031997	930.50	74,619	0	-6,819	-6,819
64,476.82000		01/06/2016		64,476.82	5,481,018	1.000000000\$ 80.192031997	64,476.82	5,170,527	0	-310,491	-310,491

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
29,058.54000		01/14/2016		29,058.54	2,404,861	1.000000000\$ 80.192031997	29,058.54	2,330,263	0	-74,598	-74,598
306,365.43000		01/20/2016		306,365.43	24,967,386	1.000000000\$ 80.192031997	306,365.43	24,568,066	0	-399,320	-399,320
453,323.95000		01/25/2016		453,323.95	37,747,169	1.000000000\$ 80.192031997	453,323.95	36,352,969	0	-1,394,200	-1,394,200
54,860.74000		01/28/2016		54,860.74	4,588,058	1.000000000\$ 80.192031997	54,860.74	4,399,394	0	-188,664	-188,664
778.74000		01/29/2016		778.74	66,688	1.000000000\$ 80.192031997	778.74	62,449	0	-4,239	-4,239
9,624.24000		02/02/2016		9,624.24	825,300	1.000000000\$ 80.192031997	9,624.24	771,787	0	-53,513	-53,513
45,449.01000		02/03/2016		45,449.01	3,852,337	1.000000000\$ 80.192031997	45,449.01	3,644,648	0	-207,689	-207,689
900,000.00000		02/19/2016		900,000.00	73,080,576	1.000000000\$ 80.192031997	900,000.00	72,172,829	0	-907,747	-907,747
549.31000		02/29/2016		549.31	44,286	1.000000000\$ 80.192031997	549.31	44,050	0	-236	-236
549.31000		02/29/2016		549.31	7	1.000000000\$ 80.192031997	549.31	44,050	0	44,043	44,043
300,000.00000		03/11/2016		300,000.00	25,334,694	1.000000000\$ 80.192031997	300,000.00	24,057,610	0	-1,277,084	-1,277,084
870,000.00000		03/18/2016		870,000.00	73,945,274	1.000000000\$ 80.192031997	870,000.00	69,767,068	0	-4,178,206	-4,178,206
670.89000		03/31/2016		670.89	58,005	1.000000000\$ 80.192031997	670.89	53,800	0	-4,205	-4,205
670.89000		03/31/2016		670.89	8	1.000000000\$ 80.192031997	670.89	53,800	0	53,792	53,792
49,152.02000		04/01/2016		49,152.02	4,249,676	1.000000000\$ 80.192031997	49,152.02	3,941,600	0	-308,076	-308,076

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
0.11000		04/04/2016		0.11	9	1.000000000 ^S 80.192031997	0.11	9	0	0	0
118,557.70000		04/04/2016		118,557.70	10,179,618	1.000000000 ^S 80.192031997	118,557.70	9,507,383	0	-672,235	-672,235
54,704.79000		04/07/2016		54,704.79	4,550,661	1.000000000 ^S 80.192031997	54,704.79	4,386,888	0	-163,773	-163,773
1,000,000.00000		04/13/2016		1,000,000.00	82,840,523	1.000000000 ^S 80.192031997	1,000,000.00	80,192,032	0	-2,648,491	-2,648,491
279,833.36000		04/18/2016		279,833.36	23,441,485	1.000000000 ^S 80.192031997	279,833.36	22,440,406	0	-1,001,079	-1,001,079
2,500,000.00000		04/21/2016		2,500,000.00	213,220,853	1.000000000 ^S 80.192031997	2,500,000.00	200,480,080	0	-12,740,773	-12,740,773
9,845.91000		04/22/2016		9,845.91	837,399	1.000000000 ^S 80.192031997	9,845.91	789,564	0	-47,835	-47,835
71,738.60000		04/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000 ^S 80.192031997	71,738.60	5,752,864	0	-296,164	-296,164
651.99000		04/29/2016		651.99	8	1.000000000 ^S 80.192031997	651.99	52,284	0	52,276	52,276
651.99000		04/29/2016		651.99	53,237	1.000000000 ^S 80.192031997	651.99	52,284	0	-953	-953
3,199.32000		05/06/2016		3,199.32	256,662	1.000000000 ^S 80.192031997	3,199.32	256,560	0	-102	-102
37,851.41000		05/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000 ^S 80.192031997	37,851.41	3,035,381	0	32,615	32,615
52,780.08000		05/13/2016		52,780.08	4,214,171	1.000000000 ^S 80.192031997	52,780.08	4,232,542	0	18,371	18,371
1,000,000.00000		05/18/2016		1,000,000.00	79,969,300	1.000000000 ^S 80.192031997	1,000,000.00	80,192,032	0	222,732	222,732
28,390.46000		05/26/2016		28,390.46	2,250,076	1.000000000 ^S 80.192031997	28,390.46	2,276,689	0	26,613	26,613

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
487.18000		05/31/2016		487.18	39,143	1.000000000 ^S 80.192031997	487.18	39,068	0	-75	-75
77,920.52000		06/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000 ^S 80.192031997	77,920.52	6,248,605	0	131,849	131,849
435,877.61000		06/24/2016		435,877.61	34,923,776	1.000000000 ^S 80.192031997	435,877.61	34,953,911	0	30,135	30,135
193,723.40000		06/27/2016		193,723.40	14,830,685	1.000000000 ^S 80.192031997	193,723.40	15,535,073	0	704,388	704,388
51,500.28000		06/28/2016		51,500.28	3,847,670	1.000000000 ^S 80.192031997	51,500.28	4,129,912	0	282,242	282,242
370.39000		06/30/2016		370.39	28,294	1.000000000 ^S 80.192031997	370.39	29,702	0	1,408	1,408
41,200.23000		06/30/2016		41,200.23	3,144,683	1.000000000 ^S 80.192031997	41,200.23	3,303,930	0	159,247	159,247
28,419.86000		07/06/2016		28,419.86	2,155,687	1.000000000 ^S 80.192031997	28,419.86	2,279,046	0	123,359	123,359
975,728.88000		07/08/2016		975,728.88	73,727,142	1.000000000 ^S 80.192031997	975,728.88	78,245,682	0	4,518,540	4,518,540
10,303.13000		07/19/2016		10,303.13	827,218	1.000000000 ^S 80.192031997	10,303.13	826,229	0	-989	-989
85,548.05000		07/26/2016		85,548.05	6,769,315	1.000000000 ^S 80.192031997	85,548.05	6,860,272	0	90,957	90,957
49,430.39000		07/27/2016		49,430.39	3,887,241	1.000000000 ^S 80.192031997	49,430.39	3,963,923	0	76,682	76,682
966.37000		07/29/2016		966.37	75,274	1.000000000 ^S 80.192031997	966.37	77,495	0	2,221	2,221
279,833.36000		08/18/2016		279,833.36	21,425,498	1.000000000 ^S 80.192031997	279,833.36	22,440,406	0	1,014,908	1,014,908
900,000.00000		08/23/2016		900,000.00	68,935,762	1.000000000 ^S 80.192031997	900,000.00	72,172,829	0	3,237,067	3,237,067

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
312.44000		08/31/2016		312.44	24,288	1.000000000 ^S 80.192031997	312.44	25,055	0	767	767
2,905.89000		08/31/2016		2,905.89	224,400	1.000000000 ^S 80.192031997	2,905.89	233,029	0	8,629	8,629
244,354.19000		09/06/2016		244,354.19	19,161,904	1.000000000 ^S 80.192031997	244,354.19	19,595,259	0	433,355	433,355
1,000,000.00000		09/08/2016		1,000,000.00	78,053,406	1.000000000 ^S 80.192031997	1,000,000.00	80,192,032	0	2,138,626	2,138,626
397,132.94000		09/14/2016		397,132.94	30,405,336	1.000000000 ^S 80.192031997	397,132.94	31,846,897	0	1,441,561	1,441,561
74,453.68000		09/20/2016		74,453.68	5,728,229	1.000000000 ^S 80.192031997	74,453.68	5,970,592	0	242,363	242,363
109,580.94000		09/26/2016		109,580.94	8,438,525	1.000000000 ^S 80.192031997	109,580.94	8,787,518	0	348,993	348,993
57,901.38000		09/27/2016		57,901.38	4,441,152	1.000000000 ^S 80.192031997	57,901.38	4,643,229	0	202,077	202,077
38,744.71000		09/28/2016		38,744.71	2,976,084	1.000000000 ^S 80.192031997	38,744.71	3,107,017	0	130,933	130,933
205,508.38000		09/29/2016		205,508.38	15,834,834	1.000000000 ^S 80.192031997	205,508.38	16,480,135	0	645,301	645,301
556.44000		09/30/2016		556.44	43,120	1.000000000 ^S 80.192031997	556.44	44,622	0	1,502	1,502
96,868.26000		09/30/2016		96,868.26	7,548,319	1.000000000 ^S 80.192031997	96,868.26	7,768,063	0	219,744	219,744
10,705.70000		10/04/2016		10,705.70	833,355	1.000000000 ^S 80.192031997	10,705.70	858,512	0	25,157	25,157
145,292.56000		10/04/2016		145,292.56	11,309,888	1.000000000 ^S 80.192031997	145,292.56	11,651,306	0	341,418	341,418
279,833.36000		10/18/2016		279,833.36	22,177,198	1.000000000 ^S 80.192031997	279,833.36	22,440,406	0	263,208	263,208

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
83,301.08000		10/27/2016		83,301.08	6,668,666	1.000000000 ^S 80.192031997	83,301.08	6,680,083	0	11,417	11,417
833.18000		10/31/2016		833.18	66,625	1.000000000 ^S 80.192031997	833.18	66,814	0	189	189
74,583.53000		10/31/2016		74,583.53	5,960,068	1.000000000 ^S 80.192031997	74,583.53	5,981,005	0	20,937	20,937
142,255.95000		11/02/2016		142,255.95	11,375,416	1.000000000 ^S 80.192031997	142,255.95	11,407,794	0	32,378	32,378
134,756.68000		11/04/2016		134,756.68	10,678,599	1.000000000 ^S 80.192031997	134,756.68	10,806,412	0	127,813	127,813
849.50000		11/30/2016		849.50	71,518	1.000000000 ^S 80.192031997	849.50	68,123	0	-3,395	-3,395
885,465.77000		12/13/2016		885,465.77	76,650,084	1.000000000 ^S 80.192031997	885,465.77	71,007,299	0	-5,642,785	-5,642,785
279,833.36000		12/15/2016		279,833.36	24,213,667	1.000000000 ^S 80.192031997	279,833.36	22,440,406	0	-1,773,261	-1,773,261
829.17000		12/21/2016		829.17	70,900	1.000000000 ^S 80.192031997	829.17	66,493	0	-4,407	-4,407
464.62000		12/30/2016		464.62	39,240	1.000000000 ^S 80.192031997	464.62	37,259	0	-1,981	-1,981
1,226,556.69000		01/05/2017		1,226,556.69	104,711,557	1.000000000 ^S 80.192031997	1,226,556.69	98,360,073	0	-6,351,484	-6,351,484
282,384.02000		01/27/2017		282,384.02	24,408,543	1.000000000 ^S 80.192031997	282,384.02	22,644,948	0	-1,763,595	-1,763,595
1,199,688.72000		01/27/2017		1,199,688.72	103,697,984	1.000000000 ^S 80.192031997	1,199,688.72	96,205,476	0	-7,492,508	-7,492,508
587.10000		01/31/2017		587.10	50,174	1.000000000 ^S 80.192031997	587.10	47,081	0	-3,093	-3,093
277,517.50000		02/15/2017		277,517.50	24,213,142	1.000000000 ^S 80.192031997	277,517.50	22,254,692	0	-1,958,450	-1,958,450

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
786,360.14000		02/15/2017		786,360.14	68,609,185	1.000000000 ^S 80.192031997	786,360.14	63,059,818	0	-5,549,367	-5,549,367
63,860.76000		02/27/2017		63,860.76	5,510,685	1.000000000 ^S 80.192031997	63,860.76	5,121,124	0	-389,561	-389,561
598.25000		02/28/2017		598.25	51,463	1.000000000 ^S 80.192031997	598.25	47,975	0	-3,488	-3,488
702,000.00000		03/10/2017		702,000.00	60,452,566	1.000000000 ^S 80.192031997	702,000.00	56,294,806	0	-4,157,760	-4,157,760
1,412,000.00000		03/16/2017		1,412,000.00	122,935,970	1.000000000 ^S 80.192031997	1,412,000.00	113,231,149	0	-9,704,821	-9,704,821
62,745.10000		03/27/2017		62,745.10	5,307,406	1.000000000 ^S 80.192031997	62,745.10	5,031,657	0	-275,749	-275,749
470.71000		03/31/2017		470.71	40,012	1.000000000 ^S 80.192031997	470.71	37,747	0	-2,265	-2,265
89,505.17000		03/31/2017		89,505.17	7,644,438	1.000000000 ^S 80.192031997	89,505.17	7,177,601	0	-466,837	-466,837
766,000.00000		04/07/2017		766,000.00	64,145,110	1.000000000 ^S 80.192031997	766,000.00	61,427,097	0	-2,718,013	-2,718,013
279,833.36000		04/18/2017		279,833.36	23,068,187	1.000000000 ^S 80.192031997	279,833.36	22,440,406	0	-627,781	-627,781
1,068,505.95000		04/18/2017		1,068,505.95	88,082,762	1.000000000 ^S 80.192031997	1,068,505.95	85,685,663	0	-2,397,099	-2,397,099
1,125,804.00000		04/18/2017		1,125,804.00	92,806,152	1.000000000 ^S 80.192031997	1,125,804.00	90,280,510	0	-2,525,642	-2,525,642
106,547.89000		04/27/2017		106,547.89	8,885,757	1.000000000 ^S 80.192031997	106,547.89	8,544,292	0	-341,465	-341,465
978.41000		04/28/2017		978.41	81,563	1.000000000 ^S 80.192031997	978.41	78,461	0	-3,102	-3,102
5,940,000.00000		04/28/2017		5,940,000.00	492,026,980	1.000000000 ^S 80.192031997	5,940,000.00	476,340,670	0	-15,686,310	-15,686,310

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
1,390,000.00000		05/05/2017		1,390,000.00	115,907,314	1.000000000\$ 80.192031997	1,390,000.00	111,466,924	0	-4,440,390	-4,440,390
1,344,823.25000		05/26/2017		1,344,823.25	112,415,381	1.000000000\$ 80.192031997	1,344,823.25	107,844,109	0	-4,571,272	-4,571,272
895.60000		05/31/2017		895.60	73,730	1.000000000\$ 80.192031997	895.60	71,820	0	-1,910	-1,910
4,843.12000		06/02/2017		4,843.12	397,848	1.000000000\$ 80.192031997	4,843.12	388,380	0	-9,468	-9,468
7,078.68000		06/13/2017		7,078.68	586,390	1.000000000\$ 80.192031997	7,078.68	567,654	0	-18,736	-18,736
275,955.42000		06/14/2017		275,955.42	22,875,822	1.000000000\$ 80.192031997	275,955.42	22,129,426	0	-746,396	-746,396
320,000.00000		06/14/2017		320,000.00	3,860	1.000000000\$ 80.192031997	320,000.00	25,661,450	0	25,657,590	25,657,590
270,000.00000		06/16/2017		270,000.00	22,642,776	1.000000000\$ 80.192031997	270,000.00	21,651,849	0	-990,927	-990,927
701,045.96000		06/28/2017		701,045.96	59,720,715	1.000000000\$ 80.192031997	701,045.96	56,218,300	0	-3,502,415	-3,502,415
1,125,804.00000		06/28/2017		1,125,804.00	95,905,011	1.000000000\$ 80.192031997	1,125,804.00	90,280,510	0	-5,624,501	-5,624,501
1,347,714.81000		06/28/2017		1,347,714.81	114,809,152	1.000000000\$ 80.192031997	1,347,714.81	108,075,989	0	-6,733,163	-6,733,163
1,390,000.00000		06/28/2017		1,390,000.00	118,411,344	1.000000000\$ 80.192031997	1,390,000.00	111,466,924	0	-6,944,420	-6,944,420
754.51000		06/30/2017		754.51	65,028	1.000000000\$ 80.192031997	754.51	60,506	0	-4,522	-4,522
1,264,000.00000		07/18/2017		1,264,000.00	111,466,230	1.000000000\$ 80.192031997	1,264,000.00	101,362,728	0	-10,103,502	-10,103,502
118,871.82000		07/25/2017		118,871.82	10,477,503	1.000000000\$ 80.192031997	118,871.82	9,532,573	0	-944,930	-944,930

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
604.28000		07/31/2017		604.28	53,306	1.000000000 ^S 80.192031997	604.28	48,458	0	-4,848	-4,848
1,203,000.00000		08/17/2017		1,203,000.00	105,081,064	1.000000000 ^S 80.192031997	1,203,000.00	96,471,014	0	-8,610,050	-8,610,050
772,000.00000		08/30/2017		772,000.00	66,991,892	1.000000000 ^S 80.192031997	772,000.00	61,908,249	0	-5,083,643	-5,083,643
607.32000		08/31/2017		607.32	53,015	1.000000000 ^S 80.192031997	607.32	48,702	0	-4,313	-4,313
2,039.21000		09/01/2017		2,039.21	178,011	1.000000000 ^S 80.192031997	2,039.21	163,528	0	-14,483	-14,483
1,760,000.00000		09/18/2017		1,760,000.00	156,419,764	1.000000000 ^S 80.192031997	1,760,000.00	141,137,976	0	-15,281,788	-15,281,788
11,349.96000		09/27/2017		11,349.96	1,003,371	1.000000000 ^S 80.192031997	11,349.96	910,176	0	-93,195	-93,195
823.11000		09/29/2017		823.11	72,700	1.000000000 ^S 80.192031997	823.11	66,007	0	-6,693	-6,693
27,121.31000		10/03/2017		27,121.31	2,392,132	1.000000000 ^S 80.192031997	27,121.31	2,174,913	0	-217,219	-217,219
88,632.36000		10/26/2017		88,632.36	7,758,635	1.000000000 ^S 80.192031997	88,632.36	7,107,609	0	-651,026	-651,026
736.84000		10/31/2017		736.84	64,198	1.000000000 ^S 80.192031997	736.84	59,089	0	-5,109	-5,109
8,233.29000		11/16/2017		8,233.29	705,946	1.000000000 ^S 80.192031997	8,233.29	660,244	0	-45,702	-45,702
484,308.44000		11/21/2017		484,308.44	41,128,430	1.000000000 ^S 80.192031997	484,308.44	38,837,678	0	-2,290,752	-2,290,752
230.45000		11/30/2017		230.45	19,577	1.000000000 ^S 80.192031997	230.45	18,480	0	-1,097	-1,097
1,695,000.00000		12/11/2017		1,695,000.00	144,533,433	1.000000000 ^S 80.192031997	1,695,000.00	135,925,494	0	-8,607,939	-8,607,939

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
27,121.31000		12/28/2017		27,121.31	2,386,064	1.000000000 ^S 80.192031997	27,121.31	2,174,913	0	-211,151	-211,151
523.56000		12/29/2017		523.56	46,130	1.000000000 ^S 80.192031997	523.56	41,985	0	-4,145	-4,145
96,866.03000		12/29/2017		96,866.03	8,518,656	1.000000000 ^S 80.192031997	96,866.03	7,767,884	0	-750,772	-750,772
19,401.29000		01/09/2018		19,401.29	1,717,947	1.000000000 ^S 80.192031997	19,401.29	1,555,829	0	-162,118	-162,118
3,712.80000		01/17/2018		3,712.80	327,014	1.000000000 ^S 80.192031997	3,712.80	297,737	0	-29,277	-29,277
759,513.00000		01/17/2018		759,513.00	66,896,074	1.000000000 ^S 80.192031997	759,513.00	60,906,891	0	-5,989,183	-5,989,183
1,439,655.07000		01/17/2018		1,439,655.07	126,801,347	1.000000000 ^S 80.192031997	1,439,655.07	115,448,865	0	-11,352,482	-11,352,482
1,571,080.15000		01/17/2018		1,571,080.15	138,376,951	1.000000000 ^S 80.192031997	1,571,080.15	125,988,110	0	-12,388,841	-12,388,841
937.46000		01/31/2018		937.46	82,860	1.000000000 ^S 80.192031997	937.46	75,177	0	-7,683	-7,683
767,000.00000		02/09/2018		767,000.00	65,324,597	1.000000000 ^S 80.192031997	767,000.00	61,507,289	0	-3,817,308	-3,817,308
222,233.52000		02/13/2018		222,233.52	18,878,141	1.000000000 ^S 80.192031997	222,233.52	17,821,358	0	-1,056,783	-1,056,783
572.52000		02/28/2018		572.52	47,605	1.000000000 ^S 80.192031997	572.52	45,912	0	-1,693	-1,693
184,792.64000		03/16/2018		184,792.64	15,316,445	1.000000000 ^S 80.192031997	184,792.64	14,818,897	0	-497,548	-497,548
116,717.00000		03/22/2018		116,717.00	9,564,337	1.000000000 ^S 80.192031997	116,717.00	9,359,773	0	-204,564	-204,564
730,655.07000		03/22/2018		730,655.07	59,873,294	1.000000000 ^S 80.192031997	730,655.07	58,592,715	0	-1,280,579	-1,280,579

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
1,359,283.00000		03/22/2018		1,359,283.00	111,386,007	1.000000000 ^S 80.192031997	1,359,283.00	109,003,666	0	-2,382,341	-2,382,341
548.62000		03/29/2018		548.62	44,754	1.000000000 ^S 80.192031997	548.62	43,995	0	-759	-759
575,000.00000		04/18/2018		575,000.00	47,878,949	1.000000000 ^S 80.192031997	575,000.00	46,110,418	0	-1,768,531	-1,768,531
0.04000		04/30/2018		0.04	3	1.000000000 ^S 80.192031997	0.04	3	0	0	0
404.67000		04/30/2018		404.67	33,426	1.000000000 ^S 80.192031997	404.67	32,451	0	-975	-975
57,148.43000		05/08/2018		57,148.43	4,695,613	1.000000000 ^S 80.192031997	57,148.43	4,582,849	0	-112,764	-112,764
700,000.00000		05/15/2018		700,000.00	57,931,683	1.000000000 ^S 80.192031997	700,000.00	56,134,422	0	-1,797,261	-1,797,261
1,305,655.07000		05/16/2018		1,305,655.07	107,677,003	1.000000000 ^S 80.192031997	1,305,655.07	104,703,133	0	-2,973,870	-2,973,870
28,442.03000		05/24/2018		28,442.03	2,361,408	1.000000000 ^S 80.192031997	28,442.03	2,280,824	0	-80,584	-80,584
337.42000		05/31/2018		337.42	27,738	1.000000000 ^S 80.192031997	337.42	27,058	0	-680	-680
41,255.59000		06/05/2018		41,255.59	3,458,418	1.000000000 ^S 80.192031997	41,255.59	3,308,370	0	-150,048	-150,048
58,915.23000		06/06/2018		58,915.23	4,919,294	1.000000000 ^S 80.192031997	58,915.23	4,724,532	0	-194,762	-194,762
777,655.00000		06/13/2018		777,655.00	65,293,219	1.000000000 ^S 80.192031997	777,655.00	62,361,735	0	-2,931,484	-2,931,484
537.23000		06/29/2018		537.23	43,966	1.000000000 ^S 80.192031997	537.23	43,082	0	-884	-884
690,000.00000		07/24/2018		690,000.00	56,754,011	1.000000000 ^S 80.192031997	690,000.00	55,332,502	0	-1,421,509	-1,421,509

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
31,207.59000		07/30/2018		31,207.59	2,564,892	1.000000000 ^S 80.192031997	31,207.59	2,502,600	0	-62,292	-62,292
377.22000		07/31/2018		377.22	31,391	1.000000000 ^S 80.192031997	377.22	30,250	0	-1,141	-1,141
144,861.46000		07/31/2018		144,861.46	11,909,905	1.000000000 ^S 80.192031997	144,861.46	11,616,735	0	-293,170	-293,170
118,572.90000		08/21/2018		118,572.90	9,567,568	1.000000000 ^S 80.192031997	118,572.90	9,508,602	0	-58,966	-58,966
110,597.95000		08/28/2018		110,597.95	9,022,493	1.000000000 ^S 80.192031997	110,597.95	8,869,074	0	-153,419	-153,419
110,062.03000		08/29/2018		110,062.03	8,986,444	1.000000000 ^S 80.192031997	110,062.03	8,826,098	0	-160,346	-160,346
-84,543.87000		10/20/2014		-84,543.87	-7,894,696	1.000000000 ^S 80.192031997	-84,543.87	-6,779,745	0	1,114,951	1,114,951
-96,073.00000		10/21/2014		-96,073.00	-9,020,412	1.000000000 ^S 80.192031997	-96,073.00	-7,704,289	0	1,316,123	1,316,123
-180,163.29000		10/22/2014		-180,163.29	-16,932,785	1.000000000 ^S 80.192031997	-180,163.29	-14,447,660	0	2,485,125	2,485,125
-134,048.72000		10/22/2014		-134,048.72	-12,598,672	1.000000000 ^S 80.192031997	-134,048.72	-10,749,639	0	1,849,033	1,849,033
-11,302.59000		10/22/2014		-11,302.59	-1,062,283	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,302.59	-906,378	0	155,905	155,905
-107,152.67000		10/23/2014		-107,152.67	-10,114,159	1.000000000 ^S 80.192031997	-107,152.67	-8,592,790	0	1,521,369	1,521,369
-31,285.75000		10/24/2014		-31,285.75	-2,965,041	1.000000000 ^S 80.192031997	-31,285.75	-2,508,868	0	456,173	456,173
-132,121.93000		10/28/2014		-132,121.93	-12,520,174	1.000000000 ^S 80.192031997	-132,121.93	-10,595,126	0	1,925,048	1,925,048
-482,451.36000		10/29/2014		-482,451.36	-46,100,869	1.000000000 ^S 80.192031997	-482,451.36	-38,688,755	0	7,412,114	7,412,114

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-290,633.73000		10/30/2014		-290,633.73	-27,973,317	1.000000000 ^S 80.192031997	-290,633.73	-23,306,509	0	4,666,808	4,666,808
-237,376.05000		11/05/2014		-237,376.05	-23,468,631	1.000000000 ^S 80.192031997	-237,376.05	-19,035,668	0	4,432,963	4,432,963
-60,273.52000		11/06/2014		-60,273.52	-5,930,648	1.000000000 ^S 80.192031997	-60,273.52	-4,833,456	0	1,097,192	1,097,192
-911,057.13000		11/07/2014		-911,057.13	-89,780,968	1.000000000 ^S 80.192031997	-911,057.13	-73,059,523	0	16,721,445	16,721,445
-395,964.91000		11/10/2014		-395,964.91	-39,200,790	1.000000000 ^S 80.192031997	-395,964.91	-31,753,231	0	7,447,559	7,447,559
-614,649.22000		11/12/2014		-614,649.22	-61,634,256	1.000000000 ^S 80.192031997	-614,649.22	-49,289,970	0	12,344,286	12,344,286
-70,444.68000		11/12/2014		-70,444.68	-7,063,875	1.000000000 ^S 80.192031997	-70,444.68	-5,649,102	0	1,414,773	1,414,773
-54,603.48000		11/13/2014		-54,603.48	-5,490,877	1.000000000 ^S 80.192031997	-54,603.48	-4,378,764	0	1,112,113	1,112,113
-319,964.21000		11/17/2014		-319,964.21	-32,542,269	1.000000000 ^S 80.192031997	-319,964.21	-25,658,580	0	6,883,689	6,883,689
-20,035.87000		11/18/2014		-20,035.87	-2,032,868	1.000000000 ^S 80.192031997	-20,035.87	-1,606,717	0	426,151	426,151
-213,850.66000		11/19/2014		-213,850.66	-21,776,026	1.000000000 ^S 80.192031997	-213,850.66	-17,149,119	0	4,626,907	4,626,907
-9,364.59000		11/20/2014		-9,364.59	-950,919	1.000000000 ^S 80.192031997	-9,364.59	-750,966	0	199,953	199,953
-2,545,581.34000		11/21/2014		-2,545,581.34	-259,289,652	1.000000000 ^S 80.192031997	-2,545,581.34	-204,135,340	0	55,154,312	55,154,312
-89,212.14000		11/25/2014		-89,212.14	-9,098,869	1.000000000 ^S 80.192031997	-89,212.14	-7,154,103	0	1,944,766	1,944,766
-603,479.44000		11/26/2014		-603,479.44	-60,728,438	1.000000000 ^S 80.192031997	-603,479.44	-48,394,243	0	12,334,195	12,334,195

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-86,787.10000		11/28/2014		-86,787.10	-8,741,712	1.000000000 ^S 80.192031997	-86,787.10	-6,959,634	0	1,782,078	1,782,078
-336,619.36000		12/01/2014		-336,619.36	-34,098,751	1.000000000 ^S 80.192031997	-336,619.36	-26,994,190	0	7,104,561	7,104,561
-93,678.58000		12/02/2014		-93,678.58	-9,411,623	1.000000000 ^S 80.192031997	-93,678.58	-7,512,276	0	1,899,347	1,899,347
-214,564.97000		12/03/2014		-214,564.97	-21,617,415	1.000000000 ^S 80.192031997	-214,564.97	-17,206,401	0	4,411,014	4,411,014
-435,539.26000		12/04/2014		-435,539.26	-43,903,822	1.000000000 ^S 80.192031997	-435,539.26	-34,926,778	0	8,977,044	8,977,044
-301,627.51000		12/09/2014		-301,627.51	-30,314,256	1.000000000 ^S 80.192031997	-301,627.51	-24,188,123	0	6,126,133	6,126,133
-128,649.45000		12/10/2014		-128,649.45	-12,782,326	1.000000000 ^S 80.192031997	-128,649.45	-10,316,661	0	2,465,665	2,465,665
-701,988.29000		12/11/2014		-701,988.29	-69,264,315	1.000000000 ^S 80.192031997	-701,988.29	-56,293,867	0	12,970,448	12,970,448
-69,226.87000		12/11/2014		-69,226.87	-6,830,529	1.000000000 ^S 80.192031997	-69,226.87	-5,551,443	0	1,279,086	1,279,086
-233,220.13000		12/12/2014		-233,220.13	-22,988,872	1.000000000 ^S 80.192031997	-233,220.13	-18,702,396	0	4,286,476	4,286,476
-1,012,066.41000		12/15/2014		-1,012,066.41	-98,967,724	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,012,066.41	-81,159,662	0	17,808,062	17,808,062
-882,994.13000		12/15/2014		-882,994.13	-86,346,033	1.000000000 ^S 80.192031997	-882,994.13	-70,809,094	0	15,536,939	15,536,939
-667,933.59000		12/15/2014		-667,933.59	-65,315,741	1.000000000 ^S 80.192031997	-667,933.59	-53,562,952	0	11,752,789	11,752,789
-230,255.10000		12/16/2014		-230,255.10	-22,377,237	1.000000000 ^S 80.192031997	-230,255.10	-18,464,624	0	3,912,613	3,912,613
-67,739.36000		12/17/2014		-67,739.36	-6,523,402	1.000000000 ^S 80.192031997	-67,739.36	-5,432,157	0	1,091,245	1,091,245

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-244,669.86000		12/19/2014		-244,669.86	-23,723,117	1.000000000\$ 80.192031997	-244,669.86	-19,620,573	0	4,102,544	4,102,544
-148,648.91000		12/22/2014		-148,648.91	-14,467,922	1.000000000\$ 80.192031997	-148,648.91	-11,920,458	0	2,547,464	2,547,464
-151,043.46000		12/24/2014		-151,043.46	-14,765,543	1.000000000\$ 80.192031997	-151,043.46	-12,112,482	0	2,653,061	2,653,061
-105,843.81000		01/05/2015		-105,843.81	-10,336,129	1.000000000\$ 80.192031997	-105,843.81	-8,487,830	0	1,848,299	1,848,299
-204,027.32000		01/07/2015		-204,027.32	-19,651,794	1.000000000\$ 80.192031997	-204,027.32	-16,361,365	0	3,290,429	3,290,429
-92,171.03000		01/08/2015		-92,171.03	-8,853,375	1.000000000\$ 80.192031997	-92,171.03	-7,391,382	0	1,461,993	1,461,993
-686,560.80000		01/09/2015		-686,560.80	-66,622,818	1.000000000\$ 80.192031997	-686,560.80	-55,056,706	0	11,566,112	11,566,112
-296,399.69000		01/13/2015		-296,399.69	-28,690,461	1.000000000\$ 80.192031997	-296,399.69	-23,768,893	0	4,921,568	4,921,568
-20,527.98000		01/14/2015		-20,527.98	-1,983,598	1.000000000\$ 80.192031997	-20,527.98	-1,646,180	0	337,418	337,418
-39,405.57000		01/15/2015		-39,405.57	-3,758,292	1.000000000\$ 80.192031997	-39,405.57	-3,160,013	0	598,279	598,279
-39,335.92000		01/21/2015		-39,335.92	-3,807,263	1.000000000\$ 80.192031997	-39,335.92	-3,154,427	0	652,836	652,836
-144,341.08000		01/22/2015		-144,341.08	-13,851,088	1.000000000\$ 80.192031997	-144,341.08	-11,575,005	0	2,276,083	2,276,083
-140,447.93000		01/22/2015		-140,447.93	-13,477,498	1.000000000\$ 80.192031997	-140,447.93	-11,262,805	0	2,214,693	2,214,693
-131,846.04000		01/22/2015		-131,846.04	-12,652,054	1.000000000\$ 80.192031997	-131,846.04	-10,573,002	0	2,079,052	2,079,052
-11,116.87000		01/22/2015		-11,116.87	-1,066,784	1.000000000\$ 80.192031997	-11,116.87	-891,484	0	175,300	175,300

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-9,303.87000		01/28/2015		-9,303.87	-869,334	1.000000000 ^S 80.192031997	-9,303.87	-746,096	0	123,238	123,238
-258,206.95000		02/05/2015		-258,206.95	-23,515,972	1.000000000 ^S 80.192031997	-258,206.95	-20,706,140	0	2,809,832	2,809,832
-128,192.28000		02/09/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.000000000 ^S 80.192031997	-128,192.28	-10,279,999	0	1,632,252	1,632,252
-76,498.09000		02/10/2015		-76,498.09	-7,094,696	1.000000000 ^S 80.192031997	-76,498.09	-6,134,537	0	960,159	960,159
-643,025.87000		02/12/2015		-643,025.87	-59,704,371	1.000000000 ^S 80.192031997	-643,025.87	-51,565,551	0	8,138,820	8,138,820
-195,720.57000		02/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.000000000 ^S 80.192031997	-195,720.57	-15,695,230	0	2,475,087	2,475,087
-12,078.57000		02/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.000000000 ^S 80.192031997	-12,078.57	-968,605	0	151,353	151,353
-203,751.45000		02/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000 ^S 80.192031997	-203,751.45	-16,339,243	0	2,609,838	2,609,838
-16,686.40000		02/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.000000000 ^S 80.192031997	-16,686.40	-1,338,116	0	216,597	216,597
-164,421.91000		03/02/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.000000000 ^S 80.192031997	-164,421.91	-13,185,327	0	2,200,265	2,200,265
-12,405.71000		03/03/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.000000000 ^S 80.192031997	-12,405.71	-994,839	0	165,034	165,034
-125,474.92000		03/06/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000 ^S 80.192031997	-125,474.92	-10,062,089	0	1,662,061	1,662,061
-152,618.80000		03/09/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.000000000 ^S 80.192031997	-152,618.80	-12,238,812	0	2,056,887	2,056,887
-708,611.63000		03/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.000000000 ^S 80.192031997	-708,611.63	-56,825,007	0	8,782,224	8,782,224
-27,978.64000		03/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.000000000 ^S 80.192031997	-27,978.64	-2,243,664	0	346,755	346,755

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-174,287.44000		03/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.000000000 ^S 80.192031997	-174,287.44	-13,976,464	0	2,309,371	2,309,371
-7,763.28000		03/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000 ^S 80.192031997	-7,763.28	-622,553	0	98,431	98,431
-302,844.98000		03/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000 ^S 80.192031997	-302,844.98	-24,285,754	0	3,978,094	3,978,094
-97,995.40000		03/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000 ^S 80.192031997	-97,995.40	-7,858,450	0	1,389,865	1,389,865
-172,798.05000		03/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000 ^S 80.192031997	-172,798.05	-13,857,027	0	2,349,884	2,349,884
-975,466.76000		03/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000 ^S 80.192031997	-975,466.76	-78,224,662	0	12,729,960	12,729,960
-256,508.24000		03/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000 ^S 80.192031997	-256,508.24	-20,569,917	0	3,124,477	3,124,477
-189,563.24000		03/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000 ^S 80.192031997	-189,563.24	-15,201,461	0	2,175,837	2,175,837
-206,250.64000		04/02/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000 ^S 80.192031997	-206,250.64	-16,539,658	0	2,259,284	2,259,284
-90,318.63000		04/07/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000 ^S 80.192031997	-90,318.63	-7,242,834	0	951,847	951,847
-74,243.21000		04/08/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000 ^S 80.192031997	-74,243.21	-5,953,714	0	881,937	881,937
-78,171.43000		04/09/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000 ^S 80.192031997	-78,171.43	-6,268,726	0	950,164	950,164
-705,086.17000		04/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000 ^S 80.192031997	-705,086.17	-56,542,293	0	8,566,410	8,566,410
-37,651.50000		04/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000 ^S 80.192031997	-37,651.50	-3,019,350	0	457,445	457,445
-246,307.80000		04/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000 ^S 80.192031997	-246,307.80	-19,751,923	0	2,681,840	2,681,840

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-57,294.63000		04/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000 ^S 80.192031997	-57,294.63	-4,594,573	0	625,551	625,551
-39,422.26000		04/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000 ^S 80.192031997	-39,422.26	-3,161,351	0	485,271	485,271
-167,462.13000		04/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000 ^S 80.192031997	-167,462.13	-13,429,128	0	2,000,232	2,000,232
-11,204.33000		04/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,204.33	-898,498	0	133,829	133,829
-58,785.17000		04/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000 ^S 80.192031997	-58,785.17	-4,714,102	0	754,063	754,063
-203,446.05000		04/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000 ^S 80.192031997	-203,446.05	-16,314,752	0	2,595,517	2,595,517
-19,719.18000		04/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000 ^S 80.192031997	-19,719.18	-1,581,321	0	254,568	254,568
-746,896.35000		04/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000 ^S 80.192031997	-746,896.35	-59,895,136	0	10,103,590	10,103,590
-47,545.85000		04/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000 ^S 80.192031997	-47,545.85	-3,812,798	0	743,245	743,245
-35,878.86000		05/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000 ^S 80.192031997	-35,878.86	-2,877,199	0	518,745	518,745
-59,220.06000		05/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000 ^S 80.192031997	-59,220.06	-4,748,977	0	872,698	872,698
-684,441.51000		05/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000 ^S 80.192031997	-684,441.51	-54,886,755	0	10,574,773	10,574,773
-157,020.19000		05/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000 ^S 80.192031997	-157,020.19	-12,591,768	0	2,425,997	2,425,997
-45,251.01000		05/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000 ^S 80.192031997	-45,251.01	-3,628,770	0	735,746	735,746
-518,763.75000		05/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000 ^S 80.192031997	-518,763.75	-41,600,719	0	7,923,366	7,923,366

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-6,306.57000		05/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000 ^S 80.192031997	-6,306.57	-505,737	0	96,123	96,123
-52,113.71000		05/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000 ^S 80.192031997	-52,113.71	-4,179,104	0	773,503	773,503
-393,354.22000		05/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000 ^S 80.192031997	-393,354.22	-31,543,874	0	5,789,111	5,789,111
-245,742.67000		06/01/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000 ^S 80.192031997	-245,742.67	-19,706,604	0	3,636,128	3,636,128
-5,170.70000		06/02/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000 ^S 80.192031997	-5,170.70	-414,649	0	75,588	75,588
-78,821.02000		06/03/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000 ^S 80.192031997	-78,821.02	-6,320,818	0	1,257,362	1,257,362
-113,860.14000		06/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000 ^S 80.192031997	-113,860.14	-9,130,676	0	1,738,330	1,738,330
-666,844.90000		06/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000 ^S 80.192031997	-666,844.90	-53,475,648	0	9,947,925	9,947,925
-110,710.67000		06/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000 ^S 80.192031997	-110,710.67	-8,878,114	0	1,651,570	1,651,570
-54,834.71000		06/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000 ^S 80.192031997	-54,834.71	-4,397,307	0	837,390	837,390
-83,284.46000		06/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000 ^S 80.192031997	-83,284.46	-6,678,750	0	1,267,634	1,267,634
-479,833.36000		06/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000 ^S 80.192031997	-479,833.36	-38,478,812	0	7,541,293	7,541,293
-17,695.85000		06/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,695.85	-1,419,066	0	278,117	278,117
-470,587.90000		06/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000 ^S 80.192031997	-470,587.90	-37,737,400	0	7,089,046	7,089,046
-156,011.32000		06/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000 ^S 80.192031997	-156,011.32	-12,510,865	0	2,503,963	2,503,963

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-49,769.29000		06/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000 ^S 80.192031997	-49,769.29	-3,991,100	0	747,261	747,261
-106,347.76000		06/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000 ^S 80.192031997	-106,347.76	-8,528,243	0	1,650,679	1,650,679
-13,612.05000		06/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000 ^S 80.192031997	-13,612.05	-1,091,578	0	209,802	209,802
-255,184.50000		06/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000 ^S 80.192031997	-255,184.50	-20,463,764	0	3,712,113	3,712,113
-321,067.80000		06/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000 ^S 80.192031997	-321,067.80	-25,747,079	0	4,389,393	4,389,393
-64,733.44000		07/01/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000 ^S 80.192031997	-64,733.44	-5,191,106	0	897,058	897,058
-28,970.18000		07/06/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000 ^S 80.192031997	-28,970.18	-2,323,178	0	349,568	349,568
-19,343.07000		07/08/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000 ^S 80.192031997	-19,343.07	-1,551,160	0	204,213	204,213
-676,268.27000		07/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000 ^S 80.192031997	-676,268.27	-54,231,327	0	6,710,010	6,710,010
-68,449.88000		07/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000 ^S 80.192031997	-68,449.88	-5,489,135	0	679,167	679,167
-275,119.99000		07/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000 ^S 80.192031997	-275,119.99	-22,062,431	0	2,980,680	2,980,680
-93,052.47000		07/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000 ^S 80.192031997	-93,052.47	-7,462,067	0	1,063,925	1,063,925
-73,784.97000		07/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000 ^S 80.192031997	-73,784.97	-5,916,967	0	843,628	843,628
-110,427.24000		07/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000 ^S 80.192031997	-110,427.24	-8,855,385	0	1,316,857	1,316,857
-164,563.52000		07/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000 ^S 80.192031997	-164,563.52	-13,196,683	0	1,865,257	1,865,257

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-87,873.33000		07/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000\$ 80.192031997	-87,873.33	-7,046,741	0	864,171	864,171
-13,601.15000		07/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000\$ 80.192031997	-13,601.15	-1,090,704	0	131,232	131,232
-59,933.50000		08/05/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000\$ 80.192031997	-59,933.50	-4,806,189	0	703,946	703,946
-143,187.55000		08/06/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000\$ 80.192031997	-143,187.55	-11,482,501	0	1,662,486	1,662,486
-158,035.75000		08/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000\$ 80.192031997	-158,035.75	-12,673,208	0	1,855,964	1,855,964
-669,741.07000		08/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000\$ 80.192031997	-669,741.07	-53,707,897	0	7,953,529	7,953,529
-284,337.22000		08/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000\$ 80.192031997	-284,337.22	-22,801,579	0	3,376,655	3,376,655
-7,892,527.01000		08/12/2015		-7,892,527.01	-718,905,956	1.000000000\$ 80.192031997	-7,892,527.01	-632,917,779	0	85,988,177	85,988,177
-156,845.94000		08/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000\$ 80.192031997	-156,845.94	-12,577,795	0	1,742,564	1,742,564
-53,128.21000		08/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000\$ 80.192031997	-53,128.21	-4,260,459	0	602,660	602,660
-162,199.09000		08/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000\$ 80.192031997	-162,199.09	-13,007,075	0	1,858,297	1,858,297
-21,061.93000		08/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000\$ 80.192031997	-21,061.93	-1,688,999	0	232,162	232,162
-265,076.96000		08/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000\$ 80.192031997	-265,076.96	-21,257,060	0	2,869,014	2,869,014
-19,404.32000		08/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000\$ 80.192031997	-19,404.32	-1,556,072	0	-1,555,859	-1,555,859
-196,668.41000		08/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000\$ 80.192031997	-196,668.41	-15,771,239	0	1,029,650	1,029,650

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-462,149.98000		08/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000\$ 80.192031997	-462,149.98	-37,060,746	0	2,698,866	2,698,866
-32,107.10000		08/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000\$ 80.192031997	-32,107.10	-2,574,734	0	144,089	144,089
-86,093.85000		09/01/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000\$ 80.192031997	-86,093.85	-6,904,041	0	492,635	492,635
-93,737.05000		09/02/2015		-93,737.05	-7,905,601	1.000000000\$ 80.192031997	-93,737.05	-7,516,965	0	388,636	388,636
-4,157.48000		09/03/2015		-4,157.48	-349,983	1.000000000\$ 80.192031997	-4,157.48	-333,397	0	16,586	16,586
-102,367.87000		09/04/2015		-102,367.87	-8,650,619	1.000000000\$ 80.192031997	-102,367.87	-8,209,088	0	441,531	441,531
-642,283.89000		09/09/2015		-642,283.89	-53,850,984	1.000000000\$ 80.192031997	-642,283.89	-51,506,050	0	2,344,934	2,344,934
-476,290.57000		09/10/2015		-476,290.57	-40,505,866	1.000000000\$ 80.192031997	-476,290.57	-38,194,709	0	2,311,157	2,311,157
-107,114.37000		09/11/2015		-107,114.37	-9,136,362	1.000000000\$ 80.192031997	-107,114.37	-8,589,719	0	546,643	546,643
-575,423.39000		09/14/2015		-575,423.39	-48,988,118	1.000000000\$ 80.192031997	-575,423.39	-46,144,371	0	2,843,747	2,843,747
-92,596.64000		09/14/2015		-92,596.64	-7,883,126	1.000000000\$ 80.192031997	-92,596.64	-7,425,513	0	457,613	457,613
-636,341.83000		09/15/2015		-636,341.83	-54,620,063	1.000000000\$ 80.192031997	-636,341.83	-51,029,544	0	3,590,519	3,590,519
-57,680.52000		09/16/2015		-57,680.52	-4,915,496	1.000000000\$ 80.192031997	-57,680.52	-4,625,518	0	289,978	289,978
-148,138.07000		09/17/2015		-148,138.07	-12,842,800	1.000000000\$ 80.192031997	-148,138.07	-11,879,493	0	963,307	963,307
-888,355.94000		09/18/2015		-888,355.94	-76,774,291	1.000000000\$ 80.192031997	-888,355.94	-71,239,068	0	5,535,223	5,535,223

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-252,646.81000		09/24/2015		-252,646.81	-21,364,671	1.000000000 ^S 80.192031997	-252,646.81	-20,260,261	0	1,104,410	1,104,410
-49,056.91000		09/25/2015		-49,056.91	-4,093,695	1.000000000 ^S 80.192031997	-49,056.91	-3,933,973	0	159,722	159,722
-72,142.91000		09/28/2015		-72,142.91	-6,115,979	1.000000000 ^S 80.192031997	-72,142.91	-5,785,287	0	330,692	330,692
-70,823.93000		09/30/2015		-70,823.93	-5,954,410	1.000000000 ^S 80.192031997	-70,823.93	-5,679,515	0	274,895	274,895
-198,025.63000		10/01/2015		-198,025.63	-16,654,940	1.000000000 ^S 80.192031997	-198,025.63	-15,880,078	0	774,862	774,862
-122,307.91000		10/06/2015		-122,307.91	-10,416,695	1.000000000 ^S 80.192031997	-122,307.91	-9,808,120	0	608,575	608,575
-39,456.54000		10/06/2015		-39,456.54	-3,360,426	1.000000000 ^S 80.192031997	-39,456.54	-3,164,100	0	196,326	196,326
-17,998.66000		10/07/2015		-17,998.66	-1,543,637	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,998.66	-1,443,349	0	100,288	100,288
-94,044.65000		10/08/2015		-94,044.65	-8,145,767	1.000000000 ^S 80.192031997	-94,044.65	-7,541,632	0	604,135	604,135
-413,942.78000		10/09/2015		-413,942.78	-35,732,854	1.000000000 ^S 80.192031997	-413,942.78	-33,194,913	0	2,537,941	2,537,941
-18,029.52000		10/09/2015		-18,029.52	-1,556,365	1.000000000 ^S 80.192031997	-18,029.52	-1,445,824	0	110,541	110,541
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324	1.000000000 ^S 80.192031997	-201,846.72	-16,186,499	0	1,292,825	1,292,825
-106,109.09000		10/15/2015		-106,109.09	-9,188,731	1.000000000 ^S 80.192031997	-106,109.09	-8,509,104	0	679,627	679,627
-13,046.14000		10/16/2015		-13,046.14	-1,131,560	1.000000000 ^S 80.192031997	-13,046.14	-1,046,196	0	85,364	85,364
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340	1.000000000 ^S 80.192031997	-938,332.24	-75,246,769	0	5,963,571	5,963,571

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-52,217.18000		10/26/2015		-52,217.18	-4,570,998	1.000000000 ^S 80.192031997	-52,217.18	-4,187,402	0	383,596	383,596
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268	1.000000000 ^S 80.192031997	-156,124.38	-12,519,931	0	1,185,337	1,185,337
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000 ^S 80.192031997	-221,516.12	-17,763,828	0	1,233,630	1,233,630
-22,603.85000		11/05/2015		-22,603.85	-1,966,401	1.000000000 ^S 80.192031997	-22,603.85	-1,812,649	0	153,752	153,752
-28,494.89000		11/06/2015		-28,494.89	-2,474,770	1.000000000 ^S 80.192031997	-28,494.89	-2,285,063	0	189,707	189,707
-33,113.93000		11/10/2015		-33,113.93	-2,878,332	1.000000000 ^S 80.192031997	-33,113.93	-2,655,473	0	222,859	222,859
-908,189.06000		11/12/2015		-908,189.06	-78,762,965	1.000000000 ^S 80.192031997	-908,189.06	-72,829,526	0	5,933,439	5,933,439
-377,515.60000		11/12/2015		-377,515.60	-32,740,152	1.000000000 ^S 80.192031997	-377,515.60	-30,273,743	0	2,466,409	2,466,409
-6,155.13000		11/13/2015		-6,155.13	-537,849	1.000000000 ^S 80.192031997	-6,155.13	-493,592	0	44,257	44,257
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000 ^S 80.192031997	-156,394.49	-12,541,592	0	1,095,940	1,095,940
-16,749.47000		11/18/2015		-16,749.47	-1,472,174	1.000000000 ^S 80.192031997	-16,749.47	-1,343,174	0	129,000	129,000
-535,263.52000		11/19/2015		-535,263.52	-46,835,996	1.000000000 ^S 80.192031997	-535,263.52	-42,923,869	0	3,912,127	3,912,127
-171,111.94000		11/20/2015		-171,111.94	-15,132,801	1.000000000 ^S 80.192031997	-171,111.94	-13,721,814	0	1,410,987	1,410,987
-74,491.46000		11/24/2015		-74,491.46	-6,589,055	1.000000000 ^S 80.192031997	-74,491.46	-5,973,622	0	615,433	615,433
-907,253.22000		11/25/2015		-907,253.22	-80,284,748	1.000000000 ^S 80.192031997	-907,253.22	-72,754,479	0	7,530,269	7,530,269

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 2018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											
-124,050.79000		11/27/2015		-124,050.79	-10,988,000	1.000000000 ^S 80.192031997	-124,050.79	-9,947,885	0	1,040,115	1,040,115
-125,483.80000		12/01/2015		-125,483.80	-11,209,303	1.000000000 ^S 80.192031997	-125,483.80	-10,062,801	0	1,146,502	1,146,502
-29,511.79000		12/03/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000 ^S 80.192031997	-29,511.79	-2,366,610	0	299,830	299,830
-33,063.02000		12/04/2015		-33,063.02	-2,969,898	1.000000000 ^S 80.192031997	-33,063.02	-2,651,391	0	318,507	318,507
-33,111.98000		12/08/2015		-33,111.98	-2,969,410	1.000000000 ^S 80.192031997	-33,111.98	-2,655,317	0	314,093	314,093
-329,209.04000		12/09/2015		-329,209.04	-29,234,099	1.000000000 ^S 80.192031997	-329,209.04	-26,399,942	0	2,834,157	2,834,157
-29,648.06000		12/10/2015		-29,648.06	-2,614,894	1.000000000 ^S 80.192031997	-29,648.06	-2,377,538	0	237,356	237,356
-327,000.00000		12/11/2015		-327,000.00	-28,998,504	1.000000000 ^S 80.192031997	-327,000.00	-26,222,794	0	2,775,710	2,775,710
-92,475.65000		12/11/2015		-92,475.65	-8,200,781	1.000000000 ^S 80.192031997	-92,475.65	-7,415,810	0	784,971	784,971
-57,766.60000		12/11/2015		-57,766.60	-5,122,768	1.000000000 ^S 80.192031997	-57,766.60	-4,632,421	0	490,347	490,347
-34,992.57000		12/14/2015		-34,992.57	-3,051,138	1.000000000 ^S 80.192031997	-34,992.57	-2,806,125	0	245,013	245,013
-288,079.45000		12/15/2015		-288,079.45	-25,176,774	1.000000000 ^S 80.192031997	-288,079.45	-23,101,676	0	2,075,098	2,075,098
-109,269.69000		12/16/2015		-109,269.69	-9,536,047	1.000000000 ^S 80.192031997	-109,269.69	-8,762,558	0	773,489	773,489
-26,796.21000		12/18/2015		-26,796.21	-2,338,039	1.000000000 ^S 80.192031997	-26,796.21	-2,148,843	0	189,196	189,196
-35,901.50000		12/30/2015		-35,901.50	-3,154,307	1.000000000 ^S 80.192031997	-35,901.50	-2,879,014	0	275,293	275,293

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-191,729.95000		01/04/2016		-191,729.95	-16,780,325	1.000000000 ^S 80.192031997	-191,729.95	-15,375,214	0	1,405,111	1,405,111
-223,008.99000		01/05/2016		-223,008.99	-19,064,056	1.000000000 ^S 80.192031997	-223,008.99	-17,883,544	0	1,180,512	1,180,512
-17,213.36000		01/07/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,213.36	-1,380,374	0	62,190	62,190
-379,405.26000		01/12/2016		-379,405.26	-31,131,953	1.000000000 ^S 80.192031997	-379,405.26	-30,425,279	0	706,674	706,674
-189,599.29000		01/15/2016		-189,599.29	-15,584,866	1.000000000 ^S 80.192031997	-189,599.29	-15,204,352	0	380,514	380,514
-8,880.25000		01/19/2016		-8,880.25	-716,821	1.000000000 ^S 80.192031997	-8,880.25	-712,125	0	4,696	4,696
-90,489.83000		01/21/2016		-90,489.83	-7,198,238	1.000000000 ^S 80.192031997	-90,489.83	-7,256,563	0	-58,325	-58,325
-57,779.34000		01/21/2016		-57,779.34	-4,596,201	1.000000000 ^S 80.192031997	-57,779.34	-4,633,443	0	-37,242	-37,242
-7,629.83000		01/21/2016		-7,629.83	-606,934	1.000000000 ^S 80.192031997	-7,629.83	-611,852	0	-4,918	-4,918
-121,619.56000		01/22/2016		-121,619.56	-9,910,282	1.000000000 ^S 80.192031997	-121,619.56	-9,752,920	0	157,362	157,362
-214,100.94000		02/01/2016		-214,100.94	-18,334,604	1.000000000 ^S 80.192031997	-214,100.94	-17,169,189	0	1,165,415	1,165,415
-21,646.66000		02/04/2016		-21,646.66	-1,815,370	1.000000000 ^S 80.192031997	-21,646.66	-1,735,890	0	79,480	79,480
-14,653.90000		02/05/2016		-14,653.90	-1,240,675	1.000000000 ^S 80.192031997	-14,653.90	-1,175,126	0	65,549	65,549
-30,116.40000		02/10/2016		-30,116.40	-2,445,030	1.000000000 ^S 80.192031997	-30,116.40	-2,415,095	0	29,935	29,935
-381,805.81000		02/12/2016		-381,805.81	-30,235,477	1.000000000 ^S 80.192031997	-381,805.81	-30,617,784	0	-382,307	-382,307

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-152,354.76000		02/12/2016		-152,354.76	-12,065,083	1.000000000 ^S 80.192031997	-152,354.76	-12,217,638	0	-152,555	-152,555
-16,916.50000		02/17/2016		-16,916.50	-1,364,954	1.000000000 ^S 80.192031997	-16,916.50	-1,356,569	0	8,385	8,385
-114,575.44000		02/22/2016		-114,575.44	-9,163,101	1.000000000 ^S 80.192031997	-114,575.44	-9,188,037	0	-24,936	-24,936
-37,349.25000		02/23/2016		-37,349.25	-3,051,565	1.000000000 ^S 80.192031997	-37,349.25	-2,995,112	0	56,453	56,453
-123,804.34000		03/02/2016		-123,804.34	-10,057,811	1.000000000 ^S 80.192031997	-123,804.34	-9,928,122	0	129,689	129,689
-27,289.30000		03/03/2016		-27,289.30	-2,257,397	1.000000000 ^S 80.192031997	-27,289.30	-2,188,384	0	69,013	69,013
-10,054.65000		03/07/2016		-10,054.65	-847,732	1.000000000 ^S 80.192031997	-10,054.65	-806,303	0	41,429	41,429
-211,885.31000		03/09/2016		-211,885.31	-17,733,243	1.000000000 ^S 80.192031997	-211,885.31	-16,991,514	0	741,729	741,729
-377,078.03000		03/11/2016		-377,078.03	-31,843,855	1.000000000 ^S 80.192031997	-377,078.03	-30,238,653	0	1,605,202	1,605,202
-74,706.21000		03/14/2016		-74,706.21	-6,403,880	1.000000000 ^S 80.192031997	-74,706.21	-5,990,843	0	413,037	413,037
-73,687.89000		03/15/2016		-73,687.89	-6,289,651	1.000000000 ^S 80.192031997	-73,687.89	-5,909,182	0	380,469	380,469
-45,075.31000		03/16/2016		-45,075.31	-3,796,491	1.000000000 ^S 80.192031997	-45,075.31	-3,614,681	0	181,810	181,810
-29,125.30000		03/18/2016		-29,125.30	-2,475,492	1.000000000 ^S 80.192031997	-29,125.30	-2,335,617	0	139,875	139,875
-97,821.68000		03/22/2016		-97,821.68	-8,292,500	1.000000000 ^S 80.192031997	-97,821.68	-7,844,519	0	447,981	447,981
-112,039.68000		03/23/2016		-112,039.68	-9,552,811	1.000000000 ^S 80.192031997	-112,039.68	-8,984,690	0	568,121	568,121

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-159,202.44000		03/24/2016		-159,202.44	-13,507,411	1.000000000\$ 80.192031997	-159,202.44	-12,766,767	0	740,644	740,644
-32,177.14000		03/31/2016		-32,177.14	-2,784,601	1.000000000\$ 80.192031997	-32,177.14	-2,580,350	0	204,251	204,251
-64,762.22000		04/05/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000\$ 80.192031997	-64,762.22	-5,193,414	0	292,205	292,205
-26,208.62000		04/06/2016		-26,208.62	-2,182,406	1.000000000\$ 80.192031997	-26,208.62	-2,101,722	0	80,684	80,684
-373,765.27000		04/11/2016		-373,765.27	-30,674,974	1.000000000\$ 80.192031997	-373,765.27	-29,972,996	0	701,978	701,978
-204,881.37000		04/11/2016		-204,881.37	-16,814,646	1.000000000\$ 80.192031997	-204,881.37	-16,429,853	0	384,793	384,793
-43,019.52000		04/12/2016		-43,019.52	-3,527,545	1.000000000\$ 80.192031997	-43,019.52	-3,449,823	0	77,722	77,722
-33,801.18000		04/13/2016		-33,801.18	-2,800,107	1.000000000\$ 80.192031997	-33,801.18	-2,710,585	0	89,522	89,522
-141,797.35000		04/14/2016		-141,797.35	-11,838,108	1.000000000\$ 80.192031997	-141,797.35	-11,371,018	0	467,090	467,090
-3,319.09000		04/18/2016		-3,319.09	-278,038	1.000000000\$ 80.192031997	-3,319.09	-266,165	0	11,873	11,873
-83,104.57000		04/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000\$ 80.192031997	-83,104.57	-6,664,324	0	335,512	335,512
-7,007.13000		04/19/2016		-7,007.13	-590,205	1.000000000\$ 80.192031997	-7,007.13	-561,916	0	28,289	28,289
-32,699.55000		04/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000\$ 80.192031997	-32,699.55	-2,622,243	0	169,839	169,839
-2,677,613.47000		04/21/2016		-2,677,613.47	-228,369,211	1.000000000\$ 80.192031997	-2,677,613.47	-214,723,265	0	13,645,946	13,645,946
-92,321.29000		04/21/2016		-92,321.29	-7,873,930	1.000000000\$ 80.192031997	-92,321.29	-7,403,432	0	470,498	470,498

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-51,467.98000		04/26/2016		-51,467.98	-4,411,808	1.000000000 ^S 80.192031997	-51,467.98	-4,127,322	0	284,486	284,486
-15,428.24000		05/09/2016		-15,428.24	-1,209,910	1.000000000 ^S 80.192031997	-15,428.24	-1,237,222	0	-27,312	-27,312
-102,314.26000		05/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000 ^S 80.192031997	-102,314.26	-8,204,788	0	17,817	17,817
-352,627.83000		05/12/2016		-352,627.83	-28,284,357	1.000000000 ^S 80.192031997	-352,627.83	-28,277,942	0	6,415	6,415
-32,453.42000		05/17/2016		-32,453.42	-2,578,702	1.000000000 ^S 80.192031997	-32,453.42	-2,602,506	0	-23,804	-23,804
-184,519.95000		05/18/2016		-184,519.95	-14,755,931	1.000000000 ^S 80.192031997	-184,519.95	-14,797,030	0	-41,099	-41,099
-346,026.04000		05/23/2016		-346,026.04	-27,596,972	1.000000000 ^S 80.192031997	-346,026.04	-27,748,531	0	-151,559	-151,559
-349,425.52000		06/10/2016		-349,425.52	-27,668,680	1.000000000 ^S 80.192031997	-349,425.52	-28,021,142	0	-352,462	-352,462
-205,061.01000		06/14/2016		-205,061.01	-16,138,898	1.000000000 ^S 80.192031997	-205,061.01	-16,444,259	0	-305,361	-305,361
-27,132.00000		06/17/2016		-27,132.00	-2,060,548	1.000000000 ^S 80.192031997	-27,132.00	-2,175,770	0	-115,222	-115,222
-3,725.24000		07/07/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000 ^S 80.192031997	-3,725.24	-298,735	0	-17,179	-17,179
-359,882.81000		07/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000 ^S 80.192031997	-359,882.81	-28,859,734	0	-1,538,691	-1,538,691
-11,042.19000		07/11/2016		-11,042.19	-838,284	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,042.19	-885,496	0	-47,212	-47,212
-123,264.71000		07/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000 ^S 80.192031997	-123,264.71	-9,884,848	0	-346,382	-346,382
-253,623.43000		07/14/2016		-253,623.43	-20,172,228	1.000000000 ^S 80.192031997	-253,623.43	-20,338,578	0	-166,350	-166,350

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-78,638.63000		07/14/2016		-78,638.63	-6,254,613	1.000000000 ^S 80.192031997	-78,638.63	-6,306,192	0	-51,579	-51,579
-6,630.58000		07/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000 ^S 80.192031997	-6,630.58	-531,720	0	-4,349	-4,349
-105,691.38000		07/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000 ^S 80.192031997	-105,691.38	-8,475,607	0	-54,660	-54,660
-26,928.63000		07/22/2016		-26,928.63	-2,148,021	1.000000000 ^S 80.192031997	-26,928.63	-2,159,462	0	-11,441	-11,441
-11,865.10000		07/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,865.10	-951,486	0	-17,023	-17,023
-64,818.19000		08/02/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000 ^S 80.192031997	-64,818.19	-5,197,902	0	-183,501	-183,501
-19,853.51000		08/02/2016		-19,853.51	-1,535,888	1.000000000 ^S 80.192031997	-19,853.51	-1,592,093	0	-56,205	-56,205
-181,375.34000		08/03/2016		-181,375.34	-13,938,155	1.000000000 ^S 80.192031997	-181,375.34	-14,544,857	0	-606,702	-606,702
-25,260.07000		08/04/2016		-25,260.07	-1,938,997	1.000000000 ^S 80.192031997	-25,260.07	-2,025,656	0	-86,659	-86,659
-356,084.08000		08/12/2016		-356,084.08	-27,843,105	1.000000000 ^S 80.192031997	-356,084.08	-28,555,106	0	-712,001	-712,001
-42,406.06000		08/12/2016		-42,406.06	-3,315,836	1.000000000 ^S 80.192031997	-42,406.06	-3,400,628	0	-84,792	-84,792
-33,369.43000		08/16/2016		-33,369.43	-2,591,016	1.000000000 ^S 80.192031997	-33,369.43	-2,675,962	0	-84,946	-84,946
-146,047.78000		08/17/2016		-146,047.78	-11,265,304	1.000000000 ^S 80.192031997	-146,047.78	-11,711,868	0	-446,564	-446,564
-12,365.22000		08/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000 ^S 80.192031997	-12,365.22	-991,592	0	-44,846	-44,846
-25,656.87000		08/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000 ^S 80.192031997	-25,656.87	-2,057,477	0	-84,678	-84,678

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-62,280.99000		08/22/2016		-62,280.99	-4,755,276	1.000000000 ^S 80.192031997	-62,280.99	-4,994,439	0	-239,163	-239,163
-115,979.16000		08/23/2016		-115,979.16	-8,883,458	1.000000000 ^S 80.192031997	-115,979.16	-9,300,605	0	-417,147	-417,147
-45,244.15000		08/24/2016		-45,244.15	-3,466,822	1.000000000 ^S 80.192031997	-45,244.15	-3,628,220	0	-161,398	-161,398
-118,911.22000		08/25/2016		-118,911.22	-9,101,467	1.000000000 ^S 80.192031997	-118,911.22	-9,535,732	0	-434,265	-434,265
-18,695.42000		09/02/2016		-18,695.42	-1,456,164	1.000000000 ^S 80.192031997	-18,695.42	-1,499,224	0	-43,060	-43,060
-647,737.56000		09/08/2016		-647,737.56	-50,558,123	1.000000000 ^S 80.192031997	-647,737.56	-51,943,391	0	-1,385,268	-1,385,268
-349,412.93000		09/12/2016		-349,412.93	-27,165,953	1.000000000 ^S 80.192031997	-349,412.93	-28,020,133	0	-854,180	-854,180
-17,748.89000		09/15/2016		-17,748.89	-1,360,703	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,748.89	-1,423,320	0	-62,617	-62,617
-179,125.75000		09/21/2016		-179,125.75	-13,765,066	1.000000000 ^S 80.192031997	-179,125.75	-14,364,458	0	-599,392	-599,392
-355,570.37000		10/12/2016		-355,570.37	-27,813,188	1.000000000 ^S 80.192031997	-355,570.37	-28,513,910	0	-700,722	-700,722
-87,209.56000		10/14/2016		-87,209.56	-6,810,737	1.000000000 ^S 80.192031997	-87,209.56	-6,993,512	0	-182,775	-182,775
-49,550.92000		10/20/2016		-49,550.92	-3,937,169	1.000000000 ^S 80.192031997	-49,550.92	-3,973,589	0	-36,420	-36,420
-108,096.46000		10/26/2016		-108,096.46	-8,631,787	1.000000000 ^S 80.192031997	-108,096.46	-8,668,475	0	-36,688	-36,688
-6,022.62000		11/09/2016		-6,022.62	-486,973	1.000000000 ^S 80.192031997	-6,022.62	-482,966	0	4,007	4,007
-358,077.71000		11/14/2016		-358,077.71	-28,775,830	1.000000000 ^S 80.192031997	-358,077.71	-28,714,979	0	60,851	60,851

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。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-105,736.37000		11/15/2016		-105,736.37	-8,633,411	1.000000000 ^S 80.192031997	-105,736.37	-8,479,214	0	154,197	154,197
-8,950.00000		11/16/2016		-8,950.00	-735,749	1.000000000 ^S 80.192031997	-8,950.00	-717,719	0	18,030	18,030
-43,039.27000		11/18/2016		-43,039.27	-3,517,706	1.000000000 ^S 80.192031997	-43,039.27	-3,451,407	0	66,299	66,299
-29,290.91000		11/25/2016		-29,290.91	-2,456,555	1.000000000 ^S 80.192031997	-29,290.91	-2,348,898	0	107,657	107,657
-51,254.81000		11/30/2016		-51,254.81	-4,320,135	1.000000000 ^S 80.192031997	-51,254.81	-4,110,227	0	209,908	209,908
-156,086.08000		12/01/2016		-156,086.08	-13,140,616	1.000000000 ^S 80.192031997	-156,086.08	-12,516,860	0	623,756	623,756
-99,004.27000		12/02/2016		-99,004.27	-8,385,070	1.000000000 ^S 80.192031997	-99,004.27	-7,939,354	0	445,716	445,716
-241,950.12000		12/06/2016		-241,950.12	-20,677,187	1.000000000 ^S 80.192031997	-241,950.12	-19,402,472	0	1,274,715	1,274,715
-52,956.42000		12/07/2016		-52,956.42	-4,499,736	1.000000000 ^S 80.192031997	-52,956.42	-4,246,683	0	253,053	253,053
-352,726.96000		12/09/2016		-352,726.96	-29,973,125	1.000000000 ^S 80.192031997	-352,726.96	-28,285,892	0	1,687,233	1,687,233
-9,409.35000		12/12/2016		-9,409.35	-807,660	1.000000000 ^S 80.192031997	-9,409.35	-754,555	0	53,105	53,105
-242,673.60000		12/14/2016		-242,673.60	-20,968,061	1.000000000 ^S 80.192031997	-242,673.60	-19,460,489	0	1,507,572	1,507,572
-8,765.00000		12/16/2016		-8,765.00	-764,049	1.000000000 ^S 80.192031997	-8,765.00	-702,883	0	61,166	61,166
-63,041.53000		12/19/2016		-63,041.53	-5,432,127	1.000000000 ^S 80.192031997	-63,041.53	-5,055,428	0	376,699	376,699
-113,105.55000		12/22/2016		-113,105.55	-9,651,835	1.000000000 ^S 80.192031997	-113,105.55	-9,070,164	0	581,671	581,671

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-202,488.26000		12/28/2016		-202,488.26	-17,117,239	1.000000000 ^S 80.192031997	-202,488.26	-16,237,945	0	879,294	879,294
-17,327.64000		12/29/2016		-17,327.64	-1,462,733	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,327.64	-1,389,539	0	73,194	73,194
-1,900.70000		12/30/2016		-1,900.70	-159,632	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,900.70	-152,421	0	7,211	7,211
-17,618.00000		01/04/2017		-17,618.00	-1,501,301	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,618.00	-1,412,823	0	88,478	88,478
-550,762.83000		01/05/2017		-550,762.83	-47,018,808	1.000000000 ^S 80.192031997	-550,762.83	-44,166,790	0	2,852,018	2,852,018
-46,205.35000		01/06/2017		-46,205.35	-3,920,910	1.000000000 ^S 80.192031997	-46,205.35	-3,705,301	0	215,609	215,609
-75,551.78000		01/11/2017		-75,551.78	-6,438,078	1.000000000 ^S 80.192031997	-75,551.78	-6,058,651	0	379,427	379,427
-349,599.06000		01/12/2017		-349,599.06	-30,063,342	1.000000000 ^S 80.192031997	-349,599.06	-28,035,059	0	2,028,283	2,028,283
-11,816.04000		01/12/2017		-11,816.04	-1,016,106	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,816.04	-947,552	0	68,554	68,554
-78,835.06000		01/18/2017		-78,835.06	-6,719,133	1.000000000 ^S 80.192031997	-78,835.06	-6,321,944	0	397,189	397,189
-11,222.99000		01/18/2017		-11,222.99	-956,538	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,222.99	-899,994	0	56,544	56,544
-6,647.14000		01/18/2017		-6,647.14	-566,537	1.000000000 ^S 80.192031997	-6,647.14	-533,048	0	33,489	33,489
-57,843.82000		01/20/2017		-57,843.82	-5,033,172	1.000000000 ^S 80.192031997	-57,843.82	-4,638,613	0	394,559	394,559
-59,564.39000		01/23/2017		-59,564.39	-5,172,781	1.000000000 ^S 80.192031997	-59,564.39	-4,776,589	0	396,192	396,192
-120,856.84000		01/24/2017		-120,856.84	-10,353,246	1.000000000 ^S 80.192031997	-120,856.84	-9,691,756	0	661,490	661,490

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-105,955.38000		01/24/2017		-105,955.38	-9,076,707	1.000000000\$ 80.192031997	-105,955.38	-8,496,777	0	579,930	579,930
-186,290.44000		01/27/2017		-186,290.44	-16,102,463	1.000000000\$ 80.192031997	-186,290.44	-14,939,009	0	1,163,454	1,163,454
-72,198.29000		01/27/2017		-72,198.29	-6,240,633	1.000000000\$ 80.192031997	-72,198.29	-5,789,728	0	450,905	450,905
-66,189.39000		02/01/2017		-66,189.39	-5,656,632	1.000000000\$ 80.192031997	-66,189.39	-5,307,862	0	348,770	348,770
-17,013.34000		02/02/2017		-17,013.34	-1,460,104	1.000000000\$ 80.192031997	-17,013.34	-1,364,334	0	95,770	95,770
-10,224.17000		02/07/2017		-10,224.17	-877,520	1.000000000\$ 80.192031997	-10,224.17	-819,897	0	57,623	57,623
-177,969.53000		02/09/2017		-177,969.53	-15,213,556	1.000000000\$ 80.192031997	-177,969.53	-14,271,738	0	941,818	941,818
-344,229.20000		02/10/2017		-344,229.20	-29,662,809	1.000000000\$ 80.192031997	-344,229.20	-27,604,439	0	2,058,370	2,058,370
-152,291.16000		02/13/2017		-152,291.16	-13,270,154	1.000000000\$ 80.192031997	-152,291.16	-12,212,538	0	1,057,616	1,057,616
-967,326.20000		02/15/2017		-967,326.20	-84,398,304	1.000000000\$ 80.192031997	-967,326.20	-77,571,854	0	6,826,450	6,826,450
-71,449.49000		02/16/2017		-71,449.49	-6,292,028	1.000000000\$ 80.192031997	-71,449.49	-5,729,680	0	562,348	562,348
-34,639.01000		02/23/2017		-34,639.01	-3,017,462	1.000000000\$ 80.192031997	-34,639.01	-2,777,773	0	239,689	239,689
-52,248.31000		03/01/2017		-52,248.31	-4,494,545	1.000000000\$ 80.192031997	-52,248.31	-4,189,898	0	304,647	304,647
-44,953.93000		03/03/2017		-44,953.93	-3,898,960	1.000000000\$ 80.192031997	-44,953.93	-3,604,947	0	294,013	294,013
-185,905.53000		03/08/2017		-185,905.53	-16,102,616	1.000000000\$ 80.192031997	-185,905.53	-14,908,142	0	1,194,474	1,194,474

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-11,158.43000		03/09/2017		-11,158.43	-965,561	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,158.43	-894,817	0	70,744	70,744
-334,340.29000		03/10/2017		-334,340.29	-28,791,636	1.000000000 ^S 80.192031997	-334,340.29	-26,811,427	0	1,980,209	1,980,209
-189,359.17000		03/14/2017		-189,359.17	-16,457,305	1.000000000 ^S 80.192031997	-189,359.17	-15,185,097	0	1,272,208	1,272,208
-201,782.17000		03/15/2017		-201,782.17	-17,521,607	1.000000000 ^S 80.192031997	-201,782.17	-16,181,322	0	1,340,285	1,340,285
-93,724.51000		03/16/2017		-93,724.51	-8,160,137	1.000000000 ^S 80.192031997	-93,724.51	-7,515,959	0	644,178	644,178
-951,148.84000		03/17/2017		-951,148.84	-82,485,587	1.000000000 ^S 80.192031997	-951,148.84	-76,274,558	0	6,211,029	6,211,029
-49,845.77000		03/21/2017		-49,845.77	-4,339,671	1.000000000 ^S 80.192031997	-49,845.77	-3,997,234	0	342,437	342,437
-97,972.14000		03/22/2017		-97,972.14	-8,458,699	1.000000000 ^S 80.192031997	-97,972.14	-7,856,585	0	602,114	602,114
-129,338.35000		03/24/2017		-129,338.35	-10,986,556	1.000000000 ^S 80.192031997	-129,338.35	-10,371,905	0	614,651	614,651
-35,149.28000		03/29/2017		-35,149.28	-2,959,437	1.000000000 ^S 80.192031997	-35,149.28	-2,818,692	0	140,745	140,745
-121,963.21000		04/03/2017		-121,963.21	-10,367,407	1.000000000 ^S 80.192031997	-121,963.21	-9,780,478	0	586,929	586,929
-17,011.29000		04/04/2017		-17,011.29	-1,434,849	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,011.29	-1,364,170	0	70,679	70,679
-99,836.86000		04/05/2017		-99,836.86	-8,339,503	1.000000000 ^S 80.192031997	-99,836.86	-8,006,121	0	333,382	333,382
-321,826.20000		04/11/2017		-321,826.20	-26,821,039	1.000000000 ^S 80.192031997	-321,826.20	-25,807,897	0	1,013,142	1,013,142
-2,535.89000		04/13/2017		-2,535.89	-208,025	1.000000000 ^S 80.192031997	-2,535.89	-203,358	0	4,667	4,667

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-17,906.57000		04/24/2017		-17,906.57	-1,469,466	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,906.57	-1,435,964	0	33,502	33,502
-97,737.47000		04/26/2017		-97,737.47	-8,168,487	1.000000000 ^S 80.192031997	-97,737.47	-7,837,766	0	330,721	330,721
-72,720.60000		04/26/2017		-72,720.60	-6,077,682	1.000000000 ^S 80.192031997	-72,720.60	-5,831,613	0	246,069	246,069
-6,131.59000		04/26/2017		-6,131.59	-512,453	1.000000000 ^S 80.192031997	-6,131.59	-491,705	0	20,748	20,748
-5,770,905.72000		05/02/2017		-5,770,905.72	-481,079,087	1.000000000 ^S 80.192031997	-5,770,905.72	-462,780,656	0	18,298,431	18,298,431
-757,937.72000		05/08/2017		-757,937.72	-63,229,524	1.000000000 ^S 80.192031997	-757,937.72	-60,780,566	0	2,448,958	2,448,958
-93,372.59000		05/11/2017		-93,372.59	-7,870,999	1.000000000 ^S 80.192031997	-93,372.59	-7,487,738	0	383,261	383,261
-277,865.98000		05/12/2017		-277,865.98	-23,283,752	1.000000000 ^S 80.192031997	-277,865.98	-22,282,638	0	1,001,114	1,001,114
-83,218.51000		05/12/2017		-83,218.51	-6,973,287	1.000000000 ^S 80.192031997	-83,218.51	-6,673,461	0	299,826	299,826
-87,633.54000		05/15/2017		-87,633.54	-7,339,187	1.000000000 ^S 80.192031997	-87,633.54	-7,027,512	0	311,675	311,675
-161,718.79000		05/16/2017		-161,718.79	-13,634,189	1.000000000 ^S 80.192031997	-161,718.79	-12,968,558	0	665,631	665,631
-51,805.98000		05/17/2017		-51,805.98	-4,351,820	1.000000000 ^S 80.192031997	-51,805.98	-4,154,427	0	197,393	197,393
-215,576.55000		05/19/2017		-215,576.55	-17,787,680	1.000000000 ^S 80.192031997	-215,576.55	-17,287,522	0	500,158	500,158
-339,293.20000		05/22/2017		-339,293.20	-28,164,073	1.000000000 ^S 80.192031997	-339,293.20	-27,208,611	0	955,462	955,462
-105,085.63000		05/24/2017		-105,085.63	-8,748,278	1.000000000 ^S 80.192031997	-105,085.63	-8,427,030	0	321,248	321,248

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-35,824.15000		05/26/2017		-35,824.15	-2,994,583	1.000000000 ^S 80.192031997	-35,824.15	-2,872,811	0	121,772	121,772
-85,534.03000		06/01/2017		-85,534.03	-7,041,589	1.000000000 ^S 80.192031997	-85,534.03	-6,859,148	0	182,441	182,441
-184,424.56000		06/06/2017		-184,424.56	-15,242,969	1.000000000 ^S 80.192031997	-184,424.56	-14,789,380	0	453,589	453,589
-268,856.14000		06/09/2017		-268,856.14	-22,316,945	1.000000000 ^S 80.192031997	-268,856.14	-21,560,120	0	756,825	756,825
-48,274.55000		06/16/2017		-48,274.55	-4,048,407	1.000000000 ^S 80.192031997	-48,274.55	-3,871,234	0	177,173	177,173
-28,558.93000		06/19/2017		-28,558.93	-2,409,398	1.000000000 ^S 80.192031997	-28,558.93	-2,290,199	0	119,199	119,199
-32,535.99000		06/22/2017		-32,535.99	-2,741,102	1.000000000 ^S 80.192031997	-32,535.99	-2,609,127	0	131,975	131,975
-36,028.00000		06/27/2017		-36,028.00	-3,046,343	1.000000000 ^S 80.192031997	-36,028.00	-2,889,159	0	157,184	157,184
-85,677.03000		06/28/2017		-85,677.03	-7,298,656	1.000000000 ^S 80.192031997	-85,677.03	-6,870,615	0	428,041	428,041
-50,207.38000		06/29/2017		-50,207.38	-4,284,996	1.000000000 ^S 80.192031997	-50,207.38	-4,026,232	0	258,764	258,764
-17,179.10000		06/30/2017		-17,179.10	-1,485,268	1.000000000 ^S 80.192031997	-17,179.10	-1,377,627	0	107,641	107,641
-24,916.13000		07/06/2017		-24,916.13	-2,139,501	1.000000000 ^S 80.192031997	-24,916.13	-1,998,075	0	141,426	141,426
-70,337.04000		07/07/2017		-70,337.04	-6,033,979	1.000000000 ^S 80.192031997	-70,337.04	-5,640,470	0	393,509	393,509
-268,122.83000		07/11/2017		-268,122.83	-23,253,058	1.000000000 ^S 80.192031997	-268,122.83	-21,501,315	0	1,751,743	1,751,743
-94,299.32000		07/12/2017		-94,299.32	-8,216,368	1.000000000 ^S 80.192031997	-94,299.32	-7,562,054	0	654,314	654,314

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-48,129.04000		07/13/2017		-48,129.04	-4,176,056	1.000000000 ^S 80.192031997	-48,129.04	-3,859,566	0	316,490	316,490
-94,307.37000		07/14/2017		-94,307.37	-8,260,227	1.000000000 ^S 80.192031997	-94,307.37	-7,562,700	0	697,527	697,527
-224,064.11000		07/18/2017		-224,064.11	-19,759,163	1.000000000 ^S 80.192031997	-224,064.11	-17,968,156	0	1,791,007	1,791,007
-62,985.03000		07/18/2017		-62,985.03	-5,554,354	1.000000000 ^S 80.192031997	-62,985.03	-5,050,898	0	503,456	503,456
-5,310.71000		07/18/2017		-5,310.71	-468,327	1.000000000 ^S 80.192031997	-5,310.71	-425,877	0	42,450	42,450
-84,652.73000		07/19/2017		-84,652.73	-7,503,258	1.000000000 ^S 80.192031997	-84,652.73	-6,788,474	0	714,784	714,784
-57,508.35000		07/24/2017		-57,508.35	-5,058,492	1.000000000 ^S 80.192031997	-57,508.35	-4,611,711	0	446,781	446,781
-34,173.40000		07/27/2017		-34,173.40	-3,033,016	1.000000000 ^S 80.192031997	-34,173.40	-2,740,434	0	292,582	292,582
-42,955.96000		07/28/2017		-42,955.96	-3,821,788	1.000000000 ^S 80.192031997	-42,955.96	-3,444,726	0	377,062	377,062
-34,563.35000		08/01/2017		-34,563.35	-3,048,960	1.000000000 ^S 80.192031997	-34,563.35	-2,771,705	0	277,255	277,255
-11,898.68000		08/02/2017		-11,898.68	-1,046,921	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,898.68	-954,179	0	92,742	92,742
-251,943.26000		08/08/2017		-251,943.26	-22,077,618	1.000000000 ^S 80.192031997	-251,943.26	-20,203,842	0	1,873,776	1,873,776
-129,223.68000		08/08/2017		-129,223.68	-11,323,784	1.000000000 ^S 80.192031997	-129,223.68	-10,362,709	0	961,075	961,075
-26,983.86000		08/09/2017		-26,983.86	-2,360,030	1.000000000 ^S 80.192031997	-26,983.86	-2,163,891	0	196,139	196,139
-5,436.08000		08/10/2017		-5,436.08	-470,606	1.000000000 ^S 80.192031997	-5,436.08	-435,930	0	34,676	34,676

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-261,862.81000		08/14/2017		-261,862.81	-22,503,263	1.000000000 ^S 80.192031997	-261,862.81	-20,999,311	0	1,503,952	1,503,952
-38,687.10000		08/14/2017		-38,687.10	-3,324,588	1.000000000 ^S 80.192031997	-38,687.10	-3,102,397	0	222,191	222,191
-234,673.89000		08/16/2017		-234,673.89	-20,287,202	1.000000000 ^S 80.192031997	-234,673.89	-18,818,976	0	1,468,226	1,468,226
-151,106.11000		08/17/2017		-151,106.11	-13,198,995	1.000000000 ^S 80.192031997	-151,106.11	-12,117,506	0	1,081,489	1,081,489
-23,853.89000		08/18/2017		-23,853.89	-2,076,341	1.000000000 ^S 80.192031997	-23,853.89	-1,912,892	0	163,449	163,449
-128,055.35000		08/22/2017		-128,055.35	-11,058,464	1.000000000 ^S 80.192031997	-128,055.35	-10,269,019	0	789,445	789,445
-20,640.91000		08/23/2017		-20,640.91	-1,790,067	1.000000000 ^S 80.192031997	-20,640.91	-1,655,237	0	134,830	134,830
-47,297.81000		08/29/2017		-47,297.81	-4,106,488	1.000000000 ^S 80.192031997	-47,297.81	-3,792,907	0	313,581	313,581
-1,347,714.81000		08/30/2017		-1,347,714.81	-116,950,732	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,347,714.81	-108,075,989	0	8,874,743	8,874,743
-1,203,000.00000		08/30/2017		-1,203,000.00	-104,392,806	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,203,000.00	-96,471,014	0	7,921,792	7,921,792
-30,083.55000		08/30/2017		-30,083.55	-2,610,562	1.000000000 ^S 80.192031997	-30,083.55	-2,412,461	0	198,101	198,101
-83,968.93000		09/05/2017		-83,968.93	-7,314,593	1.000000000 ^S 80.192031997	-83,968.93	-6,733,639	0	580,954	580,954
-61,112.18000		09/08/2017		-61,112.18	-5,325,375	1.000000000 ^S 80.192031997	-61,112.18	-4,900,710	0	424,665	424,665
-245,747.74000		09/11/2017		-245,747.74	-21,382,314	1.000000000 ^S 80.192031997	-245,747.74	-19,707,011	0	1,675,303	1,675,303
-18,460.20000		09/11/2017		-18,460.20	-1,606,207	1.000000000 ^S 80.192031997	-18,460.20	-1,480,361	0	125,846	125,846

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-110,577.39000		09/12/2017		-110,577.39	-9,667,378	1.000000000\$ 80.192031997	-110,577.39	-8,867,426	0	799,952	799,952
-140,374.85000		09/14/2017		-140,374.85	-12,413,249	1.000000000\$ 80.192031997	-140,374.85	-11,256,944	0	1,156,305	1,156,305
-93,807.37000		09/15/2017		-93,807.37	-8,281,886	1.000000000\$ 80.192031997	-93,807.37	-7,522,604	0	759,282	759,282
-94,643.60000		09/20/2017		-94,643.60	-8,441,750	1.000000000\$ 80.192031997	-94,643.60	-7,589,663	0	852,087	852,087
-37,527.78000		09/26/2017		-37,527.78	-3,332,691	1.000000000\$ 80.192031997	-37,527.78	-3,009,429	0	323,262	323,262
-20,531.50000		09/28/2017		-20,531.50	-1,818,416	1.000000000\$ 80.192031997	-20,531.50	-1,646,463	0	171,953	171,953
-233,742.95000		09/29/2017		-233,742.95	-20,642,355	1.000000000\$ 80.192031997	-233,742.95	-18,744,322	0	1,898,033	1,898,033
-149,591.47000		10/05/2017		-149,591.47	-13,246,493	1.000000000\$ 80.192031997	-149,591.47	-11,996,044	0	1,250,449	1,250,449
-25,802.59000		10/06/2017		-25,802.59	-2,268,258	1.000000000\$ 80.192031997	-25,802.59	-2,069,162	0	199,096	199,096
-250,526.60000		10/12/2017		-250,526.60	-21,872,667	1.000000000\$ 80.192031997	-250,526.60	-20,090,237	0	1,782,430	1,782,430
-150,522.57000		10/12/2017		-150,522.57	-13,141,639	1.000000000\$ 80.192031997	-150,522.57	-12,070,711	0	1,070,928	1,070,928
-58,012.04000		10/16/2017		-58,012.04	-5,122,230	1.000000000\$ 80.192031997	-58,012.04	-4,652,103	0	470,127	470,127
-4,891.40000		10/16/2017		-4,891.40	-431,891	1.000000000\$ 80.192031997	-4,891.40	-392,251	0	39,640	39,640
-8,629.54000		10/19/2017		-8,629.54	-763,983	1.000000000\$ 80.192031997	-8,629.54	-692,020	0	71,963	71,963
-79,173.19000		10/20/2017		-79,173.19	-7,021,242	1.000000000\$ 80.192031997	-79,173.19	-6,349,059	0	672,183	672,183

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-73,221.02000		10/24/2017		-73,221.02	-6,498,544	1.000000000 ^S 80.192031997	-73,221.02	-5,871,742	0	626,802	626,802
-53,753.51000		10/24/2017		-53,753.51	-4,770,755	1.000000000 ^S 80.192031997	-53,753.51	-4,310,603	0	460,152	460,152
-1,778,714.81000		10/25/2017		-1,778,714.81	-157,587,713	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,778,714.81	-142,638,755	0	14,948,958	14,948,958
-1,390,000.00000		10/25/2017		-1,390,000.00	-123,148,983	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,390,000.00	-111,466,924	0	11,682,059	11,682,059
-59,387.12000		10/25/2017		-59,387.12	-5,261,485	1.000000000 ^S 80.192031997	-59,387.12	-4,762,374	0	499,111	499,111
-7,958.77000		10/31/2017		-7,958.77	-691,905	1.000000000 ^S 80.192031997	-7,958.77	-638,230	0	53,675	53,675
-30,242.86000		11/02/2017		-30,242.86	-2,647,087	1.000000000 ^S 80.192031997	-30,242.86	-2,425,236	0	221,851	221,851
-98,737.84000		11/08/2017		-98,737.84	-8,600,813	1.000000000 ^S 80.192031997	-98,737.84	-7,917,988	0	682,825	682,825
-9,009.98000		11/09/2017		-9,009.98	-785,309	1.000000000 ^S 80.192031997	-9,009.98	-722,529	0	62,780	62,780
-247,808.62000		11/10/2017		-247,808.62	-21,573,723	1.000000000 ^S 80.192031997	-247,808.62	-19,872,277	0	1,701,446	1,701,446
-141,305.97000		11/14/2017		-141,305.97	-12,248,394	1.000000000 ^S 80.192031997	-141,305.97	-11,331,613	0	916,781	916,781
-64,748.95000		11/20/2017		-64,748.95	-5,487,267	1.000000000 ^S 80.192031997	-64,748.95	-5,192,350	0	294,917	294,917
-32,436.77000		11/22/2017		-32,436.77	-2,764,939	1.000000000 ^S 80.192031997	-32,436.77	-2,601,170	0	163,769	163,769
-203,554.78000		11/24/2017		-203,554.78	-17,261,865	1.000000000 ^S 80.192031997	-203,554.78	-16,323,471	0	938,394	938,394
-42,562.46000		11/28/2017		-42,562.46	-3,600,917	1.000000000 ^S 80.192031997	-42,562.46	-3,413,170	0	187,747	187,747

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-99,582.58000		12/01/2017		-99,582.58	-8,459,807	1.000000000 ^S 80.192031997	-99,582.58	-7,985,729	0	474,078	474,078
-47,244.20000		12/07/2017		-47,244.20	-4,017,059	1.000000000 ^S 80.192031997	-47,244.20	-3,788,608	0	228,451	228,451
-13,390.76000		12/08/2017		-13,390.76	-1,135,904	1.000000000 ^S 80.192031997	-13,390.76	-1,073,832	0	62,072	62,072
-246,793.05000		12/11/2017		-246,793.05	-21,044,157	1.000000000 ^S 80.192031997	-246,793.05	-19,790,836	0	1,253,321	1,253,321
-30,330.71000		12/11/2017		-30,330.71	-2,586,314	1.000000000 ^S 80.192031997	-30,330.71	-2,432,281	0	154,033	154,033
-85,954.84000		12/12/2017		-85,954.84	-7,349,616	1.000000000 ^S 80.192031997	-85,954.84	-6,892,893	0	456,723	456,723
-55,703.20000		12/13/2017		-55,703.20	-4,782,497	1.000000000 ^S 80.192031997	-55,703.20	-4,466,953	0	315,544	315,544
-126,098.54000		12/19/2017		-126,098.54	-10,875,723	1.000000000 ^S 80.192031997	-126,098.54	-10,112,098	0	763,625	763,625
-39,931.85000		12/20/2017		-39,931.85	-3,451,152	1.000000000 ^S 80.192031997	-39,931.85	-3,202,216	0	248,936	248,936
-28,911.07000		01/05/2018		-28,911.07	-2,563,200	1.000000000 ^S 80.192031997	-28,911.07	-2,318,437	0	244,763	244,763
-245,282.90000		01/12/2018		-245,282.90	-21,514,923	1.000000000 ^S 80.192031997	-245,282.90	-19,669,734	0	1,845,189	1,845,189
-12,441.34000		01/12/2018		-12,441.34	-1,091,289	1.000000000 ^S 80.192031997	-12,441.34	-997,696	0	93,593	93,593
-35,513.33000		01/16/2018		-35,513.33	-3,129,459	1.000000000 ^S 80.192031997	-35,513.33	-2,847,886	0	281,573	281,573
-56,303.33000		01/22/2018		-56,303.33	-4,983,918	1.000000000 ^S 80.192031997	-56,303.33	-4,515,078	0	468,840	468,840
-73,732.89000		01/24/2018		-73,732.89	-6,506,404	1.000000000 ^S 80.192031997	-73,732.89	-5,912,790	0	593,614	593,614

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-54,860.23000		01/24/2018		-54,860.23	-4,841,026	1.000000000 ^S 80.192031997	-54,860.23	-4,399,353	0	441,673	441,673
-4,625.65000		01/24/2018		-4,625.65	-408,181	1.000000000 ^S 80.192031997	-4,625.65	-370,940	0	37,241	37,241
-104,867.61000		01/29/2018		-104,867.61	-9,216,108	1.000000000 ^S 80.192031997	-104,867.61	-8,409,547	0	806,561	806,561
-315,218.62000		01/30/2018		-315,218.62	-27,821,128	1.000000000 ^S 80.192031997	-315,218.62	-25,278,022	0	2,543,106	2,543,106
-92,606.37000		01/31/2018		-92,606.37	-8,151,384	1.000000000 ^S 80.192031997	-92,606.37	-7,426,293	0	725,091	725,091
-42,223.81000		02/08/2018		-42,223.81	-3,622,522	1.000000000 ^S 80.192031997	-42,223.81	-3,386,013	0	236,509	236,509
-240,819.94000		02/09/2018		-240,819.94	-20,510,385	1.000000000 ^S 80.192031997	-240,819.94	-19,311,840	0	1,198,545	1,198,545
-114,626.90000		02/09/2018		-114,626.90	-9,762,655	1.000000000 ^S 80.192031997	-114,626.90	-9,192,164	0	570,491	570,491
-54,329.53000		02/15/2018		-54,329.53	-4,574,151	1.000000000 ^S 80.192031997	-54,329.53	-4,356,795	0	217,356	217,356
-8,354.61000		02/23/2018		-8,354.61	-701,268	1.000000000 ^S 80.192031997	-8,354.61	-669,973	0	31,295	31,295
-241,131.03000		03/09/2018		-241,131.03	-19,903,757	1.000000000 ^S 80.192031997	-241,131.03	-19,336,787	0	566,970	566,970
-11,810.63000		03/15/2018		-11,810.63	-987,676	1.000000000 ^S 80.192031997	-11,810.63	-947,118	0	40,558	40,558
-71,875.05000		03/23/2018		-71,875.05	-5,825,270	1.000000000 ^S 80.192031997	-71,875.05	-5,763,806	0	61,464	61,464
-42,568.15000		03/26/2018		-42,568.15	-3,447,582	1.000000000 ^S 80.192031997	-42,568.15	-3,413,626	0	33,956	33,956
-50,297.76000		03/27/2018		-50,297.76	-4,076,366	1.000000000 ^S 80.192031997	-50,297.76	-4,033,480	0	42,886	42,886

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-1,535.28000		04/09/2018		-1,535.28	-126,334	1.000000000 ^S 80.192031997	-1,535.28	-123,117	0	3,217	3,217
-88,985.26000		04/10/2018		-88,985.26	-7,326,140	1.000000000 ^S 80.192031997	-88,985.26	-7,135,909	0	190,231	190,231
-240,542.88000		04/11/2018		-240,542.88	-19,991,243	1.000000000 ^S 80.192031997	-240,542.88	-19,289,622	0	701,621	701,621
-106,173.13000		04/12/2018		-106,173.13	-8,804,183	1.000000000 ^S 80.192031997	-106,173.13	-8,514,239	0	289,944	289,944
-160,886.21000		04/16/2018		-160,886.21	-13,449,333	1.000000000 ^S 80.192031997	-160,886.21	-12,901,792	0	547,541	547,541
-51,033.60000		04/17/2018		-51,033.60	-4,256,750	1.000000000 ^S 80.192031997	-51,033.60	-4,092,488	0	164,262	164,262
-4,303.00000		04/17/2018		-4,303.00	-358,916	1.000000000 ^S 80.192031997	-4,303.00	-345,066	0	13,850	13,850
-103,980.92000		04/18/2018		-103,980.92	-8,658,256	1.000000000 ^S 80.192031997	-103,980.92	-8,338,441	0	319,815	319,815
-134,354.93000		04/20/2018		-134,354.93	-11,212,243	1.000000000 ^S 80.192031997	-134,354.93	-10,774,195	0	438,048	438,048
-68,589.85000		04/23/2018		-68,589.85	-5,669,514	1.000000000 ^S 80.192031997	-68,589.85	-5,500,359	0	169,155	169,155
-40,543.60000		05/02/2018		-40,543.60	-3,348,880	1.000000000 ^S 80.192031997	-40,543.60	-3,251,274	0	97,606	97,606
-237,079.40000		05/15/2018		-237,079.40	-19,620,584	1.000000000 ^S 80.192031997	-237,079.40	-19,011,879	0	608,705	608,705
-104,464.09000		05/16/2018		-104,464.09	-8,615,124	1.000000000 ^S 80.192031997	-104,464.09	-8,377,188	0	237,936	237,936
-42,940.74000		05/17/2018		-42,940.74	-3,555,049	1.000000000 ^S 80.192031997	-42,940.74	-3,443,505	0	111,544	111,544
-259,940.71000		05/25/2018		-259,940.71	-21,430,186	1.000000000 ^S 80.192031997	-259,940.71	-20,845,174	0	585,012	585,012

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-40,016.55000		05/29/2018		-40,016.55	-3,302,356	1.000000000 ^S 80.192031997	-40,016.55	-3,209,008	0	93,348	93,348
-7,569.94000		06/04/2018		-7,569.94	-627,097	1.000000000 ^S 80.192031997	-7,569.94	-607,049	0	20,048	20,048
-234,723.65000		06/08/2018		-234,723.65	-19,730,048	1.000000000 ^S 80.192031997	-234,723.65	-18,822,966	0	907,082	907,082
-354,424.37000		06/13/2018		-354,424.37	-29,758,065	1.000000000 ^S 80.192031997	-354,424.37	-28,422,010	0	1,336,055	1,336,055
-26,321.04000		06/21/2018		-26,321.04	-2,136,994	1.000000000 ^S 80.192031997	-26,321.04	-2,110,738	0	26,256	26,256
-62,568.05000		06/27/2018		-62,568.05	-5,082,558	1.000000000 ^S 80.192031997	-62,568.05	-5,017,459	0	65,099	65,099
-33,424.92000		06/28/2018		-33,424.92	-2,725,829	1.000000000 ^S 80.192031997	-33,424.92	-2,680,412	0	45,417	45,417
-59,587.09000		06/29/2018		-59,587.09	-4,831,738	1.000000000 ^S 80.192031997	-59,587.09	-4,778,410	0	53,328	53,328
-230,807.11000		07/11/2018		-230,807.11	-19,164,246	1.000000000 ^S 80.192031997	-230,807.11	-18,508,891	0	655,355	655,355
-12,445.25000		07/11/2018		-12,445.25	-1,033,347	1.000000000 ^S 80.192031997	-12,445.25	-998,010	0	35,337	35,337
-48,245.27000		07/13/2018		-48,245.27	-4,015,011	1.000000000 ^S 80.192031997	-48,245.27	-3,868,886	0	146,125	146,125
-31,820.25000		07/13/2018		-31,820.25	-2,648,107	1.000000000 ^S 80.192031997	-31,820.25	-2,551,731	0	96,376	96,376
-4,067.90000		07/13/2018		-4,067.90	-338,534	1.000000000 ^S 80.192031997	-4,067.90	-326,213	0	12,321	12,321
-64,842.30000		07/19/2018		-64,842.30	-5,396,805	1.000000000 ^S 80.192031997	-64,842.30	-5,199,836	0	196,969	196,969
-779,961.50000		07/23/2018		-779,961.50	-64,630,841	1.000000000 ^S 80.192031997	-779,961.50	-62,546,698	0	2,084,143	2,084,143

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-71,225.84000		07/24/2018		-71,225.84	-5,858,481	1.000000000 ^S 80.192031997	-71,225.84	-5,711,745	0	146,736	146,736
-38,008.43000		08/02/2018		-38,008.43	-3,151,351	1.000000000 ^S 80.192031997	-38,008.43	-3,047,973	0	103,378	103,378
-46,911.01000		08/07/2018		-46,911.01	-3,862,706	1.000000000 ^S 80.192031997	-46,911.01	-3,761,889	0	100,817	100,817
-230,631.58000		08/10/2018		-230,631.58	-18,925,734	1.000000000 ^S 80.192031997	-230,631.58	-18,494,815	0	430,919	430,919
-32,792.89000		08/17/2018		-32,792.89	-2,641,480	1.000000000 ^S 80.192031997	-32,792.89	-2,629,728	0	11,752	11,752
-27,692.84000		08/20/2018		-27,692.84	-2,226,969	1.000000000 ^S 80.192031997	-27,692.84	-2,220,745	0	6,224	6,224
-9,664.19000		08/22/2018		-9,664.19	-784,528	1.000000000 ^S 80.192031997	-9,664.19	-774,991	0	9,537	9,537
-18,900.99000		08/30/2018		-18,900.99	-1,539,099	1.000000000 ^S 80.192031997	-18,900.99	-1,515,709	0	23,390	23,390
-54,937.84000		08/31/2018		-54,937.84	-4,456,768	1.000000000 ^S 80.192031997	-54,937.84	-4,405,577	0	51,191	51,191
718,934.39000	合計 -----			718,934	-177,053,616		718,934	57,652,809	0	234,706,425	234,706,425
0.00000											
24,533.33	BRITISH POUND	08/28/2018		24,533.33	3,511,627	1.000000000 ^S 144.122778740	24,533.33	3,535,812	0	24,185	24,185
	GBP										
258,901.80		08/28/2018		258,901.80	37,058,428	1.000000000 ^S 144.122778740	258,901.80	37,313,647	0	255,219	255,219
283,435.13000	合計 -----			283,435	40,570,055		283,435	40,849,459	0	279,404	279,404
0.00000											
50.00	CANADIAN DOLLAR	08/13/2014		50.00	4,670	1.000000000 ^S 0.011759481	50.00	4,252	0	-418	-418
	CAD										
455,669.36000	EURO	08/29/2018		455,669.36	59,328,793	1.000000000 ^S 129.014697500	455,669.36	58,788,045	0	-540,748	-540,748
	EUR										

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018年8月31日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
3,987,345.80000	UNITED STATES DOLLAR USD	07/23/2018		3,987,345.80	445,924,794	1.000000000\$ 0.009018352	3,987,345.80	442,136,856	0	-3,787,938	-3,787,938
4,025,954.52000		07/23/2018		4,025,954.52	450,242,600	1.000000000\$ 0.009018352	4,025,954.52	446,417,984	0	-3,824,616	-3,824,616
520,000.00000		07/24/2018		520,000.00	57,927,998	1.000000000\$ 0.009018352	520,000.00	57,660,202	0	-267,796	-267,796
5,100,000.00000		07/24/2018		5,100,000.00	570,358,470	1.000000000\$ 0.009018352	5,100,000.00	565,513,522	0	-4,844,948	-4,844,948
750,000.00000		07/27/2018		750,000.00	83,294,999	1.000000000\$ 0.009018352	750,000.00	83,163,753	0	-131,246	-131,246
107,500.00000		07/28/2018		107,500.00	11,929,812	1.000000000\$ 0.009018352	107,500.00	11,920,138	0	-9,674	-9,674
15,003.94000		07/30/2018		15,003.94	1,665,062	1.000000000\$ 0.009018352	15,003.94	1,663,712	0	-1,350	-1,350
260,000.00000		07/30/2018		260,000.00	28,853,498	1.000000000\$ 0.009018352	260,000.00	28,830,101	0	-23,397	-23,397
10,615.87000		07/31/2018		10,615.87	1,188,341	1.000000000\$ 0.009018352	10,615.87	1,177,141	0	-11,200	-11,200
260,000.00000		07/31/2018		260,000.00	28,853,498	1.000000000\$ 0.009018352	260,000.00	28,830,101	0	-23,397	-23,397
120,139.06000		08/01/2018		120,139.06	13,448,367	1.000000000\$ 0.009018352	120,139.06	13,321,620	0	-126,747	-126,747
340,531.58000		08/02/2018		340,531.58	38,131,023	1.000000000\$ 0.009018352	340,531.58	37,759,846	0	-371,177	-371,177
991.08000		08/03/2018		991.08	110,476	1.000000000\$ 0.009018352	991.08	109,896	0	-580	-580
77,000.00000		08/03/2018		77,000.00	8,583,190	1.000000000\$ 0.009018352	77,000.00	8,538,145	0	-45,045	-45,045
207,345.11000		08/03/2018		207,345.11	23,112,758	1.000000000\$ 0.009018352	207,345.11	22,991,463	0	-121,295	-121,295

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
1,598,437.50000		08/03/2018		1,598,437.50	178,177,820	1.000000000 ^S 0.009018352	1,598,437.50	177,242,749	0	-935,071	-935,071
19,433.37000		08/06/2018		19,433.37	2,160,311	1.000000000 ^S 0.009018352	19,433.37	2,154,869	0	-5,442	-5,442
380,000.00000		08/07/2018		380,000.00	42,349,100	1.000000000 ^S 0.009018352	380,000.00	42,136,302	0	-212,798	-212,798
234,461.80000		08/08/2018		234,461.80	26,076,841	1.000000000 ^S 0.009018352	234,461.80	25,998,298	0	-78,543	-78,543
221,584.58000		08/09/2018		221,584.58	24,585,917	1.000000000 ^S 0.009018352	221,584.58	24,570,407	0	-15,510	-15,510
97,166.67000		08/13/2018		97,166.67	10,757,808	1.000000000 ^S 0.009018352	97,166.67	10,774,327	0	16,519	16,519
145,749.98000		08/14/2018		145,749.98	16,142,539	1.000000000 ^S 0.009018352	145,749.98	16,161,487	0	18,948	18,948
28,542.36000		08/15/2018		28,542.36	3,152,932	1.000000000 ^S 0.009018352	28,542.36	3,164,920	0	11,988	11,988
217,316.25000		08/15/2018		217,316.25	24,005,840	1.000000000 ^S 0.009018352	217,316.25	24,097,113	0	91,273	91,273
3,665,117.04000		08/16/2018		3,665,117.04	404,867,159	1.000000000 ^S 0.009018352	3,665,117.04	406,406,519	0	1,539,360	1,539,360
91,800.00000		08/17/2018		91,800.00	10,166,391	1.000000000 ^S 0.009018352	91,800.00	10,179,243	0	12,852	12,852
127,925.00000		08/19/2018		127,925.00	14,129,955	1.000000000 ^S 0.009018352	127,925.00	14,184,964	0	55,009	55,009
121,322.07000		08/20/2018		121,322.07	13,400,628	1.000000000 ^S 0.009018352	121,322.07	13,452,798	0	52,170	52,170
97,166.67000		08/23/2018		97,166.67	10,733,030	1.000000000 ^S 0.009018352	97,166.67	10,774,327	0	41,297	41,297
41,772.50000		08/24/2018		41,772.50	4,645,311	1.000000000 ^S 0.009018352	41,772.50	4,631,944	0	-13,367	-13,367

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
154,521.05000		08/24/2018		154,521.05	17,183,514	1.000000000 ^S 0.009018352	154,521.05	17,134,067	0	-49,447	-49,447
813,960.00000		08/24/2018		813,960.00	90,516,426	1.000000000 ^S 0.009018352	813,960.00	90,255,958	0	-260,468	-260,468
120,750.00000		08/28/2018		120,750.00	13,408,684	1.000000000 ^S 0.009018352	120,750.00	13,389,364	0	-19,320	-19,320
2,329,464.00000		08/28/2018		2,329,464.00	258,675,335	1.000000000 ^S 0.009018352	2,329,464.00	258,302,626	0	-372,709	-372,709
68,016.73000		08/29/2018		68,016.73	7,560,400	1.000000000 ^S 0.009018352	68,016.73	7,542,035	0	-18,365	-18,365
77,733.43000		08/31/2018		77,733.43	8,656,783	1.000000000 ^S 0.009018352	77,733.43	8,619,472	0	-37,311	-37,311
-3,558,651.45000		05/23/2018		-3,558,651.45	-395,081,487	1.000000000 ^S 0.009018352	-3,558,651.45	-394,601,081	0	480,406	480,406
-2,388,981.18000		05/23/2018		-2,388,981.18	-265,224,692	1.000000000 ^S 0.009018352	-2,388,981.18	-264,902,188	0	322,504	322,504
-678,459.52000		05/23/2018		-678,459.52	-75,322,576	1.000000000 ^S 0.009018352	-678,459.52	-75,230,987	0	91,589	91,589
-656,417.62000		05/23/2018		-656,417.62	-72,875,485	1.000000000 ^S 0.009018352	-656,417.62	-72,786,871	0	88,614	88,614
-298,788.78000		05/23/2018		-298,788.78	-33,171,531	1.000000000 ^S 0.009018352	-298,788.78	-33,131,195	0	40,336	40,336
-239,756.03000		05/23/2018		-239,756.03	-26,617,714	1.000000000 ^S 0.009018352	-239,756.03	-26,585,348	0	32,366	32,366
-75,809.59000		05/23/2018		-75,809.59	-8,416,381	1.000000000 ^S 0.009018352	-75,809.59	-8,406,147	0	10,234	10,234
-22,887.78000		05/23/2018		-22,887.78	-2,541,001	1.000000000 ^S 0.009018352	-22,887.78	-2,537,912	0	3,089	3,089
-10,603.34000		05/23/2018		-10,603.34	-1,177,183	1.000000000 ^S 0.009018352	-10,603.34	-1,175,751	0	1,432	1,432

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-19,811.80000		05/24/2018		-19,811.80	-2,178,506	1.000000000 ^S 0.009018352	-19,811.80	-2,196,832	0	-18,326	-18,326
-154,045.23000		05/25/2018		-154,045.23	-16,793,240	1.000000000 ^S 0.009018352	-154,045.23	-17,081,306	0	-288,066	-288,066
-28,101.04000		05/29/2018		-28,101.04	-3,072,989	1.000000000 ^S 0.009018352	-28,101.04	-3,115,984	0	-42,995	-42,995
-2,191.04000		05/30/2018		-2,191.04	-238,495	1.000000000 ^S 0.009018352	-2,191.04	-242,953	0	-4,458	-4,458
-44,802.83000		05/31/2018		-44,802.83	-4,878,804	1.000000000 ^S 0.009018352	-44,802.83	-4,967,962	0	-89,158	-89,158
-18,123.65000		06/08/2018		-18,123.65	-1,993,602	1.000000000 ^S 0.009018352	-18,123.65	-2,009,641	0	-16,039	-16,039
-456,588.66000		06/11/2018		-456,588.66	-49,930,254	1.000000000 ^S 0.009018352	-456,588.66	-50,628,836	0	-698,582	-698,582
-398,459.41000		06/11/2018		-398,459.41	-43,573,530	1.000000000 ^S 0.009018352	-398,459.41	-44,183,173	0	-609,643	-609,643
-94,756.67000		06/12/2018		-94,756.67	-10,414,232	1.000000000 ^S 0.009018352	-94,756.67	-10,507,094	0	-92,862	-92,862
-123,596.31000		06/13/2018		-123,596.31	-13,630,202	1.000000000 ^S 0.009018352	-123,596.31	-13,704,977	0	-74,775	-74,775
-31,009.10000		06/14/2018		-31,009.10	-3,424,180	1.000000000 ^S 0.009018352	-31,009.10	-3,438,444	0	-14,264	-14,264
-203,803.26000		06/15/2018		-203,803.26	-22,472,366	1.000000000 ^S 0.009018352	-203,803.26	-22,598,725	0	-126,359	-126,359
-25,748.85000		06/18/2018		-25,748.85	-2,845,119	1.000000000 ^S 0.009018352	-25,748.85	-2,855,161	0	-10,042	-10,042
-69,267.16000		06/19/2018		-69,267.16	-7,651,597	1.000000000 ^S 0.009018352	-69,267.16	-7,680,689	0	-29,092	-29,092
-32,585.52000		06/20/2018		-32,585.52	-3,579,519	1.000000000 ^S 0.009018352	-32,585.52	-3,613,246	0	-33,727	-33,727

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-1,494,736.60000		06/21/2018		-1,494,736.60	-164,563,019	1.000000000 ^S 0.009018352	-1,494,736.60	-165,743,874	0	-1,180,855	-1,180,855
-757,312.25000		06/21/2018		-757,312.25	-83,376,288	1.000000000 ^S 0.009018352	-757,312.25	-83,974,572	0	-598,284	-598,284
-519,778.11000		06/21/2018		-519,778.11	-57,224,969	1.000000000 ^S 0.009018352	-519,778.11	-57,635,598	0	-410,629	-410,629
-305,973.74000		06/21/2018		-305,973.74	-33,686,178	1.000000000 ^S 0.009018352	-305,973.74	-33,927,899	0	-241,721	-241,721
-271,853.23000		06/21/2018		-271,853.23	-29,929,680	1.000000000 ^S 0.009018352	-271,853.23	-30,144,447	0	-214,767	-214,767
-140,977.28000		06/21/2018		-140,977.28	-15,520,893	1.000000000 ^S 0.009018352	-140,977.28	-15,632,266	0	-111,373	-111,373
-19,918.10000		06/21/2018		-19,918.10	-2,192,883	1.000000000 ^S 0.009018352	-19,918.10	-2,208,619	0	-15,736	-15,736
-6,616.60000		06/21/2018		-6,616.60	-728,455	1.000000000 ^S 0.009018352	-6,616.60	-733,682	0	-5,227	-5,227
-197,405.31000		06/22/2018		-197,405.31	-21,713,598	1.000000000 ^S 0.009018352	-197,405.31	-21,889,289	0	-175,691	-175,691
-366.04000		06/26/2018		-366.04	-40,149	1.000000000 ^S 0.009018352	-366.04	-40,588	0	-439	-439
-191,850.69000		06/27/2018		-191,850.69	-21,081,513	1.000000000 ^S 0.009018352	-191,850.69	-21,273,365	0	-191,852	-191,852
-18,523.55000		06/28/2018		-18,523.55	-2,046,482	1.000000000 ^S 0.009018352	-18,523.55	-2,053,984	0	-7,502	-7,502
-152,665.63000		07/05/2018		-152,665.63	-16,875,659	1.000000000 ^S 0.009018352	-152,665.63	-16,928,329	0	-52,670	-52,670
-470,580.80000		07/11/2018		-470,580.80	-52,352,114	1.000000000 ^S 0.009018352	-470,580.80	-52,180,354	0	171,760	171,760
-30,090.81000		07/11/2018		-30,090.81	-3,347,603	1.000000000 ^S 0.009018352	-30,090.81	-3,336,620	0	10,983	10,983

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-76,522.13000		07/12/2018		-76,522.13	-8,516,148	1.000000000 ^S 0.009018352	-76,522.13	-8,485,157	0	30,991	30,991
-139,140.93000		07/13/2018		-139,140.93	-15,641,528	1.000000000 ^S 0.009018352	-139,140.93	-15,428,643	0	212,885	212,885
-43,254.05000		07/13/2018		-43,254.05	-4,862,404	1.000000000 ^S 0.009018352	-43,254.05	-4,796,226	0	66,178	66,178
-11,731.95000		07/13/2018		-11,731.95	-1,318,847	1.000000000 ^S 0.009018352	-11,731.95	-1,300,897	0	17,950	17,950
-34,901.31000		07/17/2018		-34,901.31	-3,922,558	1.000000000 ^S 0.009018352	-34,901.31	-3,870,032	0	52,526	52,526
-339,650.57000		07/18/2018		-339,650.57	-38,324,474	1.000000000 ^S 0.009018352	-339,650.57	-37,662,155	0	662,319	662,319
-1,057,037.08000		07/19/2018		-1,057,037.08	-119,217,931	1.000000000 ^S 0.009018352	-1,057,037.08	-117,209,561	0	2,008,370	2,008,370
-889,699.38000		07/19/2018		-889,699.38	-100,344,748	1.000000000 ^S 0.009018352	-889,699.38	-98,654,320	0	1,690,428	1,690,428
-354,322.26000		07/19/2018		-354,322.26	-39,962,237	1.000000000 ^S 0.009018352	-354,322.26	-39,289,025	0	673,212	673,212
-346,729.78000		07/19/2018		-346,729.78	-39,105,919	1.000000000 ^S 0.009018352	-346,729.78	-38,447,133	0	658,786	658,786
-187,007.29000		07/19/2018		-187,007.29	-21,091,618	1.000000000 ^S 0.009018352	-187,007.29	-20,736,304	0	355,314	355,314
-8,454.18000		07/19/2018		-8,454.18	-953,504	1.000000000 ^S 0.009018352	-8,454.18	-937,442	0	16,062	16,062
-1,187.20000		07/19/2018		-1,187.20	-133,898	1.000000000 ^S 0.009018352	-1,187.20	-131,643	0	2,255	2,255
-180,681.74000		07/23/2018		-180,681.74	-20,206,541	1.000000000 ^S 0.009018352	-180,681.74	-20,034,896	0	171,645	171,645
-319,562.40000		07/24/2018		-319,562.40	-35,599,250	1.000000000 ^S 0.009018352	-319,562.40	-35,434,678	0	164,572	164,572

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-1,790.26000		07/25/2018		-1,790.26	-198,907	1.000000000 ^S 0.009018352	-1,790.26	-198,513	0	394	394
-71,206.18000		07/26/2018		-71,206.18	-7,899,970	1.000000000 ^S 0.009018352	-71,206.18	-7,895,698	0	4,272	4,272
-4,322.84000		07/27/2018		-4,322.84	-480,095	1.000000000 ^S 0.009018352	-4,322.84	-479,338	0	757	757
-89,749.30000		07/31/2018		-89,749.30	-9,959,928	1.000000000 ^S 0.009018352	-89,749.30	-9,951,852	0	8,076	8,076
-33,567.51000		08/07/2018		-33,567.51	-3,740,931	1.000000000 ^S 0.009018352	-33,567.51	-3,722,133	0	18,798	18,798
-470,236.12000		08/10/2018		-470,236.12	-52,156,240	1.000000000 ^S 0.009018352	-470,236.12	-52,142,134	0	14,106	14,106
-203,646.70000		08/10/2018		-203,646.70	-22,587,474	1.000000000 ^S 0.009018352	-203,646.70	-22,581,365	0	6,109	6,109
-91,628.65000		08/17/2018		-91,628.65	-10,147,415	1.000000000 ^S 0.009018352	-91,628.65	-10,160,243	0	-12,828	-12,828
-4,182.10000		08/21/2018		-4,182.10	-461,850	1.000000000 ^S 0.009018352	-4,182.10	-463,732	0	-1,882	-1,882
-23,232.52000		08/22/2018		-23,232.52	-2,566,845	1.000000000 ^S 0.009018352	-23,232.52	-2,576,138	0	-9,293	-9,293
-187,649.16000		08/24/2018		-187,649.16	-20,867,526	1.000000000 ^S 0.009018352	-187,649.16	-20,807,478	0	60,048	60,048
-1,371.30000		08/28/2018		-1,371.30	-152,276	1.000000000 ^S 0.009018352	-1,371.30	-152,057	0	219	219
-17,625.72000		08/30/2018		-17,625.72	-1,968,529	1.000000000 ^S 0.009018352	-17,625.72	-1,954,428	0	14,101	14,101
7,032,682.79000 0.00000	合計 -----			7,032,683	790,803,851		7,032,683	779,819,059	0	-10,984,792	-10,984,792
8,490,771.67000	非グループ化の有価証券小計			8,490,772	713,653,753		8,490,772	937,113,624	0	223,459,871	223,459,871
8,490,771.67000	外貨建現金勘定合計			8,490,772	713,653,753		8,490,772	937,113,624	0	223,459,871	223,459,871

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-449,616.57000	AUD FORWARD 26 SEP FAU26SEP	07/05/2018		-449,616.57	-36,727,657	1.000000000F 80.044190797	-449,616.57	-35,989,195	0	738,462	738,462
-690,000.00000		07/19/2018		-690,000.00	-57,208,210	1.000000000F 80.044190797	-690,000.00	-55,230,492	0	1,977,718	1,977,718
-1,139,616.57000 0.00000	合計 -----			-1,139,617	-93,935,867		-1,139,617	-91,219,687	0	2,716,180	2,716,180
578,645.08000	EUR FORWARD 26 SEP FEU26SEP	07/06/2018		578,645.08	75,000,007	1.000000000F 129.028378889	578,645.08	74,661,637	0	-338,370	-338,370
165,354.92000	FEU26SEP	08/06/2018		165,354.92	21,276,316	1.000000000F 129.028378889	165,354.92	21,335,477	0	59,161	59,161
1,160,645.08000	FEU26SEP	08/06/2018		1,160,645.08	149,334,051	1.000000000F 129.028378889	1,160,645.08	149,756,153	0	422,102	422,102
3,214,000.00000		08/14/2018		3,214,000.00	406,371,336	1.000000000F 129.028378889	3,214,000.00	414,697,210	0	8,325,874	8,325,874
-26,079,453.34000		07/05/2018		-26,079,453.34	-3,387,342,358	1.000000000F 129.028378889	-26,079,453.34	-3,364,989,587	0	22,352,771	22,352,771
-26,079,453.34000		07/05/2018		-26,079,453.34	-3,389,536,176	1.000000000F 129.028378889	-26,079,453.34	-3,364,989,587	0	24,546,589	24,546,589
-578,645.08000		07/31/2018		-578,645.08	-75,814,496	1.000000000F 129.028378889	-578,645.08	-74,661,637	0	1,152,859	1,152,859
-165,354.92000		07/31/2018		-165,354.92	-21,665,744	1.000000000F 129.028378889	-165,354.92	-21,335,477	0	330,267	330,267
-3,434,483.21000		08/23/2018		-3,434,483.21	-441,754,430	1.000000000F 129.028378889	-3,434,483.21	-443,145,801	0	-1,391,371	-1,391,371
-51,218,744.81000 0.00000	合計 -----			-51,218,745	-6,664,131,494		-51,218,745	-6,608,671,612	0	55,459,882	55,459,882
137,855.00	GBP FORWARD 26 SEP FGB26SEP	08/06/2018		137,855.00	19,845,772	1.000000000F 144.012099321	137,855.00	19,852,788	0	7,016	7,016
1,048,145.00		08/06/2018		1,048,145.00	150,854,795	1.000000000F 144.012099321	1,048,145.00	150,945,562	0	90,767	90,767

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・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
3,095,000.00		08/23/2018		3,095,000.00	441,754,429	1.000000000F 144.012099321	3,095,000.00	445,717,447	0	3,963,018	3,963,018
-13,908,958.59		07/05/2018		-13,908,958.59	-2,043,309,294	1.000000000F 144.012099321	-13,908,958.59	-2,003,058,326	0	40,250,968	40,250,968
-13,908,958.58		07/05/2018		-13,908,958.58	-2,042,741,190	1.000000000F 144.012099321	-13,908,958.58	-2,003,058,324	0	39,682,866	39,682,866
-23,536,917.17000 0.00000	合計 -----			-23,536,917	-3,473,595,488		-23,536,917	-3,389,600,853	0	83,994,635	83,994,635
332,256.75000	USD FORWARD 26 SEP FUS26SEP	07/05/2018		332,256.75	36,727,657	1.000000000F 0.009034793	332,256.75	36,775,248	0	47,591	47,591
2,642,770.20000		07/05/2018		2,642,770.20	290,943,896	1.000000000F 0.009034793	2,642,770.20	292,510,321	0	1,566,425	1,566,425
18,479,657.96000		07/05/2018		18,479,657.96	2,042,741,166	1.000000000F 0.009034793	18,479,657.96	2,045,388,086	0	2,646,920	2,646,920
18,484,797.33000		07/05/2018		18,484,797.33	2,043,309,272	1.000000000F 0.009034793	18,484,797.33	2,045,956,928	0	2,647,656	2,647,656
30,643,592.39000		07/05/2018		30,643,592.39	3,387,342,330	1.000000000F 0.009034793	30,643,592.39	3,391,731,542	0	4,389,212	4,389,212
30,663,438.85000		07/05/2018		30,663,438.85	3,389,536,158	1.000000000F 0.009034793	30,663,438.85	3,393,928,212	0	4,392,054	4,392,054
507,232.59000		07/19/2018		507,232.59	57,208,210	1.000000000F 0.009034793	507,232.59	56,142,137	0	-1,066,073	-1,066,073
2,336,990.83000		08/09/2018		2,336,990.83	259,000,001	1.000000000F 0.009034793	2,336,990.83	258,665,675	0	-334,326	-334,326
-1,742,646.00000		07/31/2018		-1,742,646.00	-194,373,865	1.000000000F 0.009034793	-1,742,646.00	-192,881,674	0	1,492,191	1,492,191
-171,354.00000		07/31/2018		-171,354.00	-19,110,489	1.000000000F 0.009034793	-171,354.00	-18,966,013	0	144,476	144,476
-1,142,300.00000		08/06/2018		-1,142,300.00	-126,855,385	1.000000000F 0.009034793	-1,142,300.00	-126,433,445	0	421,940	421,940

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2018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											
-965,700.00000		08/06/2018		-965,700.00	-107,239,537	1.000000000F 0.009034793	-965,700.00	-106,886,788	0	352,749	352,749
-2,000,000.00000		08/10/2018		-2,000,000.00	-221,167,761	1.000000000F 0.009034793	-2,000,000.00	-221,366,444	0	-198,683	-198,683
-3,675,826.09000		08/14/2018		-3,675,826.09	-406,371,338	1.000000000F 0.009034793	-3,675,826.09	-406,852,275	0	-480,937	-480,937
94,392,910.81000 0.00000	合計 -----			94,392,911	10,431,690,315		94,392,911	10,447,711,510	0	16,021,195	16,021,195
18,497,632.26000	非グループ化の有価証券小計			18,497,632	200,027,466		18,497,632	358,219,358	0	158,191,892	158,191,892
18,497,632.26000	先物（ポジション）合計			18,497,632	200,027,466		18,497,632	358,219,358	0	158,191,892	158,191,892
証拠金勘定											
証拠金勘定											
140,000.00	USD MARGIN	08/14/2018		140,000.00	15,505,700	1.000000000S 0.009018352	140,000.00	15,523,901	0	18,201	18,201
260,000.00	USD MAR	08/20/2018		260,000.00	28,718,299	1.000000000S 0.009018352	260,000.00	28,830,101	0	111,802	111,802
420,000.00		08/22/2018		420,000.00	46,403,702	1.000000000S 0.009018352	420,000.00	46,571,702	0	168,000	168,000
590,000.00		08/23/2018		590,000.00	65,171,399	1.000000000S 0.009018352	590,000.00	65,422,153	0	250,754	250,754
430,000.00		08/28/2018		430,000.00	47,749,351	1.000000000S 0.009018352	430,000.00	47,680,552	0	-68,799	-68,799
1,840,000.00000 0.00000	合計 -----			1,840,000	203,548,451		1,840,000	204,028,409	0	479,958	479,958
1,840,000.00000	証拠金勘定小計			1,840,000	203,548,451		1,840,000	204,028,409	0	479,958	479,958
1,840,000.00000	証拠金勘定合計			1,840,000	203,548,451		1,840,000	204,028,409	0	479,958	479,958
566,640,574.93000	クラスに割当てられていない資産合計			573,732,177	36,030,847,173		570,566,229	36,159,259,349	-317,560,031	445,972,210	128,412,179
1,181,657,864.28000	ポートフォリオ合計			1,188,749,467	23,473,361,314		1,185,583,518	22,969,929,370	-317,560,031	-185,871,910	-503,431,941

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（2018年9月末日現在）

払込済資本金の額	187,117,965.90米ドル（約213億円）
発行済株式総数	5,051,655株

（２）事業の内容及び営業の状況

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

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

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

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

管理会社は、2018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	55	5,074,163,077.60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、2018年9月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝113.57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）

2018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	4,279,499,530	486,022,762
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,379,029,912	270,186,427
040	その他の要求払預金	1,900,469,617	215,836,334
050	売買目的で保有される金融資産	22,937,469	2,605,008
060	デリバティブ	22,937,469	2,605,008
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
096	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産	0	0
097	持分証券		
098	債務証券		
099	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産	0	0
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
141	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産	14,570	1,655
142	持分証券	14,570	1,655
143	債務証券		
144	ローンおよび貸付金		
181	償却後原価における金融資産	2,188,797,422	248,581,723
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	2,188,797,422	248,581,723
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、合弁会社および関連会社への投資		
270	有形資産	811,922	92,210
280	有形固定資産	811,922	92,210
290	投資不動産		
300	無形資産	3,102,911	352,398
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,102,911	352,398
330	税金資産	781	89
340	現行税金資産	781	89
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	22,293,804	2,531,907
370	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
380	資産合計	6,517,458,408	740,187,751

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）

2018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	23,820,080	2,705,246
020	デリバティブ	23,820,080	2,705,246
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した金融負債	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	6,095,386,173	692,253,008
120	預金	6,095,386,173	692,253,008
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	0	0
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金		
240	税金負債	15,054,113	1,709,696
250	現行税金負債	15,054,113	1,709,696
260	繰延税金負債		
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	20,180,190	2,291,864
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	6,154,440,556	698,959,814

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）

2018年6月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
010	資本	187,117,966	21,250,987
020	払込資本	187,117,966	21,250,987
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（一）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、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
320	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動		
330	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性		
340	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕		
350	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕		
360	負債の信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動		
128	損益に再分類されることがある項目	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・ヘッジ準備金〔有効部分〕		
155	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動		
165	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
180	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	3,259	370
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	158,191,749	17,965,837
220	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の準備金または累積損失		
230	その他	158,191,749	17,965,837
240	（一）自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	17,704,878	2,010,743

米ドル

千円

260	(一) 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	363,017,853	41,227,938
310	資本および負債合計	6,517,458,408	740,187,751

(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

2018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	38,370,885	4,357,781
020	売買目的で保有される金融資産	18,514,145	2,102,651
025	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
030	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産		
041	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
051	償却後原価における金融資産	16,501,150	1,874,036
070	デリバティブヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	909,780	103,324
085	負債に係る利息収益	2,445,810	277,771
090	(支払利息)	18,287,902	2,076,957
100	(売買目的で保有される金融負債)	212,615	24,147
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	11,892,224	1,350,600
130	(デリバティブヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	0	0
145	(資産に係る支払利息)	6,183,063	702,210
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	92	10
170	売買目的で保有される金融資産		
175	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
191	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産	92	10
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	56,423,901	6,408,062
210	(支払手数料)	28,467,551	3,233,060
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(一)損失、純額	0	0
231	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
241	償却後原価における金融資産		
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (一)損失、純額	2,440,541	277,172
287	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保 有以外の金融資産に係る利益または(一)損失、純額		
290	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した 金融資産および負債に係る利益または(一)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(一)損失、純額		
310	為替差額〔利益または(一)損失〕、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(一)損失、純額		
340	その他の事業収益	1,491,772	169,421
350	(その他の事業費用)	1,399,998	158,998
355	事業収益合計、純額	50,571,740	5,743,433

米ドル

千円

360	(管理費用)	25,508,536	2,897,004
370	(従業員費用)	10,251,013	1,164,208
380	(その他の管理費用)	15,257,523	1,732,797
390	(減価償却)	904,300	102,701
400	(有形固定資産)	148,413	16,855
410	(投資不動産)		
420	(その他の無形資産)	755,888	85,846
425	修正利益または(一) 損失、純額	0	0
426	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
427	償却後原価における金融資産		
430	(引当金または(一) 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(一) 減損の戻入)	411,503	46,734
481	(その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産)		
491	(償却後原価における金融資産)	411,503	46,734
510	(子会社、合弁会社および関連会社への投資の減損または(一) 減損の戻入)		
520	(非金融資産に係る減損または(一) 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	持分法を用いて計上される子会社、合弁会社および関連会社への投資の利益または(一) 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(一) 損失		
610	継続事業からの税引前利益または(一) 損失	23,747,401	2,696,992
620	(継続事業からの損益に関する税金費用または(一) 収入)	6,042,522	686,249
630	継続事業からの税引後利益または(一) 損失	17,704,879	2,010,743
640	非継続事業からの税引後利益または(一) 損失	0	0
650	非継続事業からの税引前利益または(一) 損失	0	0
660	(非継続事業に関する税金費用または(一) 収入)	0	0
670	当期利益または(一) 損失	17,704,879	2,010,743
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	17,704,879	2,010,743

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

③ 管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

(iii) 資本金の額(2018年6月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約207億円)

発行済株式総数 5,051,655株(一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(iv) 会社の沿革

(後略)

<訂正後>

(前略)

(iii) 資本金の額(2018年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約213億円)

発行済株式総数 5,051,655株(一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(注) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2018年9月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値

(1米ドル=113.57円)による。

(iv) 会社の沿革

(後略)

2 投資方針

(5) 投資制限

<訂正前>

(前略)

- (イ) 管理会社および投資顧問会社は、ファンドについて、空売りされる有価証券の時価総額が、ファンドの純資産総額を超えることとなるような空売りを行わないものとする。

(中略)

- (ハ) 管理会社の運用する証券投資信託およびミューチュアル・ファンドの全体において、一発行会社の議決権総数の50%(買付時点において計算される。))を超えて投資を行ってはならない。また、管理会社の運用する証券投資信託および／またはミューチュアル・ファンドの全体において、一発行会社の発行済株式総数の50%を超えて投資を行ってはならない。

- (ニ) ファンドは、私募株式、非上場株式、不動産、証券化関連商品等、流動性に欠ける資産の取得の結果、当該資産がファンドの純資産の15%を超える場合、投資を行わない。ただし、かかる投資対象の評価方法が開示書面において明確に開示され、価格の透明性を確保

する適切な方法がとられている場合、管理会社および投資顧問会社はかかる制限を受けない。

（中略）

- （ヘ）管理会社または投資顧問会社が投資顧問会社、管理会社またはファンド以外の第三者の利益を図る目的で行う取引等、受益者の利益を害し、またはファンドの資産の適正な運用を害するファンドのための管理会社または投資顧問会社の取引は、すべて禁止される。
- （ト）他の投資信託に対する投資を行う投資信託（いわゆるファンド・オブ・ファンズ）への投資、または（直接的もしくは間接的に）ファンドとの間で相互および循環保有となる投資信託への投資を行わない。これらの場合以外における他の投資信託への投資は、ファンドの純資産総額の5%を超えないものとする。かかる制限は、上場投資信託（ETF）に対する投資には適用されない。
- （チ）管理会社および投資顧問会社またはその取締役は、ファンドとの間で取引を行ってはならない。

ファンドの投資対象の価値の変化、再構成、合併、ファンドの資産からの支払またはファンドの受益証券の買戻しの結果としてファンドに適用される制限を超えた場合、管理会社は、直ちにファンドの投資対象を売却する必要はない。しかし、管理会社は、ファンドの受益者の利益を考慮した上で、違反が判明してから合理的な期間内にファンドに適用ある制限を遵守するために合理的に可能な措置を講じるものとする。

<訂正後>

（前略）

- （イ）ファンドは、空売りされる有価証券の時価総額が、ファンドの純資産総額を超えることとなるような空売りを行わないものとする。

（中略）

- （ハ）ファンドおよび管理会社の運用するミューチュアル・ファンドの全体において、一発行会社の議決権総数の50%を超えて投資を行ってはならない。かかる制限は、他の投資信託に対する投資には適用されない。

（注）上記の比率の計算は、買付時点基準または時価基準のいずれかによることができる。

- （ニ）ファンドは、私募株式、非上場株式、不動産、証券化関連商品等、流動性に欠ける資産の取得の結果、当該資産がファンドの純資産総額の15%を超える場合、投資を行わない。ただし、かかる投資対象の評価方法が開示書面において明確に開示され、価格の透明性を確保する適切な方法がとられている場合、ファンドはかかる制限を受けない。

（中略）

- （ヘ）管理会社、投資顧問会社または副投資顧問会社が管理会社、投資顧問会社、副投資顧問会社またはファンド以外の第三者の利益を図る目的で行う取引等、受益者の利益を害し、またはファンドの資産の適正な運用を害するファンドのための管理会社、投資顧問会社または副投資顧問会社の取引は、すべて禁止される。
- （ト）ファンドは、他の投資信託に対する投資を行う投資信託（いわゆるファンド・オブ・ファンズ）への投資、または（直接的もしくは間接的に）ファンドとの間で相互および循環保有となる投資信託への投資を行わない。これらの場合以外における他の投資信託への投資は、ファンドの純資産総額の5%を超えないものとする。かかる制限は、上場投資信託（ETF）に対する投資には適用されない。
- （チ）管理会社、投資顧問会社および副投資顧問会社はファンドのために自身またはその取締役との間で取引を行ってはならない。
- （リ）ファンドは、単一の発行体の株式または受益証券の価額（以下「株式等エクスポージャー」という。）が、純資産総額の10%を超える場合（かかる株式等エクスポージャー

は、日本証券業協会のガイドラインに従って計算される。）、当該会社の株式または当該投資信託の受益証券を保有しないものとする。

（ヌ）ファンドは、デリバティブのポジションからある単一のカウンターパーティーに対して生じるネット・エクスポージャー（以下「デリバティブ等エクスポージャー」という。）が、純資産総額の10%を超える場合（かかるデリバティブ等エクスポージャーは、日本証券業協会のガイドラインに従って計算される。）、単一のカウンターパーティーに対してデリバティブのポジションを保有しないものとする（120日以内に予約期日が到来する為替予約取引（店頭デリバティブ取引に該当するものは除く。）については、この限りでない。）。

（ル）ファンドは、単一の法主体によって発行され、組成され、または、負担される有価証券、金銭債権および匿名組合出資持分（以下これらを「債券等エクスポージャー」という。）の価額が純資産総額の10%を超える場合（かかる債券等エクスポージャーは、日本証券業協会のガイドラインに従って計算される。）、（i）有価証券（上記（リ）に記載される株式または受益証券を除く。）、（ii）金銭債権（上記（ヌ）に記載されるデリバティブを除く。）および（iii）匿名組合出資持分を保有しないものとする。

（注）担保付の取引の場合には当該担保の評価額、当該発行者等に対する債務がある場合には当該債務額を差し引くことができる。

（ヲ）ファンドは、単一の発行体またはカウンターパーティーに対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーが合計で純資産総額の20%を超える場合、単一の発行体もしくはカウンターパーティーにおいて、または、単一の発行体もしくはカウンターパーティーに対してポジションを保有しないものとする。

ファンドの投資対象の価値の変化、再構成、合併、ファンドの資産からの支払またはファンドの受益証券の買戻しの結果としてファンドに適用される制限を超えた場合、管理会社は、直ちにファンドの投資対象を売却する必要はない。しかし、管理会社は、ファンドの受益者の利益を考慮した上で、違反が判明してから合理的な期間内にファンドに適用ある制限を遵守するために合理的に可能な措置を講じるものとする。

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

2018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

2018年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

5 運用状況

(2) 投資資産

<訂正前>

① 投資有価証券の主要銘柄

(2018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	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/3/9	12,600,000.00	113.37	1,428,400,135.00	111.04	1,399,100,138.00	3.71
2	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	12,490,000.00	110.91	1,385,221,088.00	108.14	1,350,666,872.00	3.58
3	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	12,500,000.00	121.42	1,517,726,329.00	107.23	1,340,408,701.00	3.55
4	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	10,700,000.00	100.22	1,072,321,384.00	112.81	1,207,028,443.00	3.20
5	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	154.40	1,080,833,977.00	2.86
6	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.950	2027/4/23	10,140,000.00	110.46	1,120,061,421.00	105.86	1,073,457,317.00	2.84
7	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	3.950	2025/4/21	9,820,000.00	115.63	1,135,477,714.00	108.63	1,066,752,016.00	2.83
8	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	114.88	1,033,919,196.00	2.74
9	MANULIFE FINANCIAL CORP	カナダ	社債	4.061 (2027年2月以降変動金利)	2032/2/24	9,380,000.00	113.65	1,066,037,015.00	105.55	990,039,910.00	2.62
10	LB BADEN-WUERTTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	6,300,000.00	139.33	877,808,169.00	140.81	887,079,829.00	2.35
11	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	米国	社債	6.345	2034/2/15	6,850,000.00	139.56	956,007,199.00	128.14	877,756,184.00	2.33
12	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.375	2025/9/28	7,650,000.00	114.43	875,368,671.00	107.89	825,388,819.00	2.19
13	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	6,910,000.00	115.34	796,992,374.00	113.31	783,005,320.00	2.07
14	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	6,670,000.00	111.72	745,141,972.00	117.27	782,207,165.00	2.07
15	TORONTO-DOMINION BANK	カナダ	社債	3.625 (2026年9月以降変動金利)	2031/9/15	7,400,000.00	102.54	758,789,022.00	104.24	771,358,362.00	2.04
16	WELLS FARGO CAPITAL X	米国	社債	5.950	2036/12/15	6,410,000.00	79.66	510,608,458.00	120.04	769,466,422.00	2.04
17	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	4,640,000.00	174.01	807,397,831.00	161.03	747,190,027.00	1.98
18	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	社債	1.500 (2023年4月以降変動金利)	2028/4/11	5,500,000.00	130.66	718,652,173.00	127.79	702,830,182.00	1.86
19	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	6,580,000.00	120.09	790,180,858.00	106.25	699,133,718.00	1.85
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	5,000,000.00	137.11	685,552,943.00	138.41	692,036,867.00	1.83

	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	ZURICH FINANCE (UK) PLC	英国	社債	6.625 (2022年10月 以降変動金利)	永久債	4,070,000.00	169.11	688,268,590.00	164.81	670,757,422.00	1.78
22	BANK OF MONTREAL	カナダ	社債	3.803 (2027年12月 以降変動金利)	2032/12/15	6,350,000.00	112.73	715,867,225.00	102.63	651,689,056.00	1.73
23	STANDARD CHARTERED PLC	英国	社債	4.300	2027/ 2 /19	5,950,000.00	99.87	594,216,645.00	106.80	635,437,897.00	1.68
24	CYBG PLC	英国	社債	3.125 (2024年6月 以降変動金利)	2025/ 6 /22	4,250,000.00	142.56	605,890,009.00	144.86	615,636,076.00	1.63
25	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	英国	社債	4.892 (2028年5月 以降変動金利)	2029/ 5 /18	5,500,000.00	110.32	606,759,968.00	109.84	604,093,176.00	1.60
26	BANCO SANTANDER SA	スペイン	社債	3.125	2027/ 1 /19	4,400,000.00	121.54	534,762,433.00	132.49	582,948,187.00	1.54
27	MANUF & TRADERS TRUST CO	米国	社債	3.400	2027/ 8 /17	5,400,000.00	109.43	590,937,001.00	107.10	578,338,831.00	1.53
28	DIGITAL REALTY TRUST LP	米国	社債	4.450	2028/ 7 /15	5,100,000.00	110.10	561,519,214.00	111.23	567,279,697.00	1.50
29	SKANDINAVISKA ENSKILDA	スウェーデン	社債	5.625 (2022年5月 以降変動金利)	永久債	5,200,000.00	113.04	587,824,917.00	106.68	554,753,200.00	1.47
30	DNB BANK ASA	ノルウェー	社債	5.750 (2020年3月 以降変動金利)	永久債	5,000,000.00	116.36	581,799,360.00	110.34	551,681,667.00	1.46

② 投資不動産物件

該当事項なし。（2018年6月末日現在）

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（2018年6月末日現在）

<訂正後>

① 投資有価証券の主要銘柄

(2018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	CRED AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	12,500,000	121.42	1,517,726,329	111.34	1,391,771,288	3.86
2	BPCE	フランス	社債	4.500	2025/3/15	12,490,000	110.91	1,385,221,088	111.27	1,389,721,517	3.86
3	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/3/9	11,000,000	113.37	1,247,015,991	114.31	1,257,443,921	3.49
4	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	10,700,000	100.22	1,072,321,384	114.69	1,227,148,558	3.41
5	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.950	2027/4/23	10,140,000	110.46	1,120,061,421	108.93	1,104,507,117	3.07
6	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	157.59	1,103,108,299	3.06
7	BANK OF AMER CRP	米国	社債	3.950	2025/4/21	9,820,000	115.63	1,135,477,714	111.16	1,091,613,131	3.03
8	PRUDENTIAL FIN	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	118.27	1,064,474,348	2.96
9	GOLDMAN SACHS GP	米国	社債	6.345	2034/2/15	6,850,000	139.56	956,007,199	131.69	902,079,635	2.50
10	BNP PARIBAS	フランス	社債	4.375	2025/9/28	7,650,000	114.43	875,368,671	111.49	852,876,238	2.37
11	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	6,670,000	111.72	745,141,972	119.95	800,068,532	2.22
12	DAI-ICHI MUTUAL	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	115.43	797,626,562	2.21
13	TORONTO DOM BANK	カナダ	社債	3.625 (2026年9月 以降変動金利)	2031/9/15	7,400,000	102.54	758,789,022	106.58	788,718,816	2.19
14	WELLS FARGO CAP	米国	社債	5.950	2036/12/15	6,410,000	79.66	510,608,458	122.45	784,913,797	2.18
15	BANK OF IRELAND	アイル ランド	社債	1.375	2023/8/29	5,800,000	127.94	742,053,230	131.40	762,119,658	2.12
16	DBS GROUP HLDGS	シンガ ポール	社債	1.500 (2023年4月 以降変動金利)	2028/4/11	5,500,000	130.66	718,652,173	131.70	724,368,601	2.01
17	LB BADEN- WUERTT	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	4,980,000	139.33	693,886,457	142.88	711,544,418	1.98
18	RABOBANK	オランダ	社債	5.500 (2020年6月 以降変動金利)	永久債	5,000,000	137.11	685,552,943	139.21	696,044,077	1.93
19	ZURICH FINANCE	英国	社債	6.625 (2022年10月 以降変動金利)	永久債	4,070,000	169.11	688,268,590	166.19	676,410,354	1.88
20	BANK OF MONTREAL	カナダ	社債	3.803 (2027年12月 以降変動金利)	2032/12/15	6,350,000	112.73	715,867,225	105.90	672,456,807	1.87
21	STANDARD CHART	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	108.65	646,459,170	1.79

	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	ROYAL BK SCOTLAND	英国	社債	4.892 (2028年5月 以降変動金利)	2029/5/18	5,500,000	110.32	606,759,968	113.02	621,587,697	1.73
23	CYBG PLC	英国	社債	3.125 (2024年6月 以降変動金利)	2025/6/22	4,250,000	142.56	605,890,009	142.51	605,685,147	1.68
24	DIGITAL REALTY	米国	社債	4.450	2028/7/15	5,100,000	110.10	561,519,214	113.56	579,156,065	1.61
25	JPMORGAN CHASE	米国	社債	4.203 (2028年7月 以降変動金利)	2029/7/23	5,100,000	112.39	573,188,984	113.21	577,389,249	1.60
26	DNB BANK ASA	ノル ウェー	社債	5.750 (2020年3月 以降変動金利)	永久債	5,000,000	116.36	581,799,360	113.91	569,572,013	1.58
27	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	3,520,000	174.01	612,508,699	158.76	558,845,672	1.55
28	ELM BV FOR HELVE	オラン ダ	社債	3.375 (2027年9月 以降変動金利)	2047/9/29	4,000,000	118.57	474,287,805	134.56	538,238,583	1.49
29	DNB BANK ASA	ノル ウェー	社債	1.250 (2022年3月 以降変動金利)	2027/3/1	3,900,000	119.95	467,819,516	132.62	517,213,981	1.44
30	FUKOKU MUTUAL	日本	社債	5.000 (2025年7月 以降変動金利)	永久債	4,300,000	124.04	533,393,470	113.17	486,647,460	1.35

② 投資不動産物件

該当事項なし。（2018年9月末日現在）

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。（2018年9月末日現在）