

【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】 令和3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・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 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、アロン通り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦
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 - 東京海上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2,211億6,000万円)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1,662億4,000万円)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、2021年6月30
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=110.58円および1豪ドル=83.12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、2021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等を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

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

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

* 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

(2021年9月末日現在)

資産の種類	地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
社債	英国	6,491,805,290	17.04
	米国	6,350,275,674	16.67
	フランス	4,502,918,121	11.82
	オランダ	2,414,627,420	6.34
	日本	2,337,394,324	6.14
	オーストラリア	1,788,724,291	4.70
	ドイツ	1,503,941,697	3.95
	オーストリア	1,500,099,749	3.94
	ベルギー	1,210,599,552	3.18
	イタリア	1,112,056,782	2.92
	デンマーク	992,702,018	2.61
	アイルランド	901,574,563	2.37
	スペイン	900,654,601	2.36
	ケイマン諸島	767,974,108	2.02
	スイス	634,719,142	1.67
	メキシコ	606,183,625	1.59
	中国	594,461,580	1.56
	スウェーデン	375,932,303	0.99
	香港	370,773,550	0.97
	フィンランド	331,203,629	0.87
	英領ヴァージン諸島	326,989,740	0.86
	ノルウェー	235,597,319	0.62
	ルクセンブルグ	212,764,609	0.56
	シンガポール	206,482,478	0.54
韓国	194,125,717	0.51	
チェコ共和国	181,643,865	0.48	
ペルー	165,250,388	0.43	
国際機関	55,085,994	0.14	
	小計	37,266,562,129	97.82
	現金・その他の資産 (負債控除後)	828,615,268	2.18
	合計(純資産総額)	38,095,177,397	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、2021年9月30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=111.92円および1豪ドル=80.46円)による。以下、米ドルおよび豪ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

- (注3) ファンドは、ケイマン法に基づいて設定されているが、米ドル建 米ドルヘッジクラス受益証券は米ドル建、豪ドル建 豪ドルヘッジクラス受益証券は豪ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨または豪ドル貨をもって行う。
- (注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

(2) 運用実績

純資産の推移

2021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
2020年10月末日	132,001,445.24	14,773,602	0.009105	1.0190
11月末日	144,350,025.63	16,155,655	0.009257	1.0360
12月末日	146,917,355.78	16,442,990	0.009278	1.0384
2021年1月末日	155,178,233.75	17,367,548	0.009202	1.0299
2月末日	153,438,292.84	17,172,814	0.009052	1.0131
3月末日	152,997,792.17	17,123,513	0.008960	1.0028
4月末日	153,791,656.31	17,212,362	0.008956	1.0024
5月末日	155,682,608.30	17,423,998	0.008917	0.9980
6月末日	157,835,829.89	17,664,986	0.008937	1.0002
7月末日	160,341,519.26	17,945,423	0.008960	1.0028
8月末日	164,020,511.25	18,357,176	0.008912	0.9974
9月末日	155,030,397.50	17,351,002	0.008791	0.9839

<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
2020年10月末日	28,733,384.50	2,311,888	0.007789	0.6267
11月末日	29,504,115.27	2,373,901	0.007909	0.6364
12月末日	29,844,474.00	2,401,286	0.007917	0.6370
2021年1月末日	30,016,646.93	2,415,139	0.007854	0.6319
2月末日	29,452,946.93	2,369,784	0.007726	0.6216
3月末日	28,834,336.69	2,320,011	0.007642	0.6149
4月末日	28,858,117.95	2,321,924	0.007643	0.6150
5月末日	29,222,515.87	2,351,244	0.007608	0.6121
6月末日	30,976,883.64	2,492,400	0.007623	0.6133
7月末日	30,621,030.63	2,463,768	0.007649	0.6154
8月末日	30,182,404.12	2,428,476	0.007610	0.6123
9月末日	29,590,592.76	2,380,859	0.007505	0.6039

<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~2021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。

分配の推移

2021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
2020年10月1日～2021年9月末日	0.000694	0.077672

<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
2020年10月1日～2021年9月末日	0.000582	0.046828

<参考情報>

分配の推移(2021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
第7会計年度(2018年3月1日～2019年2月28日)	0.000540
第8会計年度(2019年3月1日～2020年2月29日)	0.000630
第9会計年度(2020年3月1日～2021年2月28日)	0.000720
2021年5月	0.000058
2021年6月	0.000055
2021年7月	0.000055
2021年8月	0.000055
2021年9月	0.000055
直近1年間累計	0.000694
設定来累計	0.005029

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
第7会計年度(2018年3月1日～2019年2月28日)	0.000720
第8会計年度(2019年3月1日～2020年2月29日)	0.000672
第9会計年度(2020年3月1日～2021年2月28日)	0.000622
2021年5月	0.000048
2021年6月	0.000045
2021年7月	0.000045
2021年8月	0.000045
2021年9月	0.000045
直近1年間累計	0.000582
設定来累計	0.006638

収益率の推移

2021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)
2020年10月1日～2021年9月末日	3.74%

(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)
2020年10月1日～2021年9月末日	3.41%

(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、2021年については2021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。2021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

2021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2021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
2020年10月1日～ 2021年9月末日	5,145,054,535 (5,145,054,535)	1,739,609,056 (1,739,609,056)	17,635,684,655 (17,635,684,655)

<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
2020年10月1日～ 2021年9月末日	867,922,093 (867,922,093)	517,311,324 (517,311,324)	3,942,648,722 (3,942,648,722)

(注) ()内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

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

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

貸借対照表

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2021年8月31日現在

	円
資産	
現金	845,589,338
銀行預金 - 基準通貨	225,695,405
銀行預金 - 外国通貨	619,893,933
ブローカーが保有する現金	(5,505,000)
ブローカーが保有する現金 - 米ドル	(5,505,000)
有価証券(取得原価)	34,276,458,958
債券(取得原価)	34,276,458,958
未実現評価損益	3,512,785,438
未実現時価評価損益	2,246,648,772
未実現通貨運用損益	1,266,220,798
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(428,921)
未実現通貨繰延損益	344,789
未収収益	369,410,155
期日経過の未収利息	(2)
現金に係る未収利息	45,430
債券に係る未収利息	369,364,727
資本証券	494,217,628
受益証券販売未収金	494,217,628
その他の資産	(11,440,679)
その他の資産	(11,440,679)
資産合計:	39,481,515,838

2021年8月31日現在

円

負債

資本証券		3,045,876
受益証券買戻未払金		3,045,876
未払費用		77,742,100
未払監査費用		1,909,003
未払報告費用		103,313
未払投資顧問報酬		43,544,556
未払投資顧問報酬 - 豪ドル	(36,318,075)	
未払受託報酬		658,863
未払管理報酬		8,227,416
未払代行協会員報酬		1,683,792
未払代行協会員報酬 - 豪ドル	(1,987,849)	
未払販売報酬		19,969,675
未払販売報酬 - 豪ドル	(23,570,973)	
未払副管理報酬		1,645,482
負債合計：		80,787,976

資本

ファンド受益証券		53,918,069,638
発行済ファンド受益証券(額面価額)		71,702,814,120,005
米ドル建 米ドルヘッジ	41,099,476,943,730	
ブラジル・リアル	5,017,740,095	
米ドル	3,268,654,410	
豪ドル	1,681,892,025	
ユーロ	13,913,294	
日本円	9,156,510,799	
資源国通貨バスケット	178,008,165	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,565,593,322,161	
メキシコ・ペソ	1,071,852,384	
トルコ・リラ	16,587,999,561	
ロシア・ルーブル	767,283,381	

2021年8月31日現在

円

受益証券額面超過額		(71,648,896,050,367)
米ドル建 米ドルヘッジ	(41,086,188,364,009)	
ブラジル・レアル	6,612,170,905	
米ドル	(43,629,410)	
豪ドル	(676,844,025)	
ユーロ	(2,261,294)	
日本円	3,970,545,201	
資源国通貨バスケット	3,042,835	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,227,750,744)	
メキシコ・ペソ	(133,763,884)	
トルコ・リラ	(11,431,051,061)	
ロシア・ルーブル	221,855,119	
分配金支払額		(61,163,518,201)
配当金支払額		(61,163,518,201)
米ドル建 米ドルヘッジ	(9,544,192,307)	
ブラジル・レアル	(16,557,156,098)	
米ドル	(3,207,649,122)	
豪ドル	(4,532,576,375)	
ユーロ	(20,328,879)	
日本円	(19,118,119,350)	
資源国通貨バスケット	(312,772,467)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(3,559,664,201)	
メキシコ・ペソ	(572,448,170)	
トルコ・リラ	(2,655,715,626)	
ロシア・ルーブル	(1,082,895,606)	

2021年8月31日現在

円

利益剰余金		44,921,056,948
利益剰余金		44,921,056,948
米ドル建 米ドルヘッジ	38,691,103,228	
ブラジル・リアル	32,760,437,681	
米ドル	13,221,845,731	
豪ドル	17,604,664,452	
ユーロ	71,937,869	
日本円	45,274,829,781	
資源国通貨バスケット	721,228,788	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	6,640,975,557	
メキシコ・ペソ	622,191,379	
トルコ・リラ	(454,233,602)	
ロシア・ルーブル	2,696,731,817	
中間純利益		1,725,119,477
資本合計：		39,400,727,862
負債および資本合計		39,481,515,838
純資産額合計		39,400,727,862
発行済受益証券総数		22,374,407,363.41140口
受益証券1口当たり純資産額合計		1.760973

損益計算書

東京海上ストラテジック・トラスト-

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

収益		
実現損益		271,931,821
為替取引に係る実現利益		3,784,068,164
ブラジル・レアル	345,830,993	
豪ドル	239,866,832	
ユーロ	2,818,822	
日本円	534,188,661	
資源国通貨バスケット	23,935,459	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	374,593,667	
メキシコ・ペソ	113,302,312	
トルコ・リラ	538,690,141	
ロシア・ルーブル	67,993,620	
為替取引に係る実現損失		(3,954,909,483)
ブラジル・レアル	(319,492,455)	
豪ドル	(299,979,471)	
ユーロ	(3,229,466)	
日本円	(978,316,527)	
資源国通貨バスケット	(21,852,728)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(480,414,364)	
メキシコ・ペソ	(106,553,605)	
トルコ・リラ	(577,593,944)	
ロシア・ルーブル	(59,134,757)	
市場に係る実現利益		369,915,837
市場に係る実現損失		(30,130,948)

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

通貨に係る実現利益		374,727,447
米ドル建 米ドルヘッジ	6,860,543	
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	1,851,828	
メキシコ・ペソ	1	
トルコ・リラ	4	
通貨に係る実現損失		(271,739,196)
米ドル建 米ドルヘッジ	(7,963,450)	
ブラジル・レアル	(1)	
豪ドル	(1)	
日本円	(1)	
資源国通貨バスケット	(3)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(2,826,386)	
メキシコ・ペソ	(2)	
トルコ・リラ	(2)	
ロシア・ルーブル	(1)	
受取利息		605,681,552
現金に係る受取利息		25,848
債券に係る受取利息		605,655,704
未実現評価損益		1,080,831,139
未実現時価評価損益		209,602,563

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

未実現通貨運用損益		885,892,276
ブラジル・リアル	91,815,638	
豪ドル	(25,891,279)	
ユーロ	(127,897)	
日本円	163,437,260	
資源国通貨バスケット	1,597,465	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(41,631,109)	
メキシコ・ペソ	29,415,791	
トルコ・リラ	(23,646,326)	
ロシア・ルーブル	2,962,020	
未決済取引にかかる未実現為替差損益		(441,149)
米ドル建 米ドルヘッジ	(507,299)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	66,150	
未実現通貨繰延損益		(14,222,551)
収益合計：		<u>1,958,444,512</u>

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

費用		
費用 - 報酬		228,887,185
監査費用		1,068,923
報告費用		86,671
弁護士費用		173,945
投資顧問報酬		130,055,471
米ドル建 米ドルヘッジ	69,144,871	
ブラジル・リアル	3,187,288	
米ドル	12,784,311	
豪ドル	3,889,093	
ユーロ	45,298	
日本円	21,453,278	
資源国通貨バスケット	252,623	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	9,998,252	
メキシコ・ペソ	1,532,603	
トルコ・リラ	6,045,874	
ロシア・ルーブル	770,026	
受託報酬		1,973,773
現金支出費用		576,291
未払管理報酬		24,492,064
代行協会員報酬		5,000,432
米ドル建 米ドルヘッジ	4,337,836	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	627,250	
販売報酬		59,570,223
米ドル建 米ドルヘッジ	51,446,567	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	7,439,117	
副保管報酬		990,982
副管理報酬		4,898,410
源泉徴収税費用		4,093,651
源泉徴収税		4,093,651
支払利息		344,199
当座借越利息		5,310
支払利息		338,889
費用合計：		233,325,035
投資純利益		1,725,119,477

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリ・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
30,320,894.09000	AUD FORWARD 13 SEP FAU13SEP	8/3/2021	AUD	30,320,894.09	2,436,687,421	1.000000000F 80.288215424	30,320,894.09	2,434,410,477	0	-2,276,944	-2,276,944
-22,420,300.00000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/3/2021	AUD	-22,420,300.00	-2,436,687,431	1.000000000F 0.009103586	-22,420,300.00	-2,462,798,726	0	-26,111,295	-26,111,295
7,900,594.09000	非グループ化の有価証券小計			7,900,594	-10		7,900,594	-28,388,249	0	-28,388,239	-28,388,239
7,900,594.09000	先物(ポジション)合計			7,900,594	-10		7,900,594	-28,388,249	0	-28,388,239	-28,388,239
7,900,594.09000	豪ドルクラス受益証券合計			7,900,594	-10		7,900,594	-28,388,249	0	-28,388,239	-28,388,239

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
17,452,538.02000	AUD FORWARD 13 SEP FAU13SEP	8/3/2021		17,452,538.02	1,402,543,729	1.000000000F	17,452,538.02	1,401,233,132	0	-1,310,597	-1,310,597
			AUH			80.288215424					
-12,905,000.00000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/3/2021		-12,905,000.00	-1,402,543,735	1.000000000F	-12,905,000.00	-1,417,573,251	0	-15,029,516	-15,029,516
			AUH			0.009103586					
4,547,538.02000	非グループ化の有価証券小計			4,547,538	-6		4,547,538	-16,340,119	0	-16,340,113	-16,340,113
4,547,538.02000	先物(ポジション)合計			4,547,538	-6		4,547,538	-16,340,119	0	-16,340,113	-16,340,113
4,547,538.02000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			4,547,538	-6		4,547,538	-16,340,119	0	-16,340,113	-16,340,113

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
387,188.04000	AUD FORWARD 13 SEP FAU13SEP	8/3/2021		387,188.04	31,115,713	1.000000000F 80.288215424	387,188.04	31,086,637	0	-29,076	-29,076
1,512,036.19000	BRL FORWARD 13 SEP FBR13SEP	8/3/2021	BKH	1,512,036.19	31,339,992	1.000000000F 0.046694445	1,512,036.19	32,381,500	0	1,041,508	1,041,508
-286,300.00000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/3/2021	BKH	-286,300.00	-31,339,993	1.000000000F 0.009103586	-286,300.00	-31,449,145	0	-109,152	-109,152
-286,300.00000		8/3/2021	BKH	-286,300.00	-31,115,713	1.000000000F 0.009103586	-286,300.00	-31,449,145	0	-333,432	-333,432
-286,300.00000		8/3/2021	BKH	-286,300.00	-31,321,502	1.000000000F 0.009103586	-286,300.00	-31,449,145	0	-127,643	-127,643
-858,900.00000	合計 -----			-858,900	-93,777,208		-858,900	-94,347,435	0	-570,227	-570,227
0.00000											
4,125,268.07000	ZAR FORWARD 13 SEP FZA13SEP	8/3/2021	BKH	4,125,268.07	31,321,501	1.000000000F 0.131928208	4,125,268.07	31,269,037	0	-52,464	-52,464
5,165,592.30000	非グループ化の有価証券小計			5,165,592	-2		5,165,592	389,739	0	389,741	389,741
5,165,592.30000	先物(ポジション)合計			5,165,592	-2		5,165,592	389,739	0	389,741	389,741
5,165,592.30000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			5,165,592	-2		5,165,592	389,739	0	389,741	389,741

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
59,538,735.55000	BRL FORWARD 13 SEP FBR13SEP	8/3/2021	BRH	59,538,735.55	1,234,060,089	1.000000000F 0.046694445	59,538,735.55	1,275,071,061	0	41,010,972	41,010,972
-11,273,500.00000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/3/2021	BRH	-11,273,500.00	-1,234,060,103	1.000000000F 0.009103586	-11,273,500.00	-1,238,358,159	0	-4,298,056	-4,298,056
48,265,235.55000	非グループ化の有価証券小計			48,265,236	-14		48,265,236	36,712,902	0	36,712,916	36,712,916
48,265,235.55000	先物(ポジション)合計			48,265,236	-14		48,265,236	36,712,902	0	36,712,916	36,712,916
48,265,235.55000	ブラジル・リアルクラス受益証券合計			48,265,236	-14		48,265,236	36,712,902	0	36,712,916	36,712,916

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>ユーロクラス受益証券</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
128,344.76000	EUR FORWARD 13 SEP FEU13SEP	8/3/2021		128,344.76	16,582,576	1.000000000F	128,344.76	16,646,847	0	64,271	64,271
-152,600.00000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/3/2021	EUH	-152,600.00	-16,582,576	129.704142258 1.000000000F 0.009103586	-152,600.00	-16,762,625	0	-180,049	-180,049
-24,255.24000	非グループ化の有価証券小計			-24,255	0		-24,255	-115,778	0	-115,778	-115,778
-24,255.24000	先物(ポジション)合計			-24,255	0		-24,255	-115,778	0	-115,778	-115,778
-24,255.24000	ユーロクラス受益証券合計			-24,255	0		-24,255	-115,778	0	-115,778	-115,778

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-73,849,400.00000	USD FORWARD 13 SEP	8/3/2021		-73,849,400.00	-8,062,744,625	1.000000000 ^F	-73,849,400.00	-8,112,121,970	0	-49,377,345	-49,377,345
	FUS13SEP		JPH			0.009103586					
-73,849,400.00000	非グループ化の有価証券小計			-73,849,400	-8,062,744,625		-73,849,400	-8,112,121,970	0	-49,377,345	-49,377,345
-73,849,400.00000	先物(ポジション)合計			-73,849,400	-8,062,744,625		-73,849,400	-8,112,121,970	0	-49,377,345	-49,377,345
-73,849,400.00000	日本円クラス受益証券合計			-73,849,400	-8,062,744,625		-73,849,400	-8,112,121,970	0	-49,377,345	-49,377,345

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
105,555,575.10	MXN FORWARD 13 SEP FMX13SEP	8/3/2021		105,555,575.10	577,644,270	1.000000000 ^F	105,555,575.10	577,545,898	0	-98,372	-98,372
-5,292,200.00000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/3/2021	MXH	-5,292,200.00	-577,644,272	0.182765691	-5,292,200.00	-581,331,357	0	-3,687,085	-3,687,085
			MXH			1.000000000 ^F					
						0.009103586					
100,263,375.10000	非グループ化の有価証券小計			100,263,375	-2		100,263,375	-3,785,459	0	-3,785,457	-3,785,457
100,263,375.10000	先物(ポジション)合計			100,263,375	-2		100,263,375	-3,785,459	0	-3,785,457	-3,785,457
100,263,375.10000	メキシコ・ペソクラス受益証券合計			100,263,375	-2		100,263,375	-3,785,459	0	-3,785,457	-3,785,457

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
202,898,082.06	RUB FORWARD 13 SEP FRU13SEP	8/3/2021		202,898,082.06	302,216,005	1.000000000F 0.668291636	202,898,082.06	303,607,095	0	1,391,090	1,391,090
-7,042,000.00		8/6/2021	RUH	-7,042,000.00	-10,507,640	1.000000000F 0.668291636	-7,042,000.00	-10,537,316	0	-29,676	-29,676
-7,468,000.00		8/18/2021	RUH	-7,468,000.00	-11,084,187	1.000000000F 0.668291636	-7,468,000.00	-11,174,762	0	-90,575	-90,575
188,388,082.060000	合計 -----			188,388,082	280,624,178		188,388,082	281,895,017	0	1,270,839	1,270,839
95,272.880000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/6/2021	RUH	95,272.88	10,507,640	1.000000000F 0.009103586	95,272.88	10,465,423	0	-42,217	-42,217
100,861.670000		8/18/2021	RUH	100,861.67	11,084,187	1.000000000F 0.009103586	100,861.67	11,079,334	0	-4,853	-4,853
-2,756,700.000000		8/3/2021	RUH	-2,756,700.00	-302,216,007	1.000000000F 0.009103586	-2,756,700.00	-302,814,737	0	-598,730	-598,730
-2,560,565.450000	合計 -----			-2,560,565	-280,624,180		-2,560,565	-281,269,980	0	-645,800	-645,800
185,827,516.610000	非グループ化の有価証券小計			185,827,517	-2		185,827,517	625,037	0	625,039	625,039
185,827,516.610000	先物(ポジション)合計			185,827,517	-2		185,827,517	625,037	0	625,039	625,039
185,827,516.610000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			185,827,517	-2		185,827,517	625,037	0	625,039	625,039

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
180,908,230.10	TRY FORWARD 13 SEP FTR13SEP	8/3/2021		180,908,230.10	2,338,321,663	1.000000000F 0.076195704	180,908,230.10	2,374,257,610	0	35,935,947	35,935,947
6,042,863.96		8/17/2021	TRH	6,042,863.96	78,499,499	1.000000000F 0.076195704	6,042,863.96	79,307,148	0	807,649	807,649
-7,936,000.00		8/6/2021	TRH	-7,936,000.00	-99,534,994	1.000000000F 0.076195704	-7,936,000.00	-104,152,854	0	-4,617,860	-4,617,860
179,015,094.060000	合計 -----			179,015,094	2,317,286,168		179,015,094	2,349,411,904	0	32,125,736	32,125,736
902,484.790000	USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP	8/6/2021	TRH	902,484.79	99,534,994	1.000000000F 0.009103586	902,484.79	99,135,087	0	-399,907	-399,907
-21,310,900.000000		8/3/2021	TRH	-21,310,900.00	-2,338,321,678	1.000000000F 0.009103586	-21,310,900.00	-2,340,934,660	0	-2,612,982	-2,612,982
-706,900.000000		8/17/2021	TRH	-706,900.00	-78,499,499	1.000000000F 0.009103586	-706,900.00	-77,650,719	0	848,780	848,780
-21,115,315.210000	合計 -----			-21,115,315	-2,317,286,183		-21,115,315	-2,319,450,292	0	-2,164,109	-2,164,109
157,899,778.850000	非グループ化の有価証券小計			157,899,779	-15		157,899,779	29,961,612	0	29,961,627	29,961,627
157,899,778.850000	先物(ポジション)合計			157,899,779	-15		157,899,779	29,961,612	0	29,961,627	29,961,627
157,899,778.850000	トルコ・リラクラス受益証券合計			157,899,779	-15		157,899,779	29,961,612	0	29,961,627	29,961,627

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
225,695,405.00000	JPY CASH	8/28/2021		225,695,405	225,695,405	1.000000000	225,695,405	225,695,405	0	0	0
	CASHJPY					1.000000000					
225,695,405.00000	基準通貨現金小計			225,695,405	225,695,405		225,695,405	225,695,405	0	0	0
225,695,405.00000	現金合計			225,695,405	225,695,405		225,695,405	225,695,405	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
1,700,000.00000	AGEAS	4/4/2019		1,731,875.00	215,180,494	114.750999451 ^C 129.684236999	1,950,766.99	252,983,729	28,386,841	9,416,394	37,803,235
	FRN 07022049 BBEL017Z BE0002644251										
1,400,000.00000	AGEAS	11/13/2020		1,392,370.00	172,214,561	107.485000610 ^C 129.684236999	1,504,790.01	195,147,544	14,579,103	8,353,880	22,932,983
	FRN PERP/CALL BBEL018A BE6317598850										
1,800,000.00000	AIA GROUP	3/31/2021		1,806,300.00	199,243,925	101.841003418 ^C 0.009102494	1,833,138.06	201,388,549	2,948,429	-803,805	2,144,624
	FRN PERP/CALL BHKG003W XS2328261263										
1,550,000.00000	AIB GROUP PLC	9/23/2020		1,549,256.00	190,410,454	107.529998779 ^C 129.684236999	1,666,714.98	216,146,661	15,232,578	10,503,628	25,736,206
	FRN 05302031 BIRL02BX XS2230399441										
1,600,000.00000	AMER INTL GROUP	10/30/2020		1,763,200.00	184,324,937	115.325996399 ^C 0.009102494	1,845,215.94	202,715,425	9,010,272	9,380,217	18,390,489
	FRN 04012048 BUSA9EMH US026874DM66										
1,800,000.00000	ARGENTUM NETH	8/12/2020		1,807,920.00	192,480,207	102.721000671 ^C 0.009102494	1,848,978.01	203,128,726	4,510,633	6,137,886	10,648,519
	FRN PERP/CALL BNLDTEUZ XS1640851983										
2,250,000.00000	ASR NEDERLAND NV	4/25/2019		2,298,401.00	283,695,075	112.738998413 ^C 129.684236999	2,536,627.46	328,960,597	30,894,217	14,371,305	45,265,522
	FRN 05022049 BNLD121A XS1989708836										
2,550,000.00000	ASSICURAZIONI	10/9/2020		3,031,645.00	378,289,811	122.700996399 ^C 129.684236999	3,128,875.41	405,765,820	12,609,251	14,866,758	27,476,009
	FRN 06082048 BITA038R XS1428773763										

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
4,500,000.00000	AUST & NZ BANK FRN 05052031 BAUS08CS XS2294372169	1/29/2021		4,500,450.00	569,080,991	100.517997742 ^C 129.684236999	4,523,309.90	586,601,993	2,964,568	14,556,433	17,521,001
2,000,000.00	AVIVA PLC FRN 06032055 BGBR22PZ XS2181348405	6/5/2020		2,042,380.00	285,230,621	112.727996826 ^C 151.194825005	2,254,559.94	340,877,795	32,080,508	23,566,666	55,647,174
4,700,000.00	AXA SA FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561	5/24/2013		5,063,974.18	854,967,509	116.744003296 ^C 151.194825005	5,486,968.15	829,601,190	63,954,500	-89,320,819	-25,366,319
1,500,000.00000	BANCO DE CREDITO FRN 07012030 BPER002V US05971V2C81	7/13/2021		1,494,000.00	164,810,617	99.773002625 ^C 0.009102494	1,496,595.04	164,415,933	285,091	-679,775	-394,684
3,600,000.00000	BANK OF IRELAND FRN 10142029 BIRL02BJ XS2065555562	11/18/2019		3,685,123.15	443,282,716	104.402999878 ^C 129.684236999	3,758,508.00	487,419,242	9,516,858	34,619,668	44,136,526
3,600,000.00000	BARCLAYS PLC FRN 03102042 BGBR22QR US06738EBS37	3/3/2021		3,600,000.00	385,056,019	108.662002563 ^C 0.009102494	3,911,832.09	429,753,878	34,257,874	10,439,985	44,697,859
4,000,000.00000	BAWAG GROUP AG FRN 03262029 BAUTO16H XS1968814332	3/19/2019		3,995,520.00	504,988,434	104.547996521 ^C 129.684236999	4,181,919.86	542,329,086	24,173,124	13,167,529	37,340,653
1,000,000.00	BNP PARIBAS FRN 05242031 BFRA10TI FRO014003N10	5/17/2021		997,690.00	153,807,644	101.203002930 ^C 151.194825005	1,012,030.03	153,013,703	2,168,138	-2,962,079	-793,941
2,300,000.00000	BNP PARIBAS FRN 08312033 BFRA10TP FRO0140057U9	8/23/2021		2,297,355.00	295,992,695	99.241996765 ^C 129.684236999	2,282,565.93	296,012,820	-1,917,910	1,938,035	20,125
1,800,000.00000	CAIXABANK FRN 06182031 BESPO289 XS2310118976	3/9/2021		1,792,314.00	231,711,424	101.273002625 ^C 129.684236999	1,822,914.05	236,403,217	3,968,344	723,450	4,691,794

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
5,250,000.00000	CHINA CONST BANK FRN 06242030 BCHN000Y XS2140531950	6/26/2020		5,246,528.80	563,136,140	102.358001709 ^C 0.009102494	5,373,795.09	590,365,134	13,981,475	13,247,519	27,228,994
810,000.00	CLOSE BROS GRP FRN 09112031 BGBR22R5 XS2351480566	6/3/2021		808,721.10	125,739,124	100.958000183 ^C 151.194825005	817,759.80	123,641,050	1,366,605	-3,464,679	-2,098,074
2,300,000.00000	CNP ASSURANCES FRN 07272050 BFRA10R8 FRO013463775	11/20/2019		2,285,210.00	274,710,913	105.873001099 ^C 129.684236999	2,435,079.03	315,791,365	19,435,650	21,644,802	41,080,452
3,400,000.00000	COM BK AUSTRALIA FRN 09122034 BAUS08BI USQ2704MAA64	9/5/2019		3,400,000.00	363,970,009	107.346000671 ^C 0.009102494	3,649,764.02	400,963,079	27,439,076	9,553,994	36,993,070
1,200,000.00000	COOPERATIVE RAB FRN PERP/CALL BNLDTEUU XS2202900424	7/7/2020		1,200,000.00	145,657,442	112.383003235 ^C 129.684236999	1,348,596.04	174,891,648	19,270,564	9,963,642	29,234,206
2,000,000.00000	CRDT AGR ASSR FRN 01292048 BFRA10L9 FRO013312154	1/22/2018		2,007,829.00	272,543,704	108.530998230 ^C 129.684236999	2,170,619.96	281,495,194	21,111,422	-12,159,932	8,951,490
1,400,000.00000	CRED AGRICOLE SA FRN PERP/CALL BFRA10SS FRO013533999	10/7/2020		1,400,000.00	174,581,833	110.676002502 ^C 129.684236999	1,549,464.04	200,941,061	19,383,129	6,976,099	26,359,228
1,200,000.00	CRED AGRICOLE SA FRN 12092031 BFRA10TJ FRO014003W84	6/2/2021		1,202,088.00	186,641,192	100.577003479 ^C 151.194825005	1,206,924.04	182,480,669	731,184	-4,891,707	-4,160,523
2,800,000.00	CREDIT SUISSE FRN 06092028 BCHE012Q CH0550413337	6/3/2020		2,795,455.00	382,293,772	103.078002930 ^C 151.194825005	2,886,184.08	436,376,097	13,717,768	40,364,558	54,082,326
2,650,000.00	CYBG PLC FRN 06222025 BGBR22JQ XS1637124741	11/30/2020		2,740,935.50	381,572,058	104.995002747 ^C 151.194825005	2,782,367.57	420,679,578	6,264,315	32,843,205	39,107,520

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
6,910,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		7,095,133.09	796,992,374	110.658996582 ^C 0.009102494	7,646,536.66	840,048,526	60,577,197	-17,521,046	43,056,151
2,250,000.00000	DANSKE BANK A/S FRN 06212029 BDNK024B XS1967697738	6/30/2020		2,309,239.50	279,812,950	105.550003052 ^C 129.684236999	2,374,875.07	307,983,861	8,511,899	19,659,013	28,170,912
3,000,000.00000	DANSKE BANK A/S FRN 05152031 BDNK024G XS2299135819	2/8/2021		3,000,285.00	380,237,162	100.890998840 ^C 129.684236999	3,026,729.97	392,519,166	3,429,495	8,852,509	12,282,004
1,800,000.00000	DBS GROUP HLDGS FRN PERP/CALL BSGP00AU XS2122408854	2/20/2020		1,800,000.00	201,762,010	102.973999023 ^C 0.009102494	1,853,531.98	203,629,025	5,881,024	-4,014,008	1,867,016
3,300,000.00000	DEUTSCHE BANK AG FRN 09032026 BDEU43ED DE000DL19VPO	8/27/2020		3,286,404.00	412,439,286	104.030998230 ^C 129.684236999	3,433,022.94	445,208,961	19,014,166	13,755,509	32,769,675
1,300,000.00000	DEUTSCHE BANK AG FRN 02172032 BDEU43ES DE000DL19VU0	2/8/2021		1,297,946.00	164,493,469	102.561996460 ^C 129.684236999	1,333,305.95	172,908,765	4,585,629	3,829,668	8,415,297
5,250,000.00000	DISCOVER BANK FRN 08092028 BUSA9CU3 US25466AAN19	2/28/2019		5,244,015.00	583,763,733	106.230003357 ^C 0.009102494	5,577,075.18	612,697,484	36,589,991	-7,656,240	28,933,751
2,000,000.00000	DNB BANK ASA FRN PERP/CALL BNOR024J XS2075280995	11/5/2019		2,001,800.00	218,496,472	105.990997314 ^C 0.009102494	2,119,819.95	232,883,421	12,965,671	1,421,278	14,386,949
950,000.00000	ELM BV FOR HELVE FRN 09292047 BNLD12E4 XS1587893451	3/30/2017		973,098.09	115,872,577	113.476997375 ^C 129.684236999	1,078,031.48	139,803,689	13,608,206	10,322,906	23,931,112
1,600,000.00000	ERSTE GROUP FRN PERP/CALL BAUTO17A AT0000A2L583	11/16/2020		1,600,000.00	198,086,195	107.767997742 ^C 129.684236999	1,724,287.96	223,612,969	16,118,190	9,408,584	25,526,774

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
1,700,000.00000	HANNOVER RUECKV FRN 10092039 BDEU43DF XS2063350925	10/1/2019		1,682,354.00	198,098,357	101.916000366 ^C 129.684236999	1,732,572.01	224,687,279	6,512,484	20,076,438	26,588,922
1,200,000.00000	ING GROEP NV FRN 05262031 BNLDTEUN XS2176621170	5/19/2020		1,198,056.00	141,564,503	106.709999084 ^C 129.684236999	1,280,519.99	166,063,258	10,694,279	13,804,475	24,498,754
500,000.00000	ING GROEP NV FRN 06092032 BNLDTEVQ XS2350756446	6/2/2021		497,620.00	66,582,328	100.884002686 ^C 129.684236999	504,420.01	65,415,325	881,855	-2,048,858	-1,167,003
3,400,000.00000	JPMORGAN CHASE FRN 05132031 BUSA9EB5 US46647PPB09	5/6/2020		3,400,000.00	360,570,015	105.830001831 ^C 0.009102494	3,598,220.06	395,300,460	21,776,456	12,953,988	34,730,444
2,250,000.00000	JYSKE BANK A/S FRN 01282031 BDNK024F XS2109391214	11/5/2020		2,224,035.00	272,639,083	101.914001465 ^C 129.684236999	2,293,065.03	297,374,389	8,952,107	15,783,199	24,735,306
900,000.00000	KBC GROUP NV FRN 09182029 BBEL017K BE0002290592	9/11/2017		897,642.00	117,137,187	104.265998840 ^C 129.684236999	938,393.99	121,694,909	5,284,891	-727,169	4,557,722
3,000,000.00000	KBC GROUP NV FRN 12032029 BBEL0181 BE0002664457	8/27/2019		2,985,303.00	351,000,708	100.556999207 ^C 129.684236999	3,016,709.98	391,219,732	4,072,990	36,146,034	40,219,024
3,000,000.00000	LA BANQUE POSTAL FRN 08022032 BFRA10T6 FRO014001R34	1/29/2021		2,983,050.00	379,425,930	99.577003479 ^C 129.684236999	2,987,310.10	387,407,032	552,468	7,428,633	7,981,101
1,106,000.00000	LIBERTY MUTUAL FRN 12152051 BUSA9F2F US53079EBM57	8/11/2021		1,106,000.00	122,179,825	102.385002136 ^C 0.009102494	1,132,378.12	124,403,062	2,897,901	-674,664	2,223,237
1,300,000.00	LLOYDS BK GR PLC FRN PERP/CALL BGBR22QP XS2080995405	12/18/2020		1,365,000.00	190,305,323	106.161003113 ^C 151.194825005	1,380,093.04	208,662,926	2,281,990	16,075,613	18,357,603

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
750,000.00	LLOYDS BK GR PLC FRN 12152031 BGBR22R6 XS2351166421	6/8/2021		750,777.00	116,253,092	101.207000732 ^C 151.194825005	759,052.51	114,764,811	1,251,214	-2,739,495	-1,488,281
1,250,000.00	M&G PLC FRN 10202051 BGBR22PY XS1888920276	6/4/2020		1,373,600.00	188,771,192	120.378997803 ^C 151.194825005	1,504,737.47	227,508,519	19,827,307	18,910,020	38,737,327
600,000.00000	MAPFRE FRN 03312047 BESPO267 ES0224244089	3/22/2017		600,000.00	71,996,318	116.944999695 ^C 129.684236999	701,670.00	90,995,538	13,184,996	5,814,224	18,999,220
3,100,000.00000	MITSUMI SUMITOMO FRN PERP/CALL BJPN3074 USJ4517MAA74	2/27/2019		3,100,000.00	343,774,504	114.736000061 ^C 0.009102494	3,556,816.00	390,751,810	50,185,806	-3,208,501	46,977,305
3,500,000.00000	MORGAN STANLEY FRN 04222042 BUSA9EV4 US61772BAC72	4/19/2021		3,500,000.00	378,104,998	107.036003113 ^C 0.009102494	3,746,260.11	411,564,139	27,054,136	6,405,006	33,459,142
2,000,000.00000	MUNICH RE FRN 05262049 BDEU43C0 XS1843448314	11/15/2018		2,117,407.20	267,453,226	117.199996948 ^C 129.684236999	2,343,999.94	303,979,844	29,385,506	7,141,111	36,526,617
700,000.00000	MUNICH RE FRN 05262041 BDEU43EI XS2221845683	9/15/2020		691,929.00	86,490,485	102.822998047 ^C 129.684236999	719,760.99	93,341,654	3,609,370	3,241,799	6,851,169
1,200,000.00000	MUTUELLE ASSUR FRN 06212052 BFRA10TK FRO014003XZ7	6/15/2021		1,200,123.00	160,037,988	102.302001953 ^C 129.684236999	1,227,624.02	159,203,485	3,566,449	-4,400,952	-834,503
2,400,000.00000	NATIONWIDE BLDG FRN 07182030 BGBR2209 US63861VAE74	7/12/2019		2,400,912.00	259,334,521	112.912002563 ^C 0.009102494	2,709,888.06	297,708,305	33,944,110	4,429,674	38,373,784
500,000.00	NATWEST GROUP FRN 11282031 BGBR22R3 XS2346516250	5/25/2021		500,000.00	76,971,853	101.178001404 ^C 151.194825005	505,890.01	76,487,951	890,539	-1,374,440	-483,901

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
3,000,000.00000	NIPPON LIFE INS FRN 01212051 BJPN308K USJ54675BA04	1/13/2021		3,000,000.00	311,805,000	99.415000916 ^C 0.009102494	2,982,450.03	327,651,963	-1,928,040	17,775,003	15,846,963
3,300,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		3,460,611.63	461,773,159	114.823997498 ^C 129.684236999	3,789,191.92	491,398,463	42,611,684	-12,986,380	29,625,304
2,900,000.00000	NORDEA BANK AB FRN 08182031 BSWE038F XS2343459074	5/10/2021		2,893,736.00	382,614,869	100.722999573 ^C 129.684236999	2,920,966.99	378,803,375	3,531,430	-7,342,924	-3,811,494
1,750,000.00000	PEAK RE BVI HLDN FRN PERP/CALL BVGB004A XS2239623437	10/20/2020		1,750,000.00	184,730,007	105.780998230 ^C 0.009102494	1,851,167.47	203,369,260	11,114,258	7,524,995	18,639,253
1,850,000.00000	PRINCIPAL FINL FRN 05152055 BUSA9BM4 US74251VAL62	1/12/2021		1,813,000.00	188,914,600	99.767997742 ^C 0.009102494	1,845,707.96	202,769,478	3,593,296	10,261,582	13,854,878
1,200,000.00	PRUDENTIAL PLC FRN 07202055 BGBR22DZ XS1243995302	10/28/2019		1,340,712.00	187,906,361	120.358001709 ^C 151.194825005	1,444,296.02	218,370,084	15,661,368	14,802,355	30,463,723
1,800,000.00000	RAIFFEISEN BK IN FRN 06182032 BAUT0172 XS2189786226	6/9/2020		1,789,776.00	218,898,549	110.018997192 ^C 129.684236999	1,980,341.95	256,819,135	24,713,400	13,207,186	37,920,586
800,000.00000	RAIFFEISEN BK IN FRN 06172033 BAUT017H XS2353473692	6/9/2021		796,560.00	106,383,042	101.184997559 ^C 129.684236999	809,479.98	104,976,794	1,675,518	-3,081,766	-1,406,248
1,400,000.00000	RAIFFEISENBK AS FRN 06092028 BCZE0006 XS2348241048	6/2/2021		1,396,108.00	186,801,417	100.973999023 ^C 129.684236999	1,413,635.99	183,326,304	2,273,104	-5,748,216	-3,475,112
1,200,000.00	RL FINANCE N04 FRN 10072049 BGBR220S XS2061962465	9/30/2019		1,175,712.00	156,582,293	115.035003662 ^C 151.194825005	1,380,420.04	208,712,367	30,950,797	21,179,277	52,130,074

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
2,500,000.00000	ROYAL BK SCOTLND FRN 05182029 BGBR22MB US780097BG51	5/15/2018		2,500,000.00	275,799,985	117.797996521 ^C 0.009102494	2,944,949.91	323,532,200	48,882,198	-1,149,982	47,732,216
1,550,000.00000	SAMPO OYJ FRN 09032052 BFIN015V XS2226645278	8/28/2020		1,548,891.00	194,383,740	108.069999695 ^C 129.684236999	1,675,085.00	217,232,120	16,365,372	6,483,008	22,848,380
1,750,000.00000	SHINHAN FINL GRP FRN PERP/CALL BKOR011Y USY7749XAY77	5/4/2021		1,750,000.00	191,100,003	99.276000977 ^C 0.009102494	1,737,330.02	190,863,077	-1,391,924	1,154,999	-236,925
2,200,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 06302031 BFRA10TA FRO014002QE8	3/25/2021		2,186,690.00	281,015,732	101.108001709 ^C 129.684236999	2,224,376.04	288,466,509	4,887,285	2,563,492	7,450,777
800,000.00000	SUMITOMO LIFE FRN 04152081 BJPN308Q US86564CAC47	4/8/2021		800,000.00	87,415,997	104.732002258 ^C 0.009102494	837,856.02	92,046,863	4,158,862	472,004	4,630,866
1,800,000.00000	SWISS RE FIN FRN PERP/CALL BLUX02DE XS2049422343	8/28/2019		1,806,282.00	191,312,364	106.181999207 ^C 0.009102494	1,911,275.99	209,972,782	11,534,639	7,125,778	18,660,417
1,750,000.00000	SYNOVUS BANK GA FRN 10292030 BUSA9EM7 US87164DSE12	10/22/2020		1,750,000.00	183,408,741	107.268997192 ^C 0.009102494	1,877,207.45	206,230,012	13,975,011	8,846,261	22,821,272
1,700,000.00000	UBS GROUP FRN PERP/CALL BCHE012R CHO558521263	7/23/2020		1,720,400.00	184,074,201	109.585998535 ^C 0.009102494	1,862,961.98	204,665,004	15,661,859	4,928,945	20,590,804
4,550,000.00000	UNICREDIT SPA FRN 09232029 BITA0386 XS2055089457	11/25/2020		4,520,650.50	562,443,768	101.311996460 ^C 129.684236999	4,609,695.84	597,804,888	11,547,777	23,813,343	35,361,120
1,100,000.00	VIRGIN MONEY FRN 08192031 BGBR22R1 XS2343851510	5/12/2021		1,100,242.00	169,641,846	101.747001648 ^C 151.194825005	1,119,217.02	169,219,821	2,868,925	-3,290,949	-422,024

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリ・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
3,800,000.00000	VOLKSBANK NV FRN 10222030 BNLDTEUY XS2202902636	7/15/2020		3,890,234.00	479,510,696	105.379997253 ^C 129.684236999	4,004,439.90	519,312,732	14,810,704	24,991,332	39,802,036
1,100,000.00000	VOLKSBANK WIEN A FRN 10062027 BAUT017B AT000B121967	11/30/2020		1,097,800.00	136,932,717	102.421997070 ^C 129.684236999	1,126,641.97	146,107,704	3,740,349	5,434,638	9,174,987
1,850,000.00000	WESTPAC BANKING FRN 05132031 BAUS08CY XS2342206591	5/6/2021		1,850,000.00	243,337,069	100.802001953 ^C 129.684236999	1,864,837.04	241,839,968	1,924,130	-3,421,231	-1,497,101
1,200,000.00000	XLIT LTD FRN 06292047 BCYM05AV XS1633784183	6/22/2017		1,188,648.00	147,662,895	113.169998169 ^C 129.684236999	1,358,039.98	176,116,378	21,967,469	6,486,014	28,453,483
1,800,000.00000	ZURICH FINANCE FRN 04192051 BIRLO2BY XS2283177561	1/12/2021		1,800,000.00	187,560,000	101.225997925 ^C 0.009102494	1,822,067.96	200,172,388	2,424,386	10,188,002	12,612,388
178,026,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			180,044,323	21,978,271,036		189,467,103	23,679,900,747	1,167,965,786	533,663,931	1,701,629,717
変動利率											
2,000,000.00000	AEGON NV FRN PERP/CALL BNLDTEU9 NL0000116168	2/3/2020		1,715,000.00	186,437,645	94.067001343 ^C 0.009102494	1,881,340.03	206,684,017	18,274,116	1,972,257	20,246,373
1,740,000.00000	HARTFORD FINL FRN 02122047 BUSA9COP US416515BC76	12/4/2017		1,666,050.00	187,797,158	96.550003052 ^C 0.009102494	1,679,970.05	184,561,512	1,529,257	-4,764,903	-3,235,646
2,300,000.00000	HSBC BANK PLC FRN PERP/CALL GGBR22PB XS0015190423	12/20/2019		1,805,500.00	197,620,996	95.528999329 ^C 0.009102494	2,197,166.98	241,380,767	43,028,535	731,236	43,759,771
4,150,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		4,245,496.10	390,045,442	106.972999573 ^C 0.009102494	4,439,379.48	487,710,234	21,300,029	76,364,764	97,664,793

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。

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
変動利率											
1,290,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		1,302,286.41	125,730,568	106.623001099C 0.009102494	1,375,436.71	151,105,479	8,036,292	17,338,618	25,374,910
11,480,000.00000	変動利率小計			10,734,333	1,087,631,809		11,573,293	1,271,442,009	92,168,229	91,641,972	183,810,201
ミディアム・ターム・ノート											
800,000.00000	ASSICURAZIONI 2.124 % 10012030 BITA0387 XS2056491587	9/23/2019		800,950.00	94,550,296	107.441001892C 129.684236999	859,528.02	111,467,235	7,596,645	9,320,294	16,916,939
2,600,000.00000	BANQ FED CRD MUT 2.375 % 03242026 BFRA10NI XS1385945131	8/13/2019		2,887,300.00	341,110,482	109.573997498C 129.684236999	2,848,923.93	369,460,527	-4,976,771	33,326,815	28,350,044
6,240,000.00000	BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		6,235,382.91	692,056,012	110.476997375C 0.009102494	6,893,764.64	757,348,990	72,329,817	-7,036,839	65,292,978
800,000.00	HSBC HLDGS PLC 6 % 03292040 BGBR22NX XS0498768315	5/28/2019		1,017,096.00	141,259,280	144.216003418C 151.194825005	1,153,728.03	174,437,707	20,658,055	12,520,372	33,178,427
1,300,000.00000	HUARONG FIN 2019 3.625 % 09302030 BVB0049 XS2235973869	9/24/2020		1,295,567.00	136,649,924	91.516998291C 0.009102494	1,189,720.98	130,702,748	-11,628,244	5,681,068	-5,947,176
1,980,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249	6/9/2015		1,972,495.80	275,882,567	111.700996399C 129.684236999	2,211,679.73	286,819,998	31,018,385	-20,080,954	10,937,431
3,600,000.00000	NATL AUSTRALIABK 2.332 % 08212030 BAUS08C5 USG6S94TAC79	8/17/2020		3,600,000.00	381,852,016	98.264999390C 0.009102494	3,537,539.98	388,634,146	-6,861,858	13,643,988	6,782,130
2,870,000.00000	PHOENIX GRP 4.375 % 01242029 BGBR22P5 XS1881005117	11/29/2019		3,120,805.50	380,970,967	119.066001892C 129.684236999	3,417,194.25	443,156,230	38,436,949	23,748,313	62,185,262

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
メディアム・ターム・ノート											
3,000,000.00000	SANTANDER ISSUAN 3.125 % 01192027 BESPO263 XS1548444816	1/4/2017		2,967,900.00	364,610,750	114.053001404 ^C 129.684236999	3,421,590.04	443,726,294	58,836,447	20,279,097	79,115,544
1,800,000.00000	VOLKSBANK WIEN A 0.875 % 03232026 BAUT017E AT000B122080	3/12/2021		1,790,208.00	232,917,327	101.911003113 ^C 129.684236999	1,834,398.06	237,892,512	5,730,754	-755,568	4,975,186
24,990,000.00000	メディアム・ターム・ノート小計			25,687,705	3,041,859,621		27,368,068	3,343,646,387	211,140,179	90,646,586	301,786,765
私券債											
1,372,000.00000	AVIATION CAPITAL 3.5 % 11012027 BUSA9BXQ US05369AAA97	1/22/2021		1,469,658.96	152,550,606	106.193960000 ^C 0.009102494	1,456,981.13	160,063,949	-1,392,786	8,906,129	7,513,343
1,828,000.00000	AVIATION CAPITAL 4.875 % 10012025 BUSA9EQL US05367AAH68	1/20/2021		2,046,720.20	211,978,802	111.232002258 ^C 0.009102494	2,033,321.00	223,380,647	-1,472,036	12,873,881	11,401,845
700,000.00000	AVOLON HDGS 4.25 % 04152026 BCYM05C0 US05401AAL52	11/16/2020		699,825.00	73,198,199	108.617000000 ^C 0.009102494	760,319.00	83,528,646	6,645,871	3,684,576	10,330,447
3,250,000.00000	AVOLON HDGS 2.125 % 02212026 BCYM05C2 US05401AAM36	1/20/2021		3,203,427.50	332,732,013	99.771003723 ^C 0.009102494	3,242,557.62	356,227,384	4,298,835	19,196,535	23,495,370
570,000.00000	AVOLON HDGS 5.5 % 01152026 BCYM05C3 US05401AAK79	2/4/2021		643,661.10	67,854,754	113.488998413 ^C 0.009102494	646,887.29	71,067,038	354,429	2,857,855	3,212,284
655,000.00000	AVOLON HDGS 4.375 % 05012026 BCYM05C4 US05401AAG67	2/4/2021		707,275.55	74,560,989	108.996002197 ^C 0.009102494	713,923.81	78,431,671	730,378	3,140,304	3,870,682
1,850,000.00000	BNP PARIBAS 4.375 % 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97	10/1/2015		1,794,960.54	211,690,463	110.723999023 ^C 0.009102494	2,048,393.98	225,036,565	27,842,198	-14,496,096	13,346,102

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
私募債											
1,300,000.00000	GLOBAL ATLANTI 3.125 % 06152031 BUSA9EX7 US37959GAB32	6/14/2021		1,303,641.00	143,461,410	101.669998169 ^C 0.009102494	1,321,709.98	145,203,059	1,985,058	-243,408	1,741,650
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64	8/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	110.049003601 ^C 0.009102494	6,547,915.71	719,354,027	69,504,436	55,632,946	125,137,382
17,475,000.00000	私募債小計			17,784,422	1,862,243,881		18,772,010	2,062,292,986	108,496,383	91,552,722	200,049,105
公募債											
3,150,000.00000	AMERICAN HOMES 4 4.25 % 02152028 BUSA9C4K US02666TAA51	6/6/2019		3,314,357.00	355,353,340	114.583999634 ^C 0.009102494	3,609,395.99	396,528,247	32,412,984	8,761,923	41,174,907
1,850,000.00000	AXA EQUITABLE HO 5 % 04202048 BUSA9CRL US054561AM77	7/5/2019		1,905,925.50	206,726,207	129.994003296 ^C 0.009102494	2,404,889.06	264,201,115	54,816,137	2,658,770	57,474,907
400,000.00000	BOARD 2.75 % 01222033 BSUP121Y XS2288824969	1/14/2021		396,264.00	49,925,955	106.614000000 ^C 129.684236999	426,456.00	55,304,621	3,915,426	1,463,239	5,378,665
2,100,000.00000	CAPITAL ONE FINL 1.65 % 06122029 BUSA9DOT XS2010331440	6/5/2019		2,092,713.00	254,547,631	107.122001648 ^C 129.684236999	2,249,562.03	291,732,736	20,340,847	16,844,258	37,185,105
2,600,000.00000	CHUBB INA HLDGS 2.5 % 03152038 BUSA9C6V XS1785813251	3/1/2018		2,599,974.00	339,008,298	123.597999573 ^C 129.684236999	3,213,547.99	416,746,519	79,570,875	-1,832,654	77,738,221
1,030,000.00000	CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71	5/5/2016		1,581,977.00	169,137,062	172.466003418 ^C 0.009102494	1,776,399.84	195,155,288	21,359,293	4,658,933	26,018,226
1,000,000.00000	DIGITAL DUTCH 1 % 01152032 BNLDTEV3 XS2232115423	9/14/2020		990,170.00 129.684236999	124,200,604	100.597999573 ^C	1,005,980.00	130,459,748	2,050,307	4,208,837	6,259,144

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
1,550,000.00000	FIRST HORIZON 5.75 % 05012030 BUSA9EHA US337158AJ88	8/27/2020		1,755,995.00	186,916,888	124.221000671 ^C 0.009102494	1,925,425.51	211,527,249	18,613,636	5,996,724	24,610,360
5,150,000.00000	GOLDMAN SACHS GP 6.345% 02152034 BUSA2420 US38143VAA70	10/20/2017		6,447,248.16	718,749,937	141.619995117 ^C 0.009102494	7,293,429.75	801,256,200	92,961,510	-10,455,248	82,506,262
2,800,000.00	HASTINGS GRP FIN 3 % 05242025 BJEY0016 XS1815424202	9/27/2019		2,774,604.00	368,529,829	106.252998352 ^C 151.194825005	2,975,083.95	449,817,298	30,311,532	50,975,937	81,287,469
3,000,000.00000	HSBC BANK USA NA 7 % 01152039 BUSA9CQP US4042Q1AD94	1/11/2019		3,811,320.00	413,185,215	157.149002075 ^C 0.009102494	4,714,470.06	517,931,686	99,220,067	5,526,404	104,746,471
3,050,000.00000	HSBC HLDGS PLC 6.8% 06012038 BGBR2073 US404280AJ87	5/29/2019		3,937,580.50	430,633,498	144.856994629 ^C 0.009102494	4,418,138.34	485,376,682	52,794,084	1,949,100	54,743,184
1,400,000.00000	LA MONDIALE 0.75 % 04202026 BFRA10ST FRO014000774	10/13/2020		1,396,188.00	173,043,965	101.900001526 ^C 129.684236999	1,426,600.02	185,007,535	3,943,960	8,019,610	11,963,570
3,550,000.00000	LSEGA FIN PLC 3.2 % 04062041 BGBR22QT USG5690PAE19	3/25/2021		3,532,321.00	385,499,865	106.064700000 ^C 0.009102494	3,765,296.85	413,655,516	25,594,727	2,560,924	28,155,651
2,950,000.00000	MERRILL LYNCH 7.75 % 05142038 BUSA8579 US59023VAA89	10/20/2017		4,374,083.00	496,152,228	158.623001099 ^C 0.009102494	4,679,378.53	514,076,530	33,539,767	-15,615,465	17,924,302
2,000,000.00000	METLIFE INC 6.4% 12152036 BUSA5773 US59156RAP38	6/13/2017		2,305,000.00	253,434,756	128.468994141 ^C 0.009102494	2,569,379.88	282,272,077	29,044,774	-207,454	28,837,320
900,000.00000	NASDAQ INC 3.25 % 04282050 BUSA9EAK US63111XAB73	4/23/2020		882,882.00	95,011,345	102.761001587 ^C 0.009102494	924,849.01	101,603,914	4,610,496	1,982,072	6,592,568

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

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

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

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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
400,000.00	RL FINANCE NO3 6.125 % 11132028 BGBR22RA XS1319738537	7/15/2021		499,000.00	76,129,201	124.476997375 ^C 151.194825005	497,907.99	75,281,111	-165,106	-682,983	-848,089
4,850,000.00000	SANTANDER MEXICO 5.375 % 04172025 BMEX00CF USP1507SAH06	8/11/2020		5,480,500.00	583,481,444	113.351997375 ^C 0.009102494	5,497,571.87	603,963,251	1,875,516	18,606,292	20,481,808
1,500,000.00000	SANTANDER UK GRP 5.625 % 09152045 BGBR220V XS1291352711	10/18/2019		1,794,255.00	194,703,578	132.559000000 ^C 0.009102494	1,988,385.00	218,443,978	21,327,122	2,413,278	23,740,400
1,150,000.00000	STANDARD CHART 5.3 % 01092043 BGBR2207 XS0875267394	7/1/2019		1,284,964.00	139,193,730	124.865997314 ^C 0.009102494	1,435,958.97	157,754,454	16,588,307	1,972,416	18,560,723
2,730,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.202 % 09172029 BJPN3070 US86562MBS89	9/10/2019		2,730,000.00	292,888,035	107.386001587 ^C 0.009102494	2,931,637.84	322,069,736	22,151,934	7,029,768	29,181,702
49,110,000.00000	公募債小計			55,887,321	6,306,452,611		61,729,744	7,090,165,491	666,878,195	116,834,681	783,712,876
281,081,000.00000	社債合計			290,138,103	34,276,458,958		308,910,217	37,447,447,620	2,246,648,772	924,339,892	3,170,988,664
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
831,096.41000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	9/14/2015		831,096.41	70,754,595	1.000000000 ^S 80.291180997	831,096.41	66,729,712	0	-4,024,883	-4,024,883
1,200,000.00000		9/17/2015		1,200,000.00	104,033,759	1.000000000 ^S 80.291180997	1,200,000.00	96,349,417	0	-7,684,342	-7,684,342
4,580.00000		9/29/2015		4,580.00	384,148	1.000000000 ^S 80.291180997	4,580.00	367,734	0	-16,414	-16,414
1,050.33000		9/30/2015		1,050.33	88,338	1.000000000 ^S 80.291180997	1,050.33	84,332	0	-4,006	-4,006
41,308.36000		10/2/2015		41,308.36	3,484,596	1.000000000 ^S 80.291180997	41,308.36	3,316,697	0	-167,899	-167,899

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,200,000.00000		10/7/2015		1,200,000.00	102,916,819	1.000000000 ^S	1,200,000.00	96,349,417	0	-6,567,402	-6,567,402
479,833.36000		10/14/2015		479,833.36	41,980,363	80.291180997 1.000000000 ^S	479,833.36	38,526,387	0	-3,453,976	-3,453,976
34,504.30000		10/19/2015		34,504.30	2,988,523	80.291180997 1.000000000 ^S	34,504.30	2,770,391	0	-218,132	-218,132
1,500,000.00000		10/21/2015		1,500,000.00	130,659,384	80.291180997 1.000000000 ^S	1,500,000.00	120,436,771	0	-10,222,613	-10,222,613
146,966.97000		10/23/2015		146,966.97	12,774,602	80.291180997 1.000000000 ^S	146,966.97	11,800,152	0	-974,450	-974,450
33,373.73000		10/28/2015		33,373.73	2,903,788	80.291180997 1.000000000 ^S	33,373.73	2,679,616	0	-224,172	-224,172
1,210.89000		10/30/2015		1,210.89	104,252	80.291180997 1.000000000 ^S	1,210.89	97,224	0	-7,028	-7,028
191,801.71000		11/2/2015		191,801.71	16,513,279	80.291180997 1.000000000 ^S	191,801.71	15,399,986	0	-1,113,293	-1,113,293
1,450.44000		11/9/2015		1,450.44	125,722	80.291180997 1.000000000 ^S	1,450.44	116,458	0	-9,264	-9,264
1,100,000.00000		11/10/2015		1,100,000.00	95,614,298	80.291180997 1.000000000 ^S	1,100,000.00	88,320,299	0	-7,293,999	-7,293,999
1,370,000.00000		11/20/2015		1,370,000.00	121,160,088	80.291180997 1.000000000 ^S	1,370,000.00	109,998,918	0	-11,161,170	-11,161,170
1,241.63000		11/30/2015		1,241.63	110,913	80.291180997 1.000000000 ^S	1,241.63	99,692	0	-11,221	-11,221
55,217.71000		11/30/2015		55,217.71	4,875,314	80.291180997 1.000000000 ^S	55,217.71	4,433,495	0	-441,819	-441,819

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
67,803.25000		12/2/2015		67,803.25	6,086,449	1.000000000 ^S	67,803.25	5,444,003	0	-642,446	-642,446
1,200,000.00000		12/8/2015		1,200,000.00	107,613,376	80.291180997 1.000000000 ^S	1,200,000.00	96,349,417	0	-11,263,959	-11,263,959
479,833.36000		12/14/2015		479,833.36	41,838,537	80.291180997 1.000000000 ^S	479,833.36	38,526,387	0	-3,312,150	-3,312,150
1,300,000.00000		12/14/2015		1,300,000.00	113,352,056	80.291180997 1.000000000 ^S	1,300,000.00	104,378,535	0	-8,973,521	-8,973,521
920,000.00000		12/18/2015		920,000.00	80,272,386	80.291180997 1.000000000 ^S	920,000.00	73,867,887	0	-6,404,499	-6,404,499
7,027.13000		12/21/2015		7,027.13	613,059	80.291180997 1.000000000 ^S	7,027.13	564,217	0	-48,842	-48,842
69,609.63000		12/22/2015		69,609.63	6,058,273	80.291180997 1.000000000 ^S	69,609.63	5,589,039	0	-469,234	-469,234
30,652.58000		12/24/2015		30,652.58	2,680,171	80.291180997 1.000000000 ^S	30,652.58	2,461,132	0	-219,039	-219,039
31,897.52000		12/29/2015		31,897.52	2,787,126	80.291180997 1.000000000 ^S	31,897.52	2,561,090	0	-226,036	-226,036
930.50000		12/31/2015		930.50	81,438	80.291180997 1.000000000 ^S	930.50	74,711	0	-6,727	-6,727
64,476.82000		1/6/2016		64,476.82	5,481,018	80.291180997 1.000000000 ^S	64,476.82	5,176,920	0	-304,098	-304,098
29,058.54000		1/14/2016		29,058.54	2,404,861	80.291180997 1.000000000 ^S	29,058.54	2,333,144	0	-71,717	-71,717
306,365.43000		1/20/2016		306,365.43	24,967,386	80.291180997 1.000000000 ^S	306,365.43	24,598,442	0	-368,944	-368,944
453,323.95000		1/25/2016		453,323.95	37,747,169	80.291180997 1.000000000 ^S	453,323.95	36,397,915	0	-1,349,254	-1,349,254
54,860.74000		1/28/2016		54,860.74	4,588,058	80.291180997 1.000000000 ^S	54,860.74	4,404,834	0	-183,224	-183,224

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
778.74000		1/29/2016		778.74	66,688	1.000000000 ^S	778.74	62,526	0	-4,162	-4,162
						80.291180997					
9,624.24000		2/2/2016		9,624.24	825,300	1.000000000 ^S	9,624.24	772,742	0	-52,558	-52,558
						80.291180997					
45,449.01000		2/3/2016		45,449.01	3,852,337	1.000000000 ^S	45,449.01	3,649,155	0	-203,182	-203,182
						80.291180997					
900,000.00000		2/19/2016		900,000.00	73,080,576	1.000000000 ^S	900,000.00	72,262,063	0	-818,513	-818,513
						80.291180997					
549.31000		2/29/2016		549.31	44,286	1.000000000 ^S	549.31	44,105	0	-181	-181
						80.291180997					
549.31000		2/29/2016		549.31	7	1.000000000 ^S	549.31	44,105	0	44,098	44,098
						80.291180997					
300,000.00000		3/11/2016		300,000.00	25,334,694	1.000000000 ^S	300,000.00	24,087,354	0	-1,247,340	-1,247,340
						80.291180997					
870,000.00000		3/18/2016		870,000.00	73,945,274	1.000000000 ^S	870,000.00	69,853,327	0	-4,091,947	-4,091,947
						80.291180997					
670.89000		3/31/2016		670.89	58,005	1.000000000 ^S	670.89	53,867	0	-4,138	-4,138
						80.291180997					
670.89000		3/31/2016		670.89	8	1.000000000 ^S	670.89	53,867	0	53,859	53,859
						80.291180997					
49,152.02000		4/1/2016		49,152.02	4,249,676	1.000000000 ^S	49,152.02	3,946,474	0	-303,202	-303,202
						80.291180997					
0.11000		4/4/2016		0.11	9	1.000000000 ^S	0.11	9	0	0	0
						80.291180997					
118,557.70000		4/4/2016		118,557.70	10,179,618	1.000000000 ^S	118,557.70	9,519,138	0	-660,480	-660,480
						80.291180997					
54,704.79000		4/7/2016		54,704.79	4,550,661	1.000000000 ^S	54,704.79	4,392,312	0	-158,349	-158,349
						80.291180997					
1,000,000.00000		4/13/2016		1,000,000.00	82,840,523	1.000000000 ^S	1,000,000.00	80,291,181	0	-2,549,342	-2,549,342
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
279,833.36000		4/18/2016		279,833.36	23,441,485	1.000000000 ^S	279,833.36	22,468,151	0	-973,334	-973,334
						80.291180997					
2,500,000.00000		4/21/2016		2,500,000.00	213,220,853	1.000000000 ^S	2,500,000.00	200,727,952	0	-12,492,901	-12,492,901
						80.291180997					
9,845.91000		4/22/2016		9,845.91	837,399	1.000000000 ^S	9,845.91	790,540	0	-46,859	-46,859
						80.291180997					
71,738.60000		4/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000 ^S	71,738.60	5,759,977	0	-289,051	-289,051
						80.291180997					
651.99000		4/29/2016		651.99	8	1.000000000 ^S	651.99	52,349	0	52,341	52,341
						80.291180997					
651.99000		4/29/2016		651.99	53,237	1.000000000 ^S	651.99	52,349	0	-888	-888
						80.291180997					
3,199.32000		5/6/2016		3,199.32	256,662	1.000000000 ^S	3,199.32	256,877	0	215	215
						80.291180997					
37,851.41000		5/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000 ^S	37,851.41	3,039,134	0	36,368	36,368
						80.291180997					
52,780.08000		5/13/2016		52,780.08	4,214,171	1.000000000 ^S	52,780.08	4,237,775	0	23,604	23,604
						80.291180997					
1,000,000.00000		5/18/2016		1,000,000.00	79,969,300	1.000000000 ^S	1,000,000.00	80,291,181	0	321,881	321,881
						80.291180997					
28,390.46000		5/26/2016		28,390.46	2,250,076	1.000000000 ^S	28,390.46	2,279,504	0	29,428	29,428
						80.291180997					
487.18000		5/31/2016		487.18	39,143	1.000000000 ^S	487.18	39,116	0	-27	-27
						80.291180997					
77,920.52000		6/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000 ^S	77,920.52	6,256,331	0	139,575	139,575
						80.291180997					
435,877.61000		6/24/2016		435,877.61	34,923,776	1.000000000 ^S	435,877.61	34,997,128	0	73,352	73,352
						80.291180997					
193,723.40000		6/27/2016		193,723.40	14,830,685	1.000000000 ^S	193,723.40	15,554,281	0	723,596	723,596
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
51,500.28000		6/28/2016		51,500.28	3,847,670	1.000000000 ^S	51,500.28	4,135,018	0	287,348	287,348
370.39000		6/30/2016		370.39	28,294	80.291180997 1.000000000 ^S	370.39	29,739	0	1,445	1,445
41,200.23000		6/30/2016		41,200.23	3,144,683	80.291180997 1.000000000 ^S	41,200.23	3,308,015	0	163,332	163,332
28,419.86000		7/6/2016		28,419.86	2,155,687	80.291180997 1.000000000 ^S	28,419.86	2,281,864	0	126,177	126,177
975,728.88000		7/8/2016		975,728.88	73,727,142	80.291180997 1.000000000 ^S	975,728.88	78,342,424	0	4,615,282	4,615,282
10,303.13000		7/19/2016		10,303.13	827,218	80.291180997 1.000000000 ^S	10,303.13	827,250	0	32	32
85,548.05000		7/26/2016		85,548.05	6,769,315	80.291180997 1.000000000 ^S	85,548.05	6,868,754	0	99,439	99,439
49,430.39000		7/27/2016		49,430.39	3,887,241	80.291180997 1.000000000 ^S	49,430.39	3,968,824	0	81,583	81,583
966.37000		7/29/2016		966.37	75,274	80.291180997 1.000000000 ^S	966.37	77,591	0	2,317	2,317
279,833.36000		8/18/2016		279,833.36	21,425,498	80.291180997 1.000000000 ^S	279,833.36	22,468,151	0	1,042,653	1,042,653
900,000.00000		8/23/2016		900,000.00	68,935,762	80.291180997 1.000000000 ^S	900,000.00	72,262,063	0	3,326,301	3,326,301
312.44000		8/31/2016		312.44	24,288	80.291180997 1.000000000 ^S	312.44	25,086	0	798	798
2,905.89000		8/31/2016		2,905.89	224,400	80.291180997 1.000000000 ^S	2,905.89	233,317	0	8,917	8,917
244,354.19000		9/6/2016		244,354.19	19,161,904	80.291180997 1.000000000 ^S	244,354.19	19,619,486	0	457,582	457,582
1,000,000.00000		9/8/2016		1,000,000.00	78,053,406	80.291180997 1.000000000 ^S	1,000,000.00	80,291,181	0	2,237,775	2,237,775

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
397,132.94000		9/14/2016		397,132.94	30,405,336	1.000000000 ^S	397,132.94	31,886,273	0	1,480,937	1,480,937
						80.291180997					
74,453.68000		9/20/2016		74,453.68	5,728,229	1.000000000 ^S	74,453.68	5,977,974	0	249,745	249,745
						80.291180997					
109,580.94000		9/26/2016		109,580.94	8,438,525	1.000000000 ^S	109,580.94	8,798,383	0	359,858	359,858
						80.291180997					
57,901.38000		9/27/2016		57,901.38	4,441,152	1.000000000 ^S	57,901.38	4,648,970	0	207,818	207,818
						80.291180997					
38,744.71000		9/28/2016		38,744.71	2,976,084	1.000000000 ^S	38,744.71	3,110,859	0	134,775	134,775
						80.291180997					
205,508.38000		9/29/2016		205,508.38	15,834,834	1.000000000 ^S	205,508.38	16,500,511	0	665,677	665,677
						80.291180997					
556.44000		9/30/2016		556.44	43,120	1.000000000 ^S	556.44	44,677	0	1,557	1,557
						80.291180997					
96,868.26000		9/30/2016		96,868.26	7,548,319	1.000000000 ^S	96,868.26	7,777,667	0	229,348	229,348
						80.291180997					
10,705.70000		10/4/2016		10,705.70	833,355	1.000000000 ^S	10,705.70	859,573	0	26,218	26,218
						80.291180997					
145,292.56000		10/4/2016		145,292.56	11,309,888	1.000000000 ^S	145,292.56	11,665,711	0	355,823	355,823
						80.291180997					
279,833.36000		10/18/2016		279,833.36	22,177,198	1.000000000 ^S	279,833.36	22,468,151	0	290,953	290,953
						80.291180997					
83,301.08000		10/27/2016		83,301.08	6,668,666	1.000000000 ^S	83,301.08	6,688,342	0	19,676	19,676
						80.291180997					
833.18000		10/31/2016		833.18	66,625	1.000000000 ^S	833.18	66,897	0	272	272
						80.291180997					
74,583.53000		10/31/2016		74,583.53	5,960,068	1.000000000 ^S	74,583.53	5,988,400	0	28,332	28,332
						80.291180997					
142,255.95000		11/2/2016		142,255.95	11,375,416	1.000000000 ^S	142,255.95	11,421,898	0	46,482	46,482
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
134,756.68000		11/4/2016		134,756.68	10,678,599	1.000000000 ^S	134,756.68	10,819,773	0	141,174	141,174
849.50000		11/30/2016		849.50	71,518	80.291180997 1.000000000 ^S	849.50	68,207	0	-3,311	-3,311
885,465.77000		12/13/2016		885,465.77	76,650,084	80.291180997 1.000000000 ^S	885,465.77	71,095,092	0	-5,554,992	-5,554,992
279,833.36000		12/15/2016		279,833.36	24,213,667	80.291180997 1.000000000 ^S	279,833.36	22,468,151	0	-1,745,516	-1,745,516
829.17000		12/21/2016		829.17	70,900	80.291180997 1.000000000 ^S	829.17	66,575	0	-4,325	-4,325
464.62000		12/30/2016		464.62	39,240	80.291180997 1.000000000 ^S	464.62	37,305	0	-1,935	-1,935
1,226,556.69000		1/5/2017		1,226,556.69	104,711,557	80.291180997 1.000000000 ^S	1,226,556.69	98,481,685	0	-6,229,872	-6,229,872
282,384.02000		1/27/2017		282,384.02	24,408,543	80.291180997 1.000000000 ^S	282,384.02	22,672,946	0	-1,735,597	-1,735,597
1,199,688.72000		1/27/2017		1,199,688.72	103,697,984	80.291180997 1.000000000 ^S	1,199,688.72	96,324,424	0	-7,373,560	-7,373,560
587.10000		1/31/2017		587.10	50,174	80.291180997 1.000000000 ^S	587.10	47,139	0	-3,035	-3,035
277,517.50000		2/15/2017		277,517.50	24,213,142	80.291180997 1.000000000 ^S	277,517.50	22,282,208	0	-1,930,934	-1,930,934
786,360.14000		2/15/2017		786,360.14	68,609,185	80.291180997 1.000000000 ^S	786,360.14	63,137,784	0	-5,471,401	-5,471,401
63,860.76000		2/27/2017		63,860.76	5,510,685	80.291180997 1.000000000 ^S	63,860.76	5,127,456	0	-383,229	-383,229
598.25000		2/28/2017		598.25	51,463	80.291180997 1.000000000 ^S	598.25	48,034	0	-3,429	-3,429
702,000.00000		3/10/2017		702,000.00	60,452,566	80.291180997 1.000000000 ^S	702,000.00	56,364,409	0	-4,088,157	-4,088,157

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
1,412,000.00000		3/16/2017		1,412,000.00	122,935,970	1.000000000 ^S	1,412,000.00	113,371,148	0	-9,564,822	-9,564,822
62,745.10000		3/27/2017		62,745.10	5,307,406	80.291180997 1.000000000 ^S	62,745.10	5,037,878	0	-269,528	-269,528
470.71000		3/31/2017		470.71	40,012	80.291180997 1.000000000 ^S	470.71	37,794	0	-2,218	-2,218
89,505.17000		3/31/2017		89,505.17	7,644,438	80.291180997 1.000000000 ^S	89,505.17	7,186,476	0	-457,962	-457,962
766,000.00000		4/7/2017		766,000.00	64,145,110	80.291180997 1.000000000 ^S	766,000.00	61,503,045	0	-2,642,065	-2,642,065
279,833.36000		4/18/2017		279,833.36	23,068,187	80.291180997 1.000000000 ^S	279,833.36	22,468,151	0	-600,036	-600,036
1,068,505.95000		4/18/2017		1,068,505.95	88,082,762	80.291180997 1.000000000 ^S	1,068,505.95	85,791,605	0	-2,291,157	-2,291,157
1,125,804.00000		4/18/2017		1,125,804.00	92,806,152	80.291180997 1.000000000 ^S	1,125,804.00	90,392,133	0	-2,414,019	-2,414,019
106,547.89000		4/27/2017		106,547.89	8,885,757	80.291180997 1.000000000 ^S	106,547.89	8,554,856	0	-330,901	-330,901
978.41000		4/28/2017		978.41	81,563	80.291180997 1.000000000 ^S	978.41	78,558	0	-3,005	-3,005
5,940,000.00000		4/28/2017		5,940,000.00	492,026,980	80.291180997 1.000000000 ^S	5,940,000.00	476,929,615	0	-15,097,365	-15,097,365
1,390,000.00000		5/5/2017		1,390,000.00	115,907,314	80.291180997 1.000000000 ^S	1,390,000.00	111,604,742	0	-4,302,572	-4,302,572
1,344,823.25000		5/26/2017		1,344,823.25	112,415,381	80.291180997 1.000000000 ^S	1,344,823.25	107,977,447	0	-4,437,934	-4,437,934
895.60000		5/31/2017		895.60	73,730	80.291180997 1.000000000 ^S	895.60	71,909	0	-1,821	-1,821

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

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

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

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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
4,843.12000		6/2/2017		4,843.12	397,848	1.000000000 ^S	4,843.12	388,860	0	-8,988	-8,988
						80.291180997					
7,078.68000		6/13/2017		7,078.68	586,390	1.000000000 ^S	7,078.68	568,356	0	-18,034	-18,034
						80.291180997					
275,955.42000		6/14/2017		275,955.42	22,875,822	1.000000000 ^S	275,955.42	22,156,787	0	-719,035	-719,035
						80.291180997					
320,000.00000		6/14/2017		320,000.00	3,860	1.000000000 ^S	320,000.00	25,693,178	0	25,689,318	25,689,318
						80.291180997					
270,000.00000		6/16/2017		270,000.00	22,642,776	1.000000000 ^S	270,000.00	21,678,619	0	-964,157	-964,157
						80.291180997					
701,045.96000		6/28/2017		701,045.96	59,720,715	1.000000000 ^S	701,045.96	56,287,808	0	-3,432,907	-3,432,907
						80.291180997					
1,125,804.00000		6/28/2017		1,125,804.00	95,905,011	1.000000000 ^S	1,125,804.00	90,392,133	0	-5,512,878	-5,512,878
						80.291180997					
1,347,714.81000		6/28/2017		1,347,714.81	114,809,152	1.000000000 ^S	1,347,714.81	108,209,614	0	-6,599,538	-6,599,538
						80.291180997					
1,390,000.00000		6/28/2017		1,390,000.00	118,411,344	1.000000000 ^S	1,390,000.00	111,604,742	0	-6,806,602	-6,806,602
						80.291180997					
754.51000		6/30/2017		754.51	65,028	1.000000000 ^S	754.51	60,580	0	-4,448	-4,448
						80.291180997					
1,264,000.00000		7/18/2017		1,264,000.00	111,466,230	1.000000000 ^S	1,264,000.00	101,488,053	0	-9,978,177	-9,978,177
						80.291180997					
118,871.82000		7/25/2017		118,871.82	10,477,503	1.000000000 ^S	118,871.82	9,544,359	0	-933,144	-933,144
						80.291180997					
604.28000		7/31/2017		604.28	53,306	1.000000000 ^S	604.28	48,518	0	-4,788	-4,788
						80.291180997					
1,203,000.00000		8/17/2017		1,203,000.00	105,081,064	1.000000000 ^S	1,203,000.00	96,590,291	0	-8,490,773	-8,490,773
						80.291180997					
772,000.00000		8/30/2017		772,000.00	66,991,892	1.000000000 ^S	772,000.00	61,984,792	0	-5,007,100	-5,007,100
						80.291180997					

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
607.32000		8/31/2017		607.32	53,015	1.000000000 ^S	607.32	48,762	0	-4,253	-4,253
2,039.21000		9/1/2017		2,039.21	178,011	80.291180997 1.000000000 ^S	2,039.21	163,731	0	-14,280	-14,280
1,760,000.00000		9/18/2017		1,760,000.00	156,419,764	80.291180997 1.000000000 ^S	1,760,000.00	141,312,479	0	-15,107,285	-15,107,285
11,349.96000		9/27/2017		11,349.96	1,003,371	80.291180997 1.000000000 ^S	11,349.96	911,302	0	-92,069	-92,069
823.11000		9/29/2017		823.11	72,700	80.291180997 1.000000000 ^S	823.11	66,088	0	-6,612	-6,612
27,121.31000		10/3/2017		27,121.31	2,392,132	80.291180997 1.000000000 ^S	27,121.31	2,177,602	0	-214,530	-214,530
88,632.36000		10/26/2017		88,632.36	7,758,635	80.291180997 1.000000000 ^S	88,632.36	7,116,397	0	-642,238	-642,238
736.84000		10/31/2017		736.84	64,198	80.291180997 1.000000000 ^S	736.84	59,162	0	-5,036	-5,036
8,233.29000		11/16/2017		8,233.29	705,946	80.291180997 1.000000000 ^S	8,233.29	661,061	0	-44,885	-44,885
484,308.44000		11/21/2017		484,308.44	41,128,430	80.291180997 1.000000000 ^S	484,308.44	38,885,697	0	-2,242,733	-2,242,733
230.45000		11/30/2017		230.45	19,577	80.291180997 1.000000000 ^S	230.45	18,503	0	-1,074	-1,074
1,695,000.00000		12/11/2017		1,695,000.00	144,533,433	80.291180997 1.000000000 ^S	1,695,000.00	136,093,552	0	-8,439,881	-8,439,881
27,121.31000		12/28/2017		27,121.31	2,386,064	80.291180997 1.000000000 ^S	27,121.31	2,177,602	0	-208,462	-208,462
523.56000		12/29/2017		523.56	46,130	80.291180997 1.000000000 ^S	523.56	42,037	0	-4,093	-4,093
96,866.03000		12/29/2017		96,866.03	8,518,656	80.291180997 1.000000000 ^S	96,866.03	7,777,488	0	-741,168	-741,168

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
19,401.29000		1/9/2018		19,401.29	1,717,947	1.000000000 ^S	19,401.29	1,557,752	0	-160,195	-160,195
3,712.80000		1/17/2018		3,712.80	327,014	80.291180997 1.000000000 ^S	3,712.80	298,105	0	-28,909	-28,909
759,513.00000		1/17/2018		759,513.00	66,896,074	80.291180997 1.000000000 ^S	759,513.00	60,982,196	0	-5,913,878	-5,913,878
1,439,655.07000		1/17/2018		1,439,655.07	126,801,347	80.291180997 1.000000000 ^S	1,439,655.07	115,591,606	0	-11,209,741	-11,209,741
1,571,080.15000		1/17/2018		1,571,080.15	138,376,951	80.291180997 1.000000000 ^S	1,571,080.15	126,143,881	0	-12,233,070	-12,233,070
937.46000		1/31/2018		937.46	82,860	80.291180997 1.000000000 ^S	937.46	75,270	0	-7,590	-7,590
767,000.00000		2/9/2018		767,000.00	65,324,597	80.291180997 1.000000000 ^S	767,000.00	61,583,336	0	-3,741,261	-3,741,261
222,233.52000		2/13/2018		222,233.52	18,878,141	80.291180997 1.000000000 ^S	222,233.52	17,843,392	0	-1,034,749	-1,034,749
572.52000		2/28/2018		572.52	47,605	80.291180997 1.000000000 ^S	572.52	45,968	0	-1,637	-1,637
184,792.64000		3/16/2018		184,792.64	15,316,445	80.291180997 1.000000000 ^S	184,792.64	14,837,219	0	-479,226	-479,226
116,717.00000		3/22/2018		116,717.00	9,564,337	80.291180997 1.000000000 ^S	116,717.00	9,371,346	0	-192,991	-192,991
730,655.07000		3/22/2018		730,655.07	59,873,294	80.291180997 1.000000000 ^S	730,655.07	58,665,158	0	-1,208,136	-1,208,136
1,359,283.00000		3/22/2018		1,359,283.00	111,386,007	80.291180997 1.000000000 ^S	1,359,283.00	109,138,437	0	-2,247,570	-2,247,570
548.62000		3/29/2018		548.62	44,754	80.291180997 1.000000000 ^S	548.62	44,049	0	-705	-705
575,000.00000		4/18/2018		575,000.00	47,878,949	80.291180997 1.000000000 ^S	575,000.00	46,167,429	0	-1,711,520	-1,711,520

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
0.04000		4/30/2018		0.04	3	1.000000000 ^S	0.04	3	0	0	0
404.67000		4/30/2018		404.67	33,426	80.291180997 1.000000000 ^S	404.67	32,491	0	-935	-935
57,148.43000		5/8/2018		57,148.43	4,695,613	80.291180997 1.000000000 ^S	57,148.43	4,588,515	0	-107,098	-107,098
700,000.00000		5/15/2018		700,000.00	57,931,683	80.291180997 1.000000000 ^S	700,000.00	56,203,827	0	-1,727,856	-1,727,856
1,305,655.07000		5/16/2018		1,305,655.07	107,677,003	80.291180997 1.000000000 ^S	1,305,655.07	104,832,588	0	-2,844,415	-2,844,415
28,442.03000		5/24/2018		28,442.03	2,361,408	80.291180997 1.000000000 ^S	28,442.03	2,283,644	0	-77,764	-77,764
337.42000		5/31/2018		337.42	27,738	80.291180997 1.000000000 ^S	337.42	27,092	0	-646	-646
41,255.59000		6/5/2018		41,255.59	3,458,418	80.291180997 1.000000000 ^S	41,255.59	3,312,460	0	-145,958	-145,958
58,915.23000		6/6/2018		58,915.23	4,919,294	80.291180997 1.000000000 ^S	58,915.23	4,730,373	0	-188,921	-188,921
777,655.00000		6/13/2018		777,655.00	65,293,219	80.291180997 1.000000000 ^S	777,655.00	62,438,838	0	-2,854,381	-2,854,381
537.23000		6/29/2018		537.23	43,966	80.291180997 1.000000000 ^S	537.23	43,135	0	-831	-831
690,000.00000		7/24/2018		690,000.00	56,754,011	80.291180997 1.000000000 ^S	690,000.00	55,400,915	0	-1,353,096	-1,353,096
31,207.59000		7/30/2018		31,207.59	2,564,892	80.291180997 1.000000000 ^S	31,207.59	2,505,694	0	-59,198	-59,198
377.22000		7/31/2018		377.22	31,391	80.291180997 1.000000000 ^S	377.22	30,287	0	-1,104	-1,104
144,861.46000		7/31/2018		144,861.46	11,909,905	80.291180997 1.000000000 ^S	144,861.46	11,631,098	0	-278,807	-278,807

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
118,572.90000		8/21/2018		118,572.90	9,567,568	1.000000000 ^S	118,572.90	9,520,358	0	-47,210	-47,210
						80.291180997					
110,597.95000		8/28/2018		110,597.95	9,022,493	1.000000000 ^S	110,597.95	8,880,040	0	-142,453	-142,453
						80.291180997					
110,062.03000		8/29/2018		110,062.03	8,986,444	1.000000000 ^S	110,062.03	8,837,010	0	-149,434	-149,434
						80.291180997					
541.98000		8/31/2018		541.98	43,462	1.000000000 ^S	541.98	43,516	0	54	54
						80.291180997					
35,715.85000		9/5/2018		35,715.85	2,856,195	1.000000000 ^S	35,715.85	2,867,668	0	11,473	11,473
						80.291180997					
10,030.29000		9/6/2018		10,030.29	804,746	1.000000000 ^S	10,030.29	805,344	0	598	598
						80.291180997					
587.18000		9/28/2018		587.18	48,257	1.000000000 ^S	587.18	47,145	0	-1,112	-1,112
						80.291180997					
446,987.00000		10/10/2018		446,987.00	35,791,150	1.000000000 ^S	446,987.00	35,889,114	0	97,964	97,964
						80.291180997					
653,013.00000		10/10/2018		653,013.00	52,288,067	1.000000000 ^S	653,013.00	52,431,185	0	143,118	143,118
						80.291180997					
606.11000		10/31/2018		606.11	48,480	1.000000000 ^S	606.11	48,665	0	185	185
						80.291180997					
9,875.75000		11/5/2018		9,875.75	804,182	1.000000000 ^S	9,875.75	792,936	0	-11,246	-11,246
						80.291180997					
459,000.00000		11/8/2018		459,000.00	37,882,262	1.000000000 ^S	459,000.00	36,853,652	0	-1,028,610	-1,028,610
						80.291180997					
340,876.48000		11/14/2018		340,876.48	27,993,030	1.000000000 ^S	340,876.48	27,369,375	0	-623,655	-623,655
						80.291180997					
258,427.01000		11/15/2018		258,427.01	21,246,604	1.000000000 ^S	258,427.01	20,749,410	0	-497,194	-497,194
						80.291180997					
653,013.00000		11/20/2018		653,013.00	53,686,499	1.000000000 ^S	653,013.00	52,431,185	0	-1,255,314	-1,255,314
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
1,657.84000		11/29/2018		1,657.84	136,528	1.000000000 ^S	1,657.84	133,110	0	-3,418	-3,418
554.37000		11/30/2018		554.37	45,968	80.291180997 1.000000000 ^S	554.37	44,511	0	-1,457	-1,457
94,945.23000		11/30/2018		94,945.23	7,866,272	80.291180997 1.000000000 ^S	94,945.23	7,623,265	0	-243,007	-243,007
56,052.05000		12/6/2018		56,052.05	4,609,486	80.291180997 1.000000000 ^S	56,052.05	4,500,485	0	-109,001	-109,001
48,583.36000		12/7/2018		48,583.36	3,938,270	80.291180997 1.000000000 ^S	48,583.36	3,900,815	0	-37,455	-37,455
722,616.57000		12/19/2018		722,616.57	58,370,578	80.291180997 1.000000000 ^S	722,616.57	58,019,738	0	-350,840	-350,840
748.57000		12/31/2018		748.57	57,819	80.291180997 1.000000000 ^S	748.57	60,104	0	2,285	2,285
0.09000		1/17/2019		0.09	7	80.291180997 1.000000000 ^S	0.09	7	0	0	0
44,669.10000		1/17/2019		44,669.10	3,490,922	80.291180997 1.000000000 ^S	44,669.10	3,586,535	0	95,613	95,613
8,335.47000		1/23/2019		8,335.47	651,153	80.291180997 1.000000000 ^S	8,335.47	669,265	0	18,112	18,112
48,430.88000		1/29/2019		48,430.88	3,793,245	80.291180997 1.000000000 ^S	48,430.88	3,888,573	0	95,328	95,328
722,616.57000		1/29/2019		722,616.57	56,597,394	80.291180997 1.000000000 ^S	722,616.57	58,019,738	0	1,422,344	1,422,344
44,745.30000		1/30/2019		44,745.30	3,497,538	80.291180997 1.000000000 ^S	44,745.30	3,592,653	0	95,115	95,115
481.63000		1/31/2019		481.63	38,219	80.291180997 1.000000000 ^S	481.63	38,671	0	452	452
12,725.41000		2/1/2019		12,725.41	1,009,804	80.291180997 1.000000000 ^S	12,725.41	1,021,738	0	11,934	11,934

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
587,000.00000		2/12/2019		587,000.00	45,794,312	1.000000000 ^S	587,000.00	47,130,923	0	1,336,611	1,336,611
						80.291180997					
276,145.36000		2/22/2019		276,145.36	21,664,268	1.000000000 ^S	276,145.36	22,172,037	0	507,769	507,769
						80.291180997					
7,748.98000		2/26/2019		7,748.98	616,211	1.000000000 ^S	7,748.98	622,175	0	5,964	5,964
						80.291180997					
474,707.41000		2/27/2019		474,707.41	37,717,403	1.000000000 ^S	474,707.41	38,114,819	0	397,416	397,416
						80.291180997					
344.55000		2/28/2019		344.55	27,288	1.000000000 ^S	344.55	27,664	0	376	376
						80.291180997					
130,705.64000		2/28/2019		130,705.64	10,352,769	1.000000000 ^S	130,705.64	10,494,510	0	141,741	141,741
						80.291180997					
122,045.83000		3/5/2019		122,045.83	9,671,860	1.000000000 ^S	122,045.83	9,799,204	0	127,344	127,344
						80.291180997					
6,205.83000		3/8/2019		6,205.83	486,732	1.000000000 ^S	6,205.83	498,273	0	11,541	11,541
						80.291180997					
50,174.39000		3/12/2019		50,174.39	3,937,071	1.000000000 ^S	50,174.39	4,028,561	0	91,490	91,490
						80.291180997					
1,309,616.57000		3/14/2019		1,309,616.57	103,235,373	1.000000000 ^S	1,309,616.57	105,150,661	0	1,915,288	1,915,288
						80.291180997					
817.38000		3/29/2019		817.38	64,267	1.000000000 ^S	817.38	65,628	0	1,361	1,361
						80.291180997					
980,000.00000		3/29/2019		980,000.00	76,680,395	1.000000000 ^S	980,000.00	78,685,357	0	2,004,962	2,004,962
						80.291180997					
348,561.68000		4/3/2019		348,561.68	27,414,241	1.000000000 ^S	348,561.68	27,986,429	0	572,188	572,188
						80.291180997					
757.42000		4/30/2019		757.42	59,375	1.000000000 ^S	757.42	60,814	0	1,439	1,439
						80.291180997					
225,051.00000		5/22/2019		225,051.00	17,131,923	1.000000000 ^S	225,051.00	18,069,611	0	937,688	937,688
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
270,321.00000		5/22/2019		270,321.00	20,578,085	1.000000000 ^S	270,321.00	21,704,392	0	1,126,307	1,126,307
824,616.57000		5/22/2019		824,616.57	62,773,628	80.291180997 1.000000000 ^S	824,616.57	66,209,438	0	3,435,810	3,435,810
969,628.00000		5/22/2019		969,628.00	73,812,569	80.291180997 1.000000000 ^S	969,628.00	77,852,577	0	4,040,008	4,040,008
23,246.84000		5/24/2019		23,246.84	1,756,916	80.291180997 1.000000000 ^S	23,246.84	1,866,516	0	109,600	109,600
9,866.90000		5/28/2019		9,866.90	747,461	80.291180997 1.000000000 ^S	9,866.90	792,225	0	44,764	44,764
406.98000		5/31/2019		406.98	30,616	80.291180997 1.000000000 ^S	406.98	32,677	0	2,061	2,061
407,039.23000		6/5/2019		407,039.23	30,767,128	80.291180997 1.000000000 ^S	407,039.23	32,681,660	0	1,914,532	1,914,532
108,816.91000		6/17/2019		108,816.91	8,116,170	80.291180997 1.000000000 ^S	108,816.91	8,737,038	0	620,868	620,868
264,480.03000		6/19/2019		264,480.03	19,708,851	80.291180997 1.000000000 ^S	264,480.03	21,235,414	0	1,526,563	1,526,563
279,974.49000		6/21/2019		279,974.49	20,833,547	80.291180997 1.000000000 ^S	279,974.49	22,479,482	0	1,645,935	1,645,935
28,800.40000		6/24/2019		28,800.40	2,145,362	80.291180997 1.000000000 ^S	28,800.40	2,312,418	0	167,056	167,056
21,821.41000		6/26/2019		21,821.41	1,626,618	80.291180997 1.000000000 ^S	21,821.41	1,752,067	0	125,449	125,449
55,817.33000		6/27/2019		55,817.33	4,195,210	80.291180997 1.000000000 ^S	55,817.33	4,481,639	0	286,429	286,429
350.04000		6/28/2019		350.04	26,465	80.291180997 1.000000000 ^S	350.04	28,105	0	1,640	1,640
27,908.70000		7/2/2019		27,908.70	2,106,119	80.291180997 1.000000000 ^S	27,908.70	2,240,822	0	134,703	134,703

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
59,549.79000		7/3/2019		59,549.79	4,503,747	1.000000000 ^S	59,549.79	4,781,323	0	277,576	277,576
131,731.93000		7/5/2019		131,731.93	9,968,860	80.291180997 1.000000000 ^S	131,731.93	10,576,912	0	608,052	608,052
1,131.71000		7/26/2019		1,131.71	85,538	80.291180997 1.000000000 ^S	1,131.71	90,866	0	5,328	5,328
114,258.08000		7/29/2019		114,258.08	8,579,187	80.291180997 1.000000000 ^S	114,258.08	9,173,916	0	594,729	594,729
4.01000		7/31/2019		4.01	300	80.291180997 1.000000000 ^S	4.01	322	0	22	22
417.64000		7/31/2019		417.64	31,254	80.291180997 1.000000000 ^S	417.64	33,533	0	2,279	2,279
134,803.62000		8/6/2019		134,803.62	9,687,573	80.291180997 1.000000000 ^S	134,803.62	10,823,542	0	1,135,969	1,135,969
86,380.36000		8/7/2019		86,380.36	6,225,477	80.291180997 1.000000000 ^S	86,380.36	6,935,581	0	710,104	710,104
143,214.88000		8/13/2019		143,214.88	10,194,166	80.291180997 1.000000000 ^S	143,214.88	11,498,892	0	1,304,726	1,304,726
39,099.81000		8/22/2019		39,099.81	2,826,023	80.291180997 1.000000000 ^S	39,099.81	3,139,370	0	313,347	313,347
971.71000		8/23/2019		971.71	69,976	80.291180997 1.000000000 ^S	971.71	78,020	0	8,044	8,044
121,648.02000		8/27/2019		121,648.02	8,734,737	80.291180997 1.000000000 ^S	121,648.02	9,767,263	0	1,032,526	1,032,526
61,537.04000		8/29/2019		61,537.04	4,393,490	80.291180997 1.000000000 ^S	61,537.04	4,940,882	0	547,392	547,392
153.50000		8/30/2019		153.50	10,978	80.291180997 1.000000000 ^S	153.50	12,325	0	1,347	1,347
15,452.99000		8/30/2019		15,452.99	1,107,096	80.291180997 1.000000000 ^S	15,452.99	1,240,739	0	133,643	133,643

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
55,856.26000		9/3/2019		55,856.26	3,992,855	1.000000000 ^S	55,856.26	4,484,765	0	491,910	491,910
						80.291180997					
48,430.88000		9/4/2019		48,430.88	3,464,290	1.000000000 ^S	48,430.88	3,888,573	0	424,283	424,283
						80.291180997					
54,952.37000		9/5/2019		54,952.37	3,962,710	1.000000000 ^S	54,952.37	4,412,191	0	449,481	449,481
						80.291180997					
64,772.08000		9/10/2019		64,772.08	4,770,186	1.000000000 ^S	64,772.08	5,200,627	0	430,441	430,441
						80.291180997					
153,971.37000		9/12/2019		153,971.37	11,376,349	1.000000000 ^S	153,971.37	12,362,543	0	986,194	986,194
						80.291180997					
41,554.36000		9/20/2019		41,554.36	3,053,248	1.000000000 ^S	41,554.36	3,336,449	0	283,201	283,201
						80.291180997					
971.71000		9/27/2019		971.71	70,724	1.000000000 ^S	971.71	78,020	0	7,296	7,296
						80.291180997					
154.70000		9/30/2019		154.70	11,276	1.000000000 ^S	154.70	12,421	0	1,145	1,145
						80.291180997					
441,818.69000		9/30/2019		441,818.69	32,367,102	1.000000000 ^S	441,818.69	35,474,144	0	3,107,042	3,107,042
						80.291180997					
252,253.40000		10/1/2019		252,253.40	18,387,049	1.000000000 ^S	252,253.40	20,253,723	0	1,866,674	1,866,674
						80.291180997					
23,141.04000		10/2/2019		23,141.04	1,670,366	1.000000000 ^S	23,141.04	1,858,021	0	187,655	187,655
						80.291180997					
14,691.66000		10/8/2019		14,691.66	1,060,324	1.000000000 ^S	14,691.66	1,179,611	0	119,287	119,287
						80.291180997					
42,474.00000		10/17/2019		42,474.00	3,117,927	1.000000000 ^S	42,474.00	3,410,288	0	292,361	292,361
						80.291180997					
494,616.57000		10/17/2019		494,616.57	36,308,766	1.000000000 ^S	494,616.57	39,713,349	0	3,404,583	3,404,583
						80.291180997					
796,526.00000		10/17/2019		796,526.00	58,471,304	1.000000000 ^S	796,526.00	63,954,013	0	5,482,709	5,482,709
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
93,901.30000		10/25/2019		93,901.30	6,952,942	1.000000000 ^S	93,901.30	7,539,446	0	586,504	586,504
						80.291180997					
1,189,000.00000		10/25/2019		1,189,000.00	88,039,755	1.000000000 ^S	1,189,000.00	95,466,214	0	7,426,459	7,426,459
						80.291180997					
80,888.08000		10/28/2019		80,888.08	5,997,956	1.000000000 ^S	80,888.08	6,494,599	0	496,643	496,643
						80.291180997					
174.01000		10/31/2019		174.01	12,960	1.000000000 ^S	174.01	13,971	0	1,011	1,011
						80.291180997					
54,378.37000		11/5/2019		54,378.37	4,072,485	1.000000000 ^S	54,378.37	4,366,104	0	293,619	293,619
						80.291180997					
40,069.97000		11/6/2019		40,069.97	3,015,842	1.000000000 ^S	40,069.97	3,217,265	0	201,423	201,423
						80.291180997					
44,114.45000		11/18/2019		44,114.45	3,268,289	1.000000000 ^S	44,114.45	3,542,001	0	273,712	273,712
						80.291180997					
1,583.93000		11/20/2019		1,583.93	117,312	1.000000000 ^S	1,583.93	127,176	0	9,864	9,864
						80.291180997					
57.48000		11/29/2019		57.48	4,258	1.000000000 ^S	57.48	4,615	0	357	357
						80.291180997					
58,114.35000		11/29/2019		58,114.35	4,306,495	1.000000000 ^S	58,114.35	4,666,070	0	359,575	359,575
						80.291180997					
98,741.57000		12/2/2019		98,741.57	7,314,041	1.000000000 ^S	98,741.57	7,928,077	0	614,036	614,036
						80.291180997					
48,402.75000		12/3/2019		48,402.75	3,598,527	1.000000000 ^S	48,402.75	3,886,314	0	287,787	287,787
						80.291180997					
32,537.11000		12/9/2019		32,537.11	2,414,911	1.000000000 ^S	32,537.11	2,612,443	0	197,532	197,532
						80.291180997					
172,797.71000		12/10/2019		172,797.71	12,818,591	1.000000000 ^S	172,797.71	13,874,132	0	1,055,541	1,055,541
						80.291180997					
1,198.23000		12/13/2019		1,198.23	90,365	1.000000000 ^S	1,198.23	96,207	0	5,842	5,842
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
83.64000		12/31/2019		83.64	6,390	1.000000000 ^S	83.64	6,716	0	326	326
29,041.67000		1/6/2020		29,041.67	2,182,412	80.291180997 1.000000000 ^S	29,041.67	2,331,790	0	149,378	149,378
1,470,000.00000		1/17/2020		1,470,000.00	111,680,575	80.291180997 1.000000000 ^S	1,470,000.00	118,028,036	0	6,347,461	6,347,461
29,041.67000		1/22/2020		29,041.67	2,189,532	80.291180997 1.000000000 ^S	29,041.67	2,331,790	0	142,258	142,258
141,977.62000		1/28/2020		141,977.62	10,448,495	80.291180997 1.000000000 ^S	141,977.62	11,399,551	0	951,056	951,056
181.73000		1/31/2020		181.73	13,186	80.291180997 1.000000000 ^S	181.73	14,591	0	1,405	1,405
98,842.82000		2/6/2020		98,842.82	7,316,767	80.291180997 1.000000000 ^S	98,842.82	7,936,207	0	619,440	619,440
7,549.76000		2/7/2020		7,549.76	559,446	80.291180997 1.000000000 ^S	7,549.76	606,179	0	46,733	46,733
95.44000		2/28/2020		95.44	6,637	80.291180997 1.000000000 ^S	95.44	7,663	0	1,026	1,026
57,889.69000		3/2/2020		57,889.69	4,025,994	80.291180997 1.000000000 ^S	57,889.69	4,648,032	0	622,038	622,038
272,839.00000		3/10/2020		272,839.00	18,623,739	80.291180997 1.000000000 ^S	272,839.00	21,906,566	0	3,282,827	3,282,827
659,818.00000		3/10/2020		659,818.00	45,038,569	80.291180997 1.000000000 ^S	659,818.00	52,977,566	0	7,938,997	7,938,997
700,000.00000		3/10/2020		700,000.00	47,781,355	80.291180997 1.000000000 ^S	700,000.00	56,203,827	0	8,422,472	8,422,472
18.70000		3/31/2020		18.70	1,236	80.291180997 1.000000000 ^S	18.70	1,501	0	265	265
71,462.33000		4/1/2020		71,462.33	4,721,792	80.291180997 1.000000000 ^S	71,462.33	5,737,795	0	1,016,003	1,016,003

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
9,680.58000		4/21/2020		9,680.58	665,714	1.000000000 ^S	9,680.58	777,265	0	111,551	111,551
						80.291180997					
63,772.17000		4/23/2020		63,772.17	4,339,960	1.000000000 ^S	63,772.17	5,120,343	0	780,383	780,383
						80.291180997					
251,782.00000		5/19/2020		251,782.00	17,578,822	1.000000000 ^S	251,782.00	20,215,874	0	2,637,052	2,637,052
						80.291180997					
255,125.00000		5/19/2020		255,125.00	17,812,223	1.000000000 ^S	255,125.00	20,484,288	0	2,672,065	2,672,065
						80.291180997					
273,093.00000		5/19/2020		273,093.00	19,066,706	1.000000000 ^S	273,093.00	21,926,959	0	2,860,253	2,860,253
						80.291180997					
895,616.57000		5/19/2020		895,616.57	62,529,825	1.000000000 ^S	895,616.57	71,910,112	0	9,380,287	9,380,287
						80.291180997					
71,152.03000		5/29/2020		71,152.03	5,099,670	1.000000000 ^S	71,152.03	5,712,881	0	613,211	613,211
						80.291180997					
977.46000		6/2/2020		977.46	71,336	1.000000000 ^S	977.46	78,481	0	7,145	7,145
						80.291180997					
825,000.00000		6/19/2020		825,000.00	60,452,907	1.000000000 ^S	825,000.00	66,240,224	0	5,787,317	5,787,317
						80.291180997					
14,449.44000		6/24/2020		14,449.44	1,068,462	1.000000000 ^S	14,449.44	1,160,163	0	91,701	91,701
						80.291180997					
7,942.71000		6/29/2020		7,942.71	583,600	1.000000000 ^S	7,942.71	637,730	0	54,130	54,130
						80.291180997					
500,000.00000		7/10/2020		500,000.00	37,343,226	1.000000000 ^S	500,000.00	40,145,590	0	2,802,364	2,802,364
						80.291180997					
187,138.00000		7/28/2020		187,138.00	14,063,868	1.000000000 ^S	187,138.00	15,025,531	0	961,663	961,663
						80.291180997					
368,862.00000		7/28/2020		368,862.00	27,720,860	1.000000000 ^S	368,862.00	29,616,366	0	1,895,506	1,895,506
						80.291180997					
1,664,616.57000		7/28/2020		1,664,616.57	125,099,912	1.000000000 ^S	1,664,616.57	133,654,030	0	8,554,118	8,554,118
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
8,497.85000		7/30/2020		8,497.85	639,909	1.000000000 ^S	8,497.85	682,302	0	42,393	42,393
						80.291180997					
417,000.00000		8/12/2020		417,000.00	31,803,007	1.000000000 ^S	417,000.00	33,481,422	0	1,678,415	1,678,415
						80.291180997					
71,170.60000		8/17/2020		71,170.60	5,434,220	1.000000000 ^S	71,170.60	5,714,372	0	280,152	280,152
						80.291180997					
900,000.00000		8/24/2020		900,000.00	68,215,418	1.000000000 ^S	900,000.00	72,262,063	0	4,046,645	4,046,645
						80.291180997					
978.97000		8/25/2020		978.97	74,331	1.000000000 ^S	978.97	78,603	0	4,272	4,272
						80.291180997					
32,913.88000		8/27/2020		32,913.88	2,523,983	1.000000000 ^S	32,913.88	2,642,694	0	118,711	118,711
						80.291180997					
42,672.92000		9/1/2020		42,672.92	3,346,648	1.000000000 ^S	42,672.92	3,426,259	0	79,611	79,611
						80.291180997					
23,304.76000		9/3/2020		23,304.76	1,811,440	1.000000000 ^S	23,304.76	1,871,167	0	59,727	59,727
						80.291180997					
126,727.84000		9/4/2020		126,727.84	9,821,882	1.000000000 ^S	126,727.84	10,175,128	0	353,246	353,246
						80.291180997					
290,679.76000		9/16/2020		290,679.76	22,390,123	1.000000000 ^S	290,679.76	23,339,021	0	948,898	948,898
						80.291180997					
155,318.66000		9/23/2020		155,318.66	11,702,094	1.000000000 ^S	155,318.66	12,470,719	0	768,625	768,625
						80.291180997					
51,470.92000		10/6/2020		51,470.92	3,909,939	1.000000000 ^S	51,470.92	4,132,661	0	222,722	222,722
						80.291180997					
3,562.84000		10/8/2020		3,562.84	269,638	1.000000000 ^S	3,562.84	286,065	0	16,427	16,427
						80.291180997					
12,584.74000		10/13/2020		12,584.74	955,554	1.000000000 ^S	12,584.74	1,010,444	0	54,890	54,890
						80.291180997					
22,253.78000		10/14/2020		22,253.78	1,683,325	1.000000000 ^S	22,253.78	1,786,782	0	103,457	103,457
						80.291180997					

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
862,815.16000		10/21/2020		862,815.16	64,251,517	1.000000000 ^S	862,815.16	69,276,448	0	5,024,931	5,024,931
58,541.51000		10/26/2020		58,541.51	4,358,946	80.291180997 1.000000000 ^S	58,541.51	4,700,367	0	341,421	341,421
178,062.61000		11/13/2020		178,062.61	13,596,134	80.291180997 1.000000000 ^S	178,062.61	14,296,857	0	700,723	700,723
74,506.18000		11/17/2020		74,506.18	5,705,626	80.291180997 1.000000000 ^S	74,506.18	5,982,189	0	276,563	276,563
172,617.12000		11/25/2020		172,617.12	13,265,673	80.291180997 1.000000000 ^S	172,617.12	13,859,632	0	593,959	593,959
43,562.48000		11/30/2020		43,562.48	3,351,823	80.291180997 1.000000000 ^S	43,562.48	3,497,683	0	145,860	145,860
84,957.41000		12/2/2020		84,957.41	6,529,312	80.291180997 1.000000000 ^S	84,957.41	6,821,331	0	292,019	292,019
35,306.23000		12/7/2020		35,306.23	2,734,402	80.291180997 1.000000000 ^S	35,306.23	2,834,779	0	100,377	100,377
279,767.70000		12/16/2020		279,767.70	21,880,912	80.291180997 1.000000000 ^S	279,767.70	22,462,879	0	581,967	581,967
220,000.00000		12/17/2020		220,000.00	17,226,863	80.291180997 1.000000000 ^S	220,000.00	17,664,060	0	437,197	437,197
278,065.00000		12/17/2020		278,065.00	21,773,580	80.291180997 1.000000000 ^S	278,065.00	22,326,167	0	552,587	552,587
293,903.00000		12/17/2020		293,903.00	23,013,758	80.291180997 1.000000000 ^S	293,903.00	23,597,819	0	584,061	584,061
345,000.00000		12/17/2020		345,000.00	27,014,853	80.291180997 1.000000000 ^S	345,000.00	27,700,457	0	685,604	685,604
412,032.00000		12/17/2020		412,032.00	32,263,721	80.291180997 1.000000000 ^S	412,032.00	33,082,536	0	818,815	818,815
606,097.00000		12/17/2020		606,097.00	47,459,772	80.291180997 1.000000000 ^S	606,097.00	48,664,244	0	1,204,472	1,204,472

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
766,101.00000		12/17/2020		766,101.00	59,988,713	1.000000000 ^S	766,101.00	61,511,154	0	1,522,441	1,522,441
						80.291180997					
1,079,652.57000		12/17/2020		1,079,652.57	84,541,030	1.000000000 ^S	1,079,652.57	86,686,580	0	2,145,550	2,145,550
						80.291180997					
2,721.84000		12/18/2020		2,721.84	213,629	1.000000000 ^S	2,721.84	218,540	0	4,911	4,911
						80.291180997					
49,932.28000		12/24/2020		49,932.28	3,922,933	1.000000000 ^S	49,932.28	4,009,122	0	86,189	86,189
						80.291180997					
977.46000		1/4/2021		977.46	77,873	1.000000000 ^S	977.46	78,481	0	608	608
						80.291180997					
256,589.45000		1/6/2021		256,589.45	20,385,106	1.000000000 ^S	256,589.45	20,601,870	0	216,764	216,764
						80.291180997					
99,206.26000		1/14/2021		99,206.26	7,979,169	1.000000000 ^S	99,206.26	7,965,388	0	-13,781	-13,781
						80.291180997					
977.46000		1/25/2021		977.46	78,338	1.000000000 ^S	977.46	78,481	0	143	143
						80.291180997					
3,138.00000		1/27/2021		3,138.00	251,946	1.000000000 ^S	3,138.00	251,954	0	8	8
						80.291180997					
36,989.75000		1/28/2021		36,989.75	2,959,739	1.000000000 ^S	36,989.75	2,969,951	0	10,212	10,212
						80.291180997					
198,691.97000		2/1/2021		198,691.97	15,960,377	1.000000000 ^S	198,691.97	15,953,213	0	-7,164	-7,164
						80.291180997					
125,166.54000		2/2/2021		125,166.54	10,007,952	1.000000000 ^S	125,166.54	10,049,769	0	41,817	41,817
						80.291180997					
105,617.87000		2/17/2021		105,617.87	8,679,976	1.000000000 ^S	105,617.87	8,480,184	0	-199,792	-199,792
						80.291180997					
220,000.00000		2/25/2021		220,000.00	18,454,619	1.000000000 ^S	220,000.00	17,664,060	0	-790,559	-790,559
						80.291180997					
606,097.00000		2/25/2021		606,097.00	50,842,222	1.000000000 ^S	606,097.00	48,664,244	0	-2,177,978	-2,177,978
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
1,079,652.57000		2/25/2021		1,079,652.57	90,566,256	1.000000000 ^S	1,079,652.57	86,686,580	0	-3,879,676	-3,879,676
						80.291180997					
1,178,133.00000		2/25/2021		1,178,133.00	98,827,250	1.000000000 ^S	1,178,133.00	94,593,690	0	-4,233,560	-4,233,560
						80.291180997					
27,274.36000		3/16/2021		27,274.36	2,300,840	1.000000000 ^S	27,274.36	2,189,891	0	-110,949	-110,949
						80.291180997					
230,000.00000		3/17/2021		230,000.00	19,429,054	1.000000000 ^S	230,000.00	18,466,972	0	-962,082	-962,082
						80.291180997					
68,625.67000		3/24/2021		68,625.67	5,726,146	1.000000000 ^S	68,625.67	5,510,036	0	-216,110	-216,110
						80.291180997					
21,173.53000		3/31/2021		21,173.53	1,774,898	1.000000000 ^S	21,173.53	1,700,048	0	-74,850	-74,850
						80.291180997					
16,773.41000		4/1/2021		16,773.41	1,411,689	1.000000000 ^S	16,773.41	1,346,757	0	-64,932	-64,932
						80.291180997					
16,508.40000		4/9/2021		16,508.40	1,377,708	1.000000000 ^S	16,508.40	1,325,479	0	-52,229	-52,229
						80.291180997					
178,000.00000		4/12/2021		178,000.00	14,880,930	1.000000000 ^S	178,000.00	14,291,830	0	-589,100	-589,100
						80.291180997					
34,272.09000		4/19/2021		34,272.09	2,885,186	1.000000000 ^S	34,272.09	2,751,747	0	-133,439	-133,439
						80.291180997					
227,000.00000		4/22/2021		227,000.00	19,030,155	1.000000000 ^S	227,000.00	18,226,098	0	-804,057	-804,057
						80.291180997					
2,719.28000		4/23/2021		2,719.28	227,002	1.000000000 ^S	2,719.28	218,334	0	-8,668	-8,668
						80.291180997					
48,402.75000		4/26/2021		48,402.75	4,042,204	1.000000000 ^S	48,402.75	3,886,314	0	-155,890	-155,890
						80.291180997					
42,832.87000		5/10/2021		42,832.87	3,646,416	1.000000000 ^S	42,832.87	3,439,102	0	-207,314	-207,314
						80.291180997					
29,602.39000		5/18/2021		29,602.39	2,509,916	1.000000000 ^S	29,602.39	2,376,811	0	-133,105	-133,105
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
338,819.02000		5/19/2021		338,819.02	28,754,662	1.000000000 ^S	338,819.02	27,204,179	0	-1,550,483	-1,550,483
158,194.73000		5/20/2021		158,194.73	13,306,116	80.291180997 1.000000000 ^S	158,194.73	12,701,642	0	-604,474	-604,474
122,000.37000		5/21/2021		122,000.37	10,317,694	80.291180997 1.000000000 ^S	122,000.37	9,795,554	0	-522,140	-522,140
103,675.01000		6/4/2021		103,675.01	8,763,261	80.291180997 1.000000000 ^S	103,675.01	8,324,189	0	-439,072	-439,072
111,326.28000		6/16/2021		111,326.28	9,413,337	80.291180997 1.000000000 ^S	111,326.28	8,938,518	0	-474,819	-474,819
704,554.28000		6/17/2021		704,554.28	59,707,879	80.291180997 1.000000000 ^S	704,554.28	56,569,495	0	-3,138,384	-3,138,384
20,358.08000		6/18/2021		20,358.08	1,698,573	80.291180997 1.000000000 ^S	20,358.08	1,634,574	0	-63,999	-63,999
374,599.57000		6/21/2021		374,599.57	30,903,754	80.291180997 1.000000000 ^S	374,599.57	30,077,042	0	-826,712	-826,712
155,060.62000		6/22/2021		155,060.62	12,858,750	80.291180997 1.000000000 ^S	155,060.62	12,450,000	0	-408,750	-408,750
27,585.42000		6/24/2021		27,585.42	2,296,246	80.291180997 1.000000000 ^S	27,585.42	2,214,866	0	-81,380	-81,380
15,408.23000		6/29/2021		15,408.23	1,290,589	80.291180997 1.000000000 ^S	15,408.23	1,237,145	0	-53,444	-53,444
38,622.97000		6/30/2021		38,622.97	3,207,212	80.291180997 1.000000000 ^S	38,622.97	3,101,084	0	-106,128	-106,128
290,416.31000		7/1/2021		290,416.31	24,199,155	80.291180997 1.000000000 ^S	290,416.31	23,317,869	0	-881,286	-881,286
73,842.66000		7/2/2021		73,842.66	6,159,599	80.291180997 1.000000000 ^S	73,842.66	5,928,914	0	-230,685	-230,685
64,540.65000		7/8/2021		64,540.65	5,339,767	80.291180997 1.000000000 ^S	64,540.65	5,182,045	0	-157,722	-157,722

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
29,905.52000		7/14/2021		29,905.52	2,463,219	1.000000000 ^S	29,905.52	2,401,150	0	-62,069	-62,069
						80.291180997					
36,014.76000		7/27/2021		36,014.76	2,935,161	1.000000000 ^S	36,014.76	2,891,668	0	-43,493	-43,493
						80.291180997					
49,274.00000		7/29/2021		49,274.00	3,980,733	1.000000000 ^S	49,274.00	3,956,268	0	-24,465	-24,465
						80.291180997					
128,112.34000		7/30/2021		128,112.34	10,393,021	1.000000000 ^S	128,112.34	10,286,291	0	-106,730	-106,730
						80.291180997					
141,000.00000		8/5/2021		141,000.00	11,399,302	1.000000000 ^S	141,000.00	11,321,057	0	-78,245	-78,245
						80.291180997					
5,217.67000		8/6/2021		5,217.67	424,333	1.000000000 ^S	5,217.67	418,933	0	-5,400	-5,400
						80.291180997					
11,729.09000		8/19/2021		11,729.09	932,826	1.000000000 ^S	11,729.09	941,742	0	8,916	8,916
						80.291180997					
456,000.00000		8/19/2021		456,000.00	36,266,141	1.000000000 ^S	456,000.00	36,612,779	0	346,638	346,638
						80.291180997					
5,913.02000		8/27/2021		5,913.02	471,517	1.000000000 ^S	5,913.02	474,763	0	3,246	3,246
						80.291180997					
-150,655.79000		2/12/2015		-150,655.79	-13,988,254	1.000000000 ^S	-150,655.79	-12,096,331	0	1,891,923	1,891,923
						80.291180997					
-195,720.57000		2/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.000000000 ^S	-195,720.57	-15,714,636	0	2,455,681	2,455,681
						80.291180997					
-12,078.57000		2/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.000000000 ^S	-12,078.57	-969,803	0	150,155	150,155
						80.291180997					
-203,751.45000		2/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000 ^S	-203,751.45	-16,359,445	0	2,589,636	2,589,636
						80.291180997					
-16,686.40000		2/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.000000000 ^S	-16,686.40	-1,339,771	0	214,942	214,942
						80.291180997					
-164,421.91000		3/2/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.000000000 ^S	-164,421.91	-13,201,629	0	2,183,963	2,183,963
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-12,405.71000		3/3/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.000000000 ^S	-12,405.71	-996,069	0	163,804	163,804
						80.291180997					
-125,474.92000		3/6/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000 ^S	-125,474.92	-10,074,530	0	1,649,620	1,649,620
						80.291180997					
-152,618.80000		3/9/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.000000000 ^S	-152,618.80	-12,253,944	0	2,041,755	2,041,755
						80.291180997					
-708,611.63000		3/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.000000000 ^S	-708,611.63	-56,895,265	0	8,711,966	8,711,966
						80.291180997					
-27,978.64000		3/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.000000000 ^S	-27,978.64	-2,246,438	0	343,981	343,981
						80.291180997					
-174,287.44000		3/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.000000000 ^S	-174,287.44	-13,993,744	0	2,292,091	2,292,091
						80.291180997					
-7,763.28000		3/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000 ^S	-7,763.28	-623,323	0	97,661	97,661
						80.291180997					
-302,844.98000		3/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000 ^S	-302,844.98	-24,315,781	0	3,948,067	3,948,067
						80.291180997					
-97,995.40000		3/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000 ^S	-97,995.40	-7,868,166	0	1,380,149	1,380,149
						80.291180997					
-172,798.05000		3/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000 ^S	-172,798.05	-13,874,160	0	2,332,751	2,332,751
						80.291180997					
-975,466.76000		3/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000 ^S	-975,466.76	-78,321,378	0	12,633,244	12,633,244
						80.291180997					
-256,508.24000		3/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000 ^S	-256,508.24	-20,595,350	0	3,099,044	3,099,044
						80.291180997					
-189,563.24000		3/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000 ^S	-189,563.24	-15,220,256	0	2,157,042	2,157,042
						80.291180997					
-206,250.64000		4/2/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000 ^S	-206,250.64	-16,560,107	0	2,238,835	2,238,835
						80.291180997					
-90,318.63000		4/7/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000 ^S	-90,318.63	-7,251,789	0	942,892	942,892
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-74,243.21000		4/8/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000 ^S 80.291180997	-74,243.21	-5,961,075	0	874,576	874,576
-78,171.43000		4/9/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000 ^S 80.291180997	-78,171.43	-6,276,476	0	942,414	942,414
-705,086.17000		4/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000 ^S 80.291180997	-705,086.17	-56,612,201	0	8,496,502	8,496,502
-37,651.50000		4/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000 ^S 80.291180997	-37,651.50	-3,023,083	0	453,712	453,712
-246,307.80000		4/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000 ^S 80.291180997	-246,307.80	-19,776,344	0	2,657,419	2,657,419
-57,294.63000		4/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000 ^S 80.291180997	-57,294.63	-4,600,254	0	619,870	619,870
-39,422.26000		4/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000 ^S 80.291180997	-39,422.26	-3,165,260	0	481,362	481,362
-167,462.13000		4/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000 ^S 80.291180997	-167,462.13	-13,445,732	0	1,983,628	1,983,628
-11,204.33000		4/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000 ^S 80.291180997	-11,204.33	-899,609	0	132,718	132,718
-58,785.17000		4/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000 ^S 80.291180997	-58,785.17	-4,719,931	0	748,234	748,234
-203,446.05000		4/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000 ^S 80.291180997	-203,446.05	-16,334,924	0	2,575,345	2,575,345
-19,719.18000		4/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000 ^S 80.291180997	-19,719.18	-1,583,276	0	252,613	252,613
-746,896.35000		4/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000 ^S 80.291180997	-746,896.35	-59,969,190	0	10,029,536	10,029,536
-47,545.85000		4/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000 ^S 80.291180997	-47,545.85	-3,817,512	0	738,531	738,531
-35,878.86000		5/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000 ^S 80.291180997	-35,878.86	-2,880,756	0	515,188	515,188

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-59,220.06000		5/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000 ^S 80.291180997	-59,220.06	-4,754,849	0	866,826	866,826
-684,441.51000		5/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000 ^S 80.291180997	-684,441.51	-54,954,617	0	10,506,911	10,506,911
-157,020.19000		5/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000 ^S 80.291180997	-157,020.19	-12,607,336	0	2,410,429	2,410,429
-45,251.01000		5/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000 ^S 80.291180997	-45,251.01	-3,633,257	0	731,259	731,259
-518,763.75000		5/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000 ^S 80.291180997	-518,763.75	-41,652,154	0	7,871,931	7,871,931
-6,306.57000		5/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000 ^S 80.291180997	-6,306.57	-506,362	0	95,498	95,498
-52,113.71000		5/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000 ^S 80.291180997	-52,113.71	-4,184,271	0	768,336	768,336
-393,354.22000		5/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000 ^S 80.291180997	-393,354.22	-31,582,875	0	5,750,110	5,750,110
-245,742.67000		6/1/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000 ^S 80.291180997	-245,742.67	-19,730,969	0	3,611,763	3,611,763
-5,170.70000		6/2/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000 ^S 80.291180997	-5,170.70	-415,162	0	75,075	75,075
-78,821.02000		6/3/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000 ^S 80.291180997	-78,821.02	-6,328,633	0	1,249,547	1,249,547
-113,860.14000		6/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000 ^S 80.291180997	-113,860.14	-9,141,965	0	1,727,041	1,727,041
-666,844.90000		6/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000 ^S 80.291180997	-666,844.90	-53,541,765	0	9,881,808	9,881,808
-110,710.67000		6/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000 ^S 80.291180997	-110,710.67	-8,889,090	0	1,640,594	1,640,594
-54,834.71000		6/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000 ^S 80.291180997	-54,834.71	-4,402,744	0	831,953	831,953

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-83,284.46000		6/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000 ^S	-83,284.46	-6,687,008	0	1,259,376	1,259,376
						80.291180997					
-479,833.36000		6/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000 ^S	-479,833.36	-38,526,387	0	7,493,718	7,493,718
						80.291180997					
-17,695.85000		6/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000 ^S	-17,695.85	-1,420,821	0	276,362	276,362
						80.291180997					
-470,587.90000		6/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000 ^S	-470,587.90	-37,784,058	0	7,042,388	7,042,388
						80.291180997					
-156,011.32000		6/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000 ^S	-156,011.32	-12,526,333	0	2,488,495	2,488,495
						80.291180997					
-49,769.29000		6/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000 ^S	-49,769.29	-3,996,035	0	742,326	742,326
						80.291180997					
-106,347.76000		6/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000 ^S	-106,347.76	-8,538,787	0	1,640,135	1,640,135
						80.291180997					
-13,612.05000		6/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000 ^S	-13,612.05	-1,092,928	0	208,452	208,452
						80.291180997					
-255,184.50000		6/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000 ^S	-255,184.50	-20,489,065	0	3,686,812	3,686,812
						80.291180997					
-321,067.80000		6/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000 ^S	-321,067.80	-25,778,913	0	4,357,559	4,357,559
						80.291180997					
-64,733.44000		7/1/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000 ^S	-64,733.44	-5,197,524	0	890,640	890,640
						80.291180997					
-28,970.18000		7/6/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000 ^S	-28,970.18	-2,326,050	0	346,696	346,696
						80.291180997					
-19,343.07000		7/8/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000 ^S	-19,343.07	-1,553,078	0	202,295	202,295
						80.291180997					
-676,268.27000		7/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000 ^S	-676,268.27	-54,298,378	0	6,642,959	6,642,959
						80.291180997					
-68,449.88000		7/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000 ^S	-68,449.88	-5,495,922	0	672,380	672,380
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-275,119.99000		7/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000 ^S	-275,119.99	-22,089,709	0	2,953,402	2,953,402
						80.291180997					
-93,052.47000		7/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000 ^S	-93,052.47	-7,471,293	0	1,054,699	1,054,699
						80.291180997					
-73,784.97000		7/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000 ^S	-73,784.97	-5,924,282	0	836,313	836,313
						80.291180997					
-110,427.24000		7/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000 ^S	-110,427.24	-8,866,334	0	1,305,908	1,305,908
						80.291180997					
-164,563.52000		7/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000 ^S	-164,563.52	-13,212,999	0	1,848,941	1,848,941
						80.291180997					
-87,873.33000		7/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000 ^S	-87,873.33	-7,055,453	0	855,459	855,459
						80.291180997					
-13,601.15000		7/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000 ^S	-13,601.15	-1,092,052	0	129,884	129,884
						80.291180997					
-59,933.50000		8/5/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000 ^S	-59,933.50	-4,812,131	0	698,004	698,004
						80.291180997					
-143,187.55000		8/6/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000 ^S	-143,187.55	-11,496,697	0	1,648,290	1,648,290
						80.291180997					
-158,035.75000		8/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000 ^S	-158,035.75	-12,688,877	0	1,840,295	1,840,295
						80.291180997					
-669,741.07000		8/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000 ^S	-669,741.07	-53,774,301	0	7,887,125	7,887,125
						80.291180997					
-284,337.22000		8/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000 ^S	-284,337.22	-22,829,771	0	3,348,463	3,348,463
						80.291180997					
-7,892,527.01000		8/12/2015		-7,892,527.01	-718,905,956	1.000000000 ^S	-7,892,527.01	-633,700,315	0	85,205,641	85,205,641
						80.291180997					
-156,845.94000		8/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000 ^S	-156,845.94	-12,593,346	0	1,727,013	1,727,013
						80.291180997					
-53,128.21000		8/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000 ^S	-53,128.21	-4,265,727	0	597,392	597,392
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-162,199.09000		8/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000 ^S	-162,199.09	-13,023,156	0	1,842,216	1,842,216
						80.291180997					
-21,061.93000		8/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000 ^S	-21,061.93	-1,691,087	0	230,074	230,074
						80.291180997					
-265,076.96000		8/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000 ^S	-265,076.96	-21,283,342	0	2,842,732	2,842,732
						80.291180997					
-19,404.32000		8/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000 ^S	-19,404.32	-1,557,996	0	-1,557,783	-1,557,783
						80.291180997					
-196,668.41000		8/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000 ^S	-196,668.41	-15,790,739	0	1,010,150	1,010,150
						80.291180997					
-462,149.98000		8/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000 ^S	-462,149.98	-37,106,568	0	2,653,044	2,653,044
						80.291180997					
-32,107.10000		8/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000 ^S	-32,107.10	-2,577,917	0	140,906	140,906
						80.291180997					
-86,093.85000		9/1/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000 ^S	-86,093.85	-6,912,577	0	484,099	484,099
						80.291180997					
-93,737.05000		9/2/2015		-93,737.05	-7,905,601	1.000000000 ^S	-93,737.05	-7,526,258	0	379,343	379,343
						80.291180997					
-4,157.48000		9/3/2015		-4,157.48	-349,983	1.000000000 ^S	-4,157.48	-333,809	0	16,174	16,174
						80.291180997					
-102,367.87000		9/4/2015		-102,367.87	-8,650,619	1.000000000 ^S	-102,367.87	-8,219,237	0	431,382	431,382
						80.291180997					
-642,283.89000		9/9/2015		-642,283.89	-53,850,984	1.000000000 ^S	-642,283.89	-51,569,732	0	2,281,252	2,281,252
						80.291180997					
-476,290.57000		9/10/2015		-476,290.57	-40,505,866	1.000000000 ^S	-476,290.57	-38,241,932	0	2,263,934	2,263,934
						80.291180997					
-107,114.37000		9/11/2015		-107,114.37	-9,136,362	1.000000000 ^S	-107,114.37	-8,600,339	0	536,023	536,023
						80.291180997					
-575,423.39000		9/14/2015		-575,423.39	-48,988,118	1.000000000 ^S	-575,423.39	-46,201,424	0	2,786,694	2,786,694
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-92,596.64000		9/14/2015		-92,596.64	-7,883,126	1.000000000 ^S	-92,596.64	-7,434,694	0	448,432	448,432
						80.291180997					
-636,341.83000		9/15/2015		-636,341.83	-54,620,063	1.000000000 ^S	-636,341.83	-51,092,637	0	3,527,426	3,527,426
						80.291180997					
-57,680.52000		9/16/2015		-57,680.52	-4,915,496	1.000000000 ^S	-57,680.52	-4,631,237	0	284,259	284,259
						80.291180997					
-148,138.07000		9/17/2015		-148,138.07	-12,842,800	1.000000000 ^S	-148,138.07	-11,894,181	0	948,619	948,619
						80.291180997					
-888,355.94000		9/18/2015		-888,355.94	-76,774,291	1.000000000 ^S	-888,355.94	-71,327,148	0	5,447,143	5,447,143
						80.291180997					
-252,646.81000		9/24/2015		-252,646.81	-21,364,671	1.000000000 ^S	-252,646.81	-20,285,311	0	1,079,360	1,079,360
						80.291180997					
-49,056.91000		9/25/2015		-49,056.91	-4,093,695	1.000000000 ^S	-49,056.91	-3,938,837	0	154,858	154,858
						80.291180997					
-72,142.91000		9/28/2015		-72,142.91	-6,115,979	1.000000000 ^S	-72,142.91	-5,792,439	0	323,540	323,540
						80.291180997					
-70,823.93000		9/30/2015		-70,823.93	-5,954,410	1.000000000 ^S	-70,823.93	-5,686,537	0	267,873	267,873
						80.291180997					
-198,025.63000		10/1/2015		-198,025.63	-16,654,940	1.000000000 ^S	-198,025.63	-15,899,712	0	755,228	755,228
						80.291180997					
-122,307.91000		10/6/2015		-122,307.91	-10,416,695	1.000000000 ^S	-122,307.91	-9,820,247	0	596,448	596,448
						80.291180997					
-39,456.54000		10/6/2015		-39,456.54	-3,360,426	1.000000000 ^S	-39,456.54	-3,168,012	0	192,414	192,414
						80.291180997					
-17,998.66000		10/7/2015		-17,998.66	-1,543,637	1.000000000 ^S	-17,998.66	-1,445,134	0	98,503	98,503
						80.291180997					
-94,044.65000		10/8/2015		-94,044.65	-8,145,767	1.000000000 ^S	-94,044.65	-7,550,956	0	594,811	594,811
						80.291180997					
-413,942.78000		10/9/2015		-413,942.78	-35,732,854	1.000000000 ^S	-413,942.78	-33,235,955	0	2,496,899	2,496,899
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-18,029.52000		10/9/2015		-18,029.52	-1,556,365	1.000000000 ^S	-18,029.52	-1,447,611	0	108,754	108,754
						80.291180997					
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324	1.000000000 ^S	-201,846.72	-16,206,512	0	1,272,812	1,272,812
						80.291180997					
-106,109.09000		10/15/2015		-106,109.09	-9,188,731	1.000000000 ^S	-106,109.09	-8,519,624	0	669,107	669,107
						80.291180997					
-13,046.14000		10/16/2015		-13,046.14	-1,131,560	1.000000000 ^S	-13,046.14	-1,047,490	0	84,070	84,070
						80.291180997					
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340	1.000000000 ^S	-938,332.24	-75,339,804	0	5,870,536	5,870,536
						80.291180997					
-52,217.18000		10/26/2015		-52,217.18	-4,570,998	1.000000000 ^S	-52,217.18	-4,192,579	0	378,419	378,419
						80.291180997					
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268	1.000000000 ^S	-156,124.38	-12,535,411	0	1,169,857	1,169,857
						80.291180997					
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000 ^S	-221,516.12	-17,785,791	0	1,211,667	1,211,667
						80.291180997					
-22,603.85000		11/5/2015		-22,603.85	-1,966,401	1.000000000 ^S	-22,603.85	-1,814,890	0	151,511	151,511
						80.291180997					
-28,494.89000		11/6/2015		-28,494.89	-2,474,770	1.000000000 ^S	-28,494.89	-2,287,888	0	186,882	186,882
						80.291180997					
-33,113.93000		11/10/2015		-33,113.93	-2,878,332	1.000000000 ^S	-33,113.93	-2,658,757	0	219,575	219,575
						80.291180997					
-908,189.06000		11/12/2015		-908,189.06	-78,762,965	1.000000000 ^S	-908,189.06	-72,919,572	0	5,843,393	5,843,393
						80.291180997					
-377,515.60000		11/12/2015		-377,515.60	-32,740,152	1.000000000 ^S	-377,515.60	-30,311,173	0	2,428,979	2,428,979
						80.291180997					
-6,155.13000		11/13/2015		-6,155.13	-537,849	1.000000000 ^S	-6,155.13	-494,203	0	43,646	43,646
						80.291180997					
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000 ^S	-156,394.49	-12,557,098	0	1,080,434	1,080,434
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-16,749.47000		11/18/2015		-16,749.47	-1,472,174	1.000000000 ^S	-16,749.47	-1,344,835	0	127,339	127,339
						80.291180997					
-535,263.52000		11/19/2015		-535,263.52	-46,835,996	1.000000000 ^S	-535,263.52	-42,976,940	0	3,859,056	3,859,056
						80.291180997					
-171,111.94000		11/20/2015		-171,111.94	-15,132,801	1.000000000 ^S	-171,111.94	-13,738,780	0	1,394,021	1,394,021
						80.291180997					
-74,491.46000		11/24/2015		-74,491.46	-6,589,055	1.000000000 ^S	-74,491.46	-5,981,007	0	608,048	608,048
						80.291180997					
-907,253.22000		11/25/2015		-907,253.22	-80,284,748	1.000000000 ^S	-907,253.22	-72,844,432	0	7,440,316	7,440,316
						80.291180997					
-124,050.79000		11/27/2015		-124,050.79	-10,988,000	1.000000000 ^S	-124,050.79	-9,960,184	0	1,027,816	1,027,816
						80.291180997					
-125,483.80000		12/1/2015		-125,483.80	-11,209,303	1.000000000 ^S	-125,483.80	-10,075,242	0	1,134,061	1,134,061
						80.291180997					
-29,511.79000		12/3/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000 ^S	-29,511.79	-2,369,536	0	296,904	296,904
						80.291180997					
-33,063.02000		12/4/2015		-33,063.02	-2,969,898	1.000000000 ^S	-33,063.02	-2,654,669	0	315,229	315,229
						80.291180997					
-33,111.98000		12/8/2015		-33,111.98	-2,969,410	1.000000000 ^S	-33,111.98	-2,658,600	0	310,810	310,810
						80.291180997					
-329,209.04000		12/9/2015		-329,209.04	-29,234,099	1.000000000 ^S	-329,209.04	-26,432,583	0	2,801,516	2,801,516
						80.291180997					
-29,648.06000		12/10/2015		-29,648.06	-2,614,894	1.000000000 ^S	-29,648.06	-2,380,478	0	234,416	234,416
						80.291180997					
-327,000.00000		12/11/2015		-327,000.00	-28,998,504	1.000000000 ^S	-327,000.00	-26,255,216	0	2,743,288	2,743,288
						80.291180997					
-92,475.65000		12/11/2015		-92,475.65	-8,200,781	1.000000000 ^S	-92,475.65	-7,424,979	0	775,802	775,802
						80.291180997					
-57,766.60000		12/11/2015		-57,766.60	-5,122,768	1.000000000 ^S	-57,766.60	-4,638,149	0	484,619	484,619
						80.291180997					

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-34,992.57000		12/14/2015		-34,992.57	-3,051,138	1.000000000 ^S	-34,992.57	-2,809,595	0	241,543	241,543
						80.291180997					
-288,079.45000		12/15/2015		-288,079.45	-25,176,774	1.000000000 ^S	-288,079.45	-23,130,239	0	2,046,535	2,046,535
						80.291180997					
-109,269.69000		12/16/2015		-109,269.69	-9,536,047	1.000000000 ^S	-109,269.69	-8,773,392	0	762,655	762,655
						80.291180997					
-26,796.21000		12/18/2015		-26,796.21	-2,338,039	1.000000000 ^S	-26,796.21	-2,151,499	0	186,540	186,540
						80.291180997					
-35,901.50000		12/30/2015		-35,901.50	-3,154,307	1.000000000 ^S	-35,901.50	-2,882,574	0	271,733	271,733
						80.291180997					
-191,729.95000		1/4/2016		-191,729.95	-16,780,325	1.000000000 ^S	-191,729.95	-15,394,224	0	1,386,101	1,386,101
						80.291180997					
-223,008.99000		1/5/2016		-223,008.99	-19,064,056	1.000000000 ^S	-223,008.99	-17,905,655	0	1,158,401	1,158,401
						80.291180997					
-17,213.36000		1/7/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000 ^S	-17,213.36	-1,382,081	0	60,483	60,483
						80.291180997					
-379,405.26000		1/12/2016		-379,405.26	-31,131,953	1.000000000 ^S	-379,405.26	-30,462,896	0	669,057	669,057
						80.291180997					
-189,599.29000		1/15/2016		-189,599.29	-15,584,866	1.000000000 ^S	-189,599.29	-15,223,151	0	361,715	361,715
						80.291180997					
-8,880.25000		1/19/2016		-8,880.25	-716,821	1.000000000 ^S	-8,880.25	-713,006	0	3,815	3,815
						80.291180997					
-90,489.83000		1/21/2016		-90,489.83	-7,198,238	1.000000000 ^S	-90,489.83	-7,265,535	0	-67,297	-67,297
						80.291180997					
-57,779.34000		1/21/2016		-57,779.34	-4,596,201	1.000000000 ^S	-57,779.34	-4,639,171	0	-42,970	-42,970
						80.291180997					
-7,629.83000		1/21/2016		-7,629.83	-606,934	1.000000000 ^S	-7,629.83	-612,608	0	-5,674	-5,674
						80.291180997					
-121,619.56000		1/22/2016		-121,619.56	-9,910,282	1.000000000 ^S	-121,619.56	-9,764,978	0	145,304	145,304
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-214,100.94000		2/1/2016		-214,100.94	-18,334,604	1.000000000 ^S	-214,100.94	-17,190,417	0	1,144,187	1,144,187
						80.291180997					
-21,646.66000		2/4/2016		-21,646.66	-1,815,370	1.000000000 ^S	-21,646.66	-1,738,036	0	77,334	77,334
						80.291180997					
-14,653.90000		2/5/2016		-14,653.90	-1,240,675	1.000000000 ^S	-14,653.90	-1,176,579	0	64,096	64,096
						80.291180997					
-30,116.40000		2/10/2016		-30,116.40	-2,445,030	1.000000000 ^S	-30,116.40	-2,418,081	0	26,949	26,949
						80.291180997					
-381,805.81000		2/12/2016		-381,805.81	-30,235,477	1.000000000 ^S	-381,805.81	-30,655,639	0	-420,162	-420,162
						80.291180997					
-152,354.76000		2/12/2016		-152,354.76	-12,065,083	1.000000000 ^S	-152,354.76	-12,232,744	0	-167,661	-167,661
						80.291180997					
-16,916.50000		2/17/2016		-16,916.50	-1,364,954	1.000000000 ^S	-16,916.50	-1,358,246	0	6,708	6,708
						80.291180997					
-114,575.44000		2/22/2016		-114,575.44	-9,163,101	1.000000000 ^S	-114,575.44	-9,199,397	0	-36,296	-36,296
						80.291180997					
-37,349.25000		2/23/2016		-37,349.25	-3,051,565	1.000000000 ^S	-37,349.25	-2,998,815	0	52,750	52,750
						80.291180997					
-123,804.34000		3/2/2016		-123,804.34	-10,057,811	1.000000000 ^S	-123,804.34	-9,940,397	0	117,414	117,414
						80.291180997					
-27,289.30000		3/3/2016		-27,289.30	-2,257,397	1.000000000 ^S	-27,289.30	-2,191,090	0	66,307	66,307
						80.291180997					
-10,054.65000		3/7/2016		-10,054.65	-847,732	1.000000000 ^S	-10,054.65	-807,300	0	40,432	40,432
						80.291180997					
-211,885.31000		3/9/2016		-211,885.31	-17,733,243	1.000000000 ^S	-211,885.31	-17,012,522	0	720,721	720,721
						80.291180997					
-377,078.03000		3/11/2016		-377,078.03	-31,843,855	1.000000000 ^S	-377,078.03	-30,276,040	0	1,567,815	1,567,815
						80.291180997					
-74,706.21000		3/14/2016		-74,706.21	-6,403,880	1.000000000 ^S	-74,706.21	-5,998,250	0	405,630	405,630
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-73,687.89000		3/15/2016		-73,687.89	-6,289,651	1.000000000 ^S 80.291180997	-73,687.89	-5,916,488	0	373,163	373,163
-45,075.31000		3/16/2016		-45,075.31	-3,796,491	1.000000000 ^S 80.291180997	-45,075.31	-3,619,150	0	177,341	177,341
-29,125.30000		3/18/2016		-29,125.30	-2,475,492	1.000000000 ^S 80.291180997	-29,125.30	-2,338,505	0	136,987	136,987
-97,821.68000		3/22/2016		-97,821.68	-8,292,500	1.000000000 ^S 80.291180997	-97,821.68	-7,854,218	0	438,282	438,282
-112,039.68000		3/23/2016		-112,039.68	-9,552,811	1.000000000 ^S 80.291180997	-112,039.68	-8,995,798	0	557,013	557,013
-159,202.44000		3/24/2016		-159,202.44	-13,507,411	1.000000000 ^S 80.291180997	-159,202.44	-12,782,552	0	724,859	724,859
-32,177.14000		3/31/2016		-32,177.14	-2,784,601	1.000000000 ^S 80.291180997	-32,177.14	-2,583,541	0	201,060	201,060
-64,762.22000		4/5/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000 ^S 80.291180997	-64,762.22	-5,199,835	0	285,784	285,784
-26,208.62000		4/6/2016		-26,208.62	-2,182,406	1.000000000 ^S 80.291180997	-26,208.62	-2,104,321	0	78,085	78,085
-373,765.27000		4/11/2016		-373,765.27	-30,674,974	1.000000000 ^S 80.291180997	-373,765.27	-30,010,055	0	664,919	664,919
-204,881.37000		4/11/2016		-204,881.37	-16,814,646	1.000000000 ^S 80.291180997	-204,881.37	-16,450,167	0	364,479	364,479
-43,019.52000		4/12/2016		-43,019.52	-3,527,545	1.000000000 ^S 80.291180997	-43,019.52	-3,454,088	0	73,457	73,457
-33,801.18000		4/13/2016		-33,801.18	-2,800,107	1.000000000 ^S 80.291180997	-33,801.18	-2,713,937	0	86,170	86,170
-141,797.35000		4/14/2016		-141,797.35	-11,838,108	1.000000000 ^S 80.291180997	-141,797.35	-11,385,077	0	453,031	453,031
-3,319.09000		4/18/2016		-3,319.09	-278,038	1.000000000 ^S 80.291180997	-3,319.09	-266,494	0	11,544	11,544

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-83,104.57000		4/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000 ^S	-83,104.57	-6,672,564	0	327,272	327,272
						80.291180997					
-7,007.13000		4/19/2016		-7,007.13	-590,205	1.000000000 ^S	-7,007.13	-562,611	0	27,594	27,594
						80.291180997					
-32,699.55000		4/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000 ^S	-32,699.55	-2,625,485	0	166,597	166,597
						80.291180997					
-2,677,613.47000		4/21/2016		-2,677,613.47	-228,369,211	1.000000000 ^S	-2,677,613.47	-214,988,748	0	13,380,463	13,380,463
						80.291180997					
-92,321.29000		4/21/2016		-92,321.29	-7,873,930	1.000000000 ^S	-92,321.29	-7,412,585	0	461,345	461,345
						80.291180997					
-51,467.98000		4/26/2016		-51,467.98	-4,411,808	1.000000000 ^S	-51,467.98	-4,132,425	0	279,383	279,383
						80.291180997					
-15,428.24000		5/9/2016		-15,428.24	-1,209,910	1.000000000 ^S	-15,428.24	-1,238,752	0	-28,842	-28,842
						80.291180997					
-102,314.26000		5/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000 ^S	-102,314.26	-8,214,933	0	7,672	7,672
						80.291180997					
-352,627.83000		5/12/2016		-352,627.83	-28,284,357	1.000000000 ^S	-352,627.83	-28,312,905	0	-28,548	-28,548
						80.291180997					
-32,453.42000		5/17/2016		-32,453.42	-2,578,702	1.000000000 ^S	-32,453.42	-2,605,723	0	-27,021	-27,021
						80.291180997					
-184,519.95000		5/18/2016		-184,519.95	-14,755,931	1.000000000 ^S	-184,519.95	-14,815,325	0	-59,394	-59,394
						80.291180997					
-346,026.04000		5/23/2016		-346,026.04	-27,596,972	1.000000000 ^S	-346,026.04	-27,782,839	0	-185,867	-185,867
						80.291180997					
-349,425.52000		6/10/2016		-349,425.52	-27,668,680	1.000000000 ^S	-349,425.52	-28,055,788	0	-387,108	-387,108
						80.291180997					
-205,061.01000		6/14/2016		-205,061.01	-16,138,898	1.000000000 ^S	-205,061.01	-16,464,591	0	-325,693	-325,693
						80.291180997					
-27,132.00000		6/17/2016		-27,132.00	-2,060,548	1.000000000 ^S	-27,132.00	-2,178,460	0	-117,912	-117,912
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-3,725.24000		7/7/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000 ^S	-3,725.24	-299,104	0	-17,548	-17,548
						80.291180997					
-359,882.81000		7/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000 ^S	-359,882.81	-28,895,416	0	-1,574,373	-1,574,373
						80.291180997					
-11,042.19000		7/11/2016		-11,042.19	-838,284	1.000000000 ^S	-11,042.19	-886,590	0	-48,306	-48,306
						80.291180997					
-123,264.71000		7/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000 ^S	-123,264.71	-9,897,069	0	-358,603	-358,603
						80.291180997					
-253,623.43000		7/14/2016		-253,623.43	-20,172,228	1.000000000 ^S	-253,623.43	-20,363,725	0	-191,497	-191,497
						80.291180997					
-78,638.63000		7/14/2016		-78,638.63	-6,254,613	1.000000000 ^S	-78,638.63	-6,313,988	0	-59,375	-59,375
						80.291180997					
-6,630.58000		7/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000 ^S	-6,630.58	-532,377	0	-5,006	-5,006
						80.291180997					
-105,691.38000		7/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000 ^S	-105,691.38	-8,486,086	0	-65,139	-65,139
						80.291180997					
-26,928.63000		7/22/2016		-26,928.63	-2,148,021	1.000000000 ^S	-26,928.63	-2,162,132	0	-14,111	-14,111
						80.291180997					
-11,865.10000		7/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000 ^S	-11,865.10	-952,663	0	-18,200	-18,200
						80.291180997					
-64,818.19000		8/2/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000 ^S	-64,818.19	-5,204,329	0	-189,928	-189,928
						80.291180997					
-19,853.51000		8/2/2016		-19,853.51	-1,535,888	1.000000000 ^S	-19,853.51	-1,594,062	0	-58,174	-58,174
						80.291180997					
-181,375.34000		8/3/2016		-181,375.34	-13,938,155	1.000000000 ^S	-181,375.34	-14,562,840	0	-624,685	-624,685
						80.291180997					
-25,260.07000		8/4/2016		-25,260.07	-1,938,997	1.000000000 ^S	-25,260.07	-2,028,161	0	-89,164	-89,164
						80.291180997					
-356,084.08000		8/12/2016		-356,084.08	-27,843,105	1.000000000 ^S	-356,084.08	-28,590,411	0	-747,306	-747,306
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-42,406.06000		8/12/2016		-42,406.06	-3,315,836	1.000000000 ^S	-42,406.06	-3,404,833	0	-88,997	-88,997
						80.291180997					
-33,369.43000		8/16/2016		-33,369.43	-2,591,016	1.000000000 ^S	-33,369.43	-2,679,271	0	-88,255	-88,255
						80.291180997					
-146,047.78000		8/17/2016		-146,047.78	-11,265,304	1.000000000 ^S	-146,047.78	-11,726,349	0	-461,045	-461,045
						80.291180997					
-12,365.22000		8/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000 ^S	-12,365.22	-992,818	0	-46,072	-46,072
						80.291180997					
-25,656.87000		8/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000 ^S	-25,656.87	-2,060,020	0	-87,221	-87,221
						80.291180997					
-62,280.99000		8/22/2016		-62,280.99	-4,755,276	1.000000000 ^S	-62,280.99	-5,000,614	0	-245,338	-245,338
						80.291180997					
-115,979.16000		8/23/2016		-115,979.16	-8,883,458	1.000000000 ^S	-115,979.16	-9,312,104	0	-428,646	-428,646
						80.291180997					
-45,244.15000		8/24/2016		-45,244.15	-3,466,822	1.000000000 ^S	-45,244.15	-3,632,706	0	-165,884	-165,884
						80.291180997					
-118,911.22000		8/25/2016		-118,911.22	-9,101,467	1.000000000 ^S	-118,911.22	-9,547,522	0	-446,055	-446,055
						80.291180997					
-18,695.42000		9/2/2016		-18,695.42	-1,456,164	1.000000000 ^S	-18,695.42	-1,501,077	0	-44,913	-44,913
						80.291180997					
-647,737.56000		9/8/2016		-647,737.56	-50,558,123	1.000000000 ^S	-647,737.56	-52,007,614	0	-1,449,491	-1,449,491
						80.291180997					
-349,412.93000		9/12/2016		-349,412.93	-27,165,953	1.000000000 ^S	-349,412.93	-28,054,777	0	-888,824	-888,824
						80.291180997					
-17,748.89000		9/15/2016		-17,748.89	-1,360,703	1.000000000 ^S	-17,748.89	-1,425,079	0	-64,376	-64,376
						80.291180997					
-179,125.75000		9/21/2016		-179,125.75	-13,765,066	1.000000000 ^S	-179,125.75	-14,382,218	0	-617,152	-617,152
						80.291180997					
-355,570.37000		10/12/2016		-355,570.37	-27,813,188	1.000000000 ^S	-355,570.37	-28,549,165	0	-735,977	-735,977
						80.291180997					

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-87,209.56000		10/14/2016		-87,209.56	-6,810,737	1.000000000 ^S	-87,209.56	-7,002,159	0	-191,422	-191,422
						80.291180997					
-49,550.92000		10/20/2016		-49,550.92	-3,937,169	1.000000000 ^S	-49,550.92	-3,978,502	0	-41,333	-41,333
						80.291180997					
-108,096.46000		10/26/2016		-108,096.46	-8,631,787	1.000000000 ^S	-108,096.46	-8,679,192	0	-47,405	-47,405
						80.291180997					
-6,022.62000		11/9/2016		-6,022.62	-486,973	1.000000000 ^S	-6,022.62	-483,563	0	3,410	3,410
						80.291180997					
-358,077.71000		11/14/2016		-358,077.71	-28,775,830	1.000000000 ^S	-358,077.71	-28,750,482	0	25,348	25,348
						80.291180997					
-105,736.37000		11/15/2016		-105,736.37	-8,633,411	1.000000000 ^S	-105,736.37	-8,489,698	0	143,713	143,713
						80.291180997					
-8,950.00000		11/16/2016		-8,950.00	-735,749	1.000000000 ^S	-8,950.00	-718,606	0	17,143	17,143
						80.291180997					
-43,039.27000		11/18/2016		-43,039.27	-3,517,706	1.000000000 ^S	-43,039.27	-3,455,674	0	62,032	62,032
						80.291180997					
-29,290.91000		11/25/2016		-29,290.91	-2,456,555	1.000000000 ^S	-29,290.91	-2,351,802	0	104,753	104,753
						80.291180997					
-51,254.81000		11/30/2016		-51,254.81	-4,320,135	1.000000000 ^S	-51,254.81	-4,115,309	0	204,826	204,826
						80.291180997					
-156,086.08000		12/1/2016		-156,086.08	-13,140,616	1.000000000 ^S	-156,086.08	-12,532,336	0	608,280	608,280
						80.291180997					
-99,004.27000		12/2/2016		-99,004.27	-8,385,070	1.000000000 ^S	-99,004.27	-7,949,170	0	435,900	435,900
						80.291180997					
-241,950.12000		12/6/2016		-241,950.12	-20,677,187	1.000000000 ^S	-241,950.12	-19,426,461	0	1,250,726	1,250,726
						80.291180997					
-52,956.42000		12/7/2016		-52,956.42	-4,499,736	1.000000000 ^S	-52,956.42	-4,251,934	0	247,802	247,802
						80.291180997					
-352,726.96000		12/9/2016		-352,726.96	-29,973,125	1.000000000 ^S	-352,726.96	-28,320,864	0	1,652,261	1,652,261
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-9,409.35000		12/12/2016		-9,409.35	-807,660	1.000000000 ^S	-9,409.35	-755,488	0	52,172	52,172
						80.291180997					
-242,673.60000		12/14/2016		-242,673.60	-20,968,061	1.000000000 ^S	-242,673.60	-19,484,550	0	1,483,511	1,483,511
						80.291180997					
-8,765.00000		12/16/2016		-8,765.00	-764,049	1.000000000 ^S	-8,765.00	-703,752	0	60,297	60,297
						80.291180997					
-63,041.53000		12/19/2016		-63,041.53	-5,432,127	1.000000000 ^S	-63,041.53	-5,061,679	0	370,448	370,448
						80.291180997					
-113,105.55000		12/22/2016		-113,105.55	-9,651,835	1.000000000 ^S	-113,105.55	-9,081,378	0	570,457	570,457
						80.291180997					
-202,488.26000		12/28/2016		-202,488.26	-17,117,239	1.000000000 ^S	-202,488.26	-16,258,022	0	859,217	859,217
						80.291180997					
-17,327.64000		12/29/2016		-17,327.64	-1,462,733	1.000000000 ^S	-17,327.64	-1,391,257	0	71,476	71,476
						80.291180997					
-1,900.70000		12/30/2016		-1,900.70	-159,632	1.000000000 ^S	-1,900.70	-152,609	0	7,023	7,023
						80.291180997					
-17,618.00000		1/4/2017		-17,618.00	-1,501,301	1.000000000 ^S	-17,618.00	-1,414,570	0	86,731	86,731
						80.291180997					
-550,762.83000		1/5/2017		-550,762.83	-47,018,808	1.000000000 ^S	-550,762.83	-44,221,398	0	2,797,410	2,797,410
						80.291180997					
-46,205.35000		1/6/2017		-46,205.35	-3,920,910	1.000000000 ^S	-46,205.35	-3,709,882	0	211,028	211,028
						80.291180997					
-75,551.78000		1/11/2017		-75,551.78	-6,438,078	1.000000000 ^S	-75,551.78	-6,066,142	0	371,936	371,936
						80.291180997					
-349,599.06000		1/12/2017		-349,599.06	-30,063,342	1.000000000 ^S	-349,599.06	-28,069,721	0	1,993,621	1,993,621
						80.291180997					
-11,816.04000		1/12/2017		-11,816.04	-1,016,106	1.000000000 ^S	-11,816.04	-948,724	0	67,382	67,382
						80.291180997					
-78,835.06000		1/18/2017		-78,835.06	-6,719,133	1.000000000 ^S	-78,835.06	-6,329,760	0	389,373	389,373
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-11,222.99000		1/18/2017		-11,222.99	-956,538	1.000000000 ^S	-11,222.99	-901,107	0	55,431	55,431
						80.291180997					
-6,647.14000		1/18/2017		-6,647.14	-566,537	1.000000000 ^S	-6,647.14	-533,707	0	32,830	32,830
						80.291180997					
-57,843.82000		1/20/2017		-57,843.82	-5,033,172	1.000000000 ^S	-57,843.82	-4,644,349	0	388,823	388,823
						80.291180997					
-59,564.39000		1/23/2017		-59,564.39	-5,172,781	1.000000000 ^S	-59,564.39	-4,782,495	0	390,286	390,286
						80.291180997					
-120,856.84000		1/24/2017		-120,856.84	-10,353,246	1.000000000 ^S	-120,856.84	-9,703,738	0	649,508	649,508
						80.291180997					
-105,955.38000		1/24/2017		-105,955.38	-9,076,707	1.000000000 ^S	-105,955.38	-8,507,283	0	569,424	569,424
						80.291180997					
-186,290.44000		1/27/2017		-186,290.44	-16,102,463	1.000000000 ^S	-186,290.44	-14,957,479	0	1,144,984	1,144,984
						80.291180997					
-72,198.29000		1/27/2017		-72,198.29	-6,240,633	1.000000000 ^S	-72,198.29	-5,796,886	0	443,747	443,747
						80.291180997					
-66,189.39000		2/1/2017		-66,189.39	-5,656,632	1.000000000 ^S	-66,189.39	-5,314,424	0	342,208	342,208
						80.291180997					
-17,013.34000		2/2/2017		-17,013.34	-1,460,104	1.000000000 ^S	-17,013.34	-1,366,021	0	94,083	94,083
						80.291180997					
-10,224.17000		2/7/2017		-10,224.17	-877,520	1.000000000 ^S	-10,224.17	-820,911	0	56,609	56,609
						80.291180997					
-177,969.53000		2/9/2017		-177,969.53	-15,213,556	1.000000000 ^S	-177,969.53	-14,289,384	0	924,172	924,172
						80.291180997					
-344,229.20000		2/10/2017		-344,229.20	-29,662,809	1.000000000 ^S	-344,229.20	-27,638,569	0	2,024,240	2,024,240
						80.291180997					
-152,291.16000		2/13/2017		-152,291.16	-13,270,154	1.000000000 ^S	-152,291.16	-12,227,637	0	1,042,517	1,042,517
						80.291180997					
-967,326.20000		2/15/2017		-967,326.20	-84,398,304	1.000000000 ^S	-967,326.20	-77,667,763	0	6,730,541	6,730,541
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-71,449.49000		2/16/2017		-71,449.49	-6,292,028	1.000000000 ^S	-71,449.49	-5,736,764	0	555,264	555,264
						80.291180997					
-34,639.01000		2/23/2017		-34,639.01	-3,017,462	1.000000000 ^S	-34,639.01	-2,781,207	0	236,255	236,255
						80.291180997					
-52,248.31000		3/1/2017		-52,248.31	-4,494,545	1.000000000 ^S	-52,248.31	-4,195,079	0	299,466	299,466
						80.291180997					
-44,953.93000		3/3/2017		-44,953.93	-3,898,960	1.000000000 ^S	-44,953.93	-3,609,404	0	289,556	289,556
						80.291180997					
-185,905.53000		3/8/2017		-185,905.53	-16,102,616	1.000000000 ^S	-185,905.53	-14,926,575	0	1,176,041	1,176,041
						80.291180997					
-11,158.43000		3/9/2017		-11,158.43	-965,561	1.000000000 ^S	-11,158.43	-895,924	0	69,637	69,637
						80.291180997					
-334,340.29000		3/10/2017		-334,340.29	-28,791,636	1.000000000 ^S	-334,340.29	-26,844,577	0	1,947,059	1,947,059
						80.291180997					
-189,359.17000		3/14/2017		-189,359.17	-16,457,305	1.000000000 ^S	-189,359.17	-15,203,871	0	1,253,434	1,253,434
						80.291180997					
-201,782.17000		3/15/2017		-201,782.17	-17,521,607	1.000000000 ^S	-201,782.17	-16,201,329	0	1,320,278	1,320,278
						80.291180997					
-93,724.51000		3/16/2017		-93,724.51	-8,160,137	1.000000000 ^S	-93,724.51	-7,525,252	0	634,885	634,885
						80.291180997					
-951,148.84000		3/17/2017		-951,148.84	-82,485,587	1.000000000 ^S	-951,148.84	-76,368,864	0	6,116,723	6,116,723
						80.291180997					
-49,845.77000		3/21/2017		-49,845.77	-4,339,671	1.000000000 ^S	-49,845.77	-4,002,176	0	337,495	337,495
						80.291180997					
-97,972.14000		3/22/2017		-97,972.14	-8,458,699	1.000000000 ^S	-97,972.14	-7,866,299	0	592,400	592,400
						80.291180997					
-129,338.35000		3/24/2017		-129,338.35	-10,986,556	1.000000000 ^S	-129,338.35	-10,384,729	0	601,827	601,827
						80.291180997					
-35,149.28000		3/29/2017		-35,149.28	-2,959,437	1.000000000 ^S	-35,149.28	-2,822,177	0	137,260	137,260
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-121,963.21000		4/3/2017		-121,963.21	-10,367,407	1.000000000 ^S	-121,963.21	-9,792,570	0	574,837	574,837
						80.291180997					
-17,011.29000		4/4/2017		-17,011.29	-1,434,849	1.000000000 ^S	-17,011.29	-1,365,857	0	68,992	68,992
						80.291180997					
-99,836.86000		4/5/2017		-99,836.86	-8,339,503	1.000000000 ^S	-99,836.86	-8,016,019	0	323,484	323,484
						80.291180997					
-321,826.20000		4/11/2017		-321,826.20	-26,821,039	1.000000000 ^S	-321,826.20	-25,839,806	0	981,233	981,233
						80.291180997					
-2,535.89000		4/13/2017		-2,535.89	-208,025	1.000000000 ^S	-2,535.89	-203,610	0	4,415	4,415
						80.291180997					
-17,906.57000		4/24/2017		-17,906.57	-1,469,466	1.000000000 ^S	-17,906.57	-1,437,740	0	31,726	31,726
						80.291180997					
-97,737.47000		4/26/2017		-97,737.47	-8,168,487	1.000000000 ^S	-97,737.47	-7,847,457	0	321,030	321,030
						80.291180997					
-72,720.60000		4/26/2017		-72,720.60	-6,077,682	1.000000000 ^S	-72,720.60	-5,838,823	0	238,859	238,859
						80.291180997					
-6,131.59000		4/26/2017		-6,131.59	-512,453	1.000000000 ^S	-6,131.59	-492,313	0	20,140	20,140
						80.291180997					
-5,770,905.72000		5/2/2017		-5,770,905.72	-481,079,087	1.000000000 ^S	-5,770,905.72	-463,352,836	0	17,726,251	17,726,251
						80.291180997					
-757,937.72000		5/8/2017		-757,937.72	-63,229,524	1.000000000 ^S	-757,937.72	-60,855,715	0	2,373,809	2,373,809
						80.291180997					
-93,372.59000		5/11/2017		-93,372.59	-7,870,999	1.000000000 ^S	-93,372.59	-7,496,996	0	374,003	374,003
						80.291180997					
-277,865.98000		5/12/2017		-277,865.98	-23,283,752	1.000000000 ^S	-277,865.98	-22,310,188	0	973,564	973,564
						80.291180997					
-83,218.51000		5/12/2017		-83,218.51	-6,973,287	1.000000000 ^S	-83,218.51	-6,681,712	0	291,575	291,575
						80.291180997					
-87,633.54000		5/15/2017		-87,633.54	-7,339,187	1.000000000 ^S	-87,633.54	-7,036,200	0	302,987	302,987
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-161,718.79000		5/16/2017		-161,718.79	-13,634,189	1.000000000 ^S 80.291180997	-161,718.79	-12,984,593	0	649,596	649,596
-51,805.98000		5/17/2017		-51,805.98	-4,351,820	1.000000000 ^S 80.291180997	-51,805.98	-4,159,563	0	192,257	192,257
-215,576.55000		5/19/2017		-215,576.55	-17,787,680	1.000000000 ^S 80.291180997	-215,576.55	-17,308,896	0	478,784	478,784
-339,293.20000		5/22/2017		-339,293.20	-28,164,073	1.000000000 ^S 80.291180997	-339,293.20	-27,242,252	0	921,821	921,821
-105,085.63000		5/24/2017		-105,085.63	-8,748,278	1.000000000 ^S 80.291180997	-105,085.63	-8,437,449	0	310,829	310,829
-35,824.15000		5/26/2017		-35,824.15	-2,994,583	1.000000000 ^S 80.291180997	-35,824.15	-2,876,363	0	118,220	118,220
-85,534.03000		6/1/2017		-85,534.03	-7,041,589	1.000000000 ^S 80.291180997	-85,534.03	-6,867,628	0	173,961	173,961
-184,424.56000		6/6/2017		-184,424.56	-15,242,969	1.000000000 ^S 80.291180997	-184,424.56	-14,807,666	0	435,303	435,303
-268,856.14000		6/9/2017		-268,856.14	-22,316,945	1.000000000 ^S 80.291180997	-268,856.14	-21,586,777	0	730,168	730,168
-48,274.55000		6/16/2017		-48,274.55	-4,048,407	1.000000000 ^S 80.291180997	-48,274.55	-3,876,021	0	172,386	172,386
-28,558.93000		6/19/2017		-28,558.93	-2,409,398	1.000000000 ^S 80.291180997	-28,558.93	-2,293,030	0	116,368	116,368
-32,535.99000		6/22/2017		-32,535.99	-2,741,102	1.000000000 ^S 80.291180997	-32,535.99	-2,612,353	0	128,749	128,749
-36,028.00000		6/27/2017		-36,028.00	-3,046,343	1.000000000 ^S 80.291180997	-36,028.00	-2,892,731	0	153,612	153,612
-85,677.03000		6/28/2017		-85,677.03	-7,298,656	1.000000000 ^S 80.291180997	-85,677.03	-6,879,110	0	419,546	419,546
-50,207.38000		6/29/2017		-50,207.38	-4,284,996	1.000000000 ^S 80.291180997	-50,207.38	-4,031,210	0	253,786	253,786

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-17,179.10000		6/30/2017		-17,179.10	-1,485,268	1.000000000 ^S	-17,179.10	-1,379,330	0	105,938	105,938
						80.291180997					
-24,916.13000		7/6/2017		-24,916.13	-2,139,501	1.000000000 ^S	-24,916.13	-2,000,546	0	138,955	138,955
						80.291180997					
-70,337.04000		7/7/2017		-70,337.04	-6,033,979	1.000000000 ^S	-70,337.04	-5,647,444	0	386,535	386,535
						80.291180997					
-268,122.83000		7/11/2017		-268,122.83	-23,253,058	1.000000000 ^S	-268,122.83	-21,527,899	0	1,725,159	1,725,159
						80.291180997					
-94,299.32000		7/12/2017		-94,299.32	-8,216,368	1.000000000 ^S	-94,299.32	-7,571,404	0	644,964	644,964
						80.291180997					
-48,129.04000		7/13/2017		-48,129.04	-4,176,056	1.000000000 ^S	-48,129.04	-3,864,337	0	311,719	311,719
						80.291180997					
-94,307.37000		7/14/2017		-94,307.37	-8,260,227	1.000000000 ^S	-94,307.37	-7,572,050	0	688,177	688,177
						80.291180997					
-224,064.11000		7/18/2017		-224,064.11	-19,759,163	1.000000000 ^S	-224,064.11	-17,990,372	0	1,768,791	1,768,791
						80.291180997					
-62,985.03000		7/18/2017		-62,985.03	-5,554,354	1.000000000 ^S	-62,985.03	-5,057,142	0	497,212	497,212
						80.291180997					
-5,310.71000		7/18/2017		-5,310.71	-468,327	1.000000000 ^S	-5,310.71	-426,403	0	41,924	41,924
						80.291180997					
-84,652.73000		7/19/2017		-84,652.73	-7,503,258	1.000000000 ^S	-84,652.73	-6,796,868	0	706,390	706,390
						80.291180997					
-57,508.35000		7/24/2017		-57,508.35	-5,058,492	1.000000000 ^S	-57,508.35	-4,617,413	0	441,079	441,079
						80.291180997					
-34,173.40000		7/27/2017		-34,173.40	-3,033,016	1.000000000 ^S	-34,173.40	-2,743,823	0	289,193	289,193
						80.291180997					
-42,955.96000		7/28/2017		-42,955.96	-3,821,788	1.000000000 ^S	-42,955.96	-3,448,985	0	372,803	372,803
						80.291180997					
-34,563.35000		8/1/2017		-34,563.35	-3,048,960	1.000000000 ^S	-34,563.35	-2,775,132	0	273,828	273,828
						80.291180997					

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-11,898.68000		8/2/2017		-11,898.68	-1,046,921	1.000000000 ^S	-11,898.68	-955,359	0	91,562	91,562
						80.291180997					
-251,943.26000		8/8/2017		-251,943.26	-22,077,618	1.000000000 ^S	-251,943.26	-20,228,822	0	1,848,796	1,848,796
						80.291180997					
-129,223.68000		8/8/2017		-129,223.68	-11,323,784	1.000000000 ^S	-129,223.68	-10,375,522	0	948,262	948,262
						80.291180997					
-26,983.86000		8/9/2017		-26,983.86	-2,360,030	1.000000000 ^S	-26,983.86	-2,166,566	0	193,464	193,464
						80.291180997					
-5,436.08000		8/10/2017		-5,436.08	-470,606	1.000000000 ^S	-5,436.08	-436,469	0	34,137	34,137
						80.291180997					
-261,862.81000		8/14/2017		-261,862.81	-22,503,263	1.000000000 ^S	-261,862.81	-21,025,274	0	1,477,989	1,477,989
						80.291180997					
-38,687.10000		8/14/2017		-38,687.10	-3,324,588	1.000000000 ^S	-38,687.10	-3,106,233	0	218,355	218,355
						80.291180997					
-234,673.89000		8/16/2017		-234,673.89	-20,287,202	1.000000000 ^S	-234,673.89	-18,842,244	0	1,444,958	1,444,958
						80.291180997					
-151,106.11000		8/17/2017		-151,106.11	-13,198,995	1.000000000 ^S	-151,106.11	-12,132,488	0	1,066,507	1,066,507
						80.291180997					
-23,853.89000		8/18/2017		-23,853.89	-2,076,341	1.000000000 ^S	-23,853.89	-1,915,257	0	161,084	161,084
						80.291180997					
-128,055.35000		8/22/2017		-128,055.35	-11,058,464	1.000000000 ^S	-128,055.35	-10,281,715	0	776,749	776,749
						80.291180997					
-20,640.91000		8/23/2017		-20,640.91	-1,790,067	1.000000000 ^S	-20,640.91	-1,657,283	0	132,784	132,784
						80.291180997					
-47,297.81000		8/29/2017		-47,297.81	-4,106,488	1.000000000 ^S	-47,297.81	-3,797,597	0	308,891	308,891
						80.291180997					
-1,347,714.81000		8/30/2017		-1,347,714.81	-116,950,732	1.000000000 ^S	-1,347,714.81	-108,209,614	0	8,741,118	8,741,118
						80.291180997					
-1,203,000.00000		8/30/2017		-1,203,000.00	-104,392,806	1.000000000 ^S	-1,203,000.00	-96,590,291	0	7,802,515	7,802,515
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-30,083.55000		8/30/2017		-30,083.55	-2,610,562	1.000000000 ^S 80.291180997	-30,083.55	-2,415,444	0	195,118	195,118
-83,968.93000		9/5/2017		-83,968.93	-7,314,593	1.000000000 ^S 80.291180997	-83,968.93	-6,741,965	0	572,628	572,628
-61,112.18000		9/8/2017		-61,112.18	-5,325,375	1.000000000 ^S 80.291180997	-61,112.18	-4,906,769	0	418,606	418,606
-245,747.74000		9/11/2017		-245,747.74	-21,382,314	1.000000000 ^S 80.291180997	-245,747.74	-19,731,376	0	1,650,938	1,650,938
-18,460.20000		9/11/2017		-18,460.20	-1,606,207	1.000000000 ^S 80.291180997	-18,460.20	-1,482,191	0	124,016	124,016
-110,577.39000		9/12/2017		-110,577.39	-9,667,378	1.000000000 ^S 80.291180997	-110,577.39	-8,878,389	0	788,989	788,989
-140,374.85000		9/14/2017		-140,374.85	-12,413,249	1.000000000 ^S 80.291180997	-140,374.85	-11,270,862	0	1,142,387	1,142,387
-93,807.37000		9/15/2017		-93,807.37	-8,281,886	1.000000000 ^S 80.291180997	-93,807.37	-7,531,905	0	749,981	749,981
-94,643.60000		9/20/2017		-94,643.60	-8,441,750	1.000000000 ^S 80.291180997	-94,643.60	-7,599,046	0	842,704	842,704
-37,527.78000		9/26/2017		-37,527.78	-3,332,691	1.000000000 ^S 80.291180997	-37,527.78	-3,013,150	0	319,541	319,541
-20,531.50000		9/28/2017		-20,531.50	-1,818,416	1.000000000 ^S 80.291180997	-20,531.50	-1,648,498	0	169,918	169,918
-233,742.95000		9/29/2017		-233,742.95	-20,642,355	1.000000000 ^S 80.291180997	-233,742.95	-18,767,498	0	1,874,857	1,874,857
-149,591.47000		10/5/2017		-149,591.47	-13,246,493	1.000000000 ^S 80.291180997	-149,591.47	-12,010,876	0	1,235,617	1,235,617
-25,802.59000		10/6/2017		-25,802.59	-2,268,258	1.000000000 ^S 80.291180997	-25,802.59	-2,071,720	0	196,538	196,538
-250,526.60000		10/12/2017		-250,526.60	-21,872,667	1.000000000 ^S 80.291180997	-250,526.60	-20,115,077	0	1,757,590	1,757,590

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-150,522.57000		10/12/2017		-150,522.57	-13,141,639	1.000000000 ^S	-150,522.57	-12,085,635	0	1,056,004	1,056,004
						80.291180997					
-58,012.04000		10/16/2017		-58,012.04	-5,122,230	1.000000000 ^S	-58,012.04	-4,657,855	0	464,375	464,375
						80.291180997					
-4,891.40000		10/16/2017		-4,891.40	-431,891	1.000000000 ^S	-4,891.40	-392,736	0	39,155	39,155
						80.291180997					
-8,629.54000		10/19/2017		-8,629.54	-763,983	1.000000000 ^S	-8,629.54	-692,876	0	71,107	71,107
						80.291180997					
-79,173.19000		10/20/2017		-79,173.19	-7,021,242	1.000000000 ^S	-79,173.19	-6,356,909	0	664,333	664,333
						80.291180997					
-73,221.02000		10/24/2017		-73,221.02	-6,498,544	1.000000000 ^S	-73,221.02	-5,879,002	0	619,542	619,542
						80.291180997					
-53,753.51000		10/24/2017		-53,753.51	-4,770,755	1.000000000 ^S	-53,753.51	-4,315,933	0	454,822	454,822
						80.291180997					
-1,778,714.81000		10/25/2017		-1,778,714.81	-157,587,713	1.000000000 ^S	-1,778,714.81	-142,815,113	0	14,772,600	14,772,600
						80.291180997					
-1,390,000.00000		10/25/2017		-1,390,000.00	-123,148,983	1.000000000 ^S	-1,390,000.00	-111,604,742	0	11,544,241	11,544,241
						80.291180997					
-59,387.12000		10/25/2017		-59,387.12	-5,261,485	1.000000000 ^S	-59,387.12	-4,768,262	0	493,223	493,223
						80.291180997					
-7,958.77000		10/31/2017		-7,958.77	-691,905	1.000000000 ^S	-7,958.77	-639,019	0	52,886	52,886
						80.291180997					
-30,242.86000		11/2/2017		-30,242.86	-2,647,087	1.000000000 ^S	-30,242.86	-2,428,235	0	218,852	218,852
						80.291180997					
-98,737.84000		11/8/2017		-98,737.84	-8,600,813	1.000000000 ^S	-98,737.84	-7,927,778	0	673,035	673,035
						80.291180997					
-9,009.98000		11/9/2017		-9,009.98	-785,309	1.000000000 ^S	-9,009.98	-723,422	0	61,887	61,887
						80.291180997					
-247,808.62000		11/10/2017		-247,808.62	-21,573,723	1.000000000 ^S	-247,808.62	-19,896,847	0	1,676,876	1,676,876
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-141,305.97000		11/14/2017		-141,305.97	-12,248,394	1.000000000 ^S 80.291180997	-141,305.97	-11,345,623	0	902,771	902,771
-64,748.95000		11/20/2017		-64,748.95	-5,487,267	1.000000000 ^S 80.291180997	-64,748.95	-5,198,770	0	288,497	288,497
-32,436.77000		11/22/2017		-32,436.77	-2,764,939	1.000000000 ^S 80.291180997	-32,436.77	-2,604,387	0	160,552	160,552
-203,554.78000		11/24/2017		-203,554.78	-17,261,865	1.000000000 ^S 80.291180997	-203,554.78	-16,343,654	0	918,211	918,211
-42,562.46000		11/28/2017		-42,562.46	-3,600,917	1.000000000 ^S 80.291180997	-42,562.46	-3,417,390	0	183,527	183,527
-99,582.58000		12/1/2017		-99,582.58	-8,459,807	1.000000000 ^S 80.291180997	-99,582.58	-7,995,603	0	464,204	464,204
-47,244.20000		12/7/2017		-47,244.20	-4,017,059	1.000000000 ^S 80.291180997	-47,244.20	-3,793,293	0	223,766	223,766
-13,390.76000		12/8/2017		-13,390.76	-1,135,904	1.000000000 ^S 80.291180997	-13,390.76	-1,075,160	0	60,744	60,744
-246,793.05000		12/11/2017		-246,793.05	-21,044,157	1.000000000 ^S 80.291180997	-246,793.05	-19,815,305	0	1,228,852	1,228,852
-30,330.71000		12/11/2017		-30,330.71	-2,586,314	1.000000000 ^S 80.291180997	-30,330.71	-2,435,289	0	151,025	151,025
-85,954.84000		12/12/2017		-85,954.84	-7,349,616	1.000000000 ^S 80.291180997	-85,954.84	-6,901,416	0	448,200	448,200
-55,703.20000		12/13/2017		-55,703.20	-4,782,497	1.000000000 ^S 80.291180997	-55,703.20	-4,472,476	0	310,021	310,021
-126,098.54000		12/19/2017		-126,098.54	-10,875,723	1.000000000 ^S 80.291180997	-126,098.54	-10,124,601	0	751,122	751,122
-39,931.85000		12/20/2017		-39,931.85	-3,451,152	1.000000000 ^S 80.291180997	-39,931.85	-3,206,175	0	244,977	244,977
-28,911.07000		1/5/2018		-28,911.07	-2,563,200	1.000000000 ^S 80.291180997	-28,911.07	-2,321,304	0	241,896	241,896

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

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

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

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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-245,282.90000		1/12/2018		-245,282.90	-21,514,923	1.000000000 ^S 80.291180997	-245,282.90	-19,694,054	0	1,820,869	1,820,869
-12,441.34000		1/12/2018		-12,441.34	-1,091,289	1.000000000 ^S 80.291180997	-12,441.34	-998,930	0	92,359	92,359
-35,513.33000		1/16/2018		-35,513.33	-3,129,459	1.000000000 ^S 80.291180997	-35,513.33	-2,851,407	0	278,052	278,052
-56,303.33000		1/22/2018		-56,303.33	-4,983,918	1.000000000 ^S 80.291180997	-56,303.33	-4,520,661	0	463,257	463,257
-73,732.89000		1/24/2018		-73,732.89	-6,506,404	1.000000000 ^S 80.291180997	-73,732.89	-5,920,101	0	586,303	586,303
-54,860.23000		1/24/2018		-54,860.23	-4,841,026	1.000000000 ^S 80.291180997	-54,860.23	-4,404,793	0	436,233	436,233
-4,625.65000		1/24/2018		-4,625.65	-408,181	1.000000000 ^S 80.291180997	-4,625.65	-371,399	0	36,782	36,782
104,867.61000		1/29/2018		-104,867.61	-9,216,108	1.000000000 ^S 80.291180997	-104,867.61	-8,419,944	0	796,164	796,164
315,218.62000		1/30/2018		-315,218.62	-27,821,128	1.000000000 ^S 80.291180997	-315,218.62	-25,309,275	0	2,511,853	2,511,853
-92,606.37000		1/31/2018		-92,606.37	-8,151,384	1.000000000 ^S 80.291180997	-92,606.37	-7,435,475	0	715,909	715,909
-42,223.81000		2/8/2018		-42,223.81	-3,622,522	1.000000000 ^S 80.291180997	-42,223.81	-3,390,200	0	232,322	232,322
-240,819.94000		2/9/2018		-240,819.94	-20,510,385	1.000000000 ^S 80.291180997	-240,819.94	-19,335,717	0	1,174,668	1,174,668
-114,626.90000		2/9/2018		-114,626.90	-9,762,655	1.000000000 ^S 80.291180997	-114,626.90	-9,203,529	0	559,126	559,126
-54,329.53000		2/15/2018		-54,329.53	-4,574,151	1.000000000 ^S 80.291180997	-54,329.53	-4,362,182	0	211,969	211,969
-8,354.61000		2/23/2018		-8,354.61	-701,268	1.000000000 ^S 80.291180997	-8,354.61	-670,802	0	30,466	30,466

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-241,131.03000		3/9/2018		-241,131.03	-19,903,757	1.000000000 ^S	-241,131.03	-19,360,695	0	543,062	543,062
						80.291180997					
-11,810.63000		3/15/2018		-11,810.63	-987,676	1.000000000 ^S	-11,810.63	-948,289	0	39,387	39,387
						80.291180997					
-71,875.05000		3/23/2018		-71,875.05	-5,825,270	1.000000000 ^S	-71,875.05	-5,770,933	0	54,337	54,337
						80.291180997					
-42,568.15000		3/26/2018		-42,568.15	-3,447,582	1.000000000 ^S	-42,568.15	-3,417,847	0	29,735	29,735
						80.291180997					
-50,297.76000		3/27/2018		-50,297.76	-4,076,366	1.000000000 ^S	-50,297.76	-4,038,467	0	37,899	37,899
						80.291180997					
-1,535.28000		4/9/2018		-1,535.28	-126,334	1.000000000 ^S	-1,535.28	-123,269	0	3,065	3,065
						80.291180997					
-88,985.26000		4/10/2018		-88,985.26	-7,326,140	1.000000000 ^S	-88,985.26	-7,144,732	0	181,408	181,408
						80.291180997					
-240,542.88000		4/11/2018		-240,542.88	-19,991,243	1.000000000 ^S	-240,542.88	-19,313,472	0	677,771	677,771
						80.291180997					
-106,173.13000		4/12/2018		-106,173.13	-8,804,183	1.000000000 ^S	-106,173.13	-8,524,766	0	279,417	279,417
						80.291180997					
-160,886.21000		4/16/2018		-160,886.21	-13,449,333	1.000000000 ^S	-160,886.21	-12,917,744	0	531,589	531,589
						80.291180997					
-51,033.60000		4/17/2018		-51,033.60	-4,256,750	1.000000000 ^S	-51,033.60	-4,097,548	0	159,202	159,202
						80.291180997					
-4,303.00000		4/17/2018		-4,303.00	-358,916	1.000000000 ^S	-4,303.00	-345,493	0	13,423	13,423
						80.291180997					
-103,980.92000		4/18/2018		-103,980.92	-8,658,256	1.000000000 ^S	-103,980.92	-8,348,751	0	309,505	309,505
						80.291180997					
-134,354.93000		4/20/2018		-134,354.93	-11,212,243	1.000000000 ^S	-134,354.93	-10,787,516	0	424,727	424,727
						80.291180997					
-68,589.85000		4/23/2018		-68,589.85	-5,669,514	1.000000000 ^S	-68,589.85	-5,507,160	0	162,354	162,354
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-40,543.60000		5/2/2018		-40,543.60	-3,348,880	1.000000000 ^S 80.291180997	-40,543.60	-3,255,294	0	93,586	93,586
-237,079.40000		5/15/2018		-237,079.40	-19,620,584	1.000000000 ^S 80.291180997	-237,079.40	-19,035,385	0	585,199	585,199
-104,464.09000		5/16/2018		-104,464.09	-8,615,124	1.000000000 ^S 80.291180997	-104,464.09	-8,387,545	0	227,579	227,579
-42,940.74000		5/17/2018		-42,940.74	-3,555,049	1.000000000 ^S 80.291180997	-42,940.74	-3,447,763	0	107,286	107,286
-259,940.71000		5/25/2018		-259,940.71	-21,430,186	1.000000000 ^S 80.291180997	-259,940.71	-20,870,947	0	559,239	559,239
-40,016.55000		5/29/2018		-40,016.55	-3,302,356	1.000000000 ^S 80.291180997	-40,016.55	-3,212,976	0	89,380	89,380
-7,569.94000		6/4/2018		-7,569.94	-627,097	1.000000000 ^S 80.291180997	-7,569.94	-607,799	0	19,298	19,298
-234,723.65000		6/8/2018		-234,723.65	-19,730,048	1.000000000 ^S 80.291180997	-234,723.65	-18,846,239	0	883,809	883,809
-354,424.37000		6/13/2018		-354,424.37	-29,758,065	1.000000000 ^S 80.291180997	-354,424.37	-28,457,151	0	1,300,914	1,300,914
-26,321.04000		6/21/2018		-26,321.04	-2,136,994	1.000000000 ^S 80.291180997	-26,321.04	-2,113,347	0	23,647	23,647
-62,568.05000		6/27/2018		-62,568.05	-5,082,558	1.000000000 ^S 80.291180997	-62,568.05	-5,023,663	0	58,895	58,895
-33,424.92000		6/28/2018		-33,424.92	-2,725,829	1.000000000 ^S 80.291180997	-33,424.92	-2,683,726	0	42,103	42,103
-59,587.09000		6/29/2018		-59,587.09	-4,831,738	1.000000000 ^S 80.291180997	-59,587.09	-4,784,318	0	47,420	47,420
-230,807.11000		7/11/2018		-230,807.11	-19,164,246	1.000000000 ^S 80.291180997	-230,807.11	-18,531,775	0	632,471	632,471
-12,445.25000		7/11/2018		-12,445.25	-1,033,347	1.000000000 ^S 80.291180997	-12,445.25	-999,244	0	34,103	34,103

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-48,245.27000		7/13/2018		-48,245.27	-4,015,011	1.000000000 ^S	-48,245.27	-3,873,670	0	141,341	141,341
						80.291180997					
-31,820.25000		7/13/2018		-31,820.25	-2,648,107	1.000000000 ^S	-31,820.25	-2,554,885	0	93,222	93,222
						80.291180997					
-4,067.90000		7/13/2018		-4,067.90	-338,534	1.000000000 ^S	-4,067.90	-326,616	0	11,918	11,918
						80.291180997					
-64,842.30000		7/19/2018		-64,842.30	-5,396,805	1.000000000 ^S	-64,842.30	-5,206,265	0	190,540	190,540
						80.291180997					
-779,961.50000		7/23/2018		-779,961.50	-64,630,841	1.000000000 ^S	-779,961.50	-62,624,030	0	2,006,811	2,006,811
						80.291180997					
-71,225.84000		7/24/2018		-71,225.84	-5,858,481	1.000000000 ^S	-71,225.84	-5,718,807	0	139,674	139,674
						80.291180997					
-38,008.43000		8/2/2018		-38,008.43	-3,151,351	1.000000000 ^S	-38,008.43	-3,051,742	0	99,609	99,609
						80.291180997					
-46,911.01000		8/7/2018		-46,911.01	-3,862,706	1.000000000 ^S	-46,911.01	-3,766,540	0	96,166	96,166
						80.291180997					
-230,631.58000		8/10/2018		-230,631.58	-18,925,734	1.000000000 ^S	-230,631.58	-18,517,682	0	408,052	408,052
						80.291180997					
-32,792.89000		8/17/2018		-32,792.89	-2,641,480	1.000000000 ^S	-32,792.89	-2,632,980	0	8,500	8,500
						80.291180997					
-27,692.84000		8/20/2018		-27,692.84	-2,226,969	1.000000000 ^S	-27,692.84	-2,223,491	0	3,478	3,478
						80.291180997					
-9,664.19000		8/22/2018		-9,664.19	-784,528	1.000000000 ^S	-9,664.19	-775,949	0	8,579	8,579
						80.291180997					
-18,900.99000		8/30/2018		-18,900.99	-1,539,099	1.000000000 ^S	-18,900.99	-1,517,583	0	21,516	21,516
						80.291180997					
-54,937.84000		8/31/2018		-54,937.84	-4,456,768	1.000000000 ^S	-54,937.84	-4,411,024	0	45,744	45,744
						80.291180997					
-232,403.15000		9/11/2018		-232,403.15	-18,379,859	1.000000000 ^S	-232,403.15	-18,659,923	0	-280,064	-280,064
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-31,758.92000		9/19/2018		-31,758.92	-2,571,503	1.000000000 ^S	-31,758.92	-2,549,961	0	21,542	21,542
						80.291180997					
-12,327.35000		9/25/2018		-12,327.35	-1,007,913	1.000000000 ^S	-12,327.35	-989,777	0	18,136	18,136
						80.291180997					
-16,004.18000		9/27/2018		-16,004.18	-1,313,144	1.000000000 ^S	-16,004.18	-1,284,995	0	28,149	28,149
						80.291180997					
-48,724.25000		10/2/2018		-48,724.25	-4,008,359	1.000000000 ^S	-48,724.25	-3,912,128	0	96,231	96,231
						80.291180997					
-23,470.68000		10/4/2018		-23,470.68	-1,915,543	1.000000000 ^S	-23,470.68	-1,884,489	0	31,054	31,054
						80.291180997					
-231,419.36000		10/12/2018		-231,419.36	-18,468,092	1.000000000 ^S	-231,419.36	-18,580,934	0	-112,842	-112,842
						80.291180997					
-53,598.82000		10/12/2018		-53,598.82	-4,277,377	1.000000000 ^S	-53,598.82	-4,303,513	0	-26,136	-26,136
						80.291180997					
-46,892.60000		10/12/2018		-46,892.60	-3,742,197	1.000000000 ^S	-46,892.60	-3,765,062	0	-22,865	-22,865
						80.291180997					
-3,953.84000		10/12/2018		-3,953.84	-315,531	1.000000000 ^S	-3,953.84	-317,458	0	-1,927	-1,927
						80.291180997					
-63,024.29000		10/16/2018		-63,024.29	-5,032,717	1.000000000 ^S	-63,024.29	-5,060,295	0	-27,578	-27,578
						80.291180997					
-20,113.75000		10/17/2018		-20,113.75	-1,610,303	1.000000000 ^S	-20,113.75	-1,614,957	0	-4,654	-4,654
						80.291180997					
-664,259.35000		10/18/2018		-664,259.35	-53,018,344	1.000000000 ^S	-664,259.35	-53,334,168	0	-315,824	-315,824
						80.291180997					
-18,070.52000		10/24/2018		-18,070.52	-1,429,780	1.000000000 ^S	-18,070.52	-1,450,903	0	-21,123	-21,123
						80.291180997					
-30,359.39000		10/26/2018		-30,359.39	-2,418,580	1.000000000 ^S	-30,359.39	-2,437,591	0	-19,011	-19,011
						80.291180997					
-104,308.20000		10/31/2018		-104,308.20	-8,365,512	1.000000000 ^S	-104,308.20	-8,375,029	0	-9,517	-9,517
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-50,401.50000		11/8/2018		-50,401.50	-4,159,745	1.000000000 ^S	-50,401.50	-4,046,796	0	112,949	112,949
						80.291180997					
-224,392.25000		11/9/2018		-224,392.25	-18,614,349	1.000000000 ^S	-224,392.25	-18,016,719	0	597,630	597,630
						80.291180997					
-9,986.37000		11/9/2018		-9,986.37	-828,414	1.000000000 ^S	-9,986.37	-801,817	0	26,597	26,597
						80.291180997					
-10,134.32000		11/19/2018		-10,134.32	-836,189	1.000000000 ^S	-10,134.32	-813,697	0	22,492	22,492
						80.291180997					
-1,139,616.57000		11/20/2018		-1,139,616.57	-93,691,893	1.000000000 ^S	-1,139,616.57	-91,501,160	0	2,190,733	2,190,733
						80.291180997					
-42,170.11000		11/20/2018		-42,170.11	-3,466,953	1.000000000 ^S	-42,170.11	-3,385,888	0	81,065	81,065
						80.291180997					
-38,005.37000		11/21/2018		-38,005.37	-3,108,318	1.000000000 ^S	-38,005.37	-3,051,496	0	56,822	56,822
						80.291180997					
-8,931.98000		12/3/2018		-8,931.98	-740,639	1.000000000 ^S	-8,931.98	-717,159	0	23,480	23,480
						80.291180997					
-73,433.24000		12/5/2018		-73,433.24	-6,104,102	1.000000000 ^S	-73,433.24	-5,896,042	0	208,060	208,060
						80.291180997					
-190,442.27000		12/11/2018		-190,442.27	-15,458,291	1.000000000 ^S	-190,442.27	-15,290,835	0	167,456	167,456
						80.291180997					
-12,136.99000		12/11/2018		-12,136.99	-985,165	1.000000000 ^S	-12,136.99	-974,493	0	10,672	10,672
						80.291180997					
-76,869.70000		12/13/2018		-76,869.70	-6,289,951	1.000000000 ^S	-76,869.70	-6,171,959	0	117,992	117,992
						80.291180997					
-459,000.00000		12/19/2018		-459,000.00	-37,076,503	1.000000000 ^S	-459,000.00	-36,853,652	0	222,851	222,851
						80.291180997					
-31,261.26000		12/21/2018		-31,261.26	-2,482,585	1.000000000 ^S	-31,261.26	-2,510,003	0	-27,418	-27,418
						80.291180997					
-34,959.38000		12/27/2018		-34,959.38	-2,721,231	1.000000000 ^S	-34,959.38	-2,806,930	0	-85,699	-85,699
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-13,486.62000		1/8/2019		-13,486.62	-1,043,413	1.000000000 ^S	-13,486.62	-1,082,857	0	-39,444	-39,444
						80.291180997					
-228,095.44000		1/11/2019		-228,095.44	-17,745,273	1.000000000 ^S	-228,095.44	-18,314,052	0	-568,779	-568,779
						80.291180997					
-31,995.00000		1/16/2019		-31,995.00	-2,501,010	1.000000000 ^S	-31,995.00	-2,568,916	0	-67,906	-67,906
						80.291180997					
-44,669.19000		1/17/2019		-44,669.19	-3,490,929	1.000000000 ^S	-44,669.19	-3,586,542	0	-95,613	-95,613
						80.291180997					
-60,036.00000		1/22/2019		-60,036.00	-4,709,139	1.000000000 ^S	-60,036.00	-4,820,361	0	-111,222	-111,222
						80.291180997					
-25,634.10000		1/22/2019		-25,634.10	-2,010,703	1.000000000 ^S	-25,634.10	-2,058,192	0	-47,489	-47,489
						80.291180997					
-254,230.16000		1/31/2019		-254,230.16	-20,035,819	1.000000000 ^S	-254,230.16	-20,412,440	0	-376,621	-376,621
						80.291180997					
-226,610.05000		2/12/2019		-226,610.05	-17,678,793	1.000000000 ^S	-226,610.05	-18,194,789	0	-515,996	-515,996
						80.291180997					
-46,516.42000		2/12/2019		-46,516.42	-3,628,939	1.000000000 ^S	-46,516.42	-3,734,858	0	-105,919	-105,919
						80.291180997					
-221,553.53000		2/20/2019		-221,553.53	-17,494,299	1.000000000 ^S	-221,553.53	-17,788,795	0	-294,496	-294,496
						80.291180997					
-38,774.55000		3/1/2019		-38,774.55	-3,070,891	1.000000000 ^S	-38,774.55	-3,113,254	0	-42,363	-42,363
						80.291180997					
-63,764.01000		3/4/2019		-63,764.01	-5,062,062	1.000000000 ^S	-63,764.01	-5,119,688	0	-57,626	-57,626
						80.291180997					
-231,531.52000		3/11/2019		-231,531.52	-18,113,517	1.000000000 ^S	-231,531.52	-18,589,939	0	-476,422	-476,422
						80.291180997					
-15,693.27000		3/14/2019		-15,693.27	-1,237,080	1.000000000 ^S	-15,693.27	-1,260,031	0	-22,951	-22,951
						80.291180997					
-11,606.00000		3/15/2019		-11,606.00	-915,480	1.000000000 ^S	-11,606.00	-931,859	0	-16,379	-16,379
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-600,999.98000		3/26/2019		-600,999.98	-47,070,099	1.000000000 ^S 80.291180997	-600,999.98	-48,254,998	0	-1,184,899	-1,184,899
-515,784.59000		3/29/2019		-515,784.59	-40,357,721	1.000000000 ^S 80.291180997	-515,784.59	-41,412,954	0	-1,055,233	-1,055,233
-73,349.53000		4/8/2019		-73,349.53	-5,822,604	1.000000000 ^S 80.291180997	-73,349.53	-5,889,320	0	-66,716	-66,716
-225,346.84000		4/11/2019		-225,346.84	-17,858,735	1.000000000 ^S 80.291180997	-225,346.84	-18,093,364	0	-234,629	-234,629
-35,132.62000		4/17/2019		-35,132.62	-2,821,296	1.000000000 ^S 80.291180997	-35,132.62	-2,820,840	0	456	456
-58,870.03000		4/18/2019		-58,870.03	-4,734,422	1.000000000 ^S 80.291180997	-58,870.03	-4,726,744	0	7,678	7,678
-43,801.67000		4/18/2019		-43,801.67	-3,522,600	1.000000000 ^S 80.291180997	-43,801.67	-3,516,888	0	5,712	5,712
-3,693.23000		4/18/2019		-3,693.23	-297,015	1.000000000 ^S 80.291180997	-3,693.23	-296,534	0	481	481
-225,082.95000		5/14/2019		-225,082.95	-17,085,005	1.000000000 ^S 80.291180997	-225,082.95	-18,072,176	0	-987,171	-987,171
-94,910.58000		5/17/2019		-94,910.58	-7,205,523	1.000000000 ^S 80.291180997	-94,910.58	-7,620,483	0	-414,960	-414,960
-87,834.76000		5/23/2019		-87,834.76	-6,662,312	1.000000000 ^S 80.291180997	-87,834.76	-7,052,357	0	-390,045	-390,045
-55,793.55000		5/31/2019		-55,793.55	-4,229,298	1.000000000 ^S 80.291180997	-55,793.55	-4,479,730	0	-250,432	-250,432
-226,601.48000		6/12/2019		-226,601.48	-17,112,794	1.000000000 ^S 80.291180997	-226,601.48	-18,194,100	0	-1,081,306	-1,081,306
-15,197.25000		6/25/2019		-15,197.25	-1,134,949	1.000000000 ^S 80.291180997	-15,197.25	-1,220,205	0	-85,256	-85,256
-11,644.71000		7/8/2019		-11,644.71	-880,468	1.000000000 ^S 80.291180997	-11,644.71	-934,968	0	-54,500	-54,500

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

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

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

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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-121,556.01000		7/11/2019		-121,556.01	-9,176,397	1.000000000 ^S 80.291180997	-121,556.01	-9,759,876	0	-583,479	-583,479
-44,689.00000		7/18/2019		-44,689.00	-3,384,444	1.000000000 ^S 80.291180997	-44,689.00	-3,588,133	0	-203,689	-203,689
-3,768.04000		7/18/2019		-3,768.04	-285,366	1.000000000 ^S 80.291180997	-3,768.04	-302,540	0	-17,174	-17,174
-29,373.95000		7/19/2019		-29,373.95	-2,230,106	1.000000000 ^S 80.291180997	-29,373.95	-2,358,469	0	-128,363	-128,363
-441,467.63000		7/22/2019		-441,467.63	-33,520,533	1.000000000 ^S 80.291180997	-441,467.63	-35,445,957	0	-1,925,424	-1,925,424
-175,549.92000		7/30/2019		-175,549.92	-13,177,136	1.000000000 ^S 80.291180997	-175,549.92	-14,095,110	0	-917,974	-917,974
-60,062.61000		7/31/2019		-60,062.61	-4,485,957	1.000000000 ^S 80.291180997	-60,062.61	-4,822,498	0	-336,541	-336,541
-232,223.94000		8/9/2019		-232,223.94	-16,768,953	1.000000000 ^S 80.291180997	-232,223.94	-18,645,534	0	-1,876,581	-1,876,581
-205,109.53000		9/11/2019		-205,109.53	-15,096,651	1.000000000 ^S 80.291180997	-205,109.53	-16,468,486	0	-1,371,835	-1,371,835
-17,578.68000		9/17/2019		-17,578.68	-1,302,835	1.000000000 ^S 80.291180997	-17,578.68	-1,411,413	0	-108,578	-108,578
-10,884.12000		9/19/2019		-10,884.12	-805,883	1.000000000 ^S 80.291180997	-10,884.12	-873,899	0	-68,016	-68,016
-778,958.02000		9/24/2019		-778,958.02	-56,646,058	1.000000000 ^S 80.291180997	-778,958.02	-62,543,459	0	-5,897,401	-5,897,401
-7,509.72000		10/3/2019		-7,509.72	-539,891	1.000000000 ^S 80.291180997	-7,509.72	-602,964	0	-63,073	-63,073
-205,806.16000		10/11/2019		-205,806.16	-15,010,764	1.000000000 ^S 80.291180997	-205,806.16	-16,524,420	0	-1,513,656	-1,513,656
-32,085.08000		10/11/2019		-32,085.08	-2,340,171	1.000000000 ^S 80.291180997	-32,085.08	-2,576,149	0	-235,978	-235,978

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-47,442.98000		10/15/2019		-47,442.98	-3,480,370	1.000000000 ^S	-47,442.98	-3,809,253	0	-328,883	-328,883
						80.291180997					
-4,000.25000		10/15/2019		-4,000.25	-293,454	1.000000000 ^S	-4,000.25	-321,185	0	-27,731	-27,731
						80.291180997					
-63,764.01000		10/17/2019		-63,764.01	-4,680,782	1.000000000 ^S	-63,764.01	-5,119,688	0	-438,906	-438,906
						80.291180997					
-88,188.28000		10/24/2019		-88,188.28	-6,556,354	1.000000000 ^S	-88,188.28	-7,080,741	0	-524,387	-524,387
						80.291180997					
-997,183.01000		10/29/2019		-997,183.01	-74,336,492	1.000000000 ^S	-997,183.01	-80,065,002	0	-5,728,510	-5,728,510
						80.291180997					
-18,077.89000		10/30/2019		-18,077.89	-1,350,202	1.000000000 ^S	-18,077.89	-1,451,495	0	-101,293	-101,293
						80.291180997					
-200,251.64000		11/12/2019		-200,251.64	-14,964,007	1.000000000 ^S	-200,251.64	-16,078,441	0	-1,114,434	-1,114,434
						80.291180997					
-49,082.82000		11/13/2019		-49,082.82	-3,665,794	1.000000000 ^S	-49,082.82	-3,940,918	0	-275,124	-275,124
						80.291180997					
-20,180.00000		11/25/2019		-20,180.00	-1,487,718	1.000000000 ^S	-20,180.00	-1,620,276	0	-132,558	-132,558
						80.291180997					
-202,741.20000		12/11/2019		-202,741.20	-15,005,931	1.000000000 ^S	-202,741.20	-16,278,330	0	-1,272,399	-1,272,399
						80.291180997					
-574,851.64000		12/16/2019		-574,851.64	-43,181,511	1.000000000 ^S	-574,851.64	-46,155,517	0	-2,974,006	-2,974,006
						80.291180997					
-4,780.63000		12/17/2019		-4,780.63	-361,393	1.000000000 ^S	-4,780.63	-383,842	0	-22,449	-22,449
						80.291180997					
-494,616.57000		12/19/2019		-494,616.57	-37,192,781	1.000000000 ^S	-494,616.57	-39,713,349	0	-2,520,568	-2,520,568
						80.291180997					
-13,059.23000		12/20/2019		-13,059.23	-981,935	1.000000000 ^S	-13,059.23	-1,048,541	0	-66,606	-66,606
						80.291180997					
-3,061.85000		12/24/2019		-3,061.85	-231,660	1.000000000 ^S	-3,061.85	-245,840	0	-14,180	-14,180
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-26,661.23000		12/27/2019		-26,661.23	-2,028,365	1.000000000 ^S	-26,661.23	-2,140,662	0	-112,297	-112,297
						80.291180997					
-143,370.03000		1/7/2020		-143,370.03	-10,767,119	1.000000000 ^S	-143,370.03	-11,511,349	0	-744,230	-744,230
						80.291180997					
-14,950.87000		1/8/2020		-14,950.87	-1,115,419	1.000000000 ^S	-14,950.87	-1,200,423	0	-85,004	-85,004
						80.291180997					
-197,898.31000		1/10/2020		-197,898.31	-14,857,545	1.000000000 ^S	-197,898.31	-15,889,489	0	-1,031,944	-1,031,944
						80.291180997					
-62,954.74000		1/29/2020		-62,954.74	-4,639,562	1.000000000 ^S	-62,954.74	-5,054,710	0	-415,148	-415,148
						80.291180997					
-58,342.15000		2/4/2020		-58,342.15	-4,246,537	1.000000000 ^S	-58,342.15	-4,684,360	0	-437,823	-437,823
						80.291180997					
-199,630.11000		2/12/2020		-199,630.11	-14,748,546	1.000000000 ^S	-199,630.11	-16,028,537	0	-1,279,991	-1,279,991
						80.291180997					
-16,163.64000		2/28/2020		-16,163.64	-1,169,196	1.000000000 ^S	-16,163.64	-1,297,798	0	-128,602	-128,602
						80.291180997					
-1,683,616.57000		3/10/2020		-1,683,616.57	-114,922,117	1.000000000 ^S	-1,683,616.57	-135,179,563	0	-20,257,446	-20,257,446
						80.291180997					
-341,601.08000		3/11/2020		-341,601.08	-22,956,980	1.000000000 ^S	-341,601.08	-27,427,554	0	-4,470,574	-4,470,574
						80.291180997					
-199,895.77000		3/11/2020		-199,895.77	-13,433,808	1.000000000 ^S	-199,895.77	-16,049,867	0	-2,616,059	-2,616,059
						80.291180997					
-9,798.00000		3/24/2020		-9,798.00	-627,957	1.000000000 ^S	-9,798.00	-786,693	0	-158,736	-158,736
						80.291180997					
-198,161.35000		4/14/2020		-198,161.35	-13,606,730	1.000000000 ^S	-198,161.35	-15,910,609	0	-2,303,879	-2,303,879
						80.291180997					
-59,967.25000		4/28/2020		-59,967.25	-4,154,860	1.000000000 ^S	-59,967.25	-4,814,841	0	-659,981	-659,981
						80.291180997					
-44,618.04000		4/28/2020		-44,618.04	-3,091,383	1.000000000 ^S	-44,618.04	-3,582,435	0	-491,052	-491,052
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-3,762.06000		4/28/2020		-3,762.06	-260,656	1.000000000 ^S	-3,762.06	-302,060	0	-41,404	-41,404
						80.291180997					
-198,664.80000		5/14/2020		-198,664.80	-13,775,595	1.000000000 ^S	-198,664.80	-15,951,031	0	-2,175,436	-2,175,436
						80.291180997					
-44,195.22000		5/19/2020		-44,195.22	-3,085,605	1.000000000 ^S	-44,195.22	-3,548,486	0	-462,881	-462,881
						80.291180997					
-198,852.82000		6/11/2020		-198,852.82	-14,907,920	1.000000000 ^S	-198,852.82	-15,966,128	0	-1,058,208	-1,058,208
						80.291180997					
-162.06000		6/11/2020		-162.06	-12,150	1.000000000 ^S	-162.06	-13,012	0	-862	-862
						80.291180997					
-8,754.11000		6/12/2020		-8,754.11	-644,312	1.000000000 ^S	-8,754.11	-702,878	0	-58,566	-58,566
						80.291180997					
-7,750.00000		6/15/2020		-7,750.00	-568,998	1.000000000 ^S	-7,750.00	-622,257	0	-53,259	-53,259
						80.291180997					
-15,511.80000		6/16/2020		-15,511.80	-1,142,240	1.000000000 ^S	-15,511.80	-1,245,461	0	-103,221	-103,221
						80.291180997					
-23,202.00000		6/17/2020		-23,202.00	-1,704,897	1.000000000 ^S	-23,202.00	-1,862,916	0	-158,019	-158,019
						80.291180997					
-35,546.52000		6/18/2020		-35,546.52	-2,635,936	1.000000000 ^S	-35,546.52	-2,854,072	0	-218,136	-218,136
						80.291180997					
-605,404.68000		6/19/2020		-605,404.68	-44,361,785	1.000000000 ^S	-605,404.68	-48,608,657	0	-4,246,872	-4,246,872
						80.291180997					
-152,267.88000		6/22/2020		-152,267.88	-11,176,599	1.000000000 ^S	-152,267.88	-12,225,768	0	-1,049,169	-1,049,169
						80.291180997					
-11,662.50000		6/25/2020		-11,662.50	-859,904	1.000000000 ^S	-11,662.50	-936,396	0	-76,492	-76,492
						80.291180997					
-7,777.00000		6/26/2020		-7,777.00	-571,793	1.000000000 ^S	-7,777.00	-624,425	0	-52,632	-52,632
						80.291180997					
-19,286.41000		6/30/2020		-19,286.41	-1,423,771	1.000000000 ^S	-19,286.41	-1,548,529	0	-124,758	-124,758
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-11,667.00000		7/1/2020		-11,667.00	-866,611	1.000000000 ^S	-11,667.00	-936,757	0	-70,146	-70,146
						80.291180997					
-3,891.50000		7/2/2020		-3,891.50	-289,661	1.000000000 ^S	-3,891.50	-312,453	0	-22,792	-22,792
						80.291180997					
-7,784.00000		7/6/2020		-7,784.00	-580,762	1.000000000 ^S	-7,784.00	-624,987	0	-44,225	-44,225
						80.291180997					
-11,591.56000		7/7/2020		-11,591.56	-870,380	1.000000000 ^S	-11,591.56	-930,700	0	-60,320	-60,320
						80.291180997					
-7,784.00000		7/8/2020		-7,784.00	-583,408	1.000000000 ^S	-7,784.00	-624,987	0	-41,579	-41,579
						80.291180997					
-7,812.00000		7/9/2020		-7,812.00	-585,149	1.000000000 ^S	-7,812.00	-627,235	0	-42,086	-42,086
						80.291180997					
-192,699.63000		7/10/2020		-192,699.63	-14,392,052	1.000000000 ^S	-192,699.63	-15,472,081	0	-1,080,029	-1,080,029
						80.291180997					
-5,968.29000		7/10/2020		-5,968.29	-445,750	1.000000000 ^S	-5,968.29	-479,201	0	-33,451	-33,451
						80.291180997					
-67,490.38000		7/13/2020		-67,490.38	-5,013,915	1.000000000 ^S	-67,490.38	-5,418,882	0	-404,967	-404,967
						80.291180997					
-42,642.14000		7/15/2020		-42,642.14	-3,186,186	1.000000000 ^S	-42,642.14	-3,423,788	0	-237,602	-237,602
						80.291180997					
-3,595.46000		7/15/2020		-3,595.46	-268,650	1.000000000 ^S	-3,595.46	-288,684	0	-20,034	-20,034
						80.291180997					
-24,622.52000		7/16/2020		-24,622.52	-1,847,388	1.000000000 ^S	-24,622.52	-1,976,971	0	-129,583	-129,583
						80.291180997					
-3,893.00000		7/17/2020		-3,893.00	-291,913	1.000000000 ^S	-3,893.00	-312,574	0	-20,661	-20,661
						80.291180997					
-3,896.50000		7/20/2020		-3,896.50	-291,596	1.000000000 ^S	-3,896.50	-312,855	0	-21,259	-21,259
						80.291180997					
-2,922.04000		7/21/2020		-2,922.04	-219,589	1.000000000 ^S	-2,922.04	-234,614	0	-15,025	-15,025
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-57,311.61000		7/22/2020		-57,311.61	-4,354,693	1.000000000 ^S	-57,311.61	-4,601,617	0	-246,924	-246,924
						80.291180997					
-34,354.75000		7/22/2020		-34,354.75	-2,610,368	1.000000000 ^S	-34,354.75	-2,758,383	0	-148,015	-148,015
						80.291180997					
-3,910.00000		7/27/2020		-3,910.00	-293,843	1.000000000 ^S	-3,910.00	-313,939	0	-20,096	-20,096
						80.291180997					
-5,740.95000		7/28/2020		-5,740.95	-431,446	1.000000000 ^S	-5,740.95	-460,948	0	-29,502	-29,502
						80.291180997					
-10,962.84000		8/6/2020		-10,962.84	-835,391	1.000000000 ^S	-10,962.84	-880,219	0	-44,828	-44,828
						80.291180997					
-177,143.44000		8/12/2020		-177,143.44	-13,510,058	1.000000000 ^S	-177,143.44	-14,223,056	0	-712,998	-712,998
						80.291180997					
-12,122.71000		8/12/2020		-12,122.71	-924,553	1.000000000 ^S	-12,122.71	-973,347	0	-48,794	-48,794
						80.291180997					
-52,384.44000		8/13/2020		-52,384.44	-4,016,526	1.000000000 ^S	-52,384.44	-4,206,009	0	-189,483	-189,483
						80.291180997					
-10,958.81000		8/18/2020		-10,958.81	-837,510	1.000000000 ^S	-10,958.81	-879,896	0	-42,386	-42,386
						80.291180997					
-275,950.40000		8/20/2020		-275,950.40	-21,100,323	1.000000000 ^S	-275,950.40	-22,156,384	0	-1,056,061	-1,056,061
						80.291180997					
-62,870.83000		8/21/2020		-62,870.83	-4,770,834	1.000000000 ^S	-62,870.83	-5,047,973	0	-277,139	-277,139
						80.291180997					
-116,678.12000		8/24/2020		-116,678.12	-8,843,608	1.000000000 ^S	-116,678.12	-9,368,224	0	-524,616	-524,616
						80.291180997					
-8,315.43000		8/26/2020		-8,315.43	-635,712	1.000000000 ^S	-8,315.43	-667,656	0	-31,944	-31,944
						80.291180997					
-109,281.13000		9/2/2020		-109,281.13	-8,546,704	1.000000000 ^S	-109,281.13	-8,774,311	0	-227,607	-227,607
						80.291180997					
-19,071.87000		9/8/2020		-19,071.87	-1,475,930	1.000000000 ^S	-19,071.87	-1,531,303	0	-55,373	-55,373
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-8,897.24000		9/9/2020		-8,897.24	-681,843	1.000000000 ^S	-8,897.24	-714,370	0	-32,527	-32,527
						80.291180997					
-45,660.91000		9/10/2020		-45,660.91	-3,527,735	1.000000000 ^S	-45,660.91	-3,666,168	0	-138,433	-138,433
						80.291180997					
-188,962.41000		9/14/2020		-188,962.41	-14,604,347	1.000000000 ^S	-188,962.41	-15,172,015	0	-567,668	-567,668
						80.291180997					
-107,002.10000		9/14/2020		-107,002.10	-8,269,877	1.000000000 ^S	-107,002.10	-8,591,325	0	-321,448	-321,448
						80.291180997					
-18,939.51000		9/15/2020		-18,939.51	-1,459,669	1.000000000 ^S	-18,939.51	-1,520,676	0	-61,007	-61,007
						80.291180997					
-324,702.88000		9/25/2020		-324,702.88	-24,054,108	1.000000000 ^S	-324,702.88	-26,070,778	0	-2,016,670	-2,016,670
						80.291180997					
-147,989.86000		9/29/2020		-147,989.86	-11,019,376	1.000000000 ^S	-147,989.86	-11,882,281	0	-862,905	-862,905
						80.291180997					
-227,232.20000		10/2/2020		-227,232.20	-17,241,455	1.000000000 ^S	-227,232.20	-18,244,742	0	-1,003,287	-1,003,287
						80.291180997					
-18,568.42000		10/7/2020		-18,568.42	-1,404,641	1.000000000 ^S	-18,568.42	-1,490,880	0	-86,239	-86,239
						80.291180997					
-164,820.58000		10/9/2020		-164,820.58	-12,507,804	1.000000000 ^S	-164,820.58	-13,233,639	0	-725,835	-725,835
						80.291180997					
-900,000.00000		10/13/2020		-900,000.00	-68,336,634	1.000000000 ^S	-900,000.00	-72,262,063	0	-3,925,429	-3,925,429
						80.291180997					
-766,101.00000		10/13/2020		-766,101.00	-58,169,738	1.000000000 ^S	-766,101.00	-61,511,154	0	-3,341,416	-3,341,416
						80.291180997					
-417,000.00000		10/13/2020		-417,000.00	-31,662,641	1.000000000 ^S	-417,000.00	-33,481,422	0	-1,818,781	-1,818,781
						80.291180997					
-82,580.92000		10/16/2020		-82,580.92	-6,153,555	1.000000000 ^S	-82,580.92	-6,630,520	0	-476,965	-476,965
						80.291180997					
-38,339.77000		10/19/2020		-38,339.77	-2,862,050	1.000000000 ^S	-38,339.77	-3,078,345	0	-216,295	-216,295
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-16,380.30000		10/20/2020		-16,380.30	-1,224,976	1.000000000 ^S 80.291180997	-16,380.30	-1,315,194	0	-90,218	-90,218
-23,702.06000		10/22/2020		-23,702.06	-1,763,044	1.000000000 ^S 80.291180997	-23,702.06	-1,903,066	0	-140,022	-140,022
-42,912.29000		10/27/2020		-42,912.29	-3,204,223	1.000000000 ^S 80.291180997	-42,912.29	-3,445,478	0	-241,255	-241,255
-105,280.79000		11/4/2020		-105,280.79	-7,891,026	1.000000000 ^S 80.291180997	-105,280.79	-8,453,119	0	-562,093	-562,093
-191,831.31000		11/12/2020		-191,831.31	-14,718,133	1.000000000 ^S 80.291180997	-191,831.31	-15,402,362	0	-684,229	-684,229
-18,083.02000		11/19/2020		-18,083.02	-1,373,287	1.000000000 ^S 80.291180997	-18,083.02	-1,451,907	0	-78,620	-78,620
-10,528.10000		11/20/2020		-10,528.10	-795,260	1.000000000 ^S 80.291180997	-10,528.10	-845,314	0	-50,054	-50,054
-86,099.46000		11/24/2020		-86,099.46	-6,549,885	1.000000000 ^S 80.291180997	-86,099.46	-6,913,027	0	-363,142	-363,142
-91,592.32000		12/1/2020		-91,592.32	-7,037,499	1.000000000 ^S 80.291180997	-91,592.32	-7,354,056	0	-316,557	-316,557
-25,208.93000		12/3/2020		-25,208.93	-1,946,115	1.000000000 ^S 80.291180997	-25,208.93	-2,024,055	0	-77,940	-77,940
-194,203.63000		12/11/2020		-194,203.63	-15,238,300	1.000000000 ^S 80.291180997	-194,203.63	-15,592,839	0	-354,539	-354,539
-18,310.66000		12/11/2020		-18,310.66	-1,436,757	1.000000000 ^S 80.291180997	-18,310.66	-1,470,185	0	-33,428	-33,428
-168,440.90000		12/14/2020		-168,440.90	-13,192,722	1.000000000 ^S 80.291180997	-168,440.90	-13,524,319	0	-331,597	-331,597
-17,581.87000		12/17/2020		-17,581.87	-1,376,729	1.000000000 ^S 80.291180997	-17,581.87	-1,411,669	0	-34,940	-34,940
-37,104.53000		12/21/2020		-37,104.53	-2,919,710	1.000000000 ^S 80.291180997	-37,104.53	-2,979,167	0	-59,457	-59,457

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-33,859.61000		12/22/2020		-33,859.61	-2,648,853	1.000000000 ^S	-33,859.61	-2,718,628	0	-69,775	-69,775
						80.291180997					
-39,098.57000		12/29/2020		-39,098.57	-3,071,479	1.000000000 ^S	-39,098.57	-3,139,270	0	-67,791	-67,791
						80.291180997					
-196,013.94000		1/12/2021		-196,013.94	-15,725,988	1.000000000 ^S	-196,013.94	-15,738,191	0	-12,203	-12,203
						80.291180997					
-53,466.66000		1/29/2021		-53,466.66	-4,277,362	1.000000000 ^S	-53,466.66	-4,292,901	0	-15,539	-15,539
						80.291180997					
-43,285.99000		1/29/2021		-43,285.99	-3,462,903	1.000000000 ^S	-43,285.99	-3,475,483	0	-12,580	-12,580
						80.291180997					
-3,649.75000		1/29/2021		-3,649.75	-291,982	1.000000000 ^S	-3,649.75	-293,043	0	-1,061	-1,061
						80.291180997					
-58,176.95000		2/3/2021		-58,176.95	-4,634,102	1.000000000 ^S	-58,176.95	-4,671,096	0	-36,994	-36,994
						80.291180997					
-24,989.49000		2/8/2021		-24,989.49	-2,018,410	1.000000000 ^S	-24,989.49	-2,006,436	0	11,974	11,974
						80.291180997					
-190,925.71000		2/12/2021		-190,925.71	-15,518,883	1.000000000 ^S	-190,925.71	-15,329,651	0	189,232	189,232
						80.291180997					
-18,869.59000		2/12/2021		-18,869.59	-1,533,764	1.000000000 ^S	-18,869.59	-1,515,062	0	18,702	18,702
						80.291180997					
-17,961.37000		2/22/2021		-17,961.37	-1,491,625	1.000000000 ^S	-17,961.37	-1,442,140	0	49,485	49,485
						80.291180997					
-96,401.33000		2/24/2021		-96,401.33	-8,013,355	1.000000000 ^S	-96,401.33	-7,740,177	0	273,178	273,178
						80.291180997					
-21,439.86000		2/25/2021		-21,439.86	-1,798,475	1.000000000 ^S	-21,439.86	-1,721,432	0	77,043	77,043
						80.291180997					
-43,520.35000		3/5/2021		-43,520.35	-3,653,747	1.000000000 ^S	-43,520.35	-3,494,300	0	159,447	159,447
						80.291180997					
-92,848.25000		3/8/2021		-92,848.25	-7,702,804	1.000000000 ^S	-92,848.25	-7,454,896	0	247,908	247,908
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-182,141.45000		3/11/2021		-182,141.45	-15,261,248	1.000000000 ^S	-182,141.45	-14,624,352	0	636,896	636,896
						80.291180997					
-11,345.80000		3/11/2021		-11,345.80	-950,641	1.000000000 ^S	-11,345.80	-910,968	0	39,673	39,673
						80.291180997					
-101,280.78000		3/15/2021		-101,280.78	-8,553,965	1.000000000 ^S	-101,280.78	-8,131,953	0	422,012	422,012
						80.291180997					
-36,648.89000		3/17/2021		-36,648.89	-3,095,884	1.000000000 ^S	-36,648.89	-2,942,583	0	153,301	153,301
						80.291180997					
-36,551.22000		3/23/2021		-36,551.22	-3,078,004	1.000000000 ^S	-36,551.22	-2,934,741	0	143,263	143,263
						80.291180997					
-14,560.07000		3/25/2021		-14,560.07	-1,207,674	1.000000000 ^S	-14,560.07	-1,169,045	0	38,629	38,629
						80.291180997					
-98,235.00000		3/26/2021		-98,235.00	-8,116,240	1.000000000 ^S	-98,235.00	-7,887,404	0	228,836	228,836
						80.291180997					
-181,210.69000		4/12/2021		-181,210.69	-15,149,346	1.000000000 ^S	-181,210.69	-14,549,620	0	599,726	599,726
						80.291180997					
-40,556.29000		4/12/2021		-40,556.29	-3,390,536	1.000000000 ^S	-40,556.29	-3,256,312	0	134,224	134,224
						80.291180997					
-9,353.32000		4/21/2021		-9,353.32	-783,728	1.000000000 ^S	-9,353.32	-750,989	0	32,739	32,739
						80.291180997					
-57,927.10000		4/22/2021		-57,927.10	-4,856,219	1.000000000 ^S	-57,927.10	-4,651,035	0	205,184	205,184
						80.291180997					
-43,100.09000		4/22/2021		-43,100.09	-3,613,222	1.000000000 ^S	-43,100.09	-3,460,557	0	152,665	152,665
						80.291180997					
-3,634.07000		4/22/2021		-3,634.07	-304,656	1.000000000 ^S	-3,634.07	-291,784	0	12,872	12,872
						80.291180997					
-62,487.79000		4/30/2021		-62,487.79	-5,287,225	1.000000000 ^S	-62,487.79	-5,017,218	0	270,007	270,007
						80.291180997					
-12,614.45000		5/6/2021		-12,614.45	-1,067,845	1.000000000 ^S	-12,614.45	-1,012,829	0	55,016	55,016
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-606,097.00000		5/11/2021		-606,097.00	-51,843,348	1.000000000 ^S 80.291180997	-606,097.00	-48,664,244	0	3,179,104	3,179,104
-230,000.00000		5/11/2021		-230,000.00	-19,673,369	1.000000000 ^S 80.291180997	-230,000.00	-18,466,972	0	1,206,397	1,206,397
-227,000.00000		5/11/2021		-227,000.00	-19,416,760	1.000000000 ^S 80.291180997	-227,000.00	-18,226,098	0	1,190,662	1,190,662
-178,000.00000		5/11/2021		-178,000.00	-15,225,477	1.000000000 ^S 80.291180997	-178,000.00	-14,291,830	0	933,647	933,647
-181,230.96000		5/12/2021		-181,230.96	-15,399,353	1.000000000 ^S 80.291180997	-181,230.96	-14,551,248	0	848,105	848,105
-92,511.77000		5/25/2021		-92,511.77	-7,795,140	1.000000000 ^S 80.291180997	-92,511.77	-7,427,879	0	367,261	367,261
-29,889.56000		5/27/2021		-29,889.56	-2,522,635	1.000000000 ^S 80.291180997	-29,889.56	-2,399,868	0	122,767	122,767
-30,023.89000		6/1/2021		-30,023.89	-2,542,339	1.000000000 ^S 80.291180997	-30,023.89	-2,410,654	0	131,685	131,685
-25,520.59000		6/8/2021		-25,520.59	-2,163,778	1.000000000 ^S 80.291180997	-25,520.59	-2,049,078	0	114,700	114,700
-9,103.42000		6/10/2021		-9,103.42	-771,299	1.000000000 ^S 80.291180997	-9,103.42	-730,924	0	40,375	40,375
-173,262.44000		6/11/2021		-173,262.44	-14,703,340	1.000000000 ^S 80.291180997	-173,262.44	-13,911,446	0	791,894	791,894
-124,557.16000		6/11/2021		-124,557.16	-10,570,129	1.000000000 ^S 80.291180997	-124,557.16	-10,000,841	0	569,288	569,288
-45,424.93000		6/15/2021		-45,424.93	-3,857,209	1.000000000 ^S 80.291180997	-45,424.93	-3,647,221	0	209,988	209,988
-17,660.59000		6/15/2021		-17,660.59	-1,499,630	1.000000000 ^S 80.291180997	-17,660.59	-1,417,990	0	81,640	81,640
-183,243.85000		7/12/2021		-183,243.85	-15,100,530	1.000000000 ^S 80.291180997	-183,243.85	-14,712,865	0	387,665	387,665

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-89,853.93000		7/15/2021		-89,853.93	-7,394,779	1.000000000 ^S	-89,853.93	-7,214,478	0	180,301	180,301
						80.291180997					
-43,329.45000		7/15/2021		-43,329.45	-3,565,918	1.000000000 ^S	-43,329.45	-3,478,973	0	86,945	86,945
						80.291180997					
-3,653.41000		7/15/2021		-3,653.41	-300,668	1.000000000 ^S	-3,653.41	-293,337	0	7,331	7,331
						80.291180997					
-33,912.35000		7/19/2021		-33,912.35	-2,765,901	1.000000000 ^S	-33,912.35	-2,722,863	0	43,038	43,038
						80.291180997					
-302,874.92000		7/21/2021		-302,874.92	-24,364,754	1.000000000 ^S	-302,874.92	-24,318,185	0	46,569	46,569
						80.291180997					
-58,235.37000		7/21/2021		-58,235.37	-4,684,741	1.000000000 ^S	-58,235.37	-4,675,787	0	8,954	8,954
						80.291180997					
-170,752.21000		7/27/2021		-170,752.21	-13,916,109	1.000000000 ^S	-170,752.21	-13,709,897	0	206,212	206,212
						80.291180997					
-87,399.68000		8/3/2021		-87,399.68	-7,043,401	1.000000000 ^S	-87,399.68	-7,017,424	0	25,977	25,977
						80.291180997					
-47,414.31000		8/3/2021		-47,414.31	-3,821,043	1.000000000 ^S	-47,414.31	-3,806,951	0	14,092	14,092
						80.291180997					
-4,800.77000		8/10/2021		-4,800.77	-388,292	1.000000000 ^S	-4,800.77	-385,459	0	2,833	2,833
						80.291180997					
-180,149.01000		8/12/2021		-180,149.01	-14,676,038	1.000000000 ^S	-180,149.01	-14,464,377	0	211,661	211,661
						80.291180997					
-151,641.92000		8/18/2021		-151,641.92	-12,061,932	1.000000000 ^S	-151,641.92	-12,175,509	0	-113,577	-113,577
						80.291180997					
-39,042.50000		8/20/2021		-39,042.50	-3,065,800	1.000000000 ^S	-39,042.50	-3,134,768	0	-68,968	-68,968
						80.291180997					
-75,244.96000		8/24/2021		-75,244.96	-5,945,999	1.000000000 ^S	-75,244.96	-6,041,507	0	-95,508	-95,508
						80.291180997					
-218,532.26000		8/25/2021		-218,532.26	-17,423,973	1.000000000 ^S	-218,532.26	-17,546,213	0	-122,240	-122,240
						80.291180997					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
321,814.59000	合計			321,815	-298,722,182		321,815	25,838,862	0	324,561,044	324,561,044
0.00000											
284,358.60	BRITISH POUND GBP	7/27/2021		284,358.60	43,354,328	1.000000000 ^S 151.194825005	284,358.60	42,993,549	0	-360,779	-360,779
7,338.40		8/19/2021		7,338.40	1,109,438	1.000000000 ^S 151.194825005	7,338.40	1,109,528	0	90	90
291,697.00000	合計			291,697	44,463,766		291,697	44,103,077	0	-360,689	-360,689
0.00000											
50.00	CANADIAN DOLLAR CAD	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000 ^S 0.011502367	50.00	4,347	0	-323	-323
750,149.41000	EURO EUR	8/31/2021		750,149.41	97,277,057	1.000000000 ^S 129.684236999	750,149.41	97,282,554	0	5,497	5,497
636,473.57000	UNITED STATES DOLLAR USD	7/27/2021		636,473.57	70,206,219	1.000000000 ^S 0.009102494	636,473.57	69,922,987	0	-283,232	-283,232
818,692.50000		7/27/2021		818,692.50	90,305,878	1.000000000 ^S 0.009102494	818,692.50	89,941,559	0	-364,319	-364,319
907,613.73000		7/27/2021		907,613.73	100,114,334	1.000000000 ^S 0.009102494	907,613.73	99,710,445	0	-403,889	-403,889
1,260,864.28000		7/27/2021		1,260,864.28	139,079,637	1.000000000 ^S 0.009102494	1,260,864.28	138,518,551	0	-561,086	-561,086
1,382,989.41000		7/27/2021		1,382,989.41	152,550,650	1.000000000 ^S 0.009102494	1,382,989.41	151,935,218	0	-615,432	-615,432
1,606,419.32000		7/27/2021		1,606,419.32	177,196,087	1.000000000 ^S 0.009102494	1,606,419.32	176,481,228	0	-714,859	-714,859
1,743,410.36000		7/27/2021		1,743,410.36	192,306,884	1.000000000 ^S 0.009102494	1,743,410.36	191,531,064	0	-775,820	-775,820
87,125.00000		7/29/2021		87,125.00	9,593,334	1.000000000 ^S 0.009102494	87,125.00	9,571,553	0	-21,781	-21,781

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
310,000.00000		7/30/2021		310,000.00	33,982,200	1.000000000 ^S 0.009102494	310,000.00	34,056,600	0	74,400	74,400
2,830,913.03000		8/3/2021		2,830,913.03	309,319,696	1.000000000 ^S 0.009102494	2,830,913.03	311,004,108	0	1,684,412	1,684,412
29,041.67000		8/5/2021		29,041.67	3,181,660	1.000000000 ^S 0.009102494	29,041.67	3,190,518	0	8,858	8,858
1,671.12000		8/6/2021		1,671.12	183,322	1.000000000 ^S 0.009102494	1,671.12	183,589	0	267	267
122,902.50000		8/9/2021		122,902.50	13,559,218	1.000000000 ^S 0.009102494	122,902.50	13,502,069	0	-57,149	-57,149
7.94000		8/10/2021		7.94	871	1.000000000 ^S 0.009102494	7.94	872	0	1	1
7.94000		8/10/2021		7.94	876	1.000000000 ^S 0.009102494	7.94	872	0	-4	-4
537.81000		8/12/2021		537.81	59,412	1.000000000 ^S 0.009102494	537.81	59,084	0	-328	-328
21,533.87000		8/12/2021		21,533.87	2,378,847	1.000000000 ^S 0.009102494	21,533.87	2,365,711	0	-13,136	-13,136
61,353.78000		8/12/2021		61,353.78	6,777,753	1.000000000 ^S 0.009102494	61,353.78	6,740,326	0	-37,427	-37,427
1,204,956.26000		8/12/2021		1,204,956.26	133,111,523	1.000000000 ^S 0.009102494	1,204,956.26	132,376,496	0	-735,027	-735,027
1,504,637.02000		8/12/2021		1,504,637.02	166,217,258	1.000000000 ^S 0.009102494	1,504,637.02	165,299,425	0	-917,833	-917,833
15,128.32000		8/15/2021		15,128.32	1,662,073	1.000000000 ^S 0.009102494	15,128.32	1,661,997	0	-76	-76
66,937.50000		8/15/2021		66,937.50	7,354,088	1.000000000 ^S 0.009102494	66,937.50	7,353,754	0	-334	-334
83,250.00000		8/15/2021		83,250.00	9,146,261	1.000000000 ^S 0.009102494	83,250.00	9,145,845	0	-416	-416

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
163,383.75000		8/15/2021		163,383.75	17,950,155	1.000000000 ^S 0.009102494	163,383.75	17,949,339	0	-816	-816
10,030.57000		8/16/2021		10,030.57	1,102,009	1.000000000 ^S 0.009102494	10,030.57	1,101,958	0	-51	-51
100,000.00000		8/16/2021		100,000.00	10,986,500	1.000000000 ^S 0.009102494	100,000.00	10,986,000	0	-500	-500
440,000.00000		8/16/2021		440,000.00	48,340,599	1.000000000 ^S 0.009102494	440,000.00	48,338,400	0	-2,199	-2,199
127,925.00000		8/19/2021		127,925.00	14,058,318	1.000000000 ^S 0.009102494	127,925.00	14,053,841	0	-4,477	-4,477
40,286.46000		8/21/2021		40,286.46	4,423,655	1.000000000 ^S 0.009102494	40,286.46	4,425,871	0	2,216	2,216
41,976.00000		8/21/2021		41,976.00	4,609,175	1.000000000 ^S 0.009102494	41,976.00	4,611,483	0	2,308	2,308
90,747.25000		8/23/2021		90,747.25	9,964,502	1.000000000 ^S 0.009102494	90,747.25	9,969,493	0	4,991	4,991
44,661.46000		8/25/2021		44,661.46	4,899,139	1.000000000 ^S 0.009102494	44,661.46	4,906,508	0	7,369	7,369
2,765,100.00000		8/25/2021		2,765,100.00	303,317,637	1.000000000 ^S 0.009102494	2,765,100.00	303,773,889	0	456,252	456,252
50,000.00000		8/26/2021		50,000.00	5,505,000	1.000000000 ^S 0.009102494	50,000.00	5,493,000	0	-12,000	-12,000
260,000.00000		8/26/2021		260,000.00	28,626,000	1.000000000 ^S 0.009102494	260,000.00	28,563,600	0	-62,400	-62,400
842,013.92000		8/26/2021		842,013.92	92,705,734	1.000000000 ^S 0.009102494	842,013.92	92,503,650	0	-202,084	-202,084
29,700.00000		8/27/2021		29,700.00	3,268,485	1.000000000 ^S 0.009102494	29,700.00	3,262,842	0	-5,643	-5,643
-1,596,452.35000		5/11/2021		-1,596,452.35	-173,590,243	1.000000000 ^S 0.009102494	-1,596,452.35	-175,386,257	0	-1,796,014	-1,796,014

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-995,942.01000		5/12/2021		-995,942.01	-108,044,772	1.000000000 ^S 0.009102494	-995,942.01	-109,414,190	0	-1,369,418	-1,369,418
-16.88000		5/17/2021		-16.88	-1,843	1.000000000 ^S 0.009102494	-16.88	-1,854	0	-11	-11
-20,941.23000		6/10/2021		-20,941.23	-2,295,159	1.000000000 ^S 0.009102494	-20,941.23	-2,300,604	0	-5,445	-5,445
-962,339.10000		6/11/2021		-962,339.10	-105,477,181	1.000000000 ^S 0.009102494	-962,339.10	-105,722,574	0	-245,393	-245,393
-506,285.67000		6/11/2021		-506,285.67	-55,491,443	1.000000000 ^S 0.009102494	-506,285.67	-55,620,544	0	-129,101	-129,101
-428,727.11000		6/11/2021		-428,727.11	-46,990,637	1.000000000 ^S 0.009102494	-428,727.11	-47,099,961	0	-109,324	-109,324
-81,727.99000		6/11/2021		-81,727.99	-8,957,797	1.000000000 ^S 0.009102494	-81,727.99	-8,978,637	0	-20,840	-20,840
-50,528.35000		6/11/2021		-50,528.35	-5,538,160	1.000000000 ^S 0.009102494	-50,528.35	-5,551,045	0	-12,885	-12,885
-888.00000		6/11/2021		-888.00	-97,329	1.000000000 ^S 0.009102494	-888.00	-97,556	0	-227	-227
-8,971.70000		6/18/2021		-8,971.70	-988,906	1.000000000 ^S 0.009102494	-8,971.70	-985,631	0	3,275	3,275
-33,665.86000		6/21/2021		-33,665.86	-3,711,324	1.000000000 ^S 0.009102494	-33,665.86	-3,698,531	0	12,793	12,793
-100,277.81000		6/28/2021		-100,277.81	-11,108,274	1.000000000 ^S 0.009102494	-100,277.81	-11,016,520	0	91,754	91,754
-131,794.08000		7/2/2021		-131,794.08	-14,700,311	1.000000000 ^S 0.009102494	-131,794.08	-14,478,898	0	221,413	221,413
-6,524.14000		7/8/2021		-6,524.14	-721,961	1.000000000 ^S 0.009102494	-6,524.14	-716,742	0	5,219	5,219
-1,283,413.01000		7/12/2021		-1,283,413.01	-141,355,102	1.000000000 ^S 0.009102494	-1,283,413.01	-140,995,755	0	359,347	359,347

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-971,304.86000		7/12/2021		-971,304.86	-106,979,512	1.000000000 ^S 0.009102494	-971,304.86	-106,707,553	0	271,959	271,959
-854,684.84000		7/12/2021		-854,684.84	-94,134,984	1.000000000 ^S 0.009102494	-854,684.84	-93,895,677	0	239,307	239,307
-495,812.14000		7/12/2021		-495,812.14	-54,608,746	1.000000000 ^S 0.009102494	-495,812.14	-54,469,922	0	138,824	138,824
-53,232.18000		7/12/2021		-53,232.18	-5,862,992	1.000000000 ^S 0.009102494	-53,232.18	-5,848,087	0	14,905	14,905
-17,739.06000		7/12/2021		-17,739.06	-1,953,780	1.000000000 ^S 0.009102494	-17,739.06	-1,948,813	0	4,967	4,967
-7,943.88000		7/12/2021		-7,943.88	-874,939	1.000000000 ^S 0.009102494	-7,943.88	-872,715	0	2,224	2,224
-5,109.26000		7/12/2021		-5,109.26	-562,734	1.000000000 ^S 0.009102494	-5,109.26	-561,303	0	1,431	1,431
-913,282.63000		7/15/2021		-913,282.63	-100,543,286	1.000000000 ^S 0.009102494	-913,282.63	-100,333,231	0	210,055	210,055
-228,672.66000		7/15/2021		-228,672.66	-25,174,574	1.000000000 ^S 0.009102494	-228,672.66	-25,121,979	0	52,595	52,595
-19,281.00000		7/15/2021		-19,281.00	-2,122,645	1.000000000 ^S 0.009102494	-19,281.00	-2,118,211	0	4,434	4,434
-94,735.98000		7/19/2021		-94,735.98	-10,430,905	1.000000000 ^S 0.009102494	-94,735.98	-10,407,695	0	23,210	23,210
-307,339.14000		7/21/2021		-307,339.14	-33,787,329	1.000000000 ^S 0.009102494	-307,339.14	-33,764,278	0	23,051	23,051
-62,332.68000		7/27/2021		-62,332.68	-6,875,606	1.000000000 ^S 0.009102494	-62,332.68	-6,847,868	0	27,738	27,738
-36,906.87000		7/28/2021		-36,906.87	-4,052,559	1.000000000 ^S 0.009102494	-36,906.87	-4,054,589	0	-2,030	-2,030
-4,418.20000		8/2/2021		-4,418.20	-484,897	1.000000000 ^S 0.009102494	-4,418.20	-485,383	0	-486	-486

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-1,390.75000		8/4/2021		-1,390.75	-151,515	1.000000000 ^S 0.009102494	-1,390.75	-152,788	0	-1,273	-1,273
-984,414.29000		8/12/2021		-984,414.29	-108,748,251	1.000000000 ^S 0.009102494	-984,414.29	-108,147,755	0	600,496	600,496
-433,212.64000		8/12/2021		-433,212.64	-47,857,002	1.000000000 ^S 0.009102494	-433,212.64	-47,592,741	0	264,261	264,261
-200,675.92000		8/12/2021		-200,675.92	-22,168,670	1.000000000 ^S 0.009102494	-200,675.92	-22,046,257	0	122,413	122,413
-115,508.33000		8/12/2021		-115,508.33	-12,760,206	1.000000000 ^S 0.009102494	-115,508.33	-12,689,745	0	70,461	70,461
-16,158.36000		8/12/2021		-16,158.36	-1,785,014	1.000000000 ^S 0.009102494	-16,158.36	-1,775,157	0	9,857	9,857
-9,736.47000		8/12/2021		-9,736.47	-1,075,588	1.000000000 ^S 0.009102494	-9,736.47	-1,069,649	0	5,939	5,939
-195,879.67000		8/16/2021		-195,879.67	-21,520,320	1.000000000 ^S 0.009102494	-195,879.67	-21,519,341	0	979	979
-75,367.11000		8/17/2021		-75,367.11	-8,225,943	1.000000000 ^S 0.009102494	-75,367.11	-8,279,831	0	-53,888	-53,888
-232,040.04000		8/20/2021		-232,040.04	-25,460,594	1.000000000 ^S 0.009102494	-232,040.04	-25,491,919	0	-31,325	-31,325
-36,793.28000		8/25/2021		-36,793.28	-4,036,039	1.000000000 ^S 0.009102494	-36,793.28	-4,042,110	0	-6,071	-6,071
-89,762.02000		8/31/2021		-89,762.02	-9,865,295	1.000000000 ^S 0.009102494	-89,762.02	-9,861,256	0	4,039	4,039
7,030,061.79000 0.00000	合計 -----			7,030,062	776,870,622		7,030,062	772,322,593	0	-4,548,029	-4,548,029
8,393,772.79000	非グループ化の有価証券小計			8,393,773	619,893,933		8,393,773	939,551,433	0	319,657,500	319,657,500
8,393,772.79000	外貨建現金勘定合計			8,393,773	619,893,933		8,393,773	939,551,433	0	319,657,500	319,657,500

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

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

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

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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
-141,000.00000	AUD FORWARD 14 SEP FAU14SEP	8/3/2021		-141,000.00	-11,377,279	1.000000000F 80.287989808	-141,000.00	-11,320,607	0	56,672	56,672
-456,000.00000		8/17/2021		-456,000.00	-36,299,967	1.000000000F 80.287989808	-456,000.00	-36,611,323	0	-311,356	-311,356
-597,000.00000 0.00000	合計 -----			-597,000	-47,677,246		-597,000	-47,931,930	0	-254,684	-254,684
-31,634,146.41000	EUR FORWARD 14 SEP FEU14SEP	7/16/2021		-31,634,146.41	-4,118,256,986	1.000000000F 129.705673184	-31,634,146.41	-4,103,128,256	0	15,128,730	15,128,730
-28,815,646.40000		7/16/2021		-28,815,646.40	-3,751,151,912	1.000000000F 129.705673184	-28,815,646.40	-3,737,552,815	0	13,599,097	13,599,097
-26,964,238.15000		7/16/2021		-26,964,238.15	-3,510,038,577	1.000000000F 129.705673184	-26,964,238.15	-3,497,414,661	0	12,623,916	12,623,916
-26,864,238.15000		7/16/2021		-26,864,238.15	-3,497,378,578	1.000000000F 129.705673184	-26,864,238.15	-3,484,444,094	0	12,934,484	12,934,484
-2,285,000.00000		8/27/2021		-2,285,000.00	-295,934,431	1.000000000F 129.705673184	-2,285,000.00	-296,377,463	0	-443,032	-443,032
-116,563,269.11000 0.00000	合計 -----			-116,563,269	-15,172,760,484		-116,563,269	-15,118,917,289	0	53,843,195	53,843,195
-9,932,563.69	GBP FORWARD 14 SEP FGB14SEP	7/16/2021		-9,932,563.69	-1,513,162,862	1.000000000F 151.181201404	-9,932,563.69	-1,501,616,912	0	11,545,950	11,545,950
-9,867,634.54		7/16/2021		-9,867,634.54	-1,503,132,778	1.000000000F 151.181201404	-9,867,634.54	-1,491,800,845	0	11,331,933	11,331,933
-9,080,000.00		7/16/2021		-9,080,000.00	-1,382,159,108	1.000000000F 151.181201404	-9,080,000.00	-1,372,725,309	0	9,433,799	9,433,799
-515,713.70		7/16/2021		-515,713.70	-78,301,829	1.000000000F 151.181201404	-515,713.70	-77,966,217	0	335,612	335,612
-29,395,911.93000 0.00000	合計 -----			-29,395,912	-4,476,756,577		-29,395,912	-4,444,109,283	0	32,647,294	32,647,294

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
517,196.11000	USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP	7/16/2021		517,196.11	56,923,479	1.000000000F 0.009103670	517,196.11	56,811,825	0	-111,654	-111,654
635,928.20000		7/16/2021		635,928.20	70,000,001	1.000000000F 0.009103670	635,928.20	69,854,048	0	-145,953	-145,953
711,608.58000		7/16/2021		711,608.58	78,301,828	1.000000000F 0.009103670	711,608.58	78,167,220	0	-134,608	-134,608
1,176,331.58000		7/16/2021		1,176,331.58	129,472,584	1.000000000F 0.009103670	1,176,331.58	129,215,095	0	-257,489	-257,489
2,290,304.23000		7/16/2021		2,290,304.23	252,089,232	1.000000000F 0.009103670	2,290,304.23	251,580,322	0	-508,910	-508,910
12,561,089.49000		7/16/2021		12,561,089.49	1,382,159,094	1.000000000F 0.009103670	12,561,089.49	1,379,783,042	0	-2,376,052	-2,376,052
13,660,500.65000		7/16/2021		13,660,500.65	1,503,132,767	1.000000000F 0.009103670	13,660,500.65	1,500,548,751	0	-2,584,016	-2,584,016
13,751,654.29000		7/16/2021		13,751,654.29	1,513,162,855	1.000000000F 0.009103670	13,751,654.29	1,510,561,597	0	-2,601,258	-2,601,258
31,784,246.06000		7/16/2021		31,784,246.06	3,497,378,533	1.000000000F 0.009103670	31,784,246.06	3,491,366,236	0	-6,012,297	-6,012,297
31,899,300.43000		7/16/2021		31,899,300.43	3,510,038,538	1.000000000F 0.009103670	31,899,300.43	3,504,004,476	0	-6,034,062	-6,034,062
34,090,543.54000		7/16/2021		34,090,543.54	3,751,151,905	1.000000000F 0.009103670	34,090,543.54	3,744,703,349	0	-6,448,556	-6,448,556
37,426,801.50000		7/16/2021		37,426,801.50	4,118,256,947	1.000000000F 0.009103670	37,426,801.50	4,111,177,305	0	-7,079,642	-7,079,642
1,052,000.00000		7/21/2021		1,052,000.00	115,810,691	1.000000000F 0.009103670	1,052,000.00	115,557,792	0	-252,899	-252,899
68,820.41000		8/3/2021		68,820.41	7,500,000	1.000000000F 0.009103670	68,820.41	7,559,634	0	59,634	59,634

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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・グループ別 2021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)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注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											
104,125.54000		8/3/2021		104,125.54	11,377,279	1.000000000F 0.009103670	104,125.54	11,437,754	0	60,475	60,475
1,359,619.31000		8/9/2021		1,359,619.31	149,612,318	1.000000000F 0.009103670	1,359,619.31	149,348,484	0	-263,834	-263,834
332,584.65000		8/17/2021		332,584.65	36,299,967	1.000000000F 0.009103670	332,584.65	36,533,030	0	233,063	233,063
352,480.31000		8/17/2021		352,480.31	38,500,000	1.000000000F 0.009103670	352,480.31	38,718,485	0	218,485	218,485
2,689,091.05000		8/27/2021		2,689,091.05	295,934,429	1.000000000F 0.009103670	2,689,091.05	295,385,383	0	-549,046	-549,046
-1,406,000.00000		7/16/2021		-1,406,000.00	-154,779,285	1.000000000F 0.009103670	-1,406,000.00	-154,443,208	0	336,077	336,077
-1,890,000.00000		7/26/2021		-1,890,000.00	-208,354,318	1.000000000F 0.009103670	-1,890,000.00	-207,608,580	0	745,738	745,738
183,168,225.93000 0.00000	合計 -----			183,168,226	20,153,968,844		183,168,226	20,120,262,040	0	-33,706,804	-33,706,804
36,612,044.89000	非グループ化の有価証券小計			36,612,045	456,774,537		36,612,045	509,303,538	0	52,529,001	52,529,001
36,612,044.89000	先物(ポジション)合計			36,612,045	456,774,537		36,612,045	509,303,538	0	52,529,001	52,529,001
証拠金勘定											
証拠金勘定											
-50,000.00	USD MARGIN USD MAR	8/26/2021		-50,000.00	-5,505,000	1.000000000S 0.009102494	-50,000.00	-5,493,000	0	12,000	12,000
-50,000.00000	証拠金勘定小計			-50,000	-5,505,000		-50,000	-5,493,000	0	12,000	12,000
-50,000.00000	証拠金勘定合計			-50,000	-5,505,000		-50,000	-5,493,000	0	12,000	12,000
551,732,222.68000	クラスに割当てられていない資産合計			560,789,326	35,573,317,833		579,561,440	39,116,504,996	2,246,648,772	1,296,538,393	3,543,187,165
987,728,197.96000	ポートフォリオ合計			996,785,301	27,510,573,157		1,015,557,415	31,023,442,711	2,246,648,772	1,266,220,784	3,512,869,556

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計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(2021年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約209億円)

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

管理会社は、2021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	27	4,743,413,324.05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。日本文の中間財務書類には、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、2021年9月30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=111.92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。

[次へ](#)

(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)

2021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	7,246,028,529.00	810,975,513
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	5,362,012,390.00	600,116,427
040	その他の要求払預金	1,884,016,139.00	210,859,086
050	売買目的で保有される金融資産	107,280,955.27	12,006,885
060	デリバティブ	107,280,955.27	12,006,885
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	0.00	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	0.00	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	2,939.77	329
142	持分証券	2,939.77	329
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	1,466,622,700.00	164,144,413
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	1,466,622,700.00	164,144,413
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	4,109,560.00	459,942
280	有形固定資産	4,109,560.00	459,942
290	投資不動産		
300	無形資産	3,715,285.88	415,815
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,715,285.88	415,815
330	税金資産	634.46	71
340	現行税金資産	634.46	71
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	28,126,532.00	3,147,921
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	8,855,887,136.38	991,150,888

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)

2021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	43,403,070.62	4,857,672
020	デリバティブ	43,403,070.62	4,857,672
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	0.00	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	8,290,907,401.92	927,918,356
120	預金	8,287,410,580.92	927,526,992
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	3,496,821.00	391,364
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	0.00	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	6,001,713.00	671,712
250	現行税金負債	5,196,887.00	581,636
260	繰延税金負債	804,826.00	90,076
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	26,055,829.00	2,916,168
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	8,366,368,014.54	936,363,908

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)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

		米ドル	千円
010	資本	187,117,965.90	20,942,243
020	払込資本	187,117,965.90	20,942,243
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	0.00	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	0.00	0
095	損益に再分類されることがない項目	0.00	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-)損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
124	子会社、合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	0.00	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	51,012.00	5,709
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	287,051,461.95	32,126,800
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	287,051,461.95	32,126,800
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	15,298,683.00	1,712,229

米ドル

千円

		米ドル	千円
260	(-) 中間配当	0.00	0
270	少数株主持分〔非支配持分〕	0.00	0
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	489,519,122.85	54,786,980
310	資本および負債合計	8,855,887,137.00	991,150,888

(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

2021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	24,982,244.29	2,796,013
020	売買目的で保有される金融資産	14,527,723.86	1,625,943
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	2,856,428.89	319,692
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	274,086.66	30,676
085	負債に係る利息収益	7,324,004.88	819,703
090	(支払利息)	19,004,963.84	2,127,036
100	(売買目的で保有される金融負債)	84,365.71	9,442
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)	75,371.77	8,436
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	2,730.93	306
145	(資産に係る支払利息)	18,842,495.43	2,108,852
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	0.00	0
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		
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	78,830,139.63	8,822,669
210	(支払手数料)	41,110,599.86	4,601,098
220	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負 債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額	0.00	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 (-)損失、純額	8,302,578.19	929,225
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(-)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(-)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
310	為替差額〔利益または(-)損失〕、純額		
320	子会社、合併会社および関連会社への投資に係る利益または (-)損失、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
340	その他の事業収益	3,261,533.33	365,031

米ドル

千円

		米ドル	千円
350	(その他の事業費用)	1,727,802.18	193,376
355	事業収益合計、純額	53,533,129.56	5,991,428
360	(管理費用)	29,465,307.91	3,297,757
370	(従業員費用)	12,612,334.22	1,411,572
380	(その他の管理費用)	16,852,973.69	1,886,185
385	(破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金)	1,973,595.71	220,885
390	(減価償却)	1,394,486.93	156,071
400	(有形固定資産)	749,949.70	83,934
410	(投資不動産)		
420	(その他の無形資産)	644,537.23	72,137
425	修正利益または(-)損失、純額	0.00	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(-)引当金の戻入)	0.00	0
435	(破綻処理基金および預金保証制度に支払うコミットメント)		
440	(コミットメントおよび保証)		
450	(その他の引当金)		
460	(損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または(-)減損の戻入)	314,583.91	35,208
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)	314,583.91	35,208
510	(子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または(-)減損の戻入)		
520	(非金融資産に係る減損または(-)減損の戻入)	0.00	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、合併会社および関連会社への投資の利益または(-)損失の持分		
600	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される売却グループからの利益または(-)損失		
610	継続事業からの税引前利益または(-)損失	20,385,155.10	2,281,507
620	(継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入)	5,086,471.60	569,278
630	継続事業からの税引後利益または(-)損失	15,298,683.50	1,712,229
640	非継続事業からの税引後利益または(-)損失	0.00	0
650	非継続事業からの税引前利益または(-)損失		
660	(非継続事業に関する税金費用または(-)収入)		
670	当期利益または(-)損失	15,298,683.50	1,712,229
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	15,298,683.50	1,712,229

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

() 資本金の額 (2021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。

() 会社の沿革

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

() 資本金の額 (2021年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約209億円)

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、2021年9月30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=111.92円)による。

() 会社の沿革

(後略)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

(A) 日本

2021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

2021年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

5 運用状況

(2) 投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄

(2021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	The Dai-ichi Life Insurance Co Ltd	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	122.91	849,302,643	2.16
2	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年3月以降変動金利)	永久債	4,700,000	181.91	854,967,509	177.79	835,622,471	2.12
3	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	154.91	797,802,894	2.02
4	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	6,240,000	110.91	692,056,012	122.50	764,425,579	1.94
5	Standard Chartered PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	121.77	724,527,588	1.84
6	Discover Bank	米国	社債	4.682 (2023年8月以降変動金利)	2028/8/9	5,250,000	111.19	583,763,733	117.88	618,865,518	1.57
7	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	メキシコ	社債	5.375	2025/4/17	4,850,000	120.31	583,481,444	126.20	612,081,090	1.55
8	UniCredit SpA	イタリア	社債	2.000 (2024年9月以降変動金利)	2029/9/23	4,550,000	123.61	562,443,768	132.75	604,029,264	1.53
9	China Construction Bank Corp	中国	社債	2.450 (2025年6月以降変動金利)	2030/6/24	5,250,000	107.26	563,136,140	113.40	595,336,182	1.51
10	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	オーストラリア	社債	0.669 (2026年5月以降変動金利)	2031/5/5	4,500,000	126.46	569,080,991	131.11	590,005,543	1.50
11	BAWAG Group AG	オーストリア	社債	2.375 (2024年3月以降変動金利)	2029/3/26	4,000,000	126.25	504,988,434	137.59	550,363,301	1.40
12	BNP Paribas SA	フランス	社債	4.375	2025/9/28	4,350,000	114.43	497,758,656	123.09	535,427,573	1.36
13	de Volksbank NV	オランダ	社債	1.750 (2025年10月以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	126.19	479,510,696	138.18	525,095,913	1.33
14	Bank of America Corp	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	175.47	517,645,269	1.31
15	HSBC Bank USA NA	米国	社債	7.000	2039/1/15	3,000,000	137.73	413,185,215	171.82	515,456,855	1.31
16	NN Group NV	オランダ	社債	4.500 (2026年1月以降変動金利)	永久債	3,300,000	139.93	461,773,159	150.82	497,702,518	1.26
17	Prudential Financial Inc	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	4,150,000	93.99	390,045,442	119.52	496,020,082	1.26

	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	
18	Bank of Ireland Group PLC	アイルランド	社債	2.375 (2024年10月以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	123.13	443,282,716	137.42	494,725,195	1.26
19	HSBC Holdings PLC	英国	社債	6.800	2038/6/1	3,050,000	141.19	430,633,498	160.02	488,060,483	1.24
20	Hastings Group Finance PLC	ジャージー	社債	3.000	2025/5/24	2,800,000	131.62	368,529,829	162.97	456,302,795	1.16
21	Deutsche Bank AG	ドイツ	社債	1.375 (2025年9月以降変動金利)	2026/9/3	3,300,000	124.98	412,439,286	136.47	450,353,362	1.14
22	Banco Santander SA	スペイン	社債	3.125	2027/1/19	3,000,000	121.54	364,610,750	149.54	448,626,599	1.14
23	Phoenix Group Holdings PLC	英国	社債	4.375	2029/1/24	2,870,000	132.74	380,970,967	155.00	444,863,081	1.13
24	Credit Suisse Group AG	スイス	社債	2.250 (2027年6月以降変動金利)	2028/6/9	2,800,000	136.53	382,293,772	157.58	441,229,504	1.12
25	Virgin Money UK PLC	英国	社債	3.125 (2024年6月以降変動金利)	2025/6/22	2,650,000	143.99	381,572,058	161.05	426,787,163	1.08
26	Barclays PLC	英国	社債	3.811 (2041年3月以降変動金利)	2042/3/10	3,600,000	106.96	385,056,019	117.28	422,211,271	1.07
27	Chubb INA Holdings Inc	米国	社債	2.500	2038/3/15	2,600,000	130.39	339,008,298	158.56	412,244,937	1.05
28	LSEGA Financing PLC	英国	社債	3.200	2041/4/6	3,550,000	108.59	385,499,865	115.98	411,734,107	1.04
29	Morgan Stanley	米国	社債	3.217 (2041年4月以降変動金利)	2042/4/22	3,500,000	108.03	378,104,998	117.19	410,160,753	1.04
30	Assicurazioni Generali SpA	イタリア	社債	5.000 (2028年6月以降変動金利)	2048/6/8	2,550,000	148.35	378,289,811	160.09	408,240,762	1.04

投資不動産物件

該当事項なし。(2021年6月末日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2021年6月末日現在)

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

(2021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	The Dai-ichi Life Insurance Co Ltd	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	122.88	849,099,323	2.23
2	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年3月以降変動金利)	永久債	4,700,000	181.91	854,967,509	174.62	820,733,829	2.15
3	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	156.75	807,248,337	2.12
4	Standard Chartered PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	121.66	723,885,235	1.90
5	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	5,440,000	110.91	603,330,882	122.48	666,305,214	1.75
6	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	メキシコ	社債	5.375	2025/4/17	4,850,000	120.31	583,481,444	124.99	606,183,625	1.59
7	UniCredit SpA	イタリア	社債	2.000 (2024年9月以降変動金利)	2029/9/23	4,550,000	123.61	562,443,768	131.87	599,991,658	1.57
8	China Construction Bank Corp	中国	社債	2.450 (2025年6月以降変動金利)	2030/6/24	5,250,000	107.26	563,136,140	113.23	594,461,580	1.56
9	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	オーストラリア	社債	0.669 (2026年5月以降変動金利)	2031/5/5	4,500,000	126.46	569,080,991	129.17	581,283,300	1.53
10	BAWAG Group AG	オーストリア	社債	2.375 (2024年3月以降変動金利)	2029/3/26	4,000,000	126.25	504,988,434	134.88	539,501,373	1.42
11	Bank of America Corp	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	175.74	518,431,674	1.36
12	HSBC Bank USA NA	米国	社債	7.000	2039/1/15	3,000,000	137.73	413,185,215	172.18	516,544,286	1.36
13	de Volksbank NV	オランダ	社債	1.750 (2025年10月以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	126.19	479,510,696	135.80	516,034,723	1.35
14	Prudential Financial Inc	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	4,150,000	93.99	390,045,442	118.68	492,503,882	1.29
15	NN Group NV	オランダ	社債	4.500 (2026年1月以降変動金利)	永久債	3,300,000	139.93	461,773,159	148.10	488,738,060	1.28
16	HSBC Holdings PLC	英国	社債	6.800	2038/6/1	3,050,000	141.19	430,633,498	159.53	486,573,102	1.28
17	Bank of Ireland Group PLC	アイルランド	社債	2.375 (2024年10月以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	123.13	443,282,716	134.87	485,541,930	1.27
18	NatWest Group PLC	英国	社債	1.043 (2027年9月以降変動金利)	2032/9/14	3,550,000	130.53	463,380,573	128.99	457,916,093	1.20

	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	
19	Banco Santander SA	スペイン	社債	3.125	2027/1/19	3,000,000	121.54	364,610,750	146.47	439,419,437	1.15
20	Phoenix Group Holdings PLC	英国	社債	4.375	2029/1/24	2,870,000	132.74	380,970,967	153.10	439,394,081	1.15
21	Barclays PLC	英国	社債	3.811 (2041年3月 以降変動金利)	2042/3/10	3,600,000	106.96	385,056,019	119.13	428,879,145	1.13
22	Credit Suisse Group AG	スイス	社債	2.250 (2027年6月 以降変動金利)	2028/6/9	2,800,000	136.53	382,293,772	153.08	428,630,739	1.13
23	Virgin Money UK PLC	英国	社債	3.125 (2024年6月 以降変動金利)	2025/6/22	2,650,000	143.99	381,572,058	157.22	416,619,896	1.09
24	Morgan Stanley	米国	社債	3.217 (2041年4月 以降変動金利)	2042/4/22	3,500,000	108.03	378,104,998	117.33	410,651,231	1.08
25	LSEGA Financing PLC	英国	社債	3.200	2041/4/6	3,550,000	108.59	385,499,865	115.00	408,261,164	1.07
26	Chubb INA Holdings Inc	米国	社債	2.500	2038/3/15	2,600,000	130.39	339,008,298	155.24	403,628,274	1.06
27	Assicurazioni Generali SpA	イタリア	社債	5.000 (2028年6月 以降変動金利)	2048/6/8	2,550,000	148.35	378,289,811	157.55	401,758,656	1.05
28	Commonwealth Bank of Australia	オーストラリア	社債	3.610 (2029年9月 以降変動金利)	2034/9/12	3,400,000	107.05	363,970,009	118.00	401,198,283	1.05
29	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd	日本	社債	4.950 (2029年3月 以降変動金利)	永久債	3,100,000	110.90	343,774,504	127.16	394,184,988	1.03
30	JPMorgan Chase & Co	米国	社債	2.956 (2030年5月 以降変動金利)	2031/5/13	3,400,000	106.05	360,570,015	115.90	394,074,743	1.03

投資不動産物件

該当事項なし。(2021年9月末日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2021年9月末日現在)