

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年11月29日
【計算期間】	第２期中（自 平成25年３月１日 至 平成25年８月31日）
【ファンド名】	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）
【発行者名】	三菱ＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ （Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.）
【代表者の役職氏名】	デプティ・マネージング・ディレクター 服部 努
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アールン通 り 287 - 289番 （287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg）
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三浦 健 同 下瀬 伸彦
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目６番１号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三浦 健 同 下瀬 伸彦
【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
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

1【ファンドの運用状況】

東京海上ストラテジック・トラスト（Tokio Marine Strategic Trust）（以下「トラスト」という。）のサブ・ファンドである東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund）（以下「ファンド」という。）の運用状況は以下のとおりである。

（１）【投資状況】

資産別および地域別の投資状況

（平成25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	30,204,611,940	20.15
	米国	28,320,778,724	18.90
	フランス	17,040,839,478	11.37
	オランダ	10,346,069,643	6.90
	日本	9,336,795,618	6.23
	スイス	4,781,005,590	3.19
	ルクセンブルグ	4,634,117,574	3.09
	ブラジル	4,179,262,750	2.79
	アイルランド	3,987,161,405	2.66
	デンマーク	3,940,432,527	2.63
	ガーンジー	3,458,586,478	2.31
	メキシコ	3,197,558,693	2.13
	ノルウェー	2,964,547,416	1.98
	スウェーデン	2,882,208,073	1.92
	ジャージー	2,848,376,998	1.90
	ドイツ	2,311,098,724	1.54
	ケイマン諸島	1,645,074,761	1.10
	ベルギー	1,028,290,148	0.69
	ペルー	998,811,962	0.67
	オーストラリア	508,438,443	0.34
	トルコ	371,913,357	0.25
	シンガポール	293,453,590	0.20
	小計	139,279,433,892	92.93
変動利付債	オランダ	3,199,922,009	2.13
	スウェーデン	742,881,815	0.50
	オーストラリア	511,847,459	0.34
	シンガポール	245,978,056	0.16
	小計	4,700,629,339	3.14
小計		143,980,063,231	96.06
現金・その他の資産 （負債控除後）		5,902,979,580	3.94
合計（純資産総額）		149,883,042,811	100.00

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

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）およびオーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、平成25年９月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝97.75

円および1豪ドル=90.87円)による。以下、米ドルおよび豪ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

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

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

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

平成24年12月13日（ファンドの運用開始日）から平成25年９月末日までの期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
第１会計年度末 (平成25年２月末日)	163,218,366.52	15,954,595	0.010066240	0.9840
平成24年12月末日	91,822,032.37	8,975,604	0.010175141	0.9946
平成25年１月末日	126,835,353.01	12,398,156	0.009983377	0.9759
２月末日	163,218,366.52	15,954,595	0.010066240	0.9840
３月末日	216,985,329.23	21,210,316	0.010049820	0.9824
４月末日	261,443,471.80	25,556,099	0.010287619	1.0056
５月末日	304,263,963.74	29,741,802	0.010123943	0.9896
６月末日	319,536,283.00	31,234,672	0.009699364	0.9481
７月末日	336,358,226.31	32,879,017	0.009859670	0.9638
８月末日	341,989,244.91	33,429,449	0.009736981	0.9518
９月末日	352,215,054.99	34,429,022	0.009828412	0.9607

< 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
第1会計年度末 (平成25年2月末日)	60,404,015.44	5,488,913	0.010042264	0.9125
平成24年12月末日	41,505,246.51	3,771,582	0.010115151	0.9192
平成25年1月末日	52,078,563.69	4,732,379	0.009977553	0.9067
2月末日	60,404,015.44	5,488,913	0.010042264	0.9125
3月末日	71,706,208.86	6,515,943	0.010000435	0.9087
4月末日	84,556,116.20	7,683,614	0.010238274	0.9304
5月末日	89,199,708.35	8,105,577	0.010070915	0.9151
6月末日	84,174,924.54	7,648,975	0.009646722	0.8766
7月末日	88,110,972.48	8,006,644	0.009755115	0.8864
8月末日	88,965,141.97	8,084,262	0.009626765	0.8748
9月末日	91,508,876.92	8,315,412	0.009686079	0.8802

< 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～2013年9月30日）



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

【分配の推移】

平成24年12月13日（ファンドの運用開始日）から平成25年9月末日までの期間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
平成24年12月13日～平成25年9月末日	0.000360	0.03519

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
平成24年12月13日～平成25年9月末日	0.000640	0.0581568

<参考情報>

分配の推移（2013年9月末日現在）

米ドル建 米ドルヘッジクラス	
（単位：米ドル、1口当たり課税前）	
第1会計年度（2012年12月13日～2013年2月28日）	0.000045
2013年5月	0.000045
2013年6月	0.000045
2013年7月	0.000045
2013年8月	0.000045
2013年9月	0.000045
直近1年間累計	0.000360
設定来累計	0.000360

豪ドル建 豪ドルヘッジクラス	
（単位：豪ドル、1口当たり課税前）	
第1会計年度（2012年12月13日～2013年2月28日）	0.000080
2013年5月	0.000080
2013年6月	0.000080
2013年7月	0.000080
2013年8月	0.000080
2013年9月	0.000080
直近1年間累計	0.000640
設定来累計	0.000640

【収益率の推移】

平成24年12月13日（ファンドの運用開始日）から平成25年9月末日までの期間の収益率は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成24年12月13日～平成25年9月末日	1.88%

（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 = 当初募集価格（0.01米ドル）

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率（注）
平成24年12月13日～平成25年9月末日	3.26%

（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 = 当初募集価格（0.01豪ドル）

<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、2013年については2013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。2013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】

平成24年12月13日（ファンドの運用開始日）から平成25年9月末日までの期間における販売および買戻しの実績ならびに平成25年9月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	販売口数	買戻口数	発行済口数
平成24年12月13日～ 平成25年9月末日	40,831,511,454 (40,831,511,454)	4,995,094,765 (4,995,094,765)	35,836,416,689 (35,836,416,689)

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	販売口数	買戻口数	発行済口数
平成24年12月13日～ 平成25年9月末日	12,602,965,986 (12,602,965,986)	3,155,502,330 (3,155,502,330)	9,447,463,656 (9,447,463,656)

（注1）（ ）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。

（注2）販売口数は、当初募集期間に販売された販売口数を含む。

3【ファンドの経理状況】

- a．ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．ファンドの原文の中間財務書類は日本円で表示されている。
- d．ファンドの評価日は、償還日までの期間におけるすべての営業日、または管理会社がファンドに関して随時定めるその他の日であり、営業日とは、(1) ロンドン、ルクセンブルグ、ニューヨークおよび東京において銀行が営業している日であつ(2) ニューヨーク証券取引所が取引を行っている日、または管理会社が随時定めるその他の日をいう。平成25年8月におけるファンドの最終評価日は、平成25年8月30日であった。そのため、第2期の中間財務書類は平成25年8月30日付で作成されている。

（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

2013年 8 月30日現在

円

資産	
現金	3,436,510,541
銀行預金 - 基準通貨	603,695,698
銀行預金 - 外国通貨	2,832,814,843
有価証券（取得原価）	125,194,699,119
債券（取得原価）	125,194,699,119
未実現評価損益	14,446,189,059
未実現時価評価損益	1,053,429,253
未実現通貨運用損益	13,364,339,542
未決済取引にかかる未実現為替差損益	2,248,940
未実現通貨繰延損益	26,171,324
未収収益	2,793,712,917
現金に係る未収利息	400,102
債券に係る未収利息	2,793,312,815
投資売却未収金	497,908,820
投資売却未収金	497,908,820
資本証券	692,743,219
受益証券販売未収金	692,743,219
前払費用	6,219,945
設立費用	6,219,945
資産合計：	147,067,983,620
負債	
資本証券	631,550,186
受益証券買戻未払金	631,550,186

2013年8月30日現在

	円
未払費用	235,161,059
未払監査費用	4,900,387
未払報告書作成費用	1,636,485
未払投資顧問報酬	146,005,705
未払受託報酬	2,459,525
未払管理報酬	36,864,968
未払代行協会員報酬	3,366,561
未払販売報酬	39,927,428
負債合計：	866,711,245
資本	
ファンド受益証券	148,534,763,470
発行済ファンド受益証券（額面価額）	71,784,205,600,200
米ドル建 米ドルヘッジ	41,114,188,926,963
ブラジル・レアルヘッジ	14,356,903,264
米ドルヘッジ	10,436,978,538
豪ドルヘッジ	3,974,156,840
ユーロヘッジ	47,410,644
日本円ヘッジ	70,435,887,333
資源国通貨バスケットヘッジ	520,200,712
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,570,245,135,906
受益証券額面超過額	(71,635,670,836,730)
米ドル建 米ドルヘッジ	(41,081,375,090,916)
ブラジル・レアルヘッジ	45,007,736
米ドルヘッジ	3,641,130,462
豪ドルヘッジ	(1,224,108,840)
ユーロヘッジ	10,111,356
日本円ヘッジ	4,796,128,667
資源国通貨バスケットヘッジ	38,750,288
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,602,765,483)

2013年 8 月30日現在

	円
分配金支払額	(12,796,035,935)
分配金支払額	(12,796,035,935)
米ドル建 米ドルヘッジ	(779,595,805)
ブラジル・リアルヘッジ	(4,875,100,081)
米ドルヘッジ	(352,691,599)
豪ドルヘッジ	(1,752,562,742)
ユーロヘッジ	(2,564,137)
日本円ヘッジ	(4,461,647,752)
資源国通貨バスケットヘッジ	(159,056,122)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(412,817,697)
利益剰余金	12,441,909,286
利益剰余金	12,441,909,286
米ドル建 米ドルヘッジ	915,524,968
ブラジル・リアルヘッジ	4,444,944,031
米ドル建 米ドルヘッジ	266,350,499
豪ドルヘッジ	3,519,582,639
ユーロヘッジ	3,846,092
日本円ヘッジ	2,796,081,398
資源国通貨バスケットヘッジ	172,126,716
豪ドル建 豪ドルヘッジ	323,452,943
当期純損失	(1,979,364,446)
資本合計：	146,201,272,375
負債および資本合計	147,067,983,620
純資産額合計	146,201,272,375
発行済受益証券総数	44,374,134,275.73310口
受益証券 1 口当たり純資産額合計	3.294741

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

2013年3月1日から
2013年8月30日までの期間

円

収益

実現損益

(6,648,072,241)

為替取引に係る実現利益

26,610,534,460

ブラジル・レアルヘッジ

5,882,778,855

豪ドルヘッジ

1,647,972,912

ユーロヘッジ

11,229,204

日本円ヘッジ

6,718,717,841

資源国通貨バスケットヘッジ

179,784,182

豪ドル建 豪ドルヘッジ

1,319,391,249

為替取引に係る実現損失

(34,941,415,167)

ブラジル・レアルヘッジ

(8,055,559,183)

豪ドルヘッジ

(2,316,880,078)

ユーロヘッジ

(11,220,923)

日本円ヘッジ

(12,172,090,639)

資源国通貨バスケットヘッジ

(252,805,169)

豪ドル建 豪ドルヘッジ

(2,314,259,862)

市場に係る実現利益

359,062,972

市場に係る実現損失

(197,741,383)

通貨に係る実現利益

3,122,561,220

米ドル建 米ドルヘッジ

54,991,856

ブラジル・レアルヘッジ

5

豪ドルヘッジ

3

ユーロヘッジ

2

日本円ヘッジ

2

資源国通貨バスケットヘッジ

10

豪ドル建 豪ドルヘッジ

16,991,025

2013年3月1日から
2013年8月30日までの期間

円

通貨に係る実現損失	(1,601,074,346)
米ドル建 米ドルヘッジ	(57,899,981)
ブラジル・レアルヘッジ	(6)
豪ドルヘッジ	(2)
ユーロヘッジ	(2)
日本円ヘッジ	(4)
資源国通貨バスケットヘッジ	(16)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(18,368,756)
その他の収益	3
受取利息	3,775,243,389
現金に係る受取利息	4,799,958
債券に係る受取利息	3,770,443,431
未実現評価損益	1,534,900,693
未実現時価評価損益	(3,832,078,701)
未実現通貨運用損益	5,468,848,681
ブラジル・レアルヘッジ	(579,978,890)
豪ドルヘッジ	549,958
ユーロヘッジ	389,039
日本円ヘッジ	1,835,453,585
資源国通貨バスケットヘッジ	(8,678,074)
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(102,182,499)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(4,300,702)
米ドル建 米ドルヘッジ	1,314,554
豪ドル建 豪ドルヘッジ	694,243
未実現通貨繰延損益	(97,568,585)
収益合計：	(1,337,928,159)

2013年3月1日から
2013年8月30日までの期間

円

費用	
費用 - 報酬	639,090,179
監査費用	1,286,973
報告書作成費用	437,915
投資顧問報酬	406,846,546
米ドル建 米ドルヘッジ	109,358,017
ブラジル・レアルヘッジ	44,190,752
米ドルヘッジ	24,265,900
豪ドルヘッジ	15,372,298
ユーロヘッジ	124,560
日本円ヘッジ	177,265,350
資源国通貨バスケットヘッジ	1,538,238
豪ドル建 豪ドルヘッジ	46,249,922
受託報酬	7,493,950
設立費用償却	2,445,530
米ドル建 米ドルヘッジ	950,319
豪ドル建 豪ドルヘッジ	950,319
未払管理報酬	103,081,013
代行協会員報酬	8,940,950
米ドル建 米ドルヘッジ	6,860,605
豪ドル建 豪ドルヘッジ	2,440,122
販売報酬	106,039,668
米ドル建 米ドルヘッジ	81,366,751
豪ドル建 豪ドルヘッジ	28,939,889
副保管報酬	2,517,634
源泉徴収税	2,346,108
源泉徴収税	2,346,108
費用合計：	641,436,287
投資純損失	(1,979,364,446)

（２）【投資有価証券明細表等】

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	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）											
120,336.94000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/16/2013	AUD	120,336.94	10,803,110	1.000000000F 87.119844934	120,336.94	10,483,736	0	-319,374	-319,374
14,918,963.34000		8/2/2013	AUD	14,918,963.34	1,312,937,261	1.000000000F 87.119844934	14,918,963.34	1,299,737,773	0	-13,199,488	-13,199,488
649,379.78000		8/7/2013	AUD	649,379.78	56,376,208	1.000000000F 87.119844934	649,379.78	56,573,866	0	197,658	197,658
484,595.99000		8/12/2013	AUD	484,595.99	42,936,759	1.000000000F 87.119844934	484,595.99	42,217,928	0	-718,831	-718,831
399,473.22000		8/9/2013	AUD	399,473.22	35,382,884	1.000000000F 87.119844934	399,473.22	34,802,045	0	-580,839	-580,839
16,572,749.27000	合計			16,572,749	1,458,436,222		16,572,749	1,443,815,348	0	-14,620,874	-14,620,874
0.00000											
802,159.58000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	7/12/2013	AUD	802,159.58	72,845,158	1.000000000F 87.312666309	802,159.58	70,038,692	0	-2,806,466	-2,806,466
67,124,531.02000		7/2/2013	AUD	67,124,531.02	6,175,869,874	1.000000000F 87.312666309	67,124,531.02	5,860,821,778	0	-	-
										315,048,096	315,048,096
1,092,812.49000		7/19/2013	AUD	1,092,812.49	100,930,346	1.000000000F 87.312666309	1,092,812.49	95,416,372	0	-5,513,974	-5,513,974
3,103,797.52000		7/22/2013	AUD	3,103,797.52	285,430,689	1.000000000F 87.312666309	3,103,797.52	271,000,837	0	-14,429,852	-14,429,852
438,775.57000		7/24/2013	AUD	438,775.57	40,458,120	1.000000000F 87.312666309	438,775.57	38,310,665	0	-2,147,455	-2,147,455
-126,000.00000		8/23/2013	AUD	-126,000.00	-11,142,921	1.000000000F 87.312666309	-126,000.00	-11,001,396	0	141,525	141,525
72,436,076.18000	合計			72,436,076	6,664,391,266		72,436,076	6,324,586,948	0	-	-
0.00000											
-442,000.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/12/2013	AUD	-442,000.00	-42,936,759	1.000000000F 0.010194270	-442,000.00	-43,357,690	0	-420,931	-420,931
-110,000.00000		8/16/2013	AUD	-110,000.00	-10,803,111	1.000000000F 0.010194270	-110,000.00	-10,790,375	0	12,736	12,736
-		8/2/2013	AUD	-	-	1.000000000F	-	-	0	16,640,428	16,640,428
13,214,800.00000				13,214,800.00	1,312,937,269	0.010194270	13,214,800.00	1,296,296,841			
-364,000.00000		8/9/2013	AUD	-364,000.00	-35,382,884	1.000000000F 0.010194270	-364,000.00	-35,706,333	0	-323,449	-323,449

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	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）											
-579,000.00000		8/7/2013		-579,000.00	-56,376,208	1.000000000F	-579,000.00	-56,796,612	0	-420,404	-420,404
	FUS11OCT		AUD			0.010194270					
-	合計			-14,709,800	1,458,436,231	-	-14,709,800	1,442,947,851	0	15,488,380	15,488,380
14,709,800.00000											
0.00000											
-	USD	7/2/2013		-	-	1.000000000F	-	-	0	146,418,738	146,418,738
61,456,200.00000	FORWARD		AUD	61,456,200.00	6,175,869,905	0.010192669	61,456,200.00	6,029,451,167			
	11 SEP										
	FUS11SEP										
-403,000.00000		7/24/2013		-403,000.00	-40,458,120	1.000000000F	-403,000.00	-39,538,221	0	919,899	919,899
			AUD			0.010192669					
-999,000.00000		7/19/2013		-999,000.00	-100,930,345	1.000000000F	-999,000.00	-98,011,620	0	2,918,725	2,918,725
			AUD			0.010192669					
-731,000.00000		7/12/2013		-731,000.00	-72,845,158	1.000000000F	-731,000.00	-71,718,212	0	1,126,946	1,126,946
			AUD			0.010192669					
-2,850,000.00000		7/22/2013		-2,850,000.00	-285,430,689	1.000000000F	-2,850,000.00	-279,612,730	0	5,817,959	5,817,959
			AUD			0.010192669					
113,160.60000		8/23/2013		113,160.60	11,142,921	1.000000000F	113,160.60	11,102,156	0	-40,765	-40,765
			AUD			0.010192669					
-	合計			-66,326,039	-	-	-66,326,039	-	0	157,161,502	157,161,502
66,326,039.40000					6,664,391,296			6,507,229,794			
0.00000											
7,972,986.05000	先物（ポ			7,972,986	-39		7,972,986	-181,775,349	0	-	-
	ジショ									181,775,310	181,775,310
	ン）合計										
7,972,986.05000	豪ドル建 豪ドル			7,972,986	-39		7,972,986	-181,775,349	0	-	-
	ヘッジクラス受益									181,775,310	181,775,310
	証券合計										

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
豪ドルヘッジクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
452,718.21000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/6/2013	AUH	452,718.21	39,673,789	1.000000000F 87.119844934	452,718.21	39,440,740	0	-233,049	-233,049
461,158.29000		8/22/2013	AUH	461,158.29	41,027,589	1.000000000F 87.119844934	461,158.29	40,176,039	0	-851,550	-851,550
577,688.16000		8/2/2013	AUH	577,688.16	50,839,210	1.000000000F 87.119844934	577,688.16	50,328,103	0	-511,107	-511,107
1,491,564.66000 0.00000	合計			1,491,565	131,540,588		1,491,565	129,944,882	0	-1,595,706	-1,595,706
49,091,534.64000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	7/2/2013	AUH	49,091,534.64	4,516,723,249	1.000000000F 87.312666309	49,091,534.64	4,286,312,783	0	-	-
										230,410,466	230,410,466
543,613.62000		7/26/2013	AUH	543,613.62	49,255,943	1.000000000F 87.312666309	543,613.62	47,464,355	0	-1,791,588	-1,791,588
451,724.25000		7/30/2013	AUH	451,724.25	40,141,268	1.000000000F 87.312666309	451,724.25	9,441,249	0	-700,019	-700,019
326,631.93000		7/24/2013	AUH	326,631.93	30,117,706	1.000000000F 87.312666309	326,631.93	28,519,105	0	-1,598,601	-1,598,601
-563,000.00000		8/23/2013	AUH	-563,000.00	-49,789,402	1.000000000F 87.312666309	-563,000.00	-49,157,031	0	632,371	632,371
-667,000.00000		8/16/2013	AUH	-667,000.00	-59,607,114	1.000000000F 87.312666309	-667,000.00	-58,237,548	0	1,369,566	1,369,566
49,183,504.44000 0.0000	合計			49,183,504	4,526,841,650		49,183,504	4,294,342,913	0	-	-
										232,498,737	232,498,737
-404,300.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/6/2013	AUH	-404,300.00	-39,673,789	1.000000000F 0.010194270	-404,300.00	-39,659,534	0	14,255	14,255
-414,300.00000		8/22/2013	AUH	-414,300.00	-41,027,590	1.000000000F 0.010194270	-414,300.00	-40,640,477	0	387,113	387,113
-511,700.00000		8/2/2013	AUH	-511,700.00	-50,839,210	1.000000000F 0.010194270	-511,700.00	-50,194,864	0	644,346	644,346
-1,330,300.00000 0.00000	合計			-1,330,300	-131,540,589		-1,330,300	-130,494,875	0	1,045,714	1,045,714
-408,300.00000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	7/30/2013	AUH	-408,300.00	-40,141,268	1.000000000F 0.010192669	-408,300.00	-40,058,203	0	83,065	83,065
-300,000.00000		7/24/2013	AUH	-300,000.00	-30,117,706	1.000000000F 0.010192669	-300,000.00	-29,432,919	0	684,787	684,787

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラ ス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
豪ドルヘッジクラス受益証券											
先物（ポジション）											
-502,000.00000		7/26/2013		-502,000.00	-49,255,943	1.000000000F	-502,000.00	-49,251,084	0	4,859	4,859
	FUS11SEP		AUH			0.010192669					
-		7/2/2013		-	-	1.000000000F	-	-	0	107,083,363	107,083,363
44,946,000.00000			AUH	44,946,000.00	4,516,723,272	0.010192669	44,946,000.00	4,409,639,909			
610,885.29000		8/16/2013		610,885.29	59,607,113	1.000000000F	610,885.29	59,933,791	0	326,678	326,678
			AUH			0.010192669					
505,630.30000		8/23/2013		505,630.30	49,789,402	1.000000000F	505,630.30	49,607,252	0	-182,150	-182,150
			AUH			0.010192669					
-	合計			-45,039,784	-		-45,039,784	-	0	108,000,602	108,000,602
					4,526,841,674			4,418,841,072			
45,039,784.41000											
0.00000											
4,304,984.69000	先物 (ポジ ション)合 計			4,304,985	-25		4,304,985	-125,048,152	0	-	-
									125,048,127	125,048,127	
4,304,984.69000	豪ドルヘッジクラ ス受益証券合計			4,304,985	-25		4,304,985	-125,048,152	0	-	-
									125,048,127	125,048,127	

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
資源国通貨バスケットヘッジ ラス受益証券											
先物 (ポジション)											
-17,000.00000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/12/2013	BKH	-17,000.00	-1,497,308	1.000000000F 87.119844934	-17,000.00	-1,481,037	0	16,271	16,271
-69,000.00000		8/7/2013	BKH	-69,000.00	-5,942,084	1.000000000F 87.119844934	-69,000.00	-6,011,269	0	-69,185	-69,185
-40,000.00000		8/27/2013	BKH	-40,000.00	-3,475,894	1.000000000F 87.119844934	-40,000.00	-3,484,794	0	-8,900	-8,900
2,079,767.71000		8/2/2013	BKH	2,079,767.71	183,029,106	1.000000000F 87.119844934	2,079,767.71	181,189,040	0	-1,840,066	-1,840,066
42,318.63000		7/26/2013	BKH	42,318.63	3,834,422	1.000000000F 87.119844934	42,318.63	3,686,792	0	-147,630	-147,630
22,393.41000		8/1/2013	BKH	22,393.41	1,983,455	1.000000000F 87.119844934	22,393.41	1,950,910	0	-32,545	-32,545
16,409.58000		8/16/2013	BKH	16,409.58	1,473,151	1.000000000F 87.119844934	16,409.58	1,429,600	0	-43,551	-43,551
2,034,889.33000	合計			2,034,889	179,404,848		2,034,889	177,279,242	0	-2,125,606	-2,125,606
0.00000											
4,278,509.50000	BRL FORWARD 11 OCT FBR11OCT	8/2/2013	BKH	4,278,509.50	184,660,164	1.000000000F 0.024465761	4,278,509.50	174,877,434	0	-9,782,730	-9,782,730
35,784.00000		8/16/2013	BKH	35,784.00	1,480,912	1.000000000F 0.024465761	35,784.00	1,462,615	0	-18,297	-18,297
89,169.60000		7/26/2013	BKH	89,169.60	3,884,580	1.000000000F 0.024465761	89,169.60	3,644,669	0	-239,911	-239,911
46,540.00000		8/1/2013	BKH	46,540.00	2,013,791	1.000000000F 0.024465761	46,540.00	1,902,250	0	-111,541	-111,541
-36,000.00000		8/12/2013	BKH	-36,000.00	-1,509,745	1.000000000F 0.024465761	-36,000.00	-1,471,444	0	38,301	38,301
-142,000.00000		8/7/2013	BKH	-142,000.00	-5,879,486	1.000000000F 0.024465761	-142,000.00	-5,804,030	0	75,456	75,456
-85,000.00000		8/27/2013	BKH	-85,000.00	-3,407,747	1.000000000F 0.024465761	-85,000.00	-3,474,243	0	-66,496	-66,496
4,187,003.10000	合計			4,187,003	181,242,469		4,187,003	171,137,251	0	-	-
0.00000									10,105,218	10,105,218	
61,430.72000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/7/2013	BKH	61,430.72	5,933,289	1.000000000F 0.010194270	61,430.72	6,026,005	0	92,716	92,716

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注 1）	取得原価 （基準通貨） （注 2） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注 1）	価額 （基準通貨） （注 2） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
資源国通貨バスケットヘッジク ラス受益証券											
先物（ポジション）											
35,057.33000	FUS110CT	8/27/2013	BKH	35,057.33	3,407,747	1.000000000F 0.010194270	35,057.33	3,438,925	0	31,178	31,178
35,646.71000		8/27/2013		35,646.71	3,465,037	1.000000000F 0.010194270	35,646.71	3,496,740	0	31,703	31,703
35,758.40000	BKH	8/27/2013	BKH	35,758.40	3,475,894	1.000000000F 0.010194270	35,758.40	3,507,696	0	31,802	31,802
60,873.67000		8/7/2013		60,873.67	5,879,486	1.000000000F 0.010194270	60,873.67	5,971,361	0	91,875	91,875
15,685.49000	BKH	8/12/2013	BKH	15,685.49	1,514,669	1.000000000F 0.010194270	15,685.49	1,538,658	0	23,989	23,989
61,521.78000		8/7/2013		61,521.78	5,942,084	1.000000000F 0.010194270	61,521.78	6,034,937	0	92,853	92,853
15,634.50000	BKH	8/12/2013	BKH	15,634.50	1,509,745	1.000000000F 0.010194270	15,634.50	1,533,656	0	23,911	23,911
15,505.70000		8/12/2013		15,505.70	1,497,308	1.000000000F 0.010194270	15,505.70	1,521,021	0	23,713	23,713
-15,000.00000	BKH	8/16/2013	BKH	-15,000.00	-1,473,151	1.000000000F 0.010194270	-15,000.00	-1,471,415	0	1,736	1,736
-39,000.00000		7/26/2013		-39,000.00	-3,834,422	1.000000000F 0.010194270	-39,000.00	-3,825,679	0	8,743	8,743
-39,000.00000	BKH	7/26/2013	BKH	-39,000.00	-3,884,580	1.000000000F 0.010194270	-39,000.00	-3,825,679	0	58,901	58,901
-15,000.00000		8/16/2013		-15,000.00	-1,480,912	1.000000000F 0.010194270	-15,000.00	-1,471,415	0	9,497	9,497
-15,000.00000	BKH	8/16/2013	BKH	-15,000.00	-1,469,841	1.000000000F 0.010194270	-15,000.00	-1,471,415	0	-1,574	-1,574
-		8/2/2013		-	-	1.000000000F 0.010194270	-	-	0	2,319,747	2,319,747
1,842,200.00000	BKH	7/26/2013	BKH	1,842,200.00	183,029,106	1.000000000F 0.010194270	1,842,200.00	180,709,359	0	6,598	6,598
-39,000.00000		8/1/2013		-39,000.00	-1,990,210	1.000000000F 0.010194270	-20,000.00	-1,961,886	0	28,324	28,324
-20,000.00000	BKH	8/1/2013	BKH	-20,000.00	-1,983,455	1.000000000F 0.010194270	-20,000.00	-1,961,886	0	21,569	21,569
-20,000.00000		8/1/2013		-20,000.00	-2,013,791	1.000000000F 0.010194270	-20,000.00	-1,961,886	0	51,905	51,905

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
資源国通貨バスケットヘッジ クラス受益証券											
先物（ポジション）											
-1,842,200.00000		8/2/2013		-1,842,200.00	-	1.000000000F	-1,842,200.00	-	0	5,700,759	5,700,759
			BKH		186,410,118	0.010194270		180,709,359			
-1,842,200.00000		8/2/2013		-1,842,200.00	-	1.000000000F	-1,842,200.00	-	0	3,950,804	3,950,804
			BKH		184,660,163	0.010194270		180,709,359			
-5,411,485.70000	合計			-5,411,486	-		-5,411,486	-	0	12,600,749	12,600,749
					543,436,767			530,836,018			
0.00000											
-156,000.00000	ZAR FORWARD 11 OCT FZA11OCT	8/12/2013		-156,000.00	-1,514,669	1.000000000F 0.105094279	-156,000.00	-1,484,381	0	30,288	30,288
			BKH								
-614,000.00000		8/7/2013		-614,000.00	-5,933,289	1.000000000F	-614,000.00	-5,842,373	0	90,916	90,916
			BKH			0.105094279					
-373,000.00000		8/27/2013		-373,000.00	-3,465,037	1.000000000F	-373,000.00	-3,549,194	0	-84,157	-84,157
			BKH			0.105094279					
18,617,365.31000		8/2/2013		18,617,365.31	186,410,116	1.000000000F	18,617,365.31	177,149,180	0	-9,260,936	-9,260,936
			BKH			0.105094279					
150,727.50000		8/16/2013		150,727.50	1,469,841	1.000000000F	150,727.50	1,434,212	0	-35,629	-35,629
			BKH			0.105094279					
383,030.70000		7/26/2013		383,030.70	3,832,277	1.000000000F	383,030.70	3,644,639	0	-187,638	-187,638
			BKH			0.105094279					
199,864.00000		8/1/2013		199,864.00	1,990,210	1.000000000F	199,864.00	1,901,759	0	-88,451	-88,451
			BKH			0.105094279					
18,207,987.51000	合計			18,207,988	182,789,449		18,207,988	173,253,842	0	-9,535,607	-9,535,607
0.00000											
19,018,394.24000	先物（ポジション）			19,018,394	-1		19,018,394	-9,165,683	0	-9,165,682	-9,165,682
	合計										
19,018,394.24000	資源国通貨バスケット ヘッジクラス受益証券 合計			19,018,394	-1		19,018,394	-9,165,683	0	-9,165,682	-9,165,682

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
ブラジル・リアルヘッジクラス受益証券											
先物（ポジション）											
32,113,892.20000	BRL FORWARD 11 OCT FBR11OCT	8/2/2013	BRH	32,113,892.20	1,386,033,289	1.000000000F 0.024465761	32,113,892.20	1,312,605,490	0	-73,427,799	-73,427,799
286,392,120.00000		8/2/2013	BRH	286,392,120.00	12,360,663,404	1.000000000F 0.024465761	286,392,120.00	11,705,833,307	0	-	-
-2,436,000.00000		8/23/2013	BRH	-2,436,000.00	-99,583,957	1.000000000F 0.024465761	-2,436,000.00	-99,567,718	0	654,830,097	654,830,097
-1,716,000.00000		8/19/2013	BRH	-1,716,000.00	-69,287,049	1.000000000F 0.024465761	-1,716,000.00	-70,138,836	0	16,239	16,239
-3,582,000.00000		8/16/2013	BRH	-3,582,000.00	-146,509,700	1.000000000F 0.024465761	-3,582,000.00	-146,408,689	0	-851,787	-851,787
-3,417,000.00000		8/28/2013	BRH	-3,417,000.00	-140,586,592	1.000000000F 0.024465761	-3,417,000.00	-139,664,570	0	101,011	101,011
307,355,012.20000	合計			307,355,012	13,290,729,395		307,355,012	12,562,658,984	0	922,022	922,022
0.00000										-	-
1,011,312.92000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/23/2013	BRH	1,011,312.92	99,583,956	1.000000000F 0.010194270	1,011,312.92	99,204,055	0	728,070,411	728,070,411
707,191.43000		8/19/2013	BRH	707,191.43	69,287,049	1.000000000F 0.010194270	707,191.43	69,371,464	0	-379,901	-379,901
1,501,509.05000		8/16/2013	BRH	1,501,509.05	146,509,699	1.000000000F 0.010194270	1,501,509.05	147,289,512	0	84,415	84,415
1,438,888.30000		8/28/2013	BRH	1,438,888.30	140,586,592	1.000000000F 0.010194270	1,438,888.30	141,146,772	0	779,813	779,813
-		8/2/2013	BRH	-	-	1.000000000F	-	-	0	560,180	560,180
123,312,000.00000		8/2/2013	BRH	123,312,000.00	12,360,663,372	0.010194270	123,312,000.00	12,096,206,987	0	264,456,385	264,456,385
-13,841,300.00000		8/2/2013	BRH	-13,841,300.00	-1,386,033,287	1.000000000F 0.010194270	-13,841,300.00	-1,357,752,934	0	28,280,353	28,280,353
-	合計			-132,494,398	-		-132,494,398	-	0	293,781,245	293,781,245
132,494,398.30000					13,290,729,363			12,996,948,118			
0.00000											
174,860,613.90000	先物（ポジション）合計			174,860,614	32		174,860,614	-434,289,134	0	-	-
										434,289,166	434,289,166
174,860,613.90000	ブラジル・リアルヘッジクラス受益証券合計			174,860,614	32		174,860,614	-434,289,134	0	-	-
										434,289,166	434,289,166

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益		
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通 貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)	
ユーロヘッジクラス受益証券												
先物（ポジション）												
-21,000.00000	EUR FORWARD 11 OCT FEU11OCT	8/13/2013	EUH	-21,000.00	-2,741,885	1.000000000F 129.367093488	-21,000.00	-2,716,709	0	25,176	25,176	
446,258.39000		8/2/2013	EUH	446,258.39	58,544,462	1.000000000F 129.367093488	446,258.39	57,731,151	0	-813,311	-813,311	
42,531.88000		8/27/2013	EUH	42,531.88	5,537,288	1.000000000F 129.367093488	42,531.88	5,502,226	0	-35,062	-35,062	
467,790.27000 合計 0.00000				467,790	61,339,865		467,790	60,516,668	0	-823,197	-823,197	
27,922.86000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/13/2013	EUH	27,922.86	2,741,885	1.000000000F 0.010194270	27,922.86	2,739,074	0	-2,811	-2,811	
-56,900.00000		8/27/2013	EUH	-56,900.00	-5,537,288	1.000000000F 0.010194270	-56,900.00	-5,581,567	0	-44,279	-44,279	
-590,000.00000		8/2/2013	EUH	-590,000.00	-58,544,463	1.000000000F 0.010194270	-590,000.00	-57,875,650	0	668,813	668,813	
-618,977.14000 合計 0.00000				-618,977	-61,339,866		-618,977	-60,718,143	0	621,723	621,723	
-151,186.87000	先物（ポジション）合 計			-151,187	-1		-151,187	-201,475	0	-201,474	-201,474	
-151,186.87000	ユーロヘッジクラス受 益証券合計			-151,187	-1		-151,187	-201,475	0	-201,474	-201,474	

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

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

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

保有有価証券残高明細

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

クラス・カテゴリー別 2013年 8月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
日本円ヘッジクラス受益証券											
先物（ポジション）											
- USD 422,201,900.00000	FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/2/2013	JPH	-	- 1.000000000F	0.010194270	-	-	0	642,983,511	642,983,511
-2,041,000.00000		8/20/2013	JPH	-2,041,000.00	-198,149,465	1.000000000F 0.010194270	-2,041,000.00	-200,210,510	0	-2,061,045	-2,061,045
- 合計 424,242,900.00000 0.00000				-424,242,900	-		-424,242,900	-	0	640,922,466	640,922,466
					42,256,741,941			41,615,819,475			
- USD 311,594,400.00000	FORWARD 11 SEP FUS11SEP	7/2/2013	JPH	-	- 1.000000000F	0.010192669	-	-	0	473,614,348	473,614,348
-6,403,000.00000		7/24/2013	JPH	-6,403,000.00	-639,890,214	1.000000000F 0.010192669	-6,403,000.00	-628,196,599	0	11,693,615	11,693,615
2,545,612.48000		8/29/2013	JPH	2,545,612.48	249,971,001	1.000000000F 0.010192669	2,545,612.48	249,749,352	0	-221,649	-221,649
- 合計 315,451,787.52000 0.00000				-315,451,788	-		-315,451,788	-	0	485,086,314	485,086,314
					31,433,975,905			30,948,889,591			
- 先物（ポジショ ン）合計 739,694,687.52000				-739,694,688	-		-739,694,688	-	0	1,126,008,780	1,126,008,780
					73,690,717,846			72,564,709,066			
- 日本円ヘッジクラ ス受益証券合計 739,694,687.52000				-739,694,688	-		-739,694,688	-	0	1,126,008,780	1,126,008,780
					73,690,717,846			72,564,709,066			

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

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

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
現金											
603,695,698.00000	JPY CASH CASHJPY	8/30/2013		603,695,698	603,695,698	1.0000000000 1.0000000000	603,695,698	603,695,698	0	0	0
603,695,698.00000	現金合計			603,695,698	603,695,698		603,695,698	603,695,698	0	0	0
社債											
13,240,000.00000	ABN AMRO BANK NV 6.375 % 04272021 BNLD1156 XS0619548216	11/10/2011		13,342,266.10	1,420,776,255	110.727996800C 129.374440941	14,660,386.78	1,896,679,343	170,531,126	305,371,963	475,903,088
8,190,000.00000	ABN AMRO BANK NV 7.125 % 07062022 BNLD1201 XS0802995166	8/13/2012		8,944,754.23	963,822,564	114.983001700C 129.374440941	9,417,107.84	1,218,333,062	61,110,484	193,400,014	254,510,498
12,100,000.00000	ALLIANZ FINANCE FRN 07082041 BNLD1158 DE000A1GNAH1	11/9/2011		12,026,838.00	1,294,189,955	109.932998600C 129.374440941	13,301,892.83	1,720,924,948	164,959,506	261,775,488	426,734,993
16,820,000.00000	AMERICAN EXPRESS FRN 09012066 BUSA7950 US025816AU39	11/9/2011		17,258,467.60	1,399,095,402	106.828002900C 0.010192121	17,968,470.09	1,762,976,527	69,661,897	294,219,228	363,881,125
4,700,000.00	AMLIN PLC FRN 12192026 BGBR2174 XS0251382361	11/10/2011		3,943,830.60	492,892,679	101.958999600C 151.774110342	4,792,072.98	727,312,613	128,741,233	105,678,702	234,419,934
5,600,000.00	AVIVA PLC FRN 05202058 GBR2176 XS0364880186	1/23/2013		6,038,872.00	847,016,158	102.679000800C 151.774110342	5,750,024.04	872,704,784	-43,839,641	69,528,267	25,688,626
10,850,000.00000	AXA SA FRN 04162040 BFRA1005 XS0503665290	11/9/2011		9,463,199.40	1,021,544,289	104.096000600C 129.374440941	11,294,416.07	1,461,208,764	236,912,632	202,751,843	439,664,475
19,300,000.00000	AXA SA 5.5 % 07292049 BFRA1051 XS0876682666	1/16/2013		19,188,150.00	1,713,867,072	94.410003600C 0.010192121	18,221,130.69	1,787,766,324	-94,879,104	168,778,356	73,899,252
2,950,000.00	AXA SA FRN 10292049 BFRA105Z XS0325823119	5/24/2013		3,093,812.50	473,922,496	100.944999600C 151.774110342	2,977,877.49	451,964,706	-17,595,933	-4,361,856	-21,957,790
19,590,000.00000	BANCO BRASL (CI) 5.875 % 01192023 BBRA0001 US05958AAH14	6/12/2012		20,225,334.50	1,633,218,778	92.717002800C 0.010192121	18,163,260.85	1,782,088,424	-202,320,366	351,190,012	148,869,646

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
4,280,000.00000	BANCO BRASIL (CI) FRN 12292049 BBRA003F USP3772WAA01	1/30/2013		5,157,400.00	469,658,644	107.242996200C 0.010192121	4,590,000.24	450,347,895	-55,670,430	36,359,681	-19,310,749
10,330,000.00000	BANCO DE CREDITO FRN 04242027 BPER001A US05954TAJ07	2/21/2013		11,196,552.70	1,043,648,049	98.657997100C 0.010192121	10,191,371.10	999,926,424	-98,623,397	54,901,772	-43,721,625
19,620,000.00000	BANK OF AMER CRP 2 % 01112018 BUSA95UP US06051GET22	2/13/2013		19,431,906.30	1,851,228,271	96.958999600C 0.010192121	19,023,355.72	1,866,476,636	-40,084,942	55,333,307	15,248,365
11,460,000.00000	BARCLAYS BK PLC 6% 01232018 BGBR1960 XS0342289575	11/9/2011		11,637,563.33	1,296,893,288	111.247001600C 129.374440941	12,748,906.38	1,649,382,636	143,779,386	208,709,962	352,489,348
5,930,000.00000	BARCLAYS BK PLC FRN 09292049 BGBR223T XS0269453139	3/14/2013		6,014,950.00	587,671,730	102.693000700C 0.010192121	6,089,694.94	597,490,448	7,333,600	2,485,118	9,818,718
13,900,000.00000	BARCLAYS BK PLC FRN 04102023 BGBR225W US06739FHK03	8/14/2013		14,372,275.00	1,409,273,434	102.217002800C 0.010192121	14,208,163.39	1,394,034,018	-16,101,811	862,395	-15,239,416
10,880,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0058 US05533UAB44	11/10/2011		11,887,850.00	1,081,561,710	101.369643000C 0.010192121	11,029,017.16	1,082,112,071	-84,264,388	84,814,749	550,361
8,850,000.00000	BBVA BANCOMER SA 6.5 % 03102021 BMEX0060 USP16259AB20	11/9/2011		9,106,122.60	726,964,805	101.858001700C 0.010192121	9,014,433.15	884,451,151	-8,996,111	166,482,457	157,486,346
11,370,000.00000	BBVA BANCOMER SA 7.25 % 04222020 BMEX009H USP1R23DAA49	1/29/2013		13,136,847.00	1,201,507,199	105.087997400C 0.010192121	11,948,505.30	1,172,327,654	-116,594,151	87,414,606	-29,179,545
5,200,000.00000	BNP PARIBAS FRN 04132049 BFRA0952 FR0010456764	2/26/2013		4,861,400.00	598,005,997	99.388000400C 129.374440941	5,168,176.02	668,629,883	39,688,976	30,934,910	70,623,886
2,000,000.00000	BNP PARIBAS FRN 04292049 BFRA104L FR0010306738	1/31/2013		1,830,000.00	226,134,304	99.190002400C 129.374440941	1,983,800.05	256,653,022	19,897,795	10,620,923	30,518,718
24,600,000.00000	BNP PARIBAS FRN 06292049 BFRA1050 USF1058YHV32	1/7/2013		24,193,500.00	2,119,362,095	99.254997200C 0.010192121	24,416,729.31	2,395,647,512	21,902,145	254,383,272	276,285,417

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
7,700,000.00000	BNP PARIBAS FORT FRN 10292049 BBEL0164 BE0119806116	3/19/2013		7,315,000.00	899,488,576	99.360000600C 129.374440941	7,650,720.05	989,807,629	43,433,593	46,885,459	90,319,053
4,200,000.00000	BPCE FRN 08292049 BFRA1041 USF11494AA36	4/20/2012		4,326,000.00	352,763,658	125.203002900C 0.010192121	5,258,526.12	515,940,315	91,494,805	71,681,852	163,176,657
16,590,000.00000	BPCE 9.25 % 10292049 BFRA1042 FR0010814558	4/24/2012		15,568,670.00	1,724,085,729	105.325996300C 129.374440941	17,473,582.79	2,260,635,004	246,447,027	290,102,248	536,549,275
8,600,000.00000	BPCE 4.625 % 07182023 BFRA106E FR0011538222	7/25/2013		8,525,438.00	1,130,331,610	99.893997100C 129.374440941	8,590,883.75	1,111,440,782	8,467,007	-27,357,835	-18,890,828
7,870,000.00	BUPA FINANCE PLC 5 % 04252023 BGBR2249 XS0920221453	4/18/2013		7,904,299.00	1,186,748,279	97.316001800C 151.774110342	7,658,769.34	1,162,402,903	-37,265,045	12,919,670	-24,345,376
13,500,000.00000	CA PREF FUND TRS 7 % 10292049 BUSA95ZF XS0173838847	1/22/2013		13,193,500.00	1,185,602,143	97.158996500C 0.010192121	13,116,464.53	1,286,921,979	-7,558,336	108,878,172	101,319,836
11,400,000.00000	CA PREF FUND TRS 7 % 01292049 BUSA960N XS0161441000	1/28/2013		11,214,250.00	1,034,032,896	97.512001000C 0.010192121	11,116,368.11	1,090,682,510	-9,603,682	66,253,296	56,649,614
5,000,000.00000	CBA CAP TRST II FRN 03292049 BUSA9290 US12479BAA08	4/24/2012		4,774,000.00	384,910,065	104.794998100C 0.010192121	5,239,749.91	514,098,087	45,697,054	83,490,968	129,188,022
8,200,000.00000	CITIGROUP INC 4.45 % 01102017 BUSA8317 US172967FW62	1/9/2013		9,074,858.00	797,180,913	107.406997600C 0.010192121	8,807,373.80	864,135,522	-26,244,213	93,198,822	66,954,609
3,500,000.00000	CITIGROUP INC 4.05 % 07302022 BUSA9630 US172967GK16	2/5/2013		3,500,000.00	326,882,509	96.311996400C 0.010192121	3,370,919.87	330,737,819	-12,664,697	16,520,008	3,855,310
7,900,000.00000	CLOVERIE PLC FRN 07242039 BIRL0272 XS0442190855	11/10/2011		8,394,009.00	892,911,013	120.074996900C 129.374440941	9,485,924.76	1,227,236,212	141,265,990	193,059,209	334,325,199
17,250,000.00000	CLOVERIE PLC FRN 09012042 BIRL027B XS0802738434	7/2/2012		19,515,027.00	2,170,826,452	117.285003600C 129.374440941	20,231,663.12	2,617,460,106	92,714,398	353,919,256	446,633,654

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
社債											
3,320,000.00000	COM BK AUSTRALIA 5.5 % 08062019 BAUS0764 XS0443708242	11/11/2011		3,644,098.97	362,049,917	113.497001600C 129.374440941	3,768,100.45	487,495,890	16,042,623	109,403,350	125,445,973
4,570,000.00	COVENTRY BDG SOC 5.875 % 09282022 BGBR2171 XS0544713356	11/9/2011		4,604,727.50	571,662,225	113.151000900C 151.774110342	5,171,000.74	784,824,037	85,945,617	127,216,195	213,161,812
5,550,000.00	CREDIT AGRICOLE FRN 12292049 BFRA105L FR0010291997	4/18/2013		5,223,937.50	784,665,067	97.111000000C 151.774110342	5,389,660.50	818,010,927	25,152,461	8,193,400	33,345,860
4,450,000.00000	CREDIT SUISSE 6.5 % 08082023 BCHE010D US22546DAA46	8/2/2013		4,461,750.00	442,138,132	100.875999400C 0.010192121	4,488,981.97	440,436,487	2,671,865	-4,373,510	-1,701,645
4,730,000.00000	CREDIT SUISSE 7.875 % 06292049 BJEY0009 XS0531067659	12/14/2012		5,085,160.00	427,998,928	106.852996800C 0.010192121	5,054,146.75	495,887,632	-3,042,865	70,931,569	67,888,704
33,040,000.00000	CSG GUERNSEY FRN 02242041 BGGY0001 XS0595225318	11/9/2011		34,079,238.50	3,047,986,965	106.426002500C 0.010192121	35,163,151.23	3,450,032,748	106,348,102	295,697,681	402,045,783
15,235,000.00	DANSKE BANK FRN 09292021 BDNK0229 XS0176929684	11/10/2011		14,521,576.50	2,009,635,628	101.336997900C 151.774110342	15,438,691.63	2,343,193,687	139,194,333	194,363,726	333,558,059
8,843,000.00000	DEUTSCHE BK CP FRN 09292049 BUSA96AA XS0176823424	3/1/2013		7,358,220.00	902,182,958	91.938003500C 129.374440941	8,130,077.65	1,051,824,251	99,858,652	49,782,641	149,641,293
18,036,000.00	DNB NORBANK ASA FRN 03292049 BNOR0223 XS0285087358	11/9/2011		18,273,284.15	2,506,426,995	103.152000400C 151.774110342	18,604,494.79	2,823,680,645	50,269,201	266,984,450	317,253,650
13,750,000.00000	FINANSBANK 5.15 % 11012017 BTUR0006 XS0849733273	2/25/2013		14,351,562.50	1,346,176,539	95.009002600C 0.010192121	13,063,737.86	1,281,748,702	-126,354,921	61,927,083	-64,427,837
5,870,000.00000	FINANSBANK 5.5 % 05112016 BTUR000A USM4R36CAA80	5/30/2013		6,075,450.00	613,164,778	97.871002100C 0.010192121	5,745,027.82	563,673,432	-32,419,373	-17,071,973	-49,491,346
18,880,000.00000	GE CAP TRUST I FRN 11152067 BUSA7949 US36830GAA22	11/10/2011		19,172,105.80	1,539,700,973	105.606002800C 0.010192121	19,938,413.33	1,956,257,518	75,186,267	341,370,278	416,556,545

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

口数 / 金額		種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産												
社債												
14,920,000.00000	GEN ELEC CAP CRP	12/20/2012			15,146,312.50	1,765,545,712	102.981002800C 129.374440941	15,364,765.62	1,987,807,962	28,262,250	194,000,000	222,262,250
	FRN 09152067 BUSA95RR XS0319639232											
1,000,000.00	GEN ELEC CAP CRP	5/8/2013			1,043,750.00	160,547,827	101.428001400C 151.774110342	1,014,280.01	153,941,447	-4,472,781	-2,133,599	-6,606,380
	FRN 09152066 BUSA96P5 XS0267167566											
4,820,000.00	GOLDMAN SACHS GP	4/18/2012			4,853,269.60	679,412,153	105.565002400C 151.774110342	5,088,233.12	772,262,054	35,661,379	57,188,523	92,849,901
	5.5% 10122021 BUSA4203 XS0270349003											
13,700,000.00000	GOLDMAN SACHS GP	11/9/2011			12,136,118.89	1,305,148,613	105.762001000C 129.374440941	14,489,394.14	1,874,557,266	304,453,669	264,954,984	569,408,653
	4.75 % 10122021 BUSA7943 XS0270347304											
5,000,000.00	GOLDMAN SACHS GP	4/25/2013			6,136,600.00	942,658,886	113.473999000C 151.774110342	5,673,699.95	861,120,762	-70,256,243	-11,281,880	-81,538,124
	6.875 % 01182038 BUSA96MS XS0340470490											
6,150,000.00	HSBC BANK FUND	4/25/2013			6,242,250.00	958,888,054	104.902999800C 151.774110342	6,451,534.49	979,175,907	31,763,967	-11,476,114	20,287,853
	FRN 04292049 BJEY000C XS0189704140											
9,880,000.00000	HSBC CAP FUNDING	1/29/2013			9,946,597.50	1,217,310,684	100.786003100C 129.374440941	9,957,657.11	1,288,266,321	1,430,830	69,524,807	70,955,637
	FRN 03242049 BGBR1366 XS0178404793											
6,160,000.00000	HSBC HLDGS PLC	11/9/2011			7,300,106.60	586,445,501	117.304000800C 0.010192121	7,225,926.45	708,971,808	-7,278,186	129,804,492	122,526,307
	6.8% 06012038 BGBR2073 US404280AJ87											
6,690,000.00	ING BANK NV	11/11/2011			6,641,617.00	837,014,201	110.434997500C 151.774110342	7,388,101.33	1,121,322,507	113,296,995	171,011,310	284,308,306
	FRN 05292023 BNLD1155 XS0366066222											
18,230,000.00000	IS BANKASI	3/8/2013			19,300,772.00	1,837,269,973	89.276000900C 0.010192121	16,275,014.96	1,596,823,170	-296,872,166	56,425,363	-240,446,803
	6 % 10242022 BTUR0007 XS0847042024											
20,100,000.00000	ITAU UNIBANCO	3/12/2012			20,670,979.50	1,728,919,791	91.863998400C 0.010192121	18,464,663.68	1,811,660,564	-216,472,687	299,213,460	82,740,773
	5.65 % 03192022 BBRA0024 US46556LAF13											

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

口数／金額		種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産												
社債												
9,000,000.00000		JP MORGAN CHASE 6% 01152018 BUSA5084 US46625HGY09	2/13/2013		10,732,500.00	1,003,059,413	114.163757300C 0.010192121	10,274,738.16	1,008,105,983	-44,913,305	49,959,875	5,046,570
10,700,000.00000		JPMORGAN CHASE 1.8 % 01252018 BUSA965N US46625HJG65	2/19/2013		10,719,046.00	1,002,445,174	97.306999200C 0.010192121	10,411,848.91	1,021,558,605	-30,140,644	49,254,075	19,113,431
15,760,000.00		LLOYDS TSB BANK 7.625 % 04222025 BGBR223F XS0503834821	1/10/2013		18,942,882.00	2,727,628,510	114.125000000C 151.774110342	17,986,100.00	2,729,824,326	-145,214,737	147,410,553	2,195,816
25,390,000.00000		MITSUI SUMITOMO FRN 03152072 BJPN3013 USJ45174AF61	3/9/2012		27,194,829.50	2,356,659,383	111.583999600C 0.010192121	28,331,177.50	2,779,713,614	111,492,789	311,561,442	423,054,231
13,150,000.00000		MORGAN STANLEY 4.875 % 11012022 BUSA95EL US6174824M37	10/18/2012		13,465,176.80	1,149,095,926	98.630996700C 0.010192121	12,969,976.07	1,272,549,263	-48,586,622	172,039,959	123,453,337
9,320,000.00		MUFG CAP FIN 5 FRN 01292049 BCYM055G XS0282533115	7/13/2012		9,850,000.00	1,241,860,241	110.217002800C 151.774110342	10,272,224.66	1,559,057,759	64,082,772	253,114,746	317,197,518
14,900,000.00000		MUNICH RE FRN 05262042 BDEU4349 XS0764278528	3/21/2012		15,924,322.00	1,749,022,741	114.853996200C 129.374440941	17,113,245.43	2,214,016,561	153,816,305	311,177,515	464,993,820
1,551,000.00000		NATIONAL CAP II FRN 12292049 BUSA96MD USU62948AA97	4/24/2013		1,605,285.00	159,525,198	102.195999100C 0.010192121	1,585,059.95	155,518,164	-1,984,381	-2,022,653	-4,007,034
7,376,000.00		NATIONAL CAP TST FRN 09292049 BUSA94UO XS0177395901	8/13/2012		6,809,147.50	890,898,589	100.985000600C 151.774110342	7,448,653.64	1,130,512,780	97,060,476	142,553,715	239,614,191
22,180,000.00000		NATIONWIDE BLDG 6.75 % 07222020 BGBR2178 XS0527239221	11/10/2011		23,194,320.40	2,776,411,034	111.283996500C 129.374440941	24,682,790.42	3,193,322,212	192,569,977	224,341,201	416,911,178
30,656,000.00000		NIPPON LIFE INS FRN 10182042 BJPN301S USJ54675AA13	10/24/2012		31,765,193.80	2,807,828,662	99.112998900C 0.010192121	30,384,080.94	2,981,134,245	-135,507,895	308,813,478	173,305,583
6,210,000.00000		NORDEA BANK AB 4.875% 05132021 BSWE0330 US65557FAA49	7/5/2012		6,185,953.20	497,147,805	102.222959000C 0.010192121	6,348,045.75	622,838,539	15,903,712	109,787,022	125,690,734

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニッ ト クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>社債</u>											
14,470,000.00000	NORDEA BANK AB FRN 09292049 BSWE0331 XS0453319039	11/9/2011		15,595,262.00	1,408,993,954	107.870002700C 0.010192121	15,608,789.39	1,531,456,445	1,327,240	121,135,251	122,462,491
7,400,000.00000	NORDEA BANK AB 4.25 % 09212022 BSWE034A US65557HAD44	6/28/2013		7,308,462.00	725,986,086	98.093002300C 0.010192121	7,258,882.17	712,205,258	-4,864,525	-8,916,302	-13,780,828
27,790,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		28,899,096.00	2,616,026,956	94.226997300C 0.010192121	26,185,682.55	2,569,208,367	-266,226,573	219,407,984	-46,818,589
2,530,000.00	PRUDENTIAL PLC FRN 05292039 BGBR2169 XS0431150902	11/9/2011		3,285,605.60	411,730,124	136.722000100C 151.774110342	3,459,066.60	524,996,756	26,326,889	86,939,743	113,266,632
22,820,000.00000	PRUDENTIAL PLC 5.25 % 03232049 BGBR223D XS0873630742	1/8/2013		22,595,437.50	2,024,736,811	93.379997200C 0.010192121	21,309,315.36	2,090,763,577	-126,187,880	192,214,646	66,026,766
30,500,000.00000	RABOBANK FRN 11292049 BNLD121G XS0703303262	12/13/2012		32,776,450.00	2,966,992,727	108.214996300C 0.010192121	33,005,573.87	3,238,342,036	22,480,490	248,868,819	271,349,309
5,410,000.00000	RABOBANK CAP III FRN 12292049 BUSA96GT US749769AA35	4/9/2013		5,491,150.00	543,651,304	102.071998500C 0.010192121	5,522,095.12	541,800,389	3,036,180	-4,887,096	-1,850,915
14,240,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.934 % 04092018 BGBR2179 XS0356705219	11/10/2011		12,931,532.00	1,371,834,394	106.689002900C 129.374440941	15,192,514.01	1,965,523,007	292,513,284	301,175,329	593,688,613
23,480,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.125 % 12152022 BGBR223B US780099CE50	12/13/2012		24,414,224.40	2,051,409,830	95.929392000C 0.010192121	22,524,221.24	2,209,964,073	-185,437,669	343,991,912	158,554,243
15,810,000.00000	SBERBANK 6.125 % 02072022 BLUX027P XS0743596040	10/18/2012		17,752,502.50	1,597,269,701	102.372001600C 0.010192121	16,185,013.45	1,587,992,671	-153,794,195	144,517,166	-9,277,030
4,500,000.00000	SBERBANK 5.25 % 05232023 BLUX028Q XS0935311240	5/23/2013		4,466,250.00	462,279,207	90.380996700C 0.010192121	4,067,144.85	399,047,936	-39,158,204	-24,073,067	-63,231,271

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>社債</u>											
3,300,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 09292049 BFRA1006 XS0449487619	11/10/2011		2,783,665.00	298,571,421	113.596000600C 129.374440941	3,748,668.02	484,981,829	124,846,726	61,563,682	186,410,408
24,380,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 12112049 BFRA104X XS0813929782	12/13/2012		24,301,205.00	2,041,904,336	101.433998100C 0.010192121	24,729,608.74	2,426,345,678	42,032,835	342,408,507	384,441,342
11,460,000.00000	SOCIETE GENERALE FRN 01292049 BFRA105W FR0010136382	5/2/2013		11,129,950.00	1,447,592,880	97.586997900C 129.374440941	11,183,469.96	1,446,855,174	6,924,115	-7,661,821	-737,706
29,610,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		29,892,016.00	2,885,955,119	98.124000500C 0.010192121	29,054,516.55	2,850,684,028	-82,171,263	46,900,172	-35,271,091
20,000,000.00000	STANDARD CHART FRN 01292049 BGBR2173 US853254AA86	11/10/2011		18,485,956.00	1,496,622,734	100.930999700C 0.010192121	20,186,199.94	1,980,569,102	166,819,442	317,126,926	483,946,368
10,000,000.00000	STANDARD CHART 3.95 % 01112023 BGBR223E US853254AJ95	1/8/2013		10,049,450.00	879,223,060	91.880996700C 0.010192121	9,188,099.67	901,490,442	-84,511,392	106,778,774	22,267,382
12,100,000.00000	STANDARD CHART FRN 01292049 BGBR223U USG84228AT58	3/18/2013		12,394,690.00	1,213,535,968	100.820999100C 0.010192121	12,199,340.89	1,196,938,389	-19,166,679	2,569,100	-16,597,579
18,840,000.00	STANDARD LIFE FRN 12042042 BGBR223H XS0860360295	1/24/2013		19,836,054.40	2,865,711,312	101.714996300C 151.774110342	19,163,105.30	2,908,463,259	-102,136,251	144,888,197	42,751,947
5,110,000.00000	SUMITOMO MITSUI 4.85 % 03012022 BJPN3011 XS0748939880	3/15/2012		5,175,083.50	430,569,108	103.616996700C 0.010192121	5,294,828.53	519,502,126	11,748,784	77,184,234	88,933,018
1,820,000.00000	SUMITOMO MITSUI BK 4% 11092020 BJPN2991 XS0555833580	11/9/2011		1,863,150.10	196,836,867	106.688003500C 129.374440941	1,941,721.66	251,209,155	10,165,152	44,207,136	54,372,288
3,790,000.00000	TURKIYE GARANTI 5.25 % 09132022 BTUR0002 USM8931TAF68	12/18/2012		4,077,696.97	344,482,797	85.168998700C 0.010192121	3,227,905.05	316,705,919	-83,377,338	55,600,460	-27,776,878
5,200,000.00000	UBS AG FRN 05222023 BCHE010B CH0214139930	5/15/2013		5,200,000.00	532,610,022	96.408996500C 0.010192121	5,013,267.82	491,876,796	-18,321,229	-22,411,997	-40,733,226

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
20,180,000.00000	UBS AG JERSEY FRN 02222022 BCHE0100 XS0747231362	2/15/2012		20,362,884.00	1,658,184,698	107.253997800C 0.010192121	21,643,856.76	2,123,587,108	125,682,648	339,719,762	465,402,410
7,600,000.00000	UBS AG STAMFORD 5.75% 04252018 BCHE0078 US90261XFA54	1/9/2013		9,058,288.00	795,725,322	114.816001800C 0.010192121	8,726,016.14	856,153,114	-32,600,855	93,028,648	60,427,792
7,900,000.00000	UBS AG STAMFORD 7.625 % 08172022 BCHE0106 US90261AAB89	1/24/2013		8,920,220.00	833,697,292	110.026000900C 0.010192121	8,692,054.07	852,820,926	-22,386,501	41,510,135	19,123,634
3,000,000.00000	UNITED OVERSEAS FRN 10172022 BSGP009H XS0843128603	10/16/2012		3,007,404.00	238,972,729	98.464996300C 0.010192121	2,953,949.89	289,826,807	-5,244,650	56,098,729	50,854,078
21,820,000.00000	VTB BANK 6.875 % 05292018 BLUX027U XS0365923977	12/13/2012		24,375,637.50	2,049,341,252	106.708999600C 0.010192121	23,283,903.71	2,284,500,323	-107,115,466	342,274,536	235,159,071
2,900,000.00000	VTB BANK 6.95 % 10172022 BLUX027Z XS0842078536	1/31/2013		3,078,350.00	280,930,228	98.818000700C 0.010192121	2,865,722.02	281,170,330	-20,861,995	21,102,097	240,102
12,610,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95 % 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		12,746,280.00	1,004,488,714	96.551002500C 0.010192121	12,175,081.42	1,194,558,170	-56,043,152	246,112,608	190,069,456
13,150,000.00000	WELLS FARGO CO 1.5 % 01162018 BUSA95QL US94974BFG05	4/17/2013		13,206,545.00	1,288,760,638	97.176002500C 0.010192121	12,778,644.33	1,253,776,749	-41,983,476	6,999,587	-34,983,889
3,000,000.00000	WESTPAC CAP IV FRN 12292049 BUSA8426 USU96100AA73	4/24/2013		3,105,000.00	308,559,378	102.727996800C 0.010192121	3,081,839.90	302,374,737	-2,272,353	-3,912,288	-6,184,641
5,320,000.00000	WESTPAC CAP IV FRN 12292049 BUSA9291 US96122CAA27	4/24/2012		4,965,900.00	402,593,370	102.793998700C 0.010192121	5,468,640.73	536,555,711	49,326,409	84,635,932	133,962,341
900,000.00000	YAPI VE KREDI BA 4 % 01222020 BTUR0003 US984848AC56	1/14/2013		895,761.00	79,946,668	84.360440000C 0.010192121	759,243.96	74,493,225	-13,394,370	7,940,927	-5,453,443
2,920,000.00000	YAPI VE KREDI BA 4 % 01222020 BTUR0009 XS0874840688	5/30/2013		2,905,400.00	293,227,488	84.856002800C 0.010192121	2,477,795.28	243,108,896	-41,954,439	-8,164,153	-50,118,592

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>社債</u>											
2,840,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	5/3/2012		2,774,483.00	364,574,397	108.888999900C 151.774110342	3,092,447.60	469,353,483	48,258,794	56,520,292	104,779,086
1,181,287,000.000000	社債合計			1,212,422,126	121,306,081,085		1,213,364,662	135,301,267,479	870,958,376	13,124,228,025	13,995,186,394
<u>外貨勘定</u>											
410,053.11000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	8/27/2013		410,053.11	36,564,130	1.000000000S 87.386127138	410,053.11	35,832,953	0	-731,177	-731,177
288,753.82000		8/16/2013		288,753.82	25,658,273	1.000000000S 87.386127138	288,753.82	25,233,078	0	-425,195	-425,195
646,148.93000		8/13/2013		646,148.93	57,250,874	1.000000000S 87.386127138	646,148.93	56,464,453	0	-786,421	-786,421
460,491.80000		8/13/2013		460,491.80	40,801,055	1.000000000S 87.386127138	460,491.80	40,240,595	0	-560,460	-560,460
1,069,460.49000		8/13/2013		1,069,460.49	94,757,639	1.000000000S 87.386127138	1,069,460.49	93,456,010	0	-1,301,629	-1,301,629
1,046,647.77000		8/13/2013		1,046,647.77	92,736,359	1.000000000S 87.386127138	1,046,647.77	91,462,495	0	-1,273,864	-1,273,864
33,717.70000		8/20/2013		33,717.70	3,022,199	1.000000000S 87.386127138	33,717.70	2,946,459	0	-75,740	-75,740
482,030.47000		8/19/2013		482,030.47	43,273,747	1.000000000S 87.386127138	482,030.47	42,122,776	0	-1,150,971	-1,150,971
13,098.86000		8/22/2013		13,098.86	1,154,101	1.000000000S 87.386127138	13,098.86	1,144,659	0	-9,442	-9,442
221,071.72000		8/28/2013		221,071.72	19,265,137	1.000000000S 87.386127138	221,071.72	19,318,601	0	53,464	53,464
164,821.68000		8/23/2013		164,821.68	14,663,585	1.000000000S 87.386127138	164,821.68	14,403,128	0	-260,457	-260,457
10,736.12000		8/29/2013		10,736.12	938,149	1.000000000S 87.386127138	10,736.12	938,188	0	39	39
-85,687.32000		8/21/2013		-85,687.32	-7,558,305	1.000000000S 87.386127138	-85,687.32	-7,487,883	0	70,422	70,422
-127,178.19000		8/30/2013		-127,178.19	-11,174,268	1.000000000S 87.386127138	-127,178.19	-11,113,609	0	60,659	60,659

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

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

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

[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・カテゴリ別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-300,486.74000		8/14/2013		-300,486.74	-26,818,274	1.000000000S 87.386127138	-300,486.74	-26,258,372	0	559,902	559,902
4,333,680.22000	AUD 合計			4,333,680	384,534,401		4,333,680	378,703,531	0	-5,830,870	-5,830,870
0.00000											
369,451,791.10000	BRAZILIAN REAL	6/11/2013		369,451,791.10	16,974,835,330	1.000000000S 0.024228711	369,451,791.10	15,248,512,028	0	-1,726,323,302	-1,726,323,302
32,593,600.00000	BRL	6/11/2013		32,593,600.00	1,497,545,840	1.000000000S 0.024228711	32,593,600.00	1,345,246,968	0	-152,298,872	-152,298,872
1,056,403.20000		5/14/2013		1,056,403.20	53,229,538	1.000000000S 0.024228711	1,056,403.20	43,601,296	0	-9,628,242	-9,628,242
184,874.70000		6/11/2013		184,874.70	8,494,255	1.000000000S 0.024228711	184,874.70	7,630,398	0	-863,857	-863,857
90,499.50000		6/11/2013		90,499.50	4,158,091	1.000000000S 0.024228711	90,499.50	3,735,217	0	-422,874	-422,874
3,892,793.65000		6/11/2013		3,892,793.65	178,858,332	1.000000000S 0.024228711	3,892,793.65	160,668,624	0	-18,189,708	-18,189,708
68,547.40000		5/14/2013		68,547.40	3,453,934	1.000000000S 0.024228711	68,547.40	2,829,181	0	-624,753	-624,753
-632,326.40000		5/14/2013		-632,326.40	-31,861,359	1.000000000S 0.024228711	-632,326.40	-26,098,227	0	5,763,132	5,763,132
-1,975,000.00000		6/11/2013		-1,975,000.00	-90,743,368	1.000000000S 0.024228711	-1,975,000.00	-81,514,861	0	9,228,507	9,228,507
-4,089,000.00000		6/11/2013		-4,089,000.00	-187,873,231	1.000000000S 0.024228711	-4,089,000.00	-168,766,716	0	19,106,515	19,106,515
-32,593,600.00000		6/11/2013		-32,593,600.00	-1,497,545,840	1.000000000S 0.024228711	-32,593,600.00	-1,345,246,968	0	152,298,872	152,298,872
-99,000.00000		6/11/2013		-99,000.00	-4,548,655	1.000000000S 0.024228711	-99,000.00	-4,086,061	0	462,594	462,594
-4,965,000.00000		6/11/2013		-4,965,000.00	-228,121,935	1.000000000S 0.024228711	-4,965,000.00	-204,922,169	0	23,199,766	23,199,766
-4,950,000.00000		6/11/2013		-4,950,000.00	-227,432,745	1.000000000S 0.024228711	-4,950,000.00	-204,303,068	0	23,129,677	23,129,677
-4,561,792.05000		6/11/2013		-4,561,792.05	-209,596,139	1.000000000S 0.024228711	-4,561,792.05	-188,280,427	0	21,315,712	21,315,712
-353,472,791.10000		6/11/2013		-353,472,791.10	-16,240,664,051	1.000000000S 0.024228711	-353,472,791.10	-14,589,005,214	0	1,651,658,837	1,651,658,837

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
0.00000 合計				0	2,187,997		0	1	0	-2,187,996	-2,187,996
0.00000											
49,994.04	BRITISH POUND	8/13/2013		49,994.04	7,473,242	1.000000000S 151.774110342	49,994.04	7,587,801	0	114,559	114,559
3,977,668.50000	GBP	8/19/2013		3,977,668.50	517,481,751	1.000000000S 129.374440941	3,977,668.50	514,608,638	0	-2,873,113	-2,873,113
126,632.88000	EURO	8/19/2013		126,632.88	16,474,526	1.000000000S 129.374440941	126,632.88	16,383,058	0	-91,468	-91,468
4,161,020.00000		8/20/2013		4,161,020.00	544,267,819	1.000000000S 129.374440941	4,161,020.00	538,329,636	0	-5,938,183	-5,938,183
127,117.81000		8/20/2013		127,117.81	16,627,205	1.000000000S 129.374440941	127,117.81	16,445,796	0	-181,409	-181,409
2,925,286.00000		8/20/2013		2,925,286.00	382,631,910	1.000000000S 129.374440941	2,925,286.00	378,457,241	0	-4,174,669	-4,174,669
89,326.03000		8/20/2013		89,326.03	11,683,982	1.000000000S 129.374440941	89,326.03	11,556,505	0	-127,477	-127,477
1,554,464.03000		8/13/2013		1,554,464.03	199,544,500	1.000000000S 129.374440941	1,554,464.03	201,107,915	0	1,563,415	1,563,415
12,961,515.25000 合計				12,961,515	1,688,711,693		12,961,515	1,676,888,789	0	-11,822,904	-11,822,904
0.00000											
-70,535,405.87000	UNITED STATES DOLLAR	6/18/2013		-70,535,405.87	-6,686,756,609	1.000000000S 0.010192121	-70,535,405.87	-6,920,581,680	0	-233,825,071	-233,825,071
-95,152.78000	USD	8/20/2013		-95,152.78	-9,322,594	1.000000000S 0.010192121	-95,152.78	-9,335,915	0	-13,321	-13,321
-346,000.00000		8/12/2013		-346,000.00	-33,304,229	1.000000000S 0.010192121	-346,000.00	-33,947,792	0	-643,563	-643,563
-8,890,240.41000		8/12/2013		-8,890,240.41	-855,730,066	1.000000000S 0.010192121	-8,890,240.41	-872,265,980	0	-16,535,914	-16,535,914
-20,000.00000		8/12/2013		-20,000.00	-1,925,100	1.000000000S 0.010192121	-20,000.00	-1,962,300	0	-37,200	-37,200
-8,500.00000		8/12/2013		-8,500.00	-818,167	1.000000000S 0.010192121	-8,500.00	-833,978	0	-15,811	-15,811

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

									未実現損益		
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-536,121.50000	USD	7/22/2013		-536,121.50	-53,823,920	1.000000000S 0.010192121	-536,121.50	-52,601,564	0	1,222,356	1,222,356
-406,027.81000		7/22/2013		-406,027.81	-40,763,164	1.000000000S 0.010192121	-406,027.81	-39,837,420	0	925,744	925,744
-34,235.06000		7/22/2013		-34,235.06	-3,437,029	1.000000000S 0.010192121	-34,235.06	-3,358,973	0	78,056	78,056
-6,652,333.59000		7/11/2013		-6,652,333.59	-665,931,855	1.000000000S 0.010192121	-6,652,333.59	-652,693,742	0	13,238,113	13,238,113
-103,131.34000		8/9/2013		-103,131.34	-9,889,780	1.000000000S 0.010192121	-103,131.34	-10,118,732	0	-228,952	-228,952
-8,371,070.38000		6/18/2013		-8,371,070.38	-793,577,488	1.000000000S 0.010192121	-8,371,070.38	-821,327,610	0	-27,750,122	-27,750,122
-31,107,506.86000		6/18/2013		-31,107,506.86	-2,948,991,708	1.000000000S 0.010192121	-31,107,506.86	-3,052,113,182	0	-103,121,474	-103,121,474
-26,516,061.07000		6/18/2013		-26,516,061.07	-2,513,722,639	1.000000000S 0.010192121	-26,516,061.07	-2,601,623,457	0	-87,900,818	-87,900,818
-3,475,056.25000		6/18/2013		-3,475,056.25	-329,435,339	1.000000000S 0.010192121	-3,475,056.25	-340,955,160	0	-11,519,821	-11,519,821
-55,651,643.42000		6/18/2013		-55,651,643.42	-5,275,775,900	1.000000000S 0.010192121	-55,651,643.42	-5,460,261,257	0	-184,485,357	-184,485,357
-4,488,132.16000		6/18/2013		-4,488,132.16	-425,474,937	1.000000000S 0.010192121	-4,488,132.16	-440,353,108	0	-14,878,171	-14,878,171
-1,300,000.00000		6/18/2013		-1,300,000.00	-123,240,002	1.000000000S 0.010192121	-1,300,000.00	-127,549,506	0	-4,309,504	-4,309,504
-5,365,890.40000		6/18/2013		-5,365,890.40	-508,686,420	1.000000000S 0.010192121	-5,365,890.40	-526,474,362	0	-17,787,942	-17,787,942
-46,242,088.83000		6/18/2013		-46,242,088.83	-4,383,750,107	1.000000000S 0.010192121	-46,242,088.83	-4,537,042,764	0	-153,292,657	-153,292,657
-679,616.12000		8/23/2013		-679,616.12	-67,013,545	1.000000000S 0.010192121	-679,616.12	-66,680,539	0	333,006	333,006
-1,426.76000		7/11/2013		-1,426.76	-142,826	1.000000000S 0.010192121	-1,426.76	-139,987	0	2,839	2,839
-190,808.38000		8/12/2013		-190,808.38	-18,366,260	1.000000000S 0.010192121	-190,808.38	-18,721,165	0	-354,905	-354,905
-2,261,000.00000		7/11/2013		-2,261,000.00	-226,337,405	1.000000000S 0.010192121	-2,261,000.00	-221,838,026	0	4,499,379	4,499,379

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
-208,749.90000		7/11/2013		-208,749.90	-20,896,909	1.000000000S 0.010192121	-208,749.90	-20,481,497	0	415,412	415,412
-344,346.81000		7/11/2013		-344,346.81	-34,470,837	1.000000000S 0.010192121	-344,346.81	-33,785,589	0	685,248	685,248
-763,864.09000		7/11/2013		-763,864.09	-76,466,615	1.000000000S 0.010192121	-763,864.09	-74,946,529	0	1,520,086	1,520,086
-1,660,000.00000		7/11/2013		-1,660,000.00	-166,174,300	1.000000000S 0.010192121	-1,660,000.00	-162,870,908	0	3,303,392	3,303,392
-515,000.00000		7/11/2013		-515,000.00	-51,554,075	1.000000000S 0.010192121	-515,000.00	-50,529,227	0	1,024,848	1,024,848
-6,963,737.70000		7/11/2013		-6,963,737.70	-697,104,963	1.000000000S 0.010192121	-6,963,737.70	-683,247,157	0	13,857,806	13,857,806
-510,000.00000		7/11/2013		-510,000.00	-51,053,550	1.000000000S 0.010192121	-510,000.00	-50,038,652	0	1,014,898	1,014,898
-35,203.44000		7/17/2013		-35,203.44	-3,495,174	1.000000000S 0.010192121	-35,203.44	-3,453,986	0	41,188	41,188
-56,537.66000		8/28/2013		-56,537.66	-5,495,743	1.000000000S 0.010192121	-56,537.66	-5,547,193	0	-51,450	-51,450
-41,096.35000		8/12/2013		-41,096.35	-3,955,729	1.000000000S 0.010192121	-41,096.35	-4,032,169	0	-76,440	-76,440
-25,000.00000		8/12/2013		-25,000.00	-2,406,375	1.000000000S 0.010192121	-25,000.00	-2,452,875	0	-46,500	-46,500
-47,542.47000		8/29/2013		-47,542.47	-4,645,137	1.000000000S 0.010192121	-47,542.47	-4,664,630	0	-19,493	-19,493
-768,749.96000		8/12/2013		-768,749.96	-73,996,025	1.000000000S 0.010192121	-768,749.96	-75,425,906	0	-1,429,881	-1,429,881
-202,251.80000		7/22/2013		-202,251.80	-20,305,070	1.000000000S 0.010192121	-202,251.80	-19,843,936	0	461,134	461,134
-113,202.69000		7/9/2013		-113,202.69	-11,443,093	1.000000000S 0.010192121	-113,202.69	-11,106,882	0	336,211	336,211
-10,875.02000		7/11/2013		-10,875.02	-1,088,644	1.000000000S 0.010192121	-10,875.02	-1,067,003	0	21,641	21,641
-181,865.67000		8/27/2013		-181,865.67	-17,920,134	1.000000000S 0.010192121	-181,865.67	-17,843,751	0	76,383	76,383

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
3,600,000.00000		8/13/2013		3,600,000.00	347,633,998	1.000000000S 0.010192121	3,600,000.00	353,214,017	0	5,580,019	5,580,019
4,800,000.00000		8/13/2013		4,800,000.00	463,511,998	1.000000000S 0.010192121	4,800,000.00	470,952,023	0	7,440,025	7,440,025
5,364,074.82000		8/13/2013		5,364,074.82	517,981,882	1.000000000S 0.010192121	5,364,074.82	526,296,226	0	8,314,344	8,314,344
1,014,265.63000		8/13/2013		1,014,265.63	97,942,560	1.000000000S 0.010192121	1,014,265.63	99,514,677	0	1,572,117	1,572,117
2,250,000.00000		8/13/2013		2,250,000.00	217,271,249	1.000000000S 0.010192121	2,250,000.00	220,758,761	0	3,487,512	3,487,512
4,740,000.00000		8/13/2013		4,740,000.00	457,718,098	1.000000000S 0.010192121	4,740,000.00	465,065,122	0	7,347,024	7,347,024
2,178,165.77000		8/13/2013		2,178,165.77	210,334,576	1.000000000S 0.010192121	2,178,165.77	213,710,745	0	3,376,169	3,376,169
55,427,797.80000		8/13/2013		55,427,797.80	5,352,385,267	1.000000000S 0.010192121	55,427,797.80	5,438,298,643	0	85,913,376	85,913,376
1,403,974.82000		8/30/2013		1,403,974.82	138,200,264	1.000000000S 0.010192121	1,403,974.82	137,750,996	0	-449,268	-449,268
233,708.40000		8/13/2013		233,708.40	22,568,051	1.000000000S 0.010192121	233,708.40	22,930,301	0	362,250	362,250
284,623.86000		8/16/2013		284,623.86	27,846,175	1.000000000S 0.010192121	284,623.86	27,925,871	0	79,696	79,696
1,300,950.00000		8/24/2013		1,300,950.00	128,104,550	1.000000000S 0.010192121	1,300,950.00	127,642,715	0	-461,835	-461,835
816,486.45000		8/20/2013		816,486.45	79,995,263	1.000000000S 0.010192121	816,486.45	80,109,572	0	114,309	114,309
393,417.24000		8/19/2013		393,417.24	38,387,686	1.000000000S 0.010192121	393,417.24	38,600,134	0	212,448	212,448
423,826.80000		8/21/2013		423,826.80	41,170,537	1.000000000S 0.010192121	423,826.80	41,583,768	0	413,231	413,231
301,187.50000		8/17/2013		301,187.50	29,388,370	1.000000000S 0.010192121	301,187.50	29,551,013	0	162,643	162,643
1,234,951.81000		8/22/2013		1,234,951.81	120,636,270	1.000000000S 0.010192121	1,234,951.81	121,167,303	0	531,033	531,033

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

									未実現損益		
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨勘定											
570,556.54000		8/14/2013		570,556.54	56,025,799	1.000000000S 0.010192121	570,556.54	55,980,158	0	-45,641	-45,641
31,116,404.75000		8/13/2013		31,116,404.75	3,004,755,609	1.000000000S 0.010192121	31,116,404.75	3,052,986,199	0	48,230,590	48,230,590
26,506,073.53000		8/13/2013		26,506,073.53	2,559,558,977	1.000000000S 0.010192121	26,506,073.53	2,600,643,529	0	41,084,552	41,084,552
3,473,858.26000		8/13/2013		3,473,858.26	335,453,121	1.000000000S 0.010192121	3,473,858.26	340,837,620	0	5,384,499	5,384,499
20,528,967.73000		8/13/2013		20,528,967.73	1,982,379,758	1.000000000S 0.010192121	20,528,967.73	2,014,199,766	0	31,820,008	31,820,008
118,092,462.51000		8/13/2013		118,092,462.51	11,403,598,583	1.000000000S 0.010192121	118,092,462.51	11,586,642,516	0	183,043,933	183,043,933
3,476,915.37000		8/13/2013		3,476,915.37	335,748,331	1.000000000S 0.010192121	3,476,915.37	341,137,568	0	5,389,237	5,389,237
3,807,197.04000 合計 0.00000				3,807,197	749,907,510		3,807,197	373,543,154	0	-376,364,356	-376,364,356
21,152,386.55000 外貨勘定合計				21,152,387	2,832,814,843		21,152,387	2,436,723,276	0	-396,091,567	-396,091,567
先物（ポジション）											
20,117,962.18000 AUD FORWARD 16 OCT FAU16OCT		8/1/2013		20,117,962.18	1,781,911,385	1.000000000F 87.088252187	20,117,962.18	1,752,038,164	0	-29,873,221	-29,873,221
46,127,828.84000		8/1/2013		46,127,828.84	4,085,687,339	1.000000000F 87.088252187	46,127,828.84	4,017,191,991	0	-68,495,348	-68,495,348
-5,611,294.25000		8/1/2013		-5,611,294.25	-497,427,625	1.000000000F 87.088252187	-5,611,294.25	-488,677,809	0	8,749,816	8,749,816
-460,491.80000		8/1/2013		-460,491.80	-40,585,444	1.000000000F 87.088252187	-460,491.80	-40,103,426	0	482,018	482,018
-1,069,460.49000		8/1/2013		-1,069,460.49	-94,809,323	1.000000000F 87.088252187	-1,069,460.49	-93,137,445	0	1,671,878	1,671,878
-60,726,664.32000		8/1/2013		-60,726,664.32	-5,383,331,720	1.000000000F 87.088252187	-60,726,664.32	-5,288,579,057	0	94,752,663	94,752,663
-1,622,119.84000 合計 0.00000				-1,622,120	-148,555,388		-1,622,120	-141,267,582	0	7,287,806	7,287,806

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	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）											
2,500,000.00000	EUR FORWARD 16 OCT FEU16OCT	8/23/2013		2,500,000.00	330,531,751	1.000000000F 129.366223230	2,500,000.00	323,415,558	0	-7,116,193	-7,116,193
1,451,187.49000		8/16/2013		1,451,187.49	188,777,204	1.000000000F 129.366223230	1,451,187.49	187,734,645	0	-1,042,559	-1,042,559
536,405.46000		8/21/2013		536,405.46	70,000,000	1.000000000F 129.366223230	536,405.46	69,392,748	0	-607,252	-607,252
-11,997,727.37000		8/1/2013		-11,997,727.37	-1,577,270,841	1.000000000F 129.366223230	-11,997,727.37	-1,552,100,677	0	25,170,164	25,170,164
-109,159,553.15000		8/1/2013		-109,159,553.15	-14,268,136,204	1.000000000F 129.366223230	-109,159,553.15	-14,121,559,120	0	146,577,084	146,577,084
-1,639,098.92000		8/1/2013		-1,639,098.92	-214,100,514	1.000000000F 129.366223230	-1,639,098.92	-212,044,037	0	2,056,477	2,056,477
-1,460,000.00000		8/9/2013		-1,460,000.00	-188,860,054	1.000000000F 129.366223230	-1,460,000.00	-188,874,686	0	-14,632	-14,632
-21,984,564.96000		8/1/2013		-21,984,564.96	-2,890,186,168	1.000000000F 129.366223230	-21,984,564.96	-2,844,060,138	0	46,126,030	46,126,030
-1,369,331.19000		8/2/2013		-1,369,331.19	-179,752,377	1.000000000F 129.366223230	-1,369,331.19	-177,145,204	0	2,607,173	2,607,173
-23,060,114.10000		8/1/2013		-23,060,114.10	-3,031,555,059	1.000000000F 129.366223230	-23,060,114.10	-2,983,199,868	0	48,355,191	48,355,191
-24,948,441.83000		8/1/2013		-24,948,441.83	-3,260,988,395	1.000000000F 129.366223230	-24,948,441.83	-3,227,485,695	0	33,502,700	33,502,700
-64,098,330.27000		8/1/2013		-64,098,330.27	-8,426,726,876	1.000000000F 129.366223230	-64,098,330.27	-8,292,158,902	0	134,567,974	134,567,974
-13,566,085.52000		8/1/2013		-13,566,085.52	-1,781,911,407	1.000000000F 129.366223230	-13,566,085.52	-1,754,993,248	0	26,918,159	26,918,159
-35,779,245.59000		8/1/2013		-35,779,245.59	-4,703,794,091	1.000000000F 129.366223230	-35,779,245.59	-4,628,625,872	0	75,168,219	75,168,219
-304,574,899.95000	合計			-304,574,900	-39,933,973,031		-304,574,900	-39,401,704,496	0	532,268,535	532,268,535
0.00000											
-980,859.51	GBP FORWARD 16 OCT FGB16OCT	8/2/2013		-980,859.51	-148,147,564	1.000000000F 151.682208784	-980,859.51	-148,778,937	0	-631,373	-631,373
-92,356,464.09		8/1/2013		-92,356,464.09	-13,928,188,915	1.000000000F 151.682208784	-92,356,464.09	-14,008,832,469	0	-80,643,554	-80,643,554
-59,172,624.70		8/1/2013		-59,172,624.70	-8,872,668,889	1.000000000F 151.682208784	-59,172,624.70	-8,975,434,414	0	-102,765,525	-102,765,525

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

										未実現損益	
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	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）											
-2,515,928.99		8/1/2013		-2,515,928.99	-379,428,557	1.000000000F 151.682208784	-2,515,928.99	-381,621,666	0	-2,193,109	-2,193,109
-17,023,303.49		8/1/2013		-17,023,303.49	-2,567,132,800	1.000000000F 151.682208784	-17,023,303.49	-2,582,132,274	0	-14,999,474	-14,999,474
-6,455,472.19		8/1/2013		-6,455,472.19	-973,553,112	1.000000000F 151.682208784	-6,455,472.19	-979,180,281	0	-5,627,169	-5,627,169
-2,345,415.80		8/1/2013		-2,345,415.80	-353,716,868	1.000000000F 151.682208784	-2,345,415.80	-355,757,849	0	-2,040,981	-2,040,981
-3,159,862.94		7/31/2013		-3,159,862.94	-470,370,878	1.000000000F 151.682208784	-3,159,862.94	-479,294,990	0	-8,924,112	-8,924,112
-2,218,498.63		8/1/2013		-2,218,498.63	-332,428,560	1.000000000F 151.682208784	-2,218,498.63	-336,506,772	0	-4,078,212	-4,078,212
-59,198,620.50		8/1/2013		-59,198,620.50	-8,927,099,247	1.000000000F 151.682208784	-59,198,620.50	-8,979,377,514	0	-52,278,267	-52,278,267
90,436,211.18		8/1/2013		90,436,211.18	13,561,000,417	1.000000000F 151.682208784	90,436,211.18	13,717,564,266	0	156,563,849	156,563,849
-154,990,839.66000 合計 0.00000				-154,990,840	-23,391,734,973		-154,990,840	-23,509,352,900	0	-117,617,927	-117,617,927
29,127,613.93000 USD FORWARD 16 OCT FUS16OCT		8/1/2013		29,127,613.93	2,890,186,149	1.000000000F 0.010194526	29,127,613.93	2,857,181,779	0	-33,004,370	-33,004,370
175,018,627.80000		8/1/2013		175,018,627.80	17,266,777,844	1.000000000F 0.010194526	175,018,627.80	17,167,902,441	0	-98,875,403	-98,875,403
9,811,575.35000		8/1/2013		9,811,575.35	973,553,112	1.000000000F 0.010194526	9,811,575.35	962,435,659	0	-11,117,453	-11,117,453
6,793,773.60000		8/1/2013		6,793,773.60	670,260,120	1.000000000F 0.010194526	6,793,773.60	666,413,877	0	-3,846,243	-3,846,243
54,253,809.17000		8/1/2013		54,253,809.17	5,383,331,713	1.000000000F 0.010194526	54,253,809.17	5,321,856,962	0	-61,474,751	-61,474,751
3,564,797.47000		8/1/2013		3,564,797.47	353,716,865	1.000000000F 0.010194526	3,564,797.47	349,677,608	0	-4,039,257	-4,039,257
955,498.78000		8/1/2013		955,498.78	94,809,322	1.000000000F 0.010194526	955,498.78	93,726,651	0	-1,082,671	-1,082,671
2,171,625.77000		8/1/2013		2,171,625.77	214,100,511	1.000000000F 0.010194526	2,171,625.77	213,018,807	0	-1,081,704	-1,081,704

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

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

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

保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・カテゴリー別 2013年8月30日現在

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	基準価格	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	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）											
3,371,829.51000		8/1/2013		3,371,829.51	332,428,558	1.000000000F 0.010194526	3,371,829.51	330,749,023	0	-1,679,535	-1,679,535
3,407,651.16000		8/1/2013		3,407,651.16	336,192,050	1.000000000F 0.010194526	3,407,651.16	334,262,835	0	-1,929,215	-1,929,215
2,000,000.00000		8/14/2013		2,000,000.00	196,419,801	1.000000000F 0.010194526	2,000,000.00	196,183,717	0	-236,084	-236,084
89,968,287.48000		8/1/2013		89,968,287.48	8,927,099,176	1.000000000F 0.010194526	89,968,287.48	8,825,156,509	0	-101,942,667	-101,942,667
1,119,543.49000		8/14/2013		1,119,543.49	109,882,858	1.000000000F 0.010194526	1,119,543.49	109,818,101	0	-64,757	-64,757
700,000.00000		8/2/2013		700,000.00	69,150,270	1.000000000F 0.010194526	700,000.00	68,664,301	0	-485,969	-485,969
2,400,000.00000		8/28/2013		2,400,000.00	233,659,441	1.000000000F 0.010194526	2,400,000.00	235,420,460	0	1,761,019	1,761,019
1,820,000.00000		8/2/2013		1,820,000.00	179,752,376	1.000000000F 0.010194526	1,820,000.00	178,527,182	0	-1,225,194	-1,225,194
1,500,000.00000		8/2/2013		1,500,000.00	148,147,563	1.000000000F 0.010194526	1,500,000.00	147,137,787	0	-1,009,776	-1,009,776
5,013,130.28000		8/1/2013		5,013,130.28	497,427,621	1.000000000F 0.010194526	5,013,130.28	491,747,265	0	-5,680,356	-5,680,356
47,405,353.65000		8/1/2013		47,405,353.65	4,703,794,030	1.000000000F 0.010194526	47,405,353.65	4,650,079,234	0	-53,714,796	-53,714,796
140,369,819.08000		8/1/2013		140,369,819.08	13,928,188,825	1.000000000F 0.010194526	140,369,819.08	13,769,136,405	0	-159,052,420	-159,052,420
15,895,908.97000		8/1/2013		15,895,908.97	1,577,270,835	1.000000000F 0.010194526	15,895,908.97	1,559,259,251	0	-18,011,584	-18,011,584
1,121,830.10000		8/12/2013		1,121,830.10	108,513,953	1.000000000F 0.010194526	1,121,830.10	110,042,399	0	1,528,446	1,528,446
84,925,480.23000		8/1/2013		84,925,480.23	8,426,726,860	1.000000000F 0.010194526	84,925,480.23	8,330,498,174	0	-96,228,686	-96,228,686
3,823,922.73000		8/1/2013		3,823,922.73	379,428,557	1.000000000F 0.010194526	3,823,922.73	375,095,687	0	-4,332,870	-4,332,870
30,552,345.17000		8/1/2013		30,552,345.17	3,031,555,041	1.000000000F 0.010194526	30,552,345.17	2,996,936,314	0	-34,618,727	-34,618,727

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
25,871,846.41000		8/1/2013		25,871,846.41	2,567,132,767	1.000000000F 0.010194526	25,871,846.41	2,537,817,492	0	-29,315,275	-29,315,275
-3,000,000.00000		8/9/2013		-3,000,000.00	-289,912,201	1.000000000F 0.010194526	-3,000,000.00	-294,275,575	0	-4,363,374	-4,363,374
-1,936,421.49000		8/16/2013		-1,936,421.49	-188,777,206	1.000000000F 0.010194526	-1,936,421.49	-189,947,182	0	-1,169,976	-1,169,976
-2,700,000.00000		8/13/2013		-2,700,000.00	-264,272,760	1.000000000F 0.010194526	-2,700,000.00	-264,848,017	0	-575,257	-575,257
-1,500,000.00000		8/30/2013		-1,500,000.00	-147,293,100	1.000000000F 0.010194526	-1,500,000.00	-147,137,787	0	155,313	155,313
-1,500,000.00000		8/29/2013		-1,500,000.00	-147,133,651	1.000000000F 0.010194526	-1,500,000.00	-147,137,787	0	-4,136	-4,136
-41,212,447.40000		8/1/2013		-41,212,447.40	-4,085,687,371	1.000000000F 0.010194526	-41,212,447.40	-4,042,605,551	0	43,081,820	43,081,820
-39,013,318.66000		8/1/2013		-39,013,318.66	-3,848,897,982	1.000000000F 0.010194526	-39,013,318.66	-3,826,888,926	0	22,009,056	22,009,056
-2,300,000.00000		8/19/2013		-2,300,000.00	-224,735,301	1.000000000F 0.010194526	-2,300,000.00	-225,611,274	0	-875,973	-875,973
-7,000,000.00000		8/5/2013		-7,000,000.00	-688,968,003	1.000000000F 0.010194526	-7,000,000.00	-686,643,008	0	2,324,995	2,324,995
642,802,082.58000 合計 0.00000				642,802,083	63,713,828,643		642,802,083	63,053,650,813	0	-660,177,830	-660,177,830
181,614,223.13000	先物（ポジション）合計			181,614,223	239,565,251		181,614,223	1,325,835	0	-238,239,416	-238,239,416
<u>変動利付債</u>											
8,350,000.00000	ABN AMRO BANK NV FRN 03292049 BNLD0978 XS0246487457	3/27/2013		7,473,250.00	901,380,805	93.265998800C 129.374440941	7,787,710.90	1,007,530,744	40,683,203	65,466,736	106,149,939
5,050,000.00000	ELM BV SWISS REIN CO FRN 05292049 BNLD0740 XS0253627136	3/11/2013		5,139,012.50	653,506,999	102.654998700C 129.374440941	5,184,077.43	670,687,120	5,830,251	11,349,870	17,180,121
10,890,000.00000	ING BANK NV FRN 03152019 BNLD1027 NL0000113892	3/27/2012		10,569,196.40	1,204,699,290	100.341003400C 129.374440941	10,927,135.27	1,413,692,017	46,308,141	162,684,585	208,992,727

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー別 2013年 8 月30日現在

										未実現損益	
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	基準価格	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
変動利付債											
5,100,000.00000	NATIONAL CAP II FRN 12292049	4/24/2012		4,834,500.00	392,980,632	102.178001400C 0.010192121	5,211,078.07	511,284,950	36,947,959	81,356,358	118,304,318
2,440,000.00000	BUSA3266 US635192AA58 OVERSEA CHINESE BKG 4.25% 11182019	11/10/2011		2,526,110.60	197,384,453	102.787002500C 0.010192121	2,508,002.86	246,072,713	-1,776,641	50,464,900	48,688,260
5,470,000.00000	BSGP0065 XS0466655890 SVENSKA HANDELSBANK FRN 12162049	11/10/2011		5,149,834.00	538,665,855	101.845001200C 129.374440941	5,570,921.57	720,734,863	54,477,968	127,591,040	182,069,008
	BSWE0185 XS0238196942										
37,300,000.00000	変動利付債合計			35,691,904	3,888,618,034		37,188,926	4,570,002,407	182,470,881	498,913,489	681,384,373
2,025,049,307.68000	割当前のクラス受益証券合計			2,054,576,337	128,870,774,911		2,057,015,896	142,913,014,695	1,053,429,257	12,988,810,531	14,042,239,784
1,491,360,412.17000	ポートフォリオ合計			1,520,887,441	55,180,057,031		1,523,327,000	69,597,825,836	1,053,429,257	13,364,339,552	14,417,768,805

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

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

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

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（平成25年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約36億円）

発行済株式総数 1,002,080株

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命を解除することができる。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の４分の３以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の４分の３を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社へ要求した場合。管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不履行、誠実に行為しないこと、過失、詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視の場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

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

管理会社は、平成25年８月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

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	51	8,900,574,651.51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。

5【管理会社の経理の概況】

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、円貨換算が併記されている。日本円への換算には平成25年9月30日現在における株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝97.75円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2013年 6月30日現在

（単位：米ドル）

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	375,158,892.00	36,671,782
1.2	売買目的で保有される金融資産	45,751,398.00	4,472,199
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	45,751,398.00	4,472,199
1.2.2	持分証券		
1.2.3	債務証券		
1.2.4	ローンおよび貸付金		
1.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0.00	0
1.3.1	持分証券		
1.3.2	債務証券		
1.3.3	ローンおよび貸付金		
1.4	売却可能金融資産	3,233,910.00	316,115
1.4.1	持分証券	3,233,910.00	316,115
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	3,387,826,512.00	331,160,042
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	3,387,826,512.00	331,160,042
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
1.9	有形資産	1,871,142.00	182,904
1.9.1	有形固定資産	1,871,142.00	182,904
1.9.2	投資不動産		
1.10	無形資産	4,494,270.00	439,315
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	4,494,270.00	439,315
1.12	税金資産	0.00	0
1.12.1	現行税金資産	0.00	0
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	28,868,352.00	2,821,881
1.14	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
1.15	資産合計	3,847,204,476.00	376,064,238

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2013年 6 月30日現在

（単位：米ドル）

負債

米ドル

千円

		米ドル	千円
2.1	中央銀行預金		
2.2	売買目的で保有される金融負債	45,652,356.00	4,462,518
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	45,652,356.00	4,462,518
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証書（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証書（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	3,653,841,677.00	357,163,024
2.4.1	金融機関からの預金	803,883,131.00	78,579,576
2.4.2	金融機関以外からの預金	2,849,958,546.00	278,583,448
2.4.3	債務証書（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
2.8	引当金	0.00	0
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務		
2.8.3	年金およびその他の退職後給付金債務		
2.8.4	ローン契約および保証		
2.8.5	有償契約		
2.8.99	その他の引当金	0.00	0
2.9	税金負債	5,136,456.00	502,089
2.9.1	現行税金負債	2,896,745.00	283,157
2.9.2	繰延税金負債	2,239,711.00	218,932
2.10	その他の負債	11,141,984.00	1,089,129
2.11	要求払株式資本（例えば、共同株式）		
2.12	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
2.13	負債合計	3,715,772,473.00	363,216,759

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2013年 6 月30日現在

（単位：米ドル）

資本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	3,628,281
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	3,628,281
3.1.2	未払込請求資本	0.00	0
3.2	株式発行差金		
3.3	その他のエクイティ	0.00	0
3.3.1	複合金融商品のエクイティ部分		
3.3.99	その他のエクイティ商品		
3.4	再評価準備金およびその他の評価差額：	2,441,180.00	238,625
3.4.1	有形資産		
3.4.2	無形資産		
3.4.3	外国事業純投資のヘッジ（有効部分）		
3.4.4	外貨換算		
3.4.5	キャッシュ・フロー・ヘッジ（有効部分）		
3.4.6	売却可能金融資産	2,441,180.00	238,625
3.4.7	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	77,841,959.00	7,609,051
3.6	< 自己株式 >		
3.7	当期利益	14,030,895.00	1,371,520
3.8	< 中間配当 >		
3.10	資本合計	131,432,003.00	12,847,478
3.11	負債および資本合計	3,847,204,476.00	376,064,238

（２）【損益の状況】

ミツビシＵＦＪグローバルカストディ・エス・エイ

損益計算書

2013年６月30日に終了した期間

（単位：米ドル）

		米ドル	千円
5.1	金融および運用収益および費用（＋／－）	34,822,289.00	3,403,879
5.2	利息収益	5,100,934.00	498,616
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	93,802.00	9,169
5.2.2	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）	1,581,208.00	154,563
5.2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.2.4	売却可能金融資産		
5.2.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）	3,425,924.00	334,884
5.2.6	満期保有目的投資有価証券		
5.2.7	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
5.2.99	その他の資産		
5.3	（支払利息）（－）	924,813.00	90,400
5.3.1	中央銀行からの預金	0.00	0
5.3.2	売買目的で保有される金融負債（区別して計上される場合）	132,035.00	12,906
5.3.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債		
5.3.4	償却後原価で測定される金融負債	792,778.00	77,494
5.3.5	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
5.3.99	その他の負債		
5.4	要求払株式資本に係る費用（－）		
5.5	受取配当（＋）	17.00	2
5.5.1	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）		
5.5.2	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.5.3	売却可能金融資産	17.00	2
5.6	受取手数料（＋）	54,260,320.00	5,303,946
5.7	（支払手数料）（－）	24,839,340.00	2,428,045
5.8	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負債に係る実現利益（損失）、純額（＋／－）	0.00	0
5.8.1	売却可能金融資産		
5.8.2	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）		
5.8.3	満期保有目的投資有価証券		
5.8.4	償却後原価で測定される金融負債		
5.8.99	その他		
5.9	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）	2,306,423.00	225,453
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	2,306,423.00	225,453
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（＋／－）		
5.12	為替差額、純額（＋／－）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益（損失）、純額（＋／－）		
5.14	その他の事業収益（＋）	102,759.00	10,045

米ドル

千円

5.15	その他の事業費用（－）	1,184,011.00	115,737
5.16	一般管理費（－）	15,822,658.00	1,546,665
5.16.1	従業員費用（－）	7,577,208.00	740,672
5.16.2	一般管理費用（－）	8,245,450.00	805,993
5.17	減価償却（＋／－）	673,123.00	65,798
5.17.1	有形固定資産	149,209.00	14,585
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	523,914.00	51,213
5.18	引当金（＋／－）	0.00	0
5.19	減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損（＋／－）	0.00	0
5.19.1.1	取得原価で測定される金融資産（値付けされていないエクイティ）		
5.19.1.2	売却可能金融資産		
5.19.1.3	償却後原価で測定されるローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）		
5.19.1.4	償却後原価で測定される満期保有目的投資証券		
5.19.2	非金融資産に係る減損、純額（＋／－）	0.00	0
5.19.2.1	有形固定資産		
5.19.2.2	投資不動産		
5.19.2.3	営業権		
5.19.2.4	その他の無形資産		
5.19.2.99	その他		
5.20	直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）		
5.22	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される除却グループからの損益（＋／－）		
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	18,326,508.00	1,791,416
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	4,295,613.00	419,896
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	14,030,895.00	1,371,520
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	14,030,895.00	1,371,520