

## 【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28年11月30日                                                                                                                                 |
| 【計算期間】        | 第5期中(自 平成28年3月1日 至 平成28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<br>(Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund) |
| 【発行者名】        | ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.<br>(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)                                              |
| 【代表者の役職氏名】    | マネージング・ディレクター 寺脇 恒                                                                                                                          |
| 【本店の所在の場所】    | ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通り 287 - 289番<br>(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)                     |
| 【代理人の氏名又は名称】  | 弁護士 三浦 健                                                                                                                                    |
| 【代理人の住所又は所在地】 | 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング<br>森・濱田松本法律事務所                                                                                               |
| 【事務連絡者氏名】     | 弁護士 三浦 健                                                                                                                                    |
| 【連絡場所】        | 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング<br>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28年9月末日現在)

| 資産の種類                | 地域名    | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|----------------------|--------|----------------|---------|
| 社債                   | 米国     | 12,529,497,473 | 18.59   |
|                      | フランス   | 11,696,277,768 | 17.35   |
|                      | 英国     | 10,157,590,218 | 15.07   |
|                      | オランダ   | 9,918,471,270  | 14.71   |
|                      | 日本     | 5,801,373,018  | 8.61    |
|                      | ジャージー  | 2,246,822,664  | 3.33    |
|                      | メキシコ   | 2,072,866,915  | 3.07    |
|                      | ドイツ    | 2,012,077,825  | 2.98    |
|                      | スウェーデン | 1,667,075,594  | 2.47    |
|                      | スペイン   | 1,549,383,598  | 2.30    |
|                      | オーストリア | 1,339,692,272  | 1.99    |
|                      | バーミューダ | 853,968,840    | 1.27    |
|                      | デンマーク  | 803,393,986    | 1.19    |
|                      | ノルウェー  | 764,260,019    | 1.13    |
|                      | カナダ    | 508,760,450    | 0.75    |
|                      | ケイマン諸島 | 200,641,407    | 0.30    |
| 小計                   |        | 64,122,153,317 | 95.11   |
| 現金・その他の資産<br>(負債控除後) |        | 3,294,683,546  | 4.89    |
| 合計(純資産総額)            |        | 67,416,836,863 | 100.00  |

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

(注2) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびオーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、平成28年9月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=101.12円および1豪ドル=77.04円)による。以下、米ドルおよび豪ドルの円貨表示は別段の記載がない限りこれによるものとする。

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

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

## （２）【運用実績】

## 【純資産の推移】

平成28年９月末日までの１年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

|            | 純資産総額          |            | １口当たり純資産価格 |        |
|------------|----------------|------------|------------|--------|
|            | 米ドル            | 千円         | 米ドル        | 円      |
| 平成27年10月末日 | 187,922,552.41 | 19,002,728 | 0.009709   | 0.9818 |
| 11月末日      | 183,217,796.22 | 18,526,984 | 0.009717   | 0.9826 |
| 12月末日      | 176,345,133.34 | 17,832,020 | 0.009622   | 0.9730 |
| 平成28年１月末日  | 171,783,284.47 | 17,370,726 | 0.009532   | 0.9639 |
| ２月末日       | 164,478,580.54 | 16,632,074 | 0.009333   | 0.9438 |
| ３月末日       | 165,860,829.28 | 16,771,847 | 0.009547   | 0.9654 |
| ４月末日       | 165,534,615.89 | 16,738,860 | 0.009647   | 0.9755 |
| ５月末日       | 164,877,128.25 | 16,672,375 | 0.009658   | 0.9766 |
| ６月末日       | 162,343,113.71 | 16,416,136 | 0.009574   | 0.9681 |
| ７月末日       | 163,511,881.83 | 16,534,321 | 0.009779   | 0.9889 |
| ８月末日       | 161,440,317.58 | 16,324,845 | 0.009856   | 0.9966 |
| ９月末日       | 158,697,281.52 | 16,047,469 | 0.009771   | 0.9880 |

## &lt; 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス &gt;

|             | 純資産総額         |           | 1口当たり純資産価格 |        |
|-------------|---------------|-----------|------------|--------|
|             | 豪ドル           | 千円        | 豪ドル        | 円      |
| 平成27年10月末日  | 62,394,669.58 | 4,806,885 | 0.009199   | 0.7087 |
| 11月末日       | 59,468,023.68 | 4,581,417 | 0.009207   | 0.7093 |
| 12月末日       | 57,648,607.98 | 4,441,249 | 0.009114   | 0.7021 |
| 平成28年 1 月末日 | 57,435,347.96 | 4,424,819 | 0.009015   | 0.6945 |
| 2 月末日       | 55,677,286.24 | 4,289,378 | 0.008824   | 0.6798 |
| 3 月末日       | 56,127,269.73 | 4,324,045 | 0.009015   | 0.6945 |
| 4 月末日       | 53,417,828.33 | 4,115,309 | 0.009072   | 0.6989 |
| 5 月末日       | 52,773,931.92 | 4,065,704 | 0.009062   | 0.6981 |
| 6 月末日       | 52,889,412.64 | 4,074,600 | 0.008979   | 0.6917 |
| 7 月末日       | 54,385,671.48 | 4,189,872 | 0.009160   | 0.7057 |
| 8 月末日       | 54,362,831.99 | 4,188,113 | 0.009224   | 0.7106 |
| 9 月末日       | 54,114,627.37 | 4,168,991 | 0.009131   | 0.7035 |

## &lt; 参考情報 &gt;

## 純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2012年12月13日～2016年9月30日）



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

## 【分配の推移】

平成28年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

## &lt;米ドル建 米ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 1口当たり分配金 |          |
|----------------------|----------|----------|
|                      | 米ドル      | 円        |
| 平成27年10月1日～平成28年9月末日 | 0.000540 | 0.054605 |

## &lt;豪ドル建 豪ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 1口当たり分配金 |          |
|----------------------|----------|----------|
|                      | 豪ドル      | 円        |
| 平成27年10月1日～平成28年9月末日 | 0.000720 | 0.055469 |

## &lt;参考情報&gt;

## 分配の推移(2016年9月末日現在)

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

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

## 【収益率の推移】

平成28年9月末日までの1年間の収益率は、以下のとおりである。

## &lt;米ドル建 米ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 収益率(注) |
|----------------------|--------|
| 平成27年10月1日～平成28年9月末日 | 7.43%  |

(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

## &lt;豪ドル建 豪ドルヘッジクラス&gt;

| 計算期間                 | 収益率(注) |
|----------------------|--------|
| 平成27年10月1日～平成28年9月末日 | 8.29%  |

(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

## &lt;参考情報&gt;

## 年間収益率の推移



(注1) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

ただし、2016年については2016年9月末日における課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

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

(注2) 2012年は12月13日(運用開始日)から12月末日までの収益率です。2016年は1月1日から9月末日までの収益率です。

(注3) ファンドおよび各クラスに、ベンチマークはありません。

## ２【販売及び買戻しの実績】

平成28年９月末日までの１年間における販売および買戻しの実績ならびに平成28年９月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

### <米ドル建 米ドルヘッジクラス>

| 計算期間                     | 販売口数                               | 買戻口数                               | 発行済口数                                |
|--------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|
| 平成27年10月１日～<br>平成28年９月末日 | 1,723,747,267<br>( 1,723,747,267 ) | 5,361,516,347<br>( 5,361,516,347 ) | 16,241,106,424<br>( 16,241,106,424 ) |

### <豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

| 計算期間                     | 販売口数                           | 買戻口数                               | 発行済口数                              |
|--------------------------|--------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 平成27年10月１日～<br>平成28年９月末日 | 780,963,823<br>( 780,963,823 ) | 1,779,566,013<br>( 1,779,566,013 ) | 5,926,172,809<br>( 5,926,172,809 ) |

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

### 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。

## （１）【資産及び負債の状況】

## 貸借対照表

## 東京海上ストラテジック・トラスト -

## 東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2016年 8 月31日現在

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

2016年 8 月31日現在

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

2016年８月31日現在

円

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

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

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

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

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

2016年 8 月31日現在

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

## 損益計算書

東京海上ストラテジック・トラスト－

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2016年３月１日から2016年８月31日までの期間

円

## 収益

|             |                 |                  |
|-------------|-----------------|------------------|
| 実現損益        |                 | 14,053,711,571   |
| 為替取引に係る実現利益 |                 | 23,932,981,308   |
| ブラジル・レアル    | 3,672,379,670   |                  |
| 豪ドル         | 1,173,887,237   |                  |
| ユーロ         | 6,903,285       |                  |
| 日本円         | 5,805,931,116   |                  |
| 資源国通貨バスケット  | 34,219,607      |                  |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 1,177,348,420   |                  |
| メキシコ・ペソ     | 121,532,954     |                  |
| トルコ・リラ      | 41,847,028      |                  |
| ロシア・ルーブル    | 441,223,014     |                  |
| 為替取引に係る実現損失 |                 | (14,837,260,188) |
| ブラジル・レアル    | (1,118,458,056) |                  |
| 豪ドル         | (800,883,409)   |                  |
| ユーロ         | (6,141,775)     |                  |
| 日本円         | (1,545,187,131) |                  |
| 資源国通貨バスケット  | (16,175,889)    |                  |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | (779,267,435)   |                  |
| メキシコ・ペソ     | (114,230,260)   |                  |
| トルコ・リラ      | (30,631,553)    |                  |
| ロシア・ルーブル    | (149,205,599)   |                  |
| 市場に係る実現利益   |                 | 315,291,771      |
| 市場に係る実現損失   |                 | (57,748,417)     |

2016年3月1日から2016年8月31日までの期間

円

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

2016年３月１日から2016年８月31日までの期間

円

|                   |             |               |
|-------------------|-------------|---------------|
| 未決済取引にかかる未実現為替差損益 |             | (315,314)     |
| 米ドル建 米ドルヘッジ       | (2,166,554) |               |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ       | 19,943      |               |
| 未実現通貨繰延損益         |             | 41,606,243    |
| 収益合計：             |             | 5,524,502,525 |

2016年３月１日から2016年８月31日までの期間

円

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

## (2)【投資有価証券明細表等】

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額            | 種類                             | 取引日      | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                          | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|--------------------|--------------------------------|----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <b>豪ドルクラス受益証券</b>  |                                |          |                       |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |             |
| <b>先物(ポジション)</b>   |                                |          |                       |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |             |
| <b>非グループ化の有価証券</b> |                                |          |                       |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |             |
| 53,813,866.80000   | AUD FORWARD 14 OCT<br>FAU14OCT | 8/1/2016 |                       | 53,813,866.80          | 4,163,093,728                 | 1.0000000000F<br>77.501746696 | 53,813,866.80        | 4,170,668,673               | 0         | 7,574,945          | 7,574,945   |
| -40,565,700.00000  | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/1/2016 | AUD                   | -40,565,700.00         | -4,163,093,701                | 1.0000000000F<br>0.009686497  | -40,565,700.00       | -4,187,860,689              | 0         | -24,766,988        | -24,766,988 |
| 13,248,166.80000   | 非グループ化の有価証券小計                  |          |                       | 13,248,167             | 27                            |                               | 13,248,167           | -17,192,016                 | 0         | -17,192,043        | -17,192,043 |
| 13,248,166.80000   | 先物(ポジション)合計                    |          |                       | 13,248,167             | 27                            |                               | 13,248,167           | -17,192,016                 | 0         | -17,192,043        | -17,192,043 |
| 13,248,166.80000   | 豪ドルクラス受益証券合計                   |          |                       | 13,248,167             | 27                            |                               | 13,248,167           | -17,192,016                 | 0         | -17,192,043        | -17,192,043 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                  | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|--------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <b>豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券</b> |                                |           |                       |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <b>先物(ポジション)</b>         |                                |           |                       |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <b>非グループ化の有価証券</b>       |                                |           |                       |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 26,262,076.73000         | AUD FORWARD 09 SEP<br>FAU09SEP | 7/1/2016  |                       | 26,262,076.73          | 2,017,293,500                 | 1.000000000F<br>77.684733909 | 26,262,076.73        | 2,040,162,443               | 0         | 22,868,943         | 22,868,943  |
| -26,262,076.73000        |                                | 8/30/2016 | AUH                   | -26,262,076.73         | -2,027,028,350                | 1.000000000F<br>77.684733909 | -26,262,076.73       | -2,040,162,443              | 0         | -13,134,093        | -13,134,093 |
| 0.00000                  | 合計 -----                       |           |                       | 0                      | -9,734,850                    |                              | 0                    | 0                           | 0         | 9,734,850          | 9,734,850   |
| 25,985,936.53000         | AUD FORWARD 14 NOV<br>FAU14NOV | 8/30/2016 | AUH                   | 25,985,936.53          | 2,006,694,816                 | 1.000000000F<br>77.343157358 | 25,985,936.53        | 2,009,834,378               | 0         | 3,139,562          | 3,139,562   |
| 28,175,480.72000         | AUD FORWARD 14 OCT<br>FAU14OCT | 8/1/2016  | AUH                   | 28,175,480.72          | 2,179,682,934                 | 1.000000000F<br>77.501746696 | 28,175,480.72        | 2,183,648,970               | 0         | 3,966,036          | 3,966,036   |
| 380,469.00000            |                                | 8/22/2016 | AUH                   | 380,469.00             | 29,142,125                    | 1.000000000F<br>77.501746696 | 380,469.00           | 29,487,012                  | 0         | 344,887            | 344,887     |
| 28,555,949.72000         | 合計 -----                       |           |                       | 28,555,950             | 2,208,825,059                 |                              | 28,555,950           | 2,213,135,982               | 0         | 4,310,923          | 4,310,923   |
| 19,721,060.07000         | USD FORWARD 09 SEP<br>FUS09SEP | 8/30/2016 | AUH                   | 19,721,060.07          | 2,027,028,340                 | 1.000000000F<br>0.009672038  | 19,721,060.07        | 2,038,976,694               | 0         | 11,948,354         | 11,948,354  |
| -19,598,600.00000        |                                | 7/1/2016  | AUH                   | -19,598,600.00         | -2,017,293,496                | 1.000000000F<br>0.009672038  | -19,598,600.00       | -2,026,315,447              | 0         | -9,021,951         | -9,021,951  |
| 122,460.07000            | 合計 -----                       |           |                       | 122,460                | 9,734,844                     |                              | 122,460              | 12,661,247                  | 0         | 2,926,403          | 2,926,403   |
| -19,482,800.00000        | USD FORWARD 14 NOV<br>FUS14NOV | 8/30/2016 | AUH                   | -19,482,800.00         | -2,006,694,826                | 1.000000000F<br>0.009699180  | -19,482,800.00       | -2,008,705,891              | 0         | -2,011,065         | -2,011,065  |
| -21,239,100.00000        | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/1/2016  | AUH                   | -21,239,100.00         | -2,179,682,920                | 1.000000000F<br>0.009686497  | -21,239,100.00       | -2,192,650,243              | 0         | -12,967,323        | -12,967,323 |
| -290,100.00000           |                                | 8/22/2016 | AUH                   | -290,100.00            | -29,142,125                   | 1.000000000F<br>0.009686497  | -290,100.00          | -29,948,907                 | 0         | -806,782           | -806,782    |
| -21,529,200.00000        | 合計 -----                       |           |                       | -21,529,200            | -2,208,825,045                |                              | -21,529,200          | -2,222,599,150              | 0         | -13,774,105        | -13,774,105 |
| 13,652,346.32000         | 非グループ化の有価証券小<br>計              |           |                       | 13,652,346             | -2                            |                              | 13,652,346           | 4,326,566                   | 0         | 4,326,568          | 4,326,568   |
| 13,652,346.32000         | 先物(ポジション)合計                    |           |                       | 13,652,346             | -2                            |                              | 13,652,346           | 4,326,566                   | 0         | 4,326,568          | 4,326,568   |
| 13,652,346.32000         | 豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計            |           |                       | 13,652,346             | -2                            |                              | 13,652,346           | 4,326,566                   | 0         | 4,326,568          | 4,326,568   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                  | 種類                             | 取引日      | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|--------------------------|--------------------------------|----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u> |                                |          |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>先物（ポジション）</u>         |                                |          |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>       |                                |          |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| 369,056.07000            | AUD FORWARD 14 OCT<br>FAU14OCT | 8/1/2016 |                   | 369,056.07             | 28,550,541                    | 1.000000000F<br>77.501746696 | 369,056.07           | 28,602,490                  | 0         | 51,949             | 51,949    |
| -9,000.00000             |                                | 8/3/2016 | BKH               | -9,000.00              | -689,271                      | 1.000000000F<br>77.501746696 | -9,000.00            | -697,516                    | 0         | -8,245             | -8,245    |
| -14,000.00000            |                                | 8/5/2016 | BKH               | -14,000.00             | -1,082,289                    | 1.000000000F<br>77.501746696 | -14,000.00           | -1,085,024                  | 0         | -2,735             | -2,735    |
| 346,056.07000<br>0.00000 | 合計 -----                       |          |                   | 346,056                | 26,778,981                    |                              | 346,056              | 26,819,950                  | 0         | 40,969             | 40,969    |
| 928,103.02000            | BRL FORWARD 14 OCT<br>FBR14OCT | 8/1/2016 |                   | 928,103.02             | 29,111,121                    | 1.000000000F<br>0.031752830  | 928,103.02           | 29,228,986                  | 0         | 117,865            | 117,865   |
| -22,000.00000            |                                | 8/3/2016 | BKH               | -22,000.00             | -665,121                      | 1.000000000F<br>0.031752830  | -22,000.00           | -692,852                    | 0         | -27,731            | -27,731   |
| -35,000.00000            |                                | 8/5/2016 | BKH               | -35,000.00             | -1,092,745                    | 1.000000000F<br>0.031752830  | -35,000.00           | -1,102,264                  | 0         | -9,519             | -9,519    |
| 871,103.02000<br>0.00000 | 合計 -----                       |          |                   | 871,103                | 27,353,255                    |                              | 871,103              | 27,433,870                  | 0         | 80,615             | 80,615    |
| 6,566.18000              | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/3/2016 |                   | 6,566.18               | 665,121                       | 1.000000000F<br>0.009686497  | 6,566.18             | 677,869                     | 0         | 12,748             | 12,748    |
| 6,804.59000              |                                | 8/3/2016 | BKH               | 6,804.59               | 689,271                       | 1.000000000F<br>0.009686497  | 6,804.59             | 702,482                     | 0         | 13,211             | 13,211    |
| 6,904.28000              |                                | 8/3/2016 | BKH               | 6,904.28               | 699,369                       | 1.000000000F<br>0.009686497  | 6,904.28             | 712,774                     | 0         | 13,405             | 13,405    |
| 10,623.69000             |                                | 8/5/2016 | BKH               | 10,623.69              | 1,082,289                     | 1.000000000F<br>0.009686497  | 10,623.69            | 1,096,753                   | 0         | 14,464             | 14,464    |
| 10,726.33000             |                                | 8/5/2016 | BKH               | 10,726.33              | 1,092,745                     | 1.000000000F<br>0.009686497  | 10,726.33            | 1,107,349                   | 0         | 14,604             | 14,604    |
| 10,746.37000             |                                | 8/5/2016 | BKH               | 10,746.37              | 1,094,787                     | 1.000000000F<br>0.009686497  | 10,746.37            | 1,109,418                   | 0         | 14,631             | 14,631    |
| -278,200.00000           |                                | 8/1/2016 | BKH               | -278,200.00            | -28,550,541                   | 1.000000000F<br>0.009686497  | -278,200.00          | -28,720,393                 | 0         | -169,852           | -169,852  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                    | 種類                             | 取引日      | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|----------------------------|--------------------------------|----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <b>資源国通貨バスケットクラス受益証券</b>   |                                |          |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <b>先物(ポジション)</b>           |                                |          |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <b>非グループ化の有価証券</b>         |                                |          |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| -278,200.00000             |                                | 8/1/2016 |                       | -278,200.00            | -29,111,121                   | 1.000000000F<br>0.009686497 | -278,200.00          | -28,720,393                 | 0         | 390,728            | 390,728    |
| -278,200.00000             |                                | 8/1/2016 | BKH                   | -278,200.00            | -28,887,328                   | 1.000000000F<br>0.009686497 | -278,200.00          | -28,720,393                 | 0         | 166,935            | 166,935    |
| -782,228.56000<br>0.00000  | 合計 -----                       |          | BKH                   | -782,229               | -81,225,408                   |                             | -782,229             | -80,754,534                 | 0         | 470,874            | 470,874    |
| 3,921,368.10000            | ZAR FORWARD 14 OCT<br>FZA14OCT | 8/1/2016 | BKH                   | 3,921,368.10           | 28,887,328                    | 1.000000000F<br>0.143781779 | 3,921,368.10         | 27,273,053                  | 0         | -1,614,275         | -1,614,275 |
| -98,000.00000              |                                | 8/3/2016 | BKH                   | -98,000.00             | -699,369                      | 1.000000000F<br>0.143781779 | -98,000.00           | -681,588                    | 0         | 17,781             | 17,781     |
| -150,000.00000             |                                | 8/5/2016 | BKH                   | -150,000.00            | -1,094,787                    | 1.000000000F<br>0.143781779 | -150,000.00          | -1,043,248                  | 0         | 51,539             | 51,539     |
| 3,673,368.10000<br>0.00000 | 合計 -----                       |          |                       | 3,673,368              | 27,093,172                    |                             | 3,673,368            | 25,548,217                  | 0         | -1,544,955         | -1,544,955 |
| 4,108,298.63000            | 非グループ化の有価証券小<br>計              |          |                       | 4,108,299              | 0                             |                             | 4,108,299            | -952,497                    | 0         | -952,497           | -952,497   |
| 4,108,298.63000            | 先物(ポジション)合計                    |          |                       | 4,108,299              | 0                             |                             | 4,108,299            | -952,497                    | 0         | -952,497           | -952,497   |
| 4,108,298.63000            | 資源国通貨バスケットクラス受益証券合計            |          |                       | 4,108,299              | 0                             |                             | 4,108,299            | -952,497                    | 0         | -952,497           | -952,497   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <b>ブラジル・レアルクラス受益証券</b> |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| <b>先物(ポジション)</b>       |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| <b>非グループ化の有価証券</b>     |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 36,901,529.10000       | BRL FORWARD 09 SEP<br>FBR09SEP | 7/1/2016  | BRH                   | 36,901,529.10          | 1,168,674,832                 | 1.000000000F<br>0.031363991 | 36,901,529.10        | 1,176,557,189               | 0         | 7,882,357          | 7,882,357   |
| 111,713,576.92000      |                                | 7/1/2016  | BRH                   | 111,713,576.92         | 3,537,979,292                 | 1.000000000F<br>0.031363991 | 111,713,576.92       | 3,561,841,888               | 0         | 23,862,596         | 23,862,596  |
| -9,403,000.00000       |                                | 8/18/2016 | BRH                   | -9,403,000.00          | -290,291,642                  | 1.000000000F<br>0.031363991 | -9,403,000.00        | -299,802,407                | 0         | -9,510,765         | -9,510,765  |
| -102,310,576.92000     |                                | 8/30/2016 | BRH                   | -102,310,576.92        | -3,219,837,241                | 1.000000000F<br>0.031363991 | -102,310,576.92      | -3,262,039,481              | 0         | -42,202,240        | -42,202,240 |
| -36,901,529.10000      |                                | 8/30/2016 | BRH                   | -36,901,529.10         | -1,160,553,863                | 1.000000000F<br>0.031363991 | -36,901,529.10       | -1,176,557,189              | 0         | -16,003,326        | -16,003,326 |
| 0.00000                | 合計 -----                       |           |                       | 0                      | 35,971,378                    |                             | 0                    | 0                           | 0         | -35,971,378        | -35,971,378 |
| 0.00000                |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 36,749,109.39000       | BRL FORWARD 14 NOV<br>FBR14NOV | 8/30/2016 | BRH                   | 36,749,109.39          | 1,158,506,984                 | 1.000000000F<br>0.032091905 | 36,749,109.39        | 1,145,120,846               | 0         | -13,386,138        | -13,386,138 |
| 101,790,900.00000      |                                | 8/30/2016 | BRH                   | 101,790,900.00         | 3,208,934,052                 | 1.000000000F<br>0.032091905 | 101,790,900.00       | 3,171,855,956               | 0         | -37,078,096        | -37,078,096 |
| 138,540,009.39000      | 合計 -----                       |           |                       | 138,540,009            | 4,367,441,036                 |                             | 138,540,009          | 4,316,976,802               | 0         | -50,464,234        | -50,464,234 |
| 0.00000                |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 37,885,957.50000       | BRL FORWARD 14 OCT<br>FBR14OCT | 8/1/2016  | BRH                   | 37,885,957.50          | 1,188,340,805                 | 1.000000000F<br>0.031752830 | 37,885,957.50        | 1,193,152,154               | 0         | 4,811,349          | 4,811,349   |
| 97,161,577.23000       |                                | 8/1/2016  | BRH                   | 97,161,577.23          | 3,047,595,324                 | 1.000000000F<br>0.031752830 | 97,161,577.23        | 3,059,934,413               | 0         | 12,339,089         | 12,339,089  |
| -2,210,000.00000       |                                | 8/5/2016  | BRH                   | -2,210,000.00          | -68,999,011                   | 1.000000000F<br>0.031752830 | -2,210,000.00        | -69,600,095                 | 0         | -601,084           | -601,084    |
| 132,837,534.73000      | 合計 -----                       |           |                       | 132,837,535            | 4,166,937,118                 |                             | 132,837,535          | 4,183,486,472               | 0         | 16,549,354         | 16,549,354  |
| 0.00000                |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 2,898,135.31000        | USD FORWARD 09 SEP<br>FUS09SEP | 8/18/2016 | BRH                   | 2,898,135.31           | 290,291,641                   | 1.000000000F<br>0.009672038 | 2,898,135.31         | 299,640,604                 | 0         | 9,348,963          | 9,348,963   |
| 11,291,086.56000       |                                | 8/30/2016 | BRH                   | 11,291,086.56          | 1,160,553,863                 | 1.000000000F<br>0.009672038 | 11,291,086.56        | 1,167,394,768               | 0         | 6,840,905          | 6,840,905   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                      | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>ブラジル・リアルクラス受益証券</u>       |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| <u>先物（ポジション）</u>             |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>           |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 31,325,957.42000             |                                | 8/30/2016 |                       | 31,325,957.42          | 3,219,837,232                 | 1.000000000F<br>0.009672038 | 31,325,957.42        | 3,238,816,620               | 0         | 18,979,388         | 18,979,388  |
| -33,823,900.00000            |                                | 7/1/2016  | BRH                   | -33,823,900.00         | -3,537,979,291                | 1.000000000F<br>0.009672038 | -33,823,900.00       | -3,497,080,967              | 0         | 40,898,324         | 40,898,324  |
| -11,163,000.00000            |                                | 7/1/2016  | BRH                   | -11,163,000.00         | -1,168,674,841                | 1.000000000F<br>0.009672038 | -11,163,000.00       | -1,154,151,793              | 0         | 14,523,048         | 14,523,048  |
| 528,279.29000<br>0.00000     | 合計 -----                       |           |                       | 528,279                | -35,971,396                   |                             | 528,279              | 54,619,232                  | 0         | 90,590,628         | 90,590,628  |
| -30,600,000.00000            | USD FORWARD 14 NOV<br>FUS14NOV | 8/30/2016 | BRH                   | -30,600,000.00         | -3,208,934,075                | 1.000000000F<br>0.009699180 | -30,600,000.00       | -3,154,905,879              | 0         | 54,028,196         | 54,028,196  |
| -11,036,100.00000            |                                | 8/30/2016 | BRH                   | -11,036,100.00         | -1,158,506,989                | 1.000000000F<br>0.009699180 | -11,036,100.00       | -1,137,838,456              | 0         | 20,668,533         | 20,668,533  |
| -41,636,100.00000<br>0.00000 | 合計 -----                       |           |                       | -41,636,100            | -4,367,441,064                |                             | -41,636,100          | -4,292,744,335              | 0         | 74,696,729         | 74,696,729  |
| 677,290.84000                | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/5/2016  | BRH                   | 677,290.84             | 68,999,011                    | 1.000000000F<br>0.009686497 | 677,290.84           | 69,921,132                  | 0         | 922,121            | 922,121     |
| -29,124,300.00000            |                                | 8/1/2016  | BRH                   | -29,124,300.00         | -3,047,595,333                | 1.000000000F<br>0.009686497 | -29,124,300.00       | -3,006,690,654              | 0         | 40,904,679         | 40,904,679  |
| -11,355,000.00000            |                                | 8/1/2016  | BRH                   | -11,355,000.00         | -1,188,340,810                | 1.000000000F<br>0.009686497 | -11,355,000.00       | -1,172,250,402              | 0         | 16,090,408         | 16,090,408  |
| -39,802,009.16000<br>0.00000 | 合計 -----                       |           |                       | -39,802,009            | -4,166,937,132                |                             | -39,802,009          | -4,109,019,924              | 0         | 57,917,208         | 57,917,208  |
| 190,467,714.25000            | 非グループ化の有価証券小<br>計              |           |                       | 190,467,714            | -60                           |                             | 190,467,714          | 153,318,247                 | 0         | 153,318,307        | 153,318,307 |
| 190,467,714.25000            | 先物（ポジション）合計                    |           |                       | 190,467,714            | -60                           |                             | 190,467,714          | 153,318,247                 | 0         | 153,318,307        | 153,318,307 |
| 190,467,714.25000            | ブラジル・リアルクラス受益証券合計              |           |                       | 190,467,714            | -60                           |                             | 190,467,714          | 153,318,247                 | 0         | 153,318,307        | 153,318,307 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額            | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                          | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|--------------------|--------------------------------|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>ユーロクラス受益証券</u>  |                                |           |                   |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |           |
| <u>先物(ポジション)</u>   |                                |           |                   |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u> |                                |           |                   |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |           |
| 124,221.38000      | EUR FORWARD 09 SEP<br>FEU09SEP | 7/1/2016  |                   | 124,221.38             | 14,196,846                    | 1.000000000F<br>115.198215810 | 124,221.38           | 14,310,081                  | 0         | 113,235            | 113,235   |
| 5,138.28000        |                                | 7/15/2016 | EUH               | 5,138.28               | 601,924                       | 1.000000000F<br>115.198215810 | 5,138.28             | 591,921                     | 0         | -10,003            | -10,003   |
| -129,359.66000     |                                | 8/30/2016 | EUH               | -129,359.66            | -14,831,011                   | 1.000000000F<br>115.198215810 | -129,359.66          | -14,902,002                 | 0         | -70,991            | -70,991   |
| 0.00000            | 合計 -----                       |           |                   | 0                      | -32,241                       |                               | 0                    | 0                           | 0         | 32,241             | 32,241    |
| 127,558.77000      | EUR FORWARD 14 NOV<br>FEU14NOV | 8/30/2016 | EUH               | 127,558.77             | 14,620,869                    | 1.000000000F<br>115.202595284 | 127,558.77           | 14,695,101                  | 0         | 74,232             | 74,232    |
| 126,101.04000      | EUR FORWARD 14 OCT<br>FEU14OCT | 8/1/2016  | EUH               | 126,101.04             | 14,421,244                    | 1.000000000F<br>115.199197845 | 126,101.04           | 14,526,739                  | 0         | 105,495            | 105,495   |
| 144,291.65000      | USD FORWARD 09 SEP<br>FUS09SEP | 8/30/2016 | EUH               | 144,291.65             | 14,831,011                    | 1.000000000F<br>0.009672038   | 144,291.65           | 14,918,433                  | 0         | 87,422             | 87,422    |
| -138,600.00000     |                                | 7/1/2016  | EUH               | -138,600.00            | -14,196,846                   | 1.000000000F<br>0.009672038   | -138,600.00          | -14,329,969                 | 0         | -133,123           | -133,123  |
| -5,700.00000       |                                | 7/15/2016 | EUH               | -5,700.00              | -601,924                      | 1.000000000F<br>0.009672038   | -5,700.00            | -589,328                    | 0         | 12,596             | 12,596    |
| -8.35000           | 合計 -----                       |           |                   | -8                     | 32,241                        |                               | -8                   | -864                        | 0         | -33,105            | -33,105   |
| -142,700.00000     | USD FORWARD 14 NOV<br>FUS14NOV | 8/30/2016 | EUH               | -142,700.00            | -14,620,869                   | 1.000000000F<br>0.009699180   | -142,700.00          | -14,712,584                 | 0         | -91,715            | -91,715   |
| -141,300.00000     | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/1/2016  | EUH               | -141,300.00            | -14,421,244                   | 1.000000000F<br>0.009686497   | -141,300.00          | -14,587,317                 | 0         | -166,073           | -166,073  |
| -30,348.54000      | 非グループ化の有価証券小計                  |           |                   | -30,349                | 0                             |                               | -30,349              | -78,925                     | 0         | -78,925            | -78,925   |
| -30,348.54000      | 先物(ポジション)合計                    |           |                   | -30,349                | 0                             |                               | -30,349              | -78,925                     | 0         | -78,925            | -78,925   |
| -30,348.54000      | ユーロクラス受益証券合計                   |           |                   | -30,349                | 0                             |                               | -30,349              | -78,925                     | 0         | -78,925            | -78,925   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                      | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|--------------|
| 日本円クラス受益証券                   |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |              |
| 先物(ポジション)                    |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |              |
| 非グループ化の有価証券                  |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |              |
| 224,944,136.19000            | USD FORWARD 09 SEP<br>FUS09SEP | 8/30/2016 |                       | 224,944,136.19         | 23,119,196,020                | 1.000000000F<br>0.009672038 | 224,944,136.19       | 23,257,160,093              | 0         | 137,964,073        | 137,964,073  |
| -217,107,900.00000           |                                | 7/1/2016  | JPH                   | -217,107,900.00        | -22,245,635,360               | 1.000000000F<br>0.009672038 | -217,107,900.00      | -22,446,965,159             | 0         | -201,329,799       | -201,329,799 |
| -8,274,000.00000             |                                | 7/15/2016 | JPH                   | -8,274,000.00          | -873,560,648                  | 1.000000000F<br>0.009672038 | -8,274,000.00        | -855,455,696                | 0         | 18,104,952         | 18,104,952   |
| -437,763.81000<br>0.00000    | 合計 -----                       |           | JPH                   | -437,764               | 12                            |                             | -437,764             | -45,260,762                 | 0         | -45,260,774        | -45,260,774  |
| -224,370,600.00000           | USD FORWARD 14 NOV<br>FUS14NOV | 8/30/2016 | JPH                   | -224,370,600.00        | -22,990,806,684               | 1.000000000F<br>0.009699180 | -224,370,600.00      | -23,132,945,259             | 0         | -142,138,575       | -142,138,575 |
| -51,196,500.00000            | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/1/2016  | JPH                   | -51,196,500.00         | -5,226,957,877                | 1.000000000F<br>0.009686497 | -51,196,500.00       | -5,285,347,221              | 0         | -58,389,344        | -58,389,344  |
| -2,135,000.00000             |                                | 8/18/2016 | JPH                   | -2,135,000.00          | -213,288,635                  | 1.000000000F<br>0.009686497 | -2,135,000.00        | -220,409,917                | 0         | -7,121,282         | -7,121,282   |
| -53,331,500.00000<br>0.00000 | 合計 -----                       |           | JPH                   | -53,331,500            | -5,440,246,512                |                             | -53,331,500          | -5,505,757,138              | 0         | -65,510,626        | -65,510,626  |
| -278,139,863.81000           | 非グループ化の有価証券小計                  |           |                       | -278,139,864           | -28,431,053,184               |                             | -278,139,864         | -28,683,963,159             | 0         | -252,909,975       | -252,909,975 |
| -278,139,863.81000           | 先物(ポジション)合計                    |           |                       | -278,139,864           | -28,431,053,184               |                             | -278,139,864         | -28,683,963,159             | 0         | -252,909,975       | -252,909,975 |
| -278,139,863.81000           | 日本円クラス受益証券合計                   |           |                       | -278,139,864           | -28,431,053,184               |                             | -278,139,864         | -28,683,963,159             | 0         | -252,909,975       | -252,909,975 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額               | 種類                 | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|-----------------------|--------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|--------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>メキシコ・ペソクラス受益証券</u> |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>先物(ポジション)</u>      |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>    |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| 37,628,395.95         | MXN FORWARD 09 SEP | 7/1/2016  |                       | 37,628,395.95          | 211,188,958                   | 1.000000000F | 37,628,395.95        | 206,005,463                 | 0         | -5,183,495         | -5,183,495 |
|                       | FMX09SEP           |           | MXH                   |                        |                               | 0.182657272  |                      |                             |           |                    |            |
| -37,628,395.95        |                    | 8/30/2016 |                       | -37,628,395.95         | -205,413,767                  | 1.000000000F | -37,628,395.95       | -206,005,463                | 0         | -591,696           | -591,696   |
|                       |                    |           | MXH                   |                        |                               | 0.182657272  |                      |                             |           |                    |            |
| 0.00000               | 合計 -----           |           |                       | 0                      | 5,775,191                     |              | 0                    | 0                           | 0         | -5,775,191         | -5,775,191 |
| 0.00000               |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| 37,356,585.75         | MXN FORWARD 14 NOV | 8/30/2016 |                       | 37,356,585.75          | 204,133,551                   | 1.000000000F | 37,356,585.75        | 202,671,527                 | 0         | -1,462,024         | -1,462,024 |
|                       | FMX14NOV           |           | MXH                   |                        |                               | 0.184320838  |                      |                             |           |                    |            |
| 32,986,369.68         | MXN FORWARD 14 OCT | 8/1/2016  |                       | 32,986,369.68          | 179,099,439                   | 1.000000000F | 32,986,369.68        | 179,703,072                 | 0         | 603,633            | 603,633    |
|                       | FMX14OCT           |           | MXH                   |                        |                               | 0.183560411  |                      |                             |           |                    |            |
| 1,998,480.81000       | USD FORWARD 09 SEP | 8/30/2016 |                       | 1,998,480.81           | 205,413,767                   | 1.000000000F | 1,998,480.81         | 206,624,582                 | 0         | 1,210,815          | 1,210,815  |
|                       | FUS09SEP           |           | MXH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| -2,043,500.00000      |                    | 7/1/2016  |                       | -2,043,500.00          | -211,188,960                  | 1.000000000F | -2,043,500.00        | -211,279,153                | 0         | -90,193            | -90,193    |
|                       |                    |           | MXH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| -45,019.19000         | 合計 -----           |           |                       | -45,019                | -5,775,193                    |              | -45,019              | -4,654,571                  | 0         | 1,120,622          | 1,120,622  |
| 0.00000               |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| -1,972,500.00000      | USD FORWARD 14 NOV | 8/30/2016 |                       | -1,972,500.00          | -204,133,553                  | 1.000000000F | -1,972,500.00        | -203,367,707                | 0         | 765,846            | 765,846    |
|                       | FUS14NOV           |           | MXH                   |                        |                               | 0.009699180  |                      |                             |           |                    |            |
| -1,736,600.00000      | USD FORWARD 14 OCT | 8/1/2016  |                       | -1,736,600.00          | -179,099,440                  | 1.000000000F | -1,736,600.00        | -179,280,497                | 0         | -181,057           | -181,057   |
|                       | FUS14OCT           |           | MXH                   |                        |                               | 0.009686497  |                      |                             |           |                    |            |
| 66,588,836.24000      | 非グループ化の有価証券小計      |           |                       | 66,588,836             | -5                            |              | 66,588,836           | -4,928,176                  | 0         | -4,928,171         | -4,928,171 |
| 66,588,836.24000      | 先物(ポジション)合計        |           |                       | 66,588,836             | -5                            |              | 66,588,836           | -4,928,176                  | 0         | -4,928,171         | -4,928,171 |
| 66,588,836.24000      | メキシコ・ペソクラス受益証券合計   |           |                       | 66,588,836             | -5                            |              | 66,588,836           | -4,928,176                  | 0         | -4,928,171         | -4,928,171 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額           | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| ロシア・ルーブルクラス受益証券   |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 先物(ポジション)         |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券       |                                |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 370,245,093.00    | RUB FORWARD 09 SEP<br>FRU09SEP | 7/1/2016  |                       | 370,245,093.00         | 593,050,807                   | 1.000000000F<br>0.633496772 | 370,245,093.00       | 584,446,692                 | 0         | -8,604,115         | -8,604,115  |
| 10,303,130.00     |                                | 7/15/2016 | RUH                   | 10,303,130.00          | 17,279,521                    | 1.000000000F<br>0.633496772 | 10,303,130.00        | 16,263,903                  | 0         | -1,015,618         | -1,015,618  |
| -25,574,000.00    |                                | 8/4/2016  | RUH                   | -25,574,000.00         | -38,680,468                   | 1.000000000F<br>0.633496772 | -25,574,000.00       | -40,369,582                 | 0         | -1,689,114         | -1,689,114  |
| -354,974,223.00   |                                | 8/30/2016 | RUH                   | -354,974,223.00        | -557,826,102                  | 1.000000000F<br>0.633496772 | -354,974,223.00      | -560,341,013                | 0         | -2,514,911         | -2,514,911  |
| 0.00000           | 合計 -----                       |           |                       | 0                      | 13,823,758                    |                             | 0                    | 0                           | 0         | -13,823,758        | -13,823,758 |
| 354,250,164.60    | RUB FORWARD 14 NOV<br>FRU14NOV | 8/30/2016 | RUH                   | 354,250,164.60         | 558,189,651                   | 1.000000000F<br>0.645293910 | 354,250,164.60       | 548,974,908                 | 0         | -9,214,743         | -9,214,743  |
| 301,061,297.60    | RUB FORWARD 14 OCT<br>FRU14OCT | 8/1/2016  | RUH                   | 301,061,297.60         | 463,465,673                   | 1.000000000F<br>0.639807701 | 301,061,297.60       | 470,549,662                 | 0         | 7,083,989          | 7,083,989   |
| 382,615.20000     | USD FORWARD 09 SEP<br>FUS09SEP | 8/4/2016  | RUH                   | 382,615.20             | 38,680,468                    | 1.000000000F<br>0.009672038 | 382,615.20           | 39,558,902                  | 0         | 878,434            | 878,434     |
| 5,427,118.04000   |                                | 8/30/2016 | RUH                   | 5,427,118.04           | 557,826,102                   | 1.000000000F<br>0.009672038 | 5,427,118.04         | 561,114,218                 | 0         | 3,288,116          | 3,288,116   |
| -5,683,400.00000  |                                | 7/1/2016  | RUH                   | -5,683,400.00          | -593,050,808                  | 1.000000000F<br>0.009672038 | -5,683,400.00        | -587,611,422                | 0         | 5,439,386          | 5,439,386   |
| -160,360.00000    |                                | 7/15/2016 | RUH                   | -160,360.00            | -17,279,521                   | 1.000000000F<br>0.009672038 | -160,360.00          | -16,579,753                 | 0         | 699,768            | 699,768     |
| -34,026.76000     | 合計 -----                       |           |                       | -34,027                | -13,823,759                   |                             | -34,027              | -3,518,055                  | 0         | 10,305,704         | 10,305,704  |
| -5,331,600.00000  | USD FORWARD 14 NOV<br>FUS14NOV | 8/30/2016 | RUH                   | -5,331,600.00          | -558,189,654                  | 1.000000000F<br>0.009699180 | -5,331,600.00        | -549,695,954                | 0         | 8,493,700          | 8,493,700   |
| -4,446,400.00000  | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/1/2016  | RUH                   | -4,446,400.00          | -463,465,674                  | 1.000000000F<br>0.009686497 | -4,446,400.00        | -459,030,752                | 0         | 4,434,922          | 4,434,922   |
| 645,499,435.44000 | 非グループ化の有価証券小計                  |           |                       | 645,499,435            | -5                            |                             | 645,499,435          | 7,279,809                   | 0         | 7,279,814          | 7,279,814   |
| 645,499,435.44000 | 先物(ポジション)合計                    |           |                       | 645,499,435            | -5                            |                             | 645,499,435          | 7,279,809                   | 0         | 7,279,814          | 7,279,814   |
| 645,499,435.44000 | ロシア・ルーブルクラス受益証券合計              |           |                       | 645,499,435            | -5                            |                             | 645,499,435          | 7,279,809                   | 0         | 7,279,814          | 7,279,814   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額        | 種類                 | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|----------------|--------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|--------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| トルコ・リラクラス受益証券  |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| 先物(ポジション)      |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| 非グループ化の有価証券    |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| 1,419,723.86   | TRY FORWARD 09 SEP | 7/1/2016  |                       | 1,419,723.86           | 50,371,788                    | 1.000000000F | 1,419,723.86         | 49,503,007                  | 0         | -868,781           | -868,781   |
|                | FTR09SEP           |           | TRH                   |                        |                               | 0.028679548  |                      |                             |           |                    |            |
| 45,068.25      |                    | 7/15/2016 |                       | 45,068.25              | 1,606,475                     | 1.000000000F | 45,068.25            | 1,571,442                   | 0         | -35,033            | -35,033    |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.028679548  |                      |                             |           |                    |            |
| -89,000.00     |                    | 8/3/2016  |                       | -89,000.00             | -2,962,571                    | 1.000000000F | -89,000.00           | -3,103,257                  | 0         | -140,686           | -140,686   |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.028679548  |                      |                             |           |                    |            |
| -77,000.00     |                    | 8/4/2016  |                       | -77,000.00             | -2,560,376                    | 1.000000000F | -77,000.00           | -2,684,840                  | 0         | -124,464           | -124,464   |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.028679548  |                      |                             |           |                    |            |
| -1,298,792.11  |                    | 8/30/2016 |                       | -1,298,792.11          | -44,963,386                   | 1.000000000F | -1,298,792.11        | -45,286,352                 | 0         | -322,966           | -322,966   |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.028679548  |                      |                             |           |                    |            |
| 0.00000        | 合計 -----           |           |                       | 0                      | 1,491,930                     |              | 0                    | 0                           | 0         | -1,491,930         | -1,491,930 |
| 0.00000        |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |
| 1,285,227.30   | TRY FORWARD 14 NOV | 8/30/2016 |                       | 1,285,227.30           | 44,588,400                    | 1.000000000F | 1,285,227.30         | 44,071,292                  | 0         | -517,108           | -517,108   |
|                | FTR14NOV           |           | TRH                   |                        |                               | 0.029162460  |                      |                             |           |                    |            |
| 1,133,337.42   | TRY FORWARD 14 OCT | 8/1/2016  |                       | 1,133,337.42           | 38,790,263                    | 1.000000000F | 1,133,337.42         | 39,165,510                  | 0         | 375,247            | 375,247    |
|                | FTR14OCT           |           | TRH                   |                        |                               | 0.028937129  |                      |                             |           |                    |            |
| 29,246.97000   | USD FORWARD 09 SEP | 8/3/2016  |                       | 29,246.97              | 2,962,571                     | 1.000000000F | 29,246.97            | 3,023,868                   | 0         | 61,297             | 61,297     |
|                | FUS09SEP           |           | TRH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| 25,326.45000   |                    | 8/4/2016  |                       | 25,326.45              | 2,560,376                     | 1.000000000F | 25,326.45            | 2,618,523                   | 0         | 58,147             | 58,147     |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| 437,451.03000  |                    | 8/30/2016 |                       | 437,451.03             | 44,963,386                    | 1.000000000F | 437,451.03           | 45,228,423                  | 0         | 265,037            | 265,037    |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| -483,600.00000 |                    | 7/1/2016  |                       | -483,600.00            | -50,371,788                   | 1.000000000F | -483,600.00          | -49,999,804                 | 0         | 371,984            | 371,984    |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| -15,400.00000  |                    | 7/15/2016 |                       | -15,400.00             | -1,606,475                    | 1.000000000F | -15,400.00           | -1,592,219                  | 0         | 14,256             | 14,256     |
|                |                    |           | TRH                   |                        |                               | 0.009672038  |                      |                             |           |                    |            |
| -6,975.55000   | 合計 -----           |           |                       | -6,976                 | -1,491,930                    |              | -6,976               | -721,209                    | 0         | 770,721            | 770,721    |
| 0.00000        |                    |           |                       |                        |                               |              |                      |                             |           |                    |            |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|-----------------|--------------------------------|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| トルコ・リラクラス受益証券   |                                |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |           |
| 先物(ポジション)       |                                |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |           |
| 非グループ化の有価証券     |                                |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |           |
| -427,000.00000  | USD FORWARD 14 NOV<br>FUS14NOV | 8/30/2016 | TRH               | -427,000.00            | -44,588,400                   | 1.000000000F<br>0.009699180 | -427,000.00          | -44,024,340                 | 0         | 564,060            | 564,060   |
| -372,600.00000  | USD FORWARD 14 OCT<br>FUS14OCT | 8/1/2016  |                   | -372,600.00            | -38,790,263                   | 1.000000000F<br>0.009686497 | -372,600.00          | -38,465,918                 | 0         | 324,345            | 324,345   |
| 1,611,989.17000 | 非グループ化の有価証券小計                  |           |                   | 1,611,989              | 0                             |                             | 1,611,989            | 25,335                      | 0         | 25,335             | 25,335    |
| 1,611,989.17000 | 先物(ポジション)合計                    |           |                   | 1,611,989              | 0                             |                             | 1,611,989            | 25,335                      | 0         | 25,335             | 25,335    |
| 1,611,989.17000 | トルコ・リラクラス受益証券合計                |           |                   | 1,611,989              | 0                             |                             | 1,611,989            | 25,335                      | 0         | 25,335             | 25,335    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                   | 種類                                                         | 取引日        | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円)   | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|---------------------------|------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------|--------------------|--------------|
| <b>クラスに割当てられていない資産</b>    |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| <b>現金</b>                 |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| <b>基準通貨現金</b>             |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| 107,389,341.00000         | JPY CASH                                                   | 8/31/2016  |                       | 107,389,341            | 107,389,341                   | 1.000000000                                 | 107,389,341          | 107,389,341                 | 0           | 0                  | 0            |
|                           | CASHJPY                                                    |            |                       |                        |                               | 1.000000000                                 |                      |                             |             |                    |              |
| 107,389,341.00000         | 基準通貨現金小計                                                   |            |                       | 107,389,341            | 107,389,341                   |                                             | 107,389,341          | 107,389,341                 | 0           | 0                  | 0            |
| 107,389,341.00000         | 現金合計                                                       |            |                       | 107,389,341            | 107,389,341                   |                                             | 107,389,341          | 107,389,341                 | 0           | 0                  | 0            |
| <b>社債</b>                 |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| <b>固定利率から変動利率に転換される社債</b> |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| 5,900,000.00000           | ASR NEDERLAND NV<br>FRN 09292045<br>BNLD12AD XS1293505639  | 9/22/2015  |                       | 5,877,627.68           | 777,249,320                   | 108.532997131 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 6,403,446.83         | 737,681,757                 | 60,574,751  | -100,142,313       | -39,567,562  |
| 6,250,000.00              | AVIVA PLC<br>FRN 06042050<br>BGBR22DX XS1242413166         | 5/29/2015  |                       | 6,254,385.50           | 1,186,043,097                 | 107.503997803 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 6,718,999.86         | 910,214,980                 | 62,940,759  | -338,768,877       | -275,828,118 |
| 11,600,000.00             | AXA SA<br>FRN PERP/CALL<br>BFRA10DI XS1134541561           | 5/24/2013  |                       | 12,498,319.25          | 2,110,132,576                 | 107.543998718 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 12,475,103.85        | 1,689,987,592               | -3,144,963  | -417,000,022       | -420,144,985 |
| 2,300,000.00000           | BARCLAYS PLC<br>FRN 11112025<br>BGBR22FO XS1319647068      | 11/4/2015  |                       | 2,288,431.00           | 302,209,165                   | 98.238998413 <sup>C</sup><br>115.200731246  | 2,259,496.96         | 260,295,702                 | -3,333,222  | -38,580,240        | -41,913,462  |
| 5,800,000.00000           | BBVA SUB CAP UNI<br>FRN 04112024<br>BESPO25A XS1055241373  | 2/9/2015   |                       | 6,103,236.00           | 823,557,868                   | 104.657997131 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 6,070,163.83         | 699,287,312                 | -3,809,938  | -120,460,618       | -124,270,556 |
| 12,200,000.00000          | CAIXABANK<br>FRN 11142023<br>BESPO259 XS0989061345         | 2/9/2015   |                       | 13,256,138.00          | 1,768,735,194                 | 106.045997620 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 12,937,611.71        | 1,490,422,330               | -36,694,462 | -241,618,403       | -278,312,865 |
| 4,100,000.00000           | CREDIT AGRICOLE<br>FRN PERP/CALL<br>BFRA10I15 US225313AA37 | 7/7/2016   |                       | 4,069,500.00           | 415,223,661                   | 101.008003235 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 4,141,328.13         | 428,358,292                 | 7,429,543   | 5,705,088          | 13,134,631   |
| 6,910,000.00000           | DAI-ICHI MUTUAL<br>FRN PERP/CALL<br>BJPN303K US23380YAC12  | 10/23/2014 |                       | 7,095,133.09           | 796,992,374                   | 111.059997559 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 7,674,245.83         | 793,785,649                 | 59,900,529  | -63,107,254        | -3,206,725   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                   | 種類                                                         | 取引日        | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円)   | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|---------------------------|------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------|--------------------|--------------|
| <b>クラスに割当てられていない資産</b>    |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| <b>社債</b>                 |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| <b>固定利率から変動利率に転換される社債</b> |                                                            |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| 9,400,000.00000           | FUKOKU MUTUAL<br>FRN PERP/CALL<br>BJPN3042 XS1262602532    | 7/22/2015  |                       | 9,400,000.00           | 1,166,022,935                 | 109.217002869 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 10,266,398.27        | 1,061,904,947               | 89,615,909  | -193,733,897       | -104,117,988 |
| 7,150,000.00000           | GENERALI FINANCE<br>FRN PERP/CALL<br>BNLD1280 XS1140860534 | 11/14/2014 |                       | 7,253,750.00           | 1,014,869,196                 | 98.325996399 <sup>C</sup><br>115.200731246  | 7,030,308.74         | 809,896,708                 | -25,740,596 | -179,231,892       | -204,972,488 |
| 6,100,000.00              | HISCOX LTD<br>FRN 11242045<br>BBMU003B XS1323450236        | 11/17/2015 |                       | 6,066,500.00           | 1,061,449,735                 | 106.074996948 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 6,470,574.81         | 876,561,131                 | 54,739,538  | -239,628,142       | -184,888,604 |
| 5,950,000.00000           | HSBC HOLDINGS<br>FRN PERP/CALL<br>BGBR22CP XS1111123987    | 4/8/2015   |                       | 6,255,463.85           | 805,448,653                   | 98.333999634 <sup>C</sup><br>115.200731246  | 5,850,872.98         | 674,024,846                 | -46,609,164 | -84,814,643        | -131,423,807 |
| 5,000,000.00              | LEGAL & GENL GRP<br>FRN 10272045<br>BGBR22EX XS1310962839  | 10/20/2015 |                       | 4,991,326.00           | 924,386,234                   | 108.024002075 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 5,401,200.10         | 731,694,202                 | 55,525,161  | -248,217,193       | -192,692,032 |
| 14,300,000.00000          | NN GROUP NV<br>FRN PERP/CALL<br>BNLD127Z XS1028950290      | 11/10/2014 |                       | 14,244,655.00          | 2,051,282,311                 | 104.149002075 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 14,893,307.30        | 1,715,719,891               | 74,725,219  | -410,287,639       | -335,562,420 |
| 12,500,000.00000          | NORDEA BANK AB<br>FRN PERP/CALL<br>BSWE0367 XS1202090947   | 4/9/2015   |                       | 12,478,639.24          | 1,501,103,453                 | 97.571998596 <sup>C</sup><br>0.009667907    | 12,196,499.82        | 1,261,545,009               | -29,183,092 | -210,375,352       | -239,558,444 |
| 10,900,000.00000          | RABOBANK<br>FRN PERP/CALL<br>BNLD128M XS1171914515         | 4/8/2015   |                       | 11,543,645.00          | 1,494,505,414                 | 101.487998962 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 11,062,191.89        | 1,274,372,595               | -55,463,751 | -164,669,069       | -220,132,820 |
| 11,500,000.00000          | SOCIETE GENERALE<br>FRN 09162026<br>BFRA10CK XS1110558407  | 9/9/2014   |                       | 11,424,659.00          | 1,567,283,607                 | 102.806999207 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 11,822,804.91        | 1,361,995,771               | 45,866,700  | -251,154,536       | -205,287,836 |
| 4,400,000.00000           | SWEDBANK AB<br>FRN PERP/CALL<br>BSWE0364 XS1190655776      | 3/24/2015  |                       | 4,407,382.22           | 528,508,290                   | 102.843002319 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 4,525,092.10         | 468,052,920                 | 12,175,322  | -72,630,692        | -60,455,370  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                   | 種類                                                                            | 取引日        | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円)   | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)      |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------|--------------------|----------------|
| <b>クラスに割当てられていない資産</b>    |                                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |                |
| <b>社債</b>                 |                                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |                |
| <b>固定利率から変動利率に転換される社債</b> |                                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |                |
| 2,550,000.00              | TSB BANKING<br>FRN 05062026                                                   | 8/3/2016   |                       | 2,592,177.00           | 349,880,616                   | 105.267997742 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 2,684,333.94         | 363,643,550                 | 12,484,392  | 1,278,542          | 13,762,934     |
| 3,000,000.00000           | BGBR22GV XS1061206337<br>VONOVIA BV<br>FRN PERP/CALL<br>BNLD12BW XS1117300837 | 7/11/2016  |                       | 3,090,000.00           | 342,824,315                   | 107.512001038 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 3,225,360.03         | 371,563,834                 | 15,593,575  | 13,145,945         | 28,739,520     |
| 147,810,000.00000         | 固定利率から変動利率に転換される社債小計                                                          |            |                       | 151,190,968            | 20,987,708,014                |                                             | 154,109,342          | 17,981,009,018              | 347,592,210 | -3,354,291,207     | -3,006,698,997 |
| <b>変動利率</b>               |                                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |                |
| 16,820,000.00000          | AMERICAN EXPRESS<br>FRN 09012066                                              | 11/9/2011  |                       | 17,258,467.60          | 1,399,095,402                 | 100.050000000 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 16,828,410.00        | 1,740,646,657               | -44,483,010 | 386,034,265        | 341,551,255    |
| 3,000,000.00000           | BUSA7950 US025816AU39<br>AVIVA PLC<br>FRN 07052043                            | 9/11/2013  |                       | 3,137,000.00           | 417,938,836                   | 117.482002258 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 3,524,460.07         | 406,020,377                 | 44,635,683  | -56,554,142        | -11,918,459    |
| 4,200,000.00000           | BGBR2263 XS0951553592<br>BPCE<br>FRN 08292049                                 | 4/20/2012  |                       | 4,326,000.00           | 352,763,658                   | 127.278999329 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 5,345,717.97         | 552,934,360                 | 105,474,533 | 94,696,170         | 200,170,703    |
| 5,745,000.00              | BFRA1041 USF11494AA36<br>DANSKE BANK<br>FRN 09292021                          | 11/10/2011 |                       | 5,475,973.55           | 757,817,965                   | 105.366996765 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 6,053,333.96         | 820,038,006                 | 78,214,334  | -15,994,293        | 62,220,041     |
| 5,700,000.00              | BDNK0229 XS0176929684<br>DNB NORBANK ASA<br>FRN 03292049                      | 11/9/2011  |                       | 5,817,347.23           | 839,581,025                   | 102.069999695 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 5,817,989.98         | 788,156,235                 | 87,073      | -51,511,863        | -51,424,790    |
| 6,150,000.00              | BNOR0223 XS0285087358<br>HSBC BANK FUND<br>FRN 04292049                       | 4/25/2013  |                       | 6,242,250.00           | 958,888,054                   | 107.054000854 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 6,583,821.05         | 891,902,466                 | 46,272,227  | -113,257,815       | -66,985,588    |
| 16,800,000.00000          | BJEY000C XS0189704140<br>MITSUI SUMITOMO<br>FRN 03152072                      | 3/9/2012   |                       | 17,994,215.66          | 1,559,349,257                 | 121.214996338 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 20,364,119.38        | 2,106,362,772               | 245,131,001 | 301,882,513        | 547,013,514    |
|                           | BJPN3013 USJ45174AF61                                                         |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |                |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類                                                            | 取引日        | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円)     | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)     |
|------------------------|---------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|---------------|--------------------|---------------|
| <b>クラスに割当てられていない資産</b> |                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |               |                    |               |
| <b>社債</b>              |                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |               |                    |               |
| <b>変動利率</b>            |                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |               |                    |               |
| 7,376,000.00           | NATIONAL CAP TST<br>FRN 09292049<br>BUSA94UO XS0177395901     | 8/13/2012  |                       | 6,809,147.50           | 890,898,589                   | 104.990997314 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 7,744,135.96         | 1,049,088,957               | 126,661,783   | 31,528,585         | 158,190,368   |
| 9,000,000.00000        | PRUDENTIAL FIN<br>FRN 06152043<br>BUSA95MG US744320AM42       | 12/14/2012 |                       | 9,207,099.97           | 845,881,683                   | 107.410003662 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 9,666,900.33         | 999,895,875                 | 47,559,452    | 106,454,740        | 154,014,192   |
| 2,530,000.00           | PRUDENTIAL PLC<br>FRN 05292039<br>BGBR2169 XS0431150902       | 11/9/2011  |                       | 3,285,605.60           | 411,730,124                   | 123.469001770 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 3,123,765.74         | 423,172,858                 | -21,924,254   | 33,366,988         | 11,442,734    |
| 4,010,000.00000        | RABOBANK CAP III<br>FRN 12292049<br>BUSA96GT US749769AA35     | 4/9/2013   |                       | 4,070,150.00           | 402,965,199                   | 100.310800000 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 4,022,463.08         | 416,063,485                 | -4,932,497    | 18,030,783         | 13,098,286    |
| 9,700,000.00000        | SOCIETE GENERALE<br>FRN 09292049<br>BFRA1006 XS0449487619     | 11/10/2011 |                       | 10,659,415.00          | 1,373,574,896                 | 121.969001770 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 11,830,993.17        | 1,362,939,065               | 134,966,662   | -145,602,493       | -10,635,831   |
| 17,200,000.00000       | SOMPO JAPAN INS<br>FRN 03282073<br>BJPN302D USJ7620TAB73      | 3/22/2013  |                       | 17,363,818.82          | 1,676,407,567                 | 112.815002441 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 19,404,180.42        | 2,007,071,481               | 211,044,810   | 119,619,104        | 330,663,914   |
| 7,340,000.00           | ZURICH FINANCE<br>FRN 10292049<br>BGBR2220 XS0177600920       | 5/3/2012   |                       | 7,878,833.00           | 1,241,250,971                 | 115.195999146 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 8,455,386.34         | 1,145,441,206               | 78,105,000    | -173,914,765       | -95,809,765   |
| 115,571,000.00000      | 変動利率小計                                                        |            |                       | 119,525,324            | 13,128,143,226                |                                             | 128,765,677          | 14,709,733,800              | 1,046,812,797 | 534,777,777        | 1,581,590,574 |
| <b>メディアム・ターム・ノート</b>   |                                                               |            |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |               |                    |               |
| 5,300,000.00000        | ABN AMRO BANK NV<br>6.375 % 04272021<br>BNLD1156 XS0619548216 | 11/10/2011 |                       | 5,340,937.34           | 568,739,740                   | 123.411003113 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 6,540,783.16         | 753,503,004                 | 138,223,116   | 46,540,147         | 184,763,263   |
| 2,490,000.00000        | ABN AMRO BANK NV<br>7.125 % 07062022<br>BNLD1201 XS0802995166 | 8/13/2012  |                       | 2,719,467.40           | 293,030,303                   | 129.930999756 <sup>C</sup><br>115.200731246 | 3,235,281.89         | 372,706,840                 | 59,422,207    | 20,254,330         | 79,676,537    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

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

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額          | 種類                                                            | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円)   | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|------------------|---------------------------------------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------|--------------------|--------------|
| クラスに割当てられていない資産  |                                                               |           |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| 社債               |                                                               |           |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| 公募債              |                                                               |           |                       |                        |                               |                                             |                      |                             |             |                    |              |
| 14,300,000.00000 | BANK OF AMER CRP<br>3.95 % 04212025<br>BUSA99D5 US06051GFP90  | 4/16/2015 |                       | 14,120,517.00          | 1,653,496,060                 | 104.063003540 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 14,881,009.51        | 1,539,217,279               | 78,661,545  | -192,940,326       | -114,278,781 |
| 11,370,000.00000 | BBVA BANCOMER SA<br>7.25 % 04222020<br>BMEX009H USP1R23DAA49  | 1/29/2013 |                       | 13,136,847.00          | 1,201,507,199                 | 111.103996277 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 12,632,524.38        | 1,306,645,210               | -52,164,613 | 157,302,624        | 105,138,011  |
| 6,450,000.00000  | CAPITAL ONE FINL<br>3.75 % 07282026<br>BUSA9AR8 US14040HBK05  | 7/28/2016 |                       | 6,476,122.50           | 678,924,307                   | 100.628997803 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 6,490,570.36         | 671,352,171                 | 1,494,414   | -9,066,550         | -7,572,136   |
| 1,030,000.00000  | CITIGROUP INC<br>8.125 % 07152039<br>BUSA9426 US172967EW71    | 5/5/2016  |                       | 1,581,977.00           | 169,137,062                   | 157.684800000 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 1,624,153.44         | 167,994,318                 | 4,362,520   | -5,505,265         | -1,142,745   |
| 12,600,000.00000 | CITIGROUP INC<br>4.6 % 03092026<br>BUSA9ACG US172967KJ96      | 3/1/2016  |                       | 12,575,052.00          | 1,428,400,135                 | 107.551002502 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 13,551,426.32        | 1,401,691,836               | 100,991,281 | -127,699,580       | -26,708,299  |
| 24,000,000.00000 | CRED AGRICOLE SA<br>4.375 % 03172025<br>BFRA10ER USF2R125AC99 | 3/10/2015 |                       | 24,040,851.43          | 2,914,034,551                 | 103.099998474 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 24,743,999.63        | 2,559,395,703               | 72,730,137  | -427,368,985       | -354,638,848 |
| 12,250,000.00000 | DISCOVER BANK<br>4.25 % 03132026<br>BUSA97XY US25466AAE10     | 8/8/2016  |                       | 13,017,217.50          | 1,334,720,444                 | 107.073997498 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 13,116,564.69        | 1,356,711,923               | 10,275,977  | 11,715,501         | 21,991,478   |
| 4,820,000.00     | GOLDMAN SACHS GP<br>5.5% 10122021<br>BUSA4203 XS0270349003    | 4/18/2012 |                       | 4,853,269.60           | 679,412,153                   | 115.637001038 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 5,573,703.45         | 755,063,027                 | 97,596,323  | -21,945,450        | 75,650,873   |
| 1,000,000.00     | GOLDMAN SACHS GP<br>6.875 % 01182038<br>BUSA96MS XS0340470490 | 4/25/2013 |                       | 1,227,320.00           | 188,531,777                   | 153.386001587 <sup>C</sup><br>135.468819497 | 1,533,860.02         | 207,790,206                 | 41,526,614  | -22,268,185        | 19,258,429   |
| 1,800,000.00000  | MIZUHO FIN GROUP<br>4.6 % 03272024<br>BCYM058L USG6180BAB39   | 3/20/2014 |                       | 1,795,572.00           | 183,857,592                   | 110.549003601 <sup>C</sup><br>0.009667907   | 1,989,882.06         | 205,823,459                 | 20,098,462  | 1,867,405          | 21,965,867   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

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

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 5,722.47000            |    | 8/29/2014  |                   | 5,722.47               | 556,016                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 5,722.47             | 444,845                     | 0         | -111,171           | -111,171    |
| 19,318.75000           |    | 9/2/2014   |                   | 19,318.75              | 1,881,269                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 19,318.75            | 1,501,773                   | 0         | -379,496           | -379,496    |
| 1,607,716.44000        |    | 9/3/2014   |                   | 1,607,716.44           | 156,782,241                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,607,716.44         | 124,978,368                 | 0         | -31,803,873        | -31,803,873 |
| 2,093,263.14000        |    | 9/11/2014  |                   | 2,093,263.14           | 204,473,184                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,093,263.14         | 162,723,106                 | 0         | -41,750,078        | -41,750,078 |
| 206,869.01000          |    | 9/12/2014  |                   | 206,869.01             | 20,130,886                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 206,869.01           | 16,081,288                  | 0         | -4,049,598         | -4,049,598  |
| 32,827.64000           |    | 9/16/2014  |                   | 32,827.64              | 3,178,630                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 32,827.64            | 2,551,908                   | 0         | -626,722           | -626,722    |
| 190,691.93000          |    | 9/17/2014  |                   | 190,691.93             | 18,451,593                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 190,691.93           | 14,823,737                  | 0         | -3,627,856         | -3,627,856  |
| 246,997.33000          |    | 9/22/2014  |                   | 246,997.33             | 24,069,629                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 246,997.33           | 19,200,726                  | 0         | -4,868,903         | -4,868,903  |
| 779,044.36000          |    | 9/26/2014  |                   | 779,044.36             | 74,670,301                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 779,044.36           | 60,560,240                  | 0         | -14,110,061        | -14,110,061 |
| 4,808.27000            |    | 9/30/2014  |                   | 4,808.27               | 461,539                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 4,808.27             | 373,778                     | 0         | -87,761            | -87,761     |
| 193,723.40000          |    | 10/1/2014  |                   | 193,723.40             | 18,595,241                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 193,723.40           | 15,059,393                  | 0         | -3,535,848         | -3,535,848  |
| 93,320.89000           |    | 10/3/2014  |                   | 93,320.89              | 8,882,531                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 93,320.89            | 7,254,446                   | 0         | -1,628,085         | -1,628,085  |
| 1,179,910.48000        |    | 10/7/2014  |                   | 1,179,910.48           | 112,450,563                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,179,910.48         | 91,722,199                  | 0         | -20,728,364        | -20,728,364 |
| 22,257.67000           |    | 10/9/2014  |                   | 22,257.67              | 2,108,924                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 22,257.67            | 1,730,235                   | 0         | -378,689           | -378,689    |
| 25,335.57000           |    | 10/14/2014 |                   | 25,335.57              | 2,380,321                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 25,335.57            | 1,969,500                   | 0         | -410,821           | -410,821    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 155,694.36000   |    | 10/27/2014 |                   | 155,694.36             | 14,815,589                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 155,694.36           | 12,103,146                  | 0         | -2,712,443         | -2,712,443  |
| 1,012,066.41000 |    | 10/30/2014 |                   | 1,012,066.41           | 97,410,767                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,012,066.41         | 78,674,576                  | 0         | -18,736,191        | -18,736,191 |
| 2,442.23000     |    | 11/3/2014  |                   | 2,442.23               | 240,658                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,442.23             | 189,851                     | 0         | -50,807            | -50,807     |
| 701,249.41000   |    | 11/4/2014  |                   | 701,249.41             | 69,693,864                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 701,249.41           | 54,512,727                  | 0         | -15,181,137        | -15,181,137 |
| 1,642,127.35000 |    | 11/12/2014 |                   | 1,642,127.35           | 164,665,136                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,642,127.35         | 127,653,355                 | 0         | -37,011,781        | -37,011,781 |
| 2,700,000.00000 |    | 11/21/2014 |                   | 2,700,000.00           | 275,018,538                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,700,000.00         | 209,888,750                 | 0         | -65,129,788        | -65,129,788 |
| 2,200,000.00000 |    | 11/24/2014 |                   | 2,200,000.00           | 224,592,650                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,200,000.00         | 171,020,463                 | 0         | -53,572,187        | -53,572,187 |
| 1,775.32000     |    | 11/28/2014 |                   | 1,775.32               | 179,836                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,775.32             | 138,007                     | 0         | -41,829            | -41,829     |
| 25,737.85000    |    | 12/5/2014  |                   | 25,737.85              | 2,588,276                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 25,737.85            | 2,000,772                   | 0         | -587,504           | -587,504    |
| 1,200,271.26000 |    | 12/10/2014 |                   | 1,200,271.26           | 119,256,313                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,200,271.26         | 93,304,976                  | 0         | -25,951,337        | -25,951,337 |
| 1,159,803.53000 |    | 12/15/2014 |                   | 1,159,803.53           | 113,414,608                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,159,803.53         | 90,159,153                  | 0         | -23,255,455        | -23,255,455 |
| 58,528.71000    |    | 12/18/2014 |                   | 58,528.71              | 5,610,975                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 58,528.71            | 4,549,821                   | 0         | -1,061,154         | -1,061,154  |
| 24,573.92000    |    | 12/29/2014 |                   | 24,573.92              | 2,401,342                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 24,573.92            | 1,910,292                   | 0         | -491,050           | -491,050    |
| 485,468.43000   |    | 12/30/2014 |                   | 485,468.43             | 47,691,683                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 485,468.43           | 37,738,653                  | 0         | -9,953,030         | -9,953,030  |
| 1,564.21000     |    | 12/31/2014 |                   | 1,564.21               | 153,474                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,564.21             | 121,596                     | 0         | -31,878            | -31,878     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 1,300,000.00000 |    | 1/12/2015 |                   | 1,300,000.00           | 126,516,938                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,300,000.00         | 101,057,547                 | 0         | -25,459,391        | -25,459,391 |
| 207,747.74000   |    | 1/27/2015 |                   | 207,747.74             | 19,495,459                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 207,747.74           | 16,149,598                  | 0         | -3,345,861         | -3,345,861  |
| 696,374.06000   |    | 1/29/2015 |                   | 696,374.06             | 65,271,775                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 696,374.06           | 54,133,734                  | 0         | -11,138,041        | -11,138,041 |
| 1,406.23000     |    | 1/30/2015 |                   | 1,406.23               | 128,636                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,406.23             | 109,316                     | 0         | -19,320            | -19,320     |
| 206,582.45000   |    | 1/30/2015 |                   | 206,582.45             | 18,993,836                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 206,582.45           | 16,059,012                  | 0         | -2,934,824         | -2,934,824  |
| 54,791.29000    |    | 2/2/2015  |                   | 54,791.29              | 5,012,081                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 54,791.29            | 4,259,287                   | 0         | -752,794           | -752,794    |
| 253,877.80000   |    | 2/3/2015  |                   | 253,877.80             | 23,278,426                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 253,877.80           | 19,735,590                  | 0         | -3,542,836         | -3,542,836  |
| 205,542.23000   |    | 2/4/2015  |                   | 205,542.23             | 18,576,235                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 205,542.23           | 15,978,149                  | 0         | -2,598,086         | -2,598,086  |
| 115,628.17000   |    | 2/13/2015 |                   | 115,628.17             | 10,612,693                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 115,628.17           | 8,988,538                   | 0         | -1,624,155         | -1,624,155  |
| 29,412.99000    |    | 2/17/2015 |                   | 29,412.99              | 2,709,706                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 29,412.99            | 2,286,465                   | 0         | -423,241           | -423,241    |
| 667,933.59000   |    | 2/17/2015 |                   | 667,933.59             | 61,534,158                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 667,933.59           | 51,922,869                  | 0         | -9,611,289         | -9,611,289  |
| 326,807.08000   |    | 2/19/2015 |                   | 326,807.08             | 30,343,940                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 326,807.08           | 25,404,863                  | 0         | -4,939,077         | -4,939,077  |
| 2,192,063.20000 |    | 2/24/2015 |                   | 2,192,063.20           | 203,418,105                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,192,063.20         | 170,403,484                 | 0         | -33,014,621        | -33,014,621 |
| 53,434.29000    |    | 2/26/2015 |                   | 53,434.29              | 5,009,829                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 53,434.29            | 4,153,799                   | 0         | -856,030           | -856,030    |
| 2,003.28000     |    | 2/27/2015 |                   | 2,003.28               | 187,455                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,003.28             | 155,728                     | 0         | -31,727            | -31,727     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額                  | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 61,389.07000           |    | 2/27/2015 |                   | 61,389.07              | 5,734,296                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 61,389.07            | 4,772,176                   | 0         | -962,120           | -962,120    |
| 8,272.79000            |    | 3/4/2015  |                   | 8,272.79               | 774,772                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 8,272.79             | 643,098                     | 0         | -131,674           | -131,674    |
| 73,974.98000           |    | 3/5/2015  |                   | 73,974.98              | 6,922,876                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 73,974.98            | 5,750,562                   | 0         | -1,172,314         | -1,172,314  |
| 6,525.72000            |    | 3/10/2015 |                   | 6,525.72               | 610,308                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 6,525.72             | 507,287                     | 0         | -103,021           | -103,021    |
| 30,000.03000           |    | 3/12/2015 |                   | 30,000.03              | 2,763,346                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 30,000.03            | 2,332,100                   | 0         | -431,246           | -431,246    |
| 169,508.06000          |    | 3/16/2015 |                   | 169,508.06             | 15,673,421                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 169,508.06           | 13,176,976                  | 0         | -2,496,445         | -2,496,445  |
| 494,617.75000          |    | 3/18/2015 |                   | 494,617.75             | 45,673,172                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 494,617.75           | 38,449,889                  | 0         | -7,223,283         | -7,223,283  |
| 493,314.13000          |    | 3/19/2015 |                   | 493,314.13             | 45,648,649                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 493,314.13           | 38,348,550                  | 0         | -7,300,099         | -7,300,099  |
| 60,525.11000           |    | 3/20/2015 |                   | 60,525.11              | 5,576,441                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 60,525.11            | 4,705,015                   | 0         | -871,426           | -871,426    |
| 637,230.13000          |    | 3/24/2015 |                   | 637,230.13             | 59,886,633                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 637,230.13           | 49,536,087                  | 0         | -10,350,546        | -10,350,546 |
| 3,884.02000            |    | 3/31/2015 |                   | 3,884.02               | 355,841                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 3,884.02             | 301,930                     | 0         | -53,911            | -53,911     |
| 281,169.60000          |    | 4/1/2015  |                   | 281,169.60             | 25,759,832                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 281,169.60           | 21,857,161                  | 0         | -3,902,671         | -3,902,671  |
| 52,665.13000           |    | 4/10/2015 |                   | 52,665.13              | 4,878,576                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 52,665.13            | 4,094,007                   | 0         | -784,569           | -784,569    |
| 94,219.67000           |    | 4/16/2015 |                   | 94,219.67              | 8,562,177                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 94,219.67            | 7,324,314                   | 0         | -1,237,863         | -1,237,863  |
| 185,609.77000          |    | 4/16/2015 |                   | 185,609.77             | 16,867,218                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 185,609.77           | 14,428,668                  | 0         | -2,438,550         | -2,438,550  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 979,482.42000          |    | 4/16/2015 |                   | 979,482.42             | 89,010,097                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 979,482.42           | 76,141,608                  | 0         | -12,868,489        | -12,868,489 |
| 1,084,907.81000        |    | 4/16/2015 |                   | 1,084,907.81           | 98,590,590                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,084,907.81         | 84,337,017                  | 0         | -14,253,573        | -14,253,573 |
| 95,260.21000           |    | 4/22/2015 |                   | 95,260.21              | 8,815,560                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 95,260.21            | 7,405,202                   | 0         | -1,410,358         | -1,410,358  |
| 1,200,000.00000        |    | 4/27/2015 |                   | 1,200,000.00           | 111,722,034                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,200,000.00         | 93,283,889                  | 0         | -18,438,145        | -18,438,145 |
| 1,624.58000            |    | 4/30/2015 |                   | 1,624.58               | 153,344                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,624.58             | 126,289                     | 0         | -27,055            | -27,055     |
| 97,398.84000           |    | 5/7/2015  |                   | 97,398.84              | 9,322,518                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 97,398.84            | 7,571,452                   | 0         | -1,751,066         | -1,751,066  |
| 1,200,000.00000        |    | 5/12/2015 |                   | 1,200,000.00           | 113,914,267                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,200,000.00         | 93,283,889                  | 0         | -20,630,378        | -20,630,378 |
| 1,204.66000            |    | 5/18/2015 |                   | 1,204.66               | 115,742                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,204.66             | 93,646                      | 0         | -22,096            | -22,096     |
| 102,958.65000          |    | 5/21/2015 |                   | 102,958.65             | 9,829,791                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 102,958.65           | 8,003,653                   | 0         | -1,826,138         | -1,826,138  |
| 240,337.15000          |    | 5/27/2015 |                   | 240,337.15             | 22,898,966                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 240,337.15           | 18,682,987                  | 0         | -4,215,979         | -4,215,979  |
| 1,040.35000            |    | 5/29/2015 |                   | 1,040.35               | 98,821                        | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,040.35             | 80,873                      | 0         | -17,948            | -17,948     |
| 58,140.06000           |    | 6/4/2015  |                   | 58,140.06              | 5,632,409                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 58,140.06            | 4,519,609                   | 0         | -1,112,800         | -1,112,800  |
| 463,495.15000          |    | 6/5/2015  |                   | 463,495.15             | 44,299,139                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 463,495.15           | 36,030,525                  | 0         | -8,268,614         | -8,268,614  |
| 86,583.78000           |    | 6/9/2015  |                   | 86,583.78              | 8,282,560                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 86,583.78            | 6,730,726                   | 0         | -1,551,834         | -1,551,834  |
| 1,000,000.00000        |    | 6/11/2015 |                   | 1,000,000.00           | 95,109,932                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,000,000.00         | 77,736,574                  | 0         | -17,373,358        | -17,373,358 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|--------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |              |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |              |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |              |
| 950,000.00000          |    | 6/23/2015 |                   | 950,000.00             | 90,927,877                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 950,000.00           | 73,849,746                  | 0         | -17,078,131        | -17,078,131  |
| 742.88000              |    | 6/30/2015 |                   | 742.88                 | 69,868                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 742.88               | 57,749                      | 0         | -12,119            | -12,119      |
| 87,175.55000           |    | 7/2/2015  |                   | 87,175.55              | 8,216,800                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 87,175.55            | 6,776,729                   | 0         | -1,440,071         | -1,440,071   |
| 1,500,000.00000        |    | 7/8/2015  |                   | 1,500,000.00           | 136,124,157                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 1,500,000.00         | 116,604,861                 | 0         | -19,519,296        | -19,519,296  |
| 5,077.27000            |    | 7/9/2015  |                   | 5,077.27               | 457,130                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 5,077.27             | 394,690                     | 0         | -62,440            | -62,440      |
| 100,237.08000          |    | 7/17/2015 |                   | 100,237.08             | 9,227,204                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 100,237.08           | 7,792,087                   | 0         | -1,435,117         | -1,435,117   |
| 945.93000              |    | 7/31/2015 |                   | 945.93                 | 86,063                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 945.93               | 73,533                      | 0         | -12,530            | -12,530      |
| 88,380.65000           |    | 7/31/2015 |                   | 88,380.65              | 7,994,358                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 88,380.65            | 6,870,409                   | 0         | -1,123,949         | -1,123,949   |
| 1,940,000.00000        |    | 8/7/2015  |                   | 1,940,000.00           | 177,758,540                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 1,940,000.00         | 150,808,954                 | 0         | -26,949,586        | -26,949,586  |
| 7,650,000.00000        |    | 8/11/2015 |                   | 7,650,000.00           | 704,316,836                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 7,650,000.00         | 594,684,793                 | 0         | -109,632,043       | -109,632,043 |
| 479,833.36000          |    | 8/13/2015 |                   | 479,833.36             | 43,809,780                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 479,833.36           | 37,300,602                  | 0         | -6,509,178         | -6,509,178   |
| 75,403.65000           |    | 8/18/2015 |                   | 75,403.65              | 6,920,738                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 75,403.65            | 5,861,621                   | 0         | -1,059,117         | -1,059,117   |
| 1,260,000.00000        |    | 8/25/2015 |                   | 1,260,000.00           | 107,638,641                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 1,260,000.00         | 97,948,084                  | 0         | -9,690,557         | -9,690,557   |
| 20,000.03000           |    | 8/28/2015 |                   | 20,000.03              | 1,724,493                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 20,000.03            | 1,554,734                   | 0         | -169,759           | -169,759     |
| 1,123.56000            |    | 8/31/2015 |                   | 1,123.56               | 96,530                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 1,123.56             | 87,342                      | 0         | -9,188             | -9,188       |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額           | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 1,500,000.00000 |    | 9/8/2015   |                   | 1,500,000.00           | 124,005,422                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,500,000.00         | 116,604,861                 | 0         | -7,400,561         | -7,400,561  |
| 1,500,000.00000 |    | 9/14/2015  |                   | 1,500,000.00           | 127,701,060                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,500,000.00         | 116,604,861                 | 0         | -11,096,199        | -11,096,199 |
| 1,200,000.00000 |    | 9/17/2015  |                   | 1,200,000.00           | 104,033,759                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,200,000.00         | 93,283,889                  | 0         | -10,749,870        | -10,749,870 |
| 4,580.00000     |    | 9/29/2015  |                   | 4,580.00               | 384,148                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 4,580.00             | 356,034                     | 0         | -28,114            | -28,114     |
| 1,050.33000     |    | 9/30/2015  |                   | 1,050.33               | 88,338                        | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,050.33             | 81,649                      | 0         | -6,689             | -6,689      |
| 41,308.36000    |    | 10/2/2015  |                   | 41,308.36              | 3,484,596                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 41,308.36            | 3,211,170                   | 0         | -273,426           | -273,426    |
| 1,200,000.00000 |    | 10/7/2015  |                   | 1,200,000.00           | 102,916,819                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,200,000.00         | 93,283,889                  | 0         | -9,632,930         | -9,632,930  |
| 479,833.36000   |    | 10/14/2015 |                   | 479,833.36             | 41,980,363                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 479,833.36           | 37,300,602                  | 0         | -4,679,761         | -4,679,761  |
| 34,504.30000    |    | 10/19/2015 |                   | 34,504.30              | 2,988,523                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 34,504.30            | 2,682,246                   | 0         | -306,277           | -306,277    |
| 1,500,000.00000 |    | 10/21/2015 |                   | 1,500,000.00           | 130,659,384                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,500,000.00         | 116,604,861                 | 0         | -14,054,523        | -14,054,523 |
| 146,966.97000   |    | 10/23/2015 |                   | 146,966.97             | 12,774,602                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 146,966.97           | 11,424,709                  | 0         | -1,349,893         | -1,349,893  |
| 33,373.73000    |    | 10/28/2015 |                   | 33,373.73              | 2,903,788                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 33,373.73            | 2,594,359                   | 0         | -309,429           | -309,429    |
| 1,210.89000     |    | 10/30/2015 |                   | 1,210.89               | 104,252                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,210.89             | 94,130                      | 0         | -10,122            | -10,122     |
| 191,801.71000   |    | 11/2/2015  |                   | 191,801.71             | 16,513,279                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 191,801.71           | 14,910,008                  | 0         | -1,603,271         | -1,603,271  |
| 1,450.44000     |    | 11/9/2015  |                   | 1,450.44               | 125,722                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,450.44             | 112,752                     | 0         | -12,970            | -12,970     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 1,100,000.00000 |    | 11/10/2015 |                   | 1,100,000.00           | 95,614,298                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,100,000.00         | 85,510,232                  | 0         | -10,104,066        | -10,104,066 |
| 1,370,000.00000 |    | 11/20/2015 |                   | 1,370,000.00           | 121,160,088                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,370,000.00         | 106,499,107                 | 0         | -14,660,981        | -14,660,981 |
| 1,241.63000     |    | 11/30/2015 |                   | 1,241.63               | 110,913                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,241.63             | 96,520                      | 0         | -14,393            | -14,393     |
| 55,217.71000    |    | 11/30/2015 |                   | 55,217.71              | 4,875,314                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 55,217.71            | 4,292,436                   | 0         | -582,878           | -582,878    |
| 67,803.25000    |    | 12/2/2015  |                   | 67,803.25              | 6,086,449                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 67,803.25            | 5,270,792                   | 0         | -815,657           | -815,657    |
| 1,200,000.00000 |    | 12/8/2015  |                   | 1,200,000.00           | 107,613,376                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,200,000.00         | 93,283,889                  | 0         | -14,329,487        | -14,329,487 |
| 479,833.36000   |    | 12/14/2015 |                   | 479,833.36             | 41,838,537                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 479,833.36           | 37,300,602                  | 0         | -4,537,935         | -4,537,935  |
| 1,300,000.00000 |    | 12/14/2015 |                   | 1,300,000.00           | 113,352,056                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,300,000.00         | 101,057,547                 | 0         | -12,294,509        | -12,294,509 |
| 920,000.00000   |    | 12/18/2015 |                   | 920,000.00             | 80,272,386                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 920,000.00           | 71,517,648                  | 0         | -8,754,738         | -8,754,738  |
| 7,027.13000     |    | 12/21/2015 |                   | 7,027.13               | 613,059                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 7,027.13             | 546,265                     | 0         | -66,794            | -66,794     |
| 69,609.63000    |    | 12/22/2015 |                   | 69,609.63              | 6,058,273                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 69,609.63            | 5,411,214                   | 0         | -647,059           | -647,059    |
| 30,652.58000    |    | 12/24/2015 |                   | 30,652.58              | 2,680,171                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 30,652.58            | 2,382,827                   | 0         | -297,344           | -297,344    |
| 31,897.52000    |    | 12/29/2015 |                   | 31,897.52              | 2,787,126                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 31,897.52            | 2,479,604                   | 0         | -307,522           | -307,522    |
| 930.50000       |    | 12/31/2015 |                   | 930.50                 | 81,438                        | 1.000000000S<br>77.736574249 | 930.50               | 72,334                      | 0         | -9,104             | -9,104      |
| 64,476.82000    |    | 1/6/2016   |                   | 64,476.82              | 5,481,018                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 64,476.82            | 5,012,207                   | 0         | -468,811           | -468,811    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| 29,058.54000           |    | 1/14/2016 |                   | 29,058.54              | 2,404,861                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 29,058.54            | 2,258,911                   | 0         | -145,950           | -145,950   |
| 306,365.43000          |    | 1/20/2016 |                   | 306,365.43             | 24,967,386                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 306,365.43           | 23,815,799                  | 0         | -1,151,587         | -1,151,587 |
| 453,323.95000          |    | 1/25/2016 |                   | 453,323.95             | 37,747,169                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 453,323.95           | 35,239,851                  | 0         | -2,507,318         | -2,507,318 |
| 54,860.74000           |    | 1/28/2016 |                   | 54,860.74              | 4,588,058                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 54,860.74            | 4,264,686                   | 0         | -323,372           | -323,372   |
| 778.74000              |    | 1/29/2016 |                   | 778.74                 | 66,688                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 778.74               | 60,537                      | 0         | -6,151             | -6,151     |
| 9,624.24000            |    | 2/2/2016  |                   | 9,624.24               | 825,300                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 9,624.24             | 748,155                     | 0         | -77,145            | -77,145    |
| 45,449.01000           |    | 2/3/2016  |                   | 45,449.01              | 3,852,337                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 45,449.01            | 3,533,050                   | 0         | -319,287           | -319,287   |
| 900,000.00000          |    | 2/19/2016 |                   | 900,000.00             | 73,080,576                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 900,000.00           | 69,962,917                  | 0         | -3,117,659         | -3,117,659 |
| 549.31000              |    | 2/29/2016 |                   | 549.31                 | 44,286                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 549.31               | 42,701                      | 0         | -1,585             | -1,585     |
| 549.31000              |    | 2/29/2016 |                   | 549.31                 | 7                             | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 549.31               | 42,701                      | 0         | 42,694             | 42,694     |
| 300,000.00000          |    | 3/11/2016 |                   | 300,000.00             | 25,334,694                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 300,000.00           | 23,320,972                  | 0         | -2,013,722         | -2,013,722 |
| 870,000.00000          |    | 3/18/2016 |                   | 870,000.00             | 73,945,274                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 870,000.00           | 67,630,820                  | 0         | -6,314,454         | -6,314,454 |
| 670.89000              |    | 3/31/2016 |                   | 670.89                 | 58,005                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 670.89               | 52,153                      | 0         | -5,852             | -5,852     |
| 670.89000              |    | 3/31/2016 |                   | 670.89                 | 8                             | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 670.89               | 52,153                      | 0         | 52,145             | 52,145     |
| 49,152.02000           |    | 4/1/2016  |                   | 49,152.02              | 4,249,676                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 49,152.02            | 3,820,910                   | 0         | -428,766           | -428,766   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 0.11000                |    | 4/4/2016  |                   | 0.11                   | 9                             | 1.000000000S<br>77.736574249 | 0.11                 | 9                           | 0         | 0                  | 0           |
| 118,557.70000          |    | 4/4/2016  |                   | 118,557.70             | 10,179,618                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 118,557.70           | 9,216,269                   | 0         | -963,349           | -963,349    |
| 54,704.79000           |    | 4/7/2016  |                   | 54,704.79              | 4,550,661                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 54,704.79            | 4,252,563                   | 0         | -298,098           | -298,098    |
| 1,000,000.00000        |    | 4/13/2016 |                   | 1,000,000.00           | 82,840,523                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,000,000.00         | 77,736,574                  | 0         | -5,103,949         | -5,103,949  |
| 279,833.36000          |    | 4/18/2016 |                   | 279,833.36             | 23,441,485                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 279,833.36           | 21,753,287                  | 0         | -1,688,198         | -1,688,198  |
| 2,500,000.00000        |    | 4/21/2016 |                   | 2,500,000.00           | 213,220,853                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,500,000.00         | 194,341,436                 | 0         | -18,879,417        | -18,879,417 |
| 9,845.91000            |    | 4/22/2016 |                   | 9,845.91               | 837,399                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 9,845.91             | 765,387                     | 0         | -72,012            | -72,012     |
| 71,738.60000           |    | 4/28/2016 |                   | 71,738.60              | 6,049,028                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 71,738.60            | 5,576,713                   | 0         | -472,315           | -472,315    |
| 651.99000              |    | 4/29/2016 |                   | 651.99                 | 8                             | 1.000000000S<br>77.736574249 | 651.99               | 50,683                      | 0         | 50,675             | 50,675      |
| 651.99000              |    | 4/29/2016 |                   | 651.99                 | 53,237                        | 1.000000000S<br>77.736574249 | 651.99               | 50,683                      | 0         | -2,554             | -2,554      |
| 3,199.32000            |    | 5/6/2016  |                   | 3,199.32               | 256,662                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 3,199.32             | 248,704                     | 0         | -7,958             | -7,958      |
| 37,851.41000           |    | 5/10/2016 |                   | 37,851.41              | 3,002,766                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 37,851.41            | 2,942,439                   | 0         | -60,327            | -60,327     |
| 52,780.08000           |    | 5/13/2016 |                   | 52,780.08              | 4,214,171                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 52,780.08            | 4,102,943                   | 0         | -111,228           | -111,228    |
| 1,000,000.00000        |    | 5/18/2016 |                   | 1,000,000.00           | 79,969,300                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | 1,000,000.00         | 77,736,574                  | 0         | -2,232,726         | -2,232,726  |
| 28,390.46000           |    | 5/26/2016 |                   | 28,390.46              | 2,250,076                     | 1.000000000S<br>77.736574249 | 28,390.46            | 2,206,977                   | 0         | -43,099            | -43,099     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注 1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注 2)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注 1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注 2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|-------------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                         |                                |                                          |                       |                              |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                         |                                |                                          |                       |                              |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                         |                                |                                          |                       |                              |           |                    |            |
| 487.18000              |    | 5/31/2016 |                   | 487.18                  | 39,143                         | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 487.18                | 37,872                       | 0         | -1,271             | -1,271     |
| 77,920.52000           |    | 6/16/2016 |                   | 77,920.52               | 6,116,756                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 77,920.52             | 6,057,274                    | 0         | -59,482            | -59,482    |
| 435,877.61000          |    | 6/24/2016 |                   | 435,877.61              | 34,923,776                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 435,877.61            | 33,883,632                   | 0         | -1,040,144         | -1,040,144 |
| 193,723.40000          |    | 6/27/2016 |                   | 193,723.40              | 14,830,685                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 193,723.40            | 15,059,393                   | 0         | 228,708            | 228,708    |
| 51,500.28000           |    | 6/28/2016 |                   | 51,500.28               | 3,847,670                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 51,500.28             | 4,003,455                    | 0         | 155,785            | 155,785    |
| 370.39000              |    | 6/30/2016 |                   | 370.39                  | 28,294                         | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 370.39                | 28,793                       | 0         | 499                | 499        |
| 41,200.23000           |    | 6/30/2016 |                   | 41,200.23               | 3,144,683                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 41,200.23             | 3,202,765                    | 0         | 58,082             | 58,082     |
| 28,419.86000           |    | 7/6/2016  |                   | 28,419.86               | 2,155,687                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 28,419.86             | 2,209,263                    | 0         | 53,576             | 53,576     |
| 975,728.88000          |    | 7/8/2016  |                   | 975,728.88              | 73,727,142                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 975,728.88            | 75,849,821                   | 0         | 2,122,679          | 2,122,679  |
| 10,303.13000           |    | 7/19/2016 |                   | 10,303.13               | 827,218                        | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 10,303.13             | 800,930                      | 0         | -26,288            | -26,288    |
| 85,548.05000           |    | 7/26/2016 |                   | 85,548.05               | 6,769,315                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 85,548.05             | 6,650,212                    | 0         | -119,103           | -119,103   |
| 49,430.39000           |    | 7/27/2016 |                   | 49,430.39               | 3,887,241                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 49,430.39             | 3,842,549                    | 0         | -44,692            | -44,692    |
| 966.37000              |    | 7/29/2016 |                   | 966.37                  | 75,274                         | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 966.37                | 75,122                       | 0         | -152               | -152       |
| 279,833.36000          |    | 8/18/2016 |                   | 279,833.36              | 21,425,498                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 279,833.36            | 21,753,287                   | 0         | 327,789            | 327,789    |
| 900,000.00000          |    | 8/23/2016 |                   | 900,000.00              | 68,935,762                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | 900,000.00            | 69,962,917                   | 0         | 1,027,155          | 1,027,155  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |             |
| 2,905.89000            |    | 8/31/2016  |                   | 2,905.89               | 224,400                       | 1.000000000S<br>77.736574249 | 2,905.89             | 225,894                     | 0         | 1,494              | 1,494       |
| -9,598,636.48000       |    | 10/15/2014 |                   | -9,598,636.48          | -896,719,529                  | 1.000000000S<br>77.736574249 | -9,598,636.48        | -746,165,117                | 0         | 150,554,412        | 150,554,412 |
| -2,000,000.00000       |    | 10/15/2014 |                   | -2,000,000.00          | -186,843,106                  | 1.000000000S<br>77.736574249 | -2,000,000.00        | -155,473,148                | 0         | 31,369,958         | 31,369,958  |
| -124,452.66000         |    | 10/16/2014 |                   | -124,452.66            | -11,611,456                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -124,452.66          | -9,674,523                  | 0         | 1,936,933          | 1,936,933   |
| -95,422.92000          |    | 10/17/2014 |                   | -95,422.92             | -8,874,101                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -95,422.92           | -7,417,851                  | 0         | 1,456,250          | 1,456,250   |
| -212,367.10000         |    | 10/20/2014 |                   | -212,367.10            | -19,830,814                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -212,367.10          | -16,508,691                 | 0         | 3,322,123          | 3,322,123   |
| -96,073.00000          |    | 10/21/2014 |                   | -96,073.00             | -9,020,412                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -96,073.00           | -7,468,386                  | 0         | 1,552,026          | 1,552,026   |
| -180,163.29000         |    | 10/22/2014 |                   | -180,163.29            | -16,932,785                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -180,163.29          | -14,005,277                 | 0         | 2,927,508          | 2,927,508   |
| -134,048.72000         |    | 10/22/2014 |                   | -134,048.72            | -12,598,672                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -134,048.72          | -10,420,488                 | 0         | 2,178,184          | 2,178,184   |
| -11,302.59000          |    | 10/22/2014 |                   | -11,302.59             | -1,062,283                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -11,302.59           | -878,625                    | 0         | 183,658            | 183,658     |
| -107,152.67000         |    | 10/23/2014 |                   | -107,152.67            | -10,114,159                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -107,152.67          | -8,329,681                  | 0         | 1,784,478          | 1,784,478   |
| -31,285.75000          |    | 10/24/2014 |                   | -31,285.75             | -2,965,041                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -31,285.75           | -2,432,047                  | 0         | 532,994            | 532,994     |
| -132,121.93000         |    | 10/28/2014 |                   | -132,121.93            | -12,520,174                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -132,121.93          | -10,270,706                 | 0         | 2,249,468          | 2,249,468   |
| -482,451.36000         |    | 10/29/2014 |                   | -482,451.36            | -46,100,869                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -482,451.36          | -37,504,116                 | 0         | 8,596,753          | 8,596,753   |
| -290,633.73000         |    | 10/30/2014 |                   | -290,633.73            | -27,973,317                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -290,633.73          | -22,592,871                 | 0         | 5,380,446          | 5,380,446   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| -237,376.05000         |    | 11/5/2014  |                   | -237,376.05            | -23,468,631                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -237,376.05          | -18,452,801                 | 0         | 5,015,830          | 5,015,830  |
| -60,273.52000          |    | 11/6/2014  |                   | -60,273.52             | -5,930,648                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -60,273.52           | -4,685,457                  | 0         | 1,245,191          | 1,245,191  |
| -911,057.13000         |    | 11/7/2014  |                   | -911,057.13            | -89,780,968                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -911,057.13          | -70,822,460                 | 0         | 18,958,508         | 18,958,508 |
| -395,964.91000         |    | 11/10/2014 |                   | -395,964.91            | -39,200,790                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -395,964.91          | -30,780,956                 | 0         | 8,419,834          | 8,419,834  |
| -614,649.22000         |    | 11/12/2014 |                   | -614,649.22            | -61,634,256                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -614,649.22          | -47,780,725                 | 0         | 13,853,531         | 13,853,531 |
| -70,444.68000          |    | 11/12/2014 |                   | -70,444.68             | -7,063,875                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -70,444.68           | -5,476,128                  | 0         | 1,587,747          | 1,587,747  |
| -54,603.48000          |    | 11/13/2014 |                   | -54,603.48             | -5,490,877                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -54,603.48           | -4,244,687                  | 0         | 1,246,190          | 1,246,190  |
| -319,964.21000         |    | 11/17/2014 |                   | -319,964.21            | -32,542,269                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -319,964.21          | -24,872,922                 | 0         | 7,669,347          | 7,669,347  |
| -20,035.87000          |    | 11/18/2014 |                   | -20,035.87             | -2,032,868                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -20,035.87           | -1,557,520                  | 0         | 475,348            | 475,348    |
| -213,850.66000         |    | 11/19/2014 |                   | -213,850.66            | -21,776,026                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -213,850.66          | -16,624,018                 | 0         | 5,152,008          | 5,152,008  |
| -9,364.59000           |    | 11/20/2014 |                   | -9,364.59              | -950,919                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -9,364.59            | -727,971                    | 0         | 222,948            | 222,948    |
| -2,545,581.34000       |    | 11/21/2014 |                   | -2,545,581.34          | -259,289,652                  | 1.000000000S<br>77.736574249 | -2,545,581.34        | -197,884,773                | 0         | 61,404,879         | 61,404,879 |
| -89,212.14000          |    | 11/25/2014 |                   | -89,212.14             | -9,098,869                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -89,212.14           | -6,935,046                  | 0         | 2,163,823          | 2,163,823  |
| -603,479.44000         |    | 11/26/2014 |                   | -603,479.44            | -60,728,438                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -603,479.44          | -46,912,424                 | 0         | 13,816,014         | 13,816,014 |
| -86,787.10000          |    | 11/28/2014 |                   | -86,787.10             | -8,741,712                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -86,787.10           | -6,746,532                  | 0         | 1,995,180          | 1,995,180  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| -336,619.36000         |    | 12/1/2014  |                   | -336,619.36            | -34,098,751                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -336,619.36          | -26,167,636                 | 0         | 7,931,115          | 7,931,115  |
| -93,678.58000          |    | 12/2/2014  |                   | -93,678.58             | -9,411,623                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -93,678.58           | -7,282,252                  | 0         | 2,129,371          | 2,129,371  |
| -214,564.97000         |    | 12/3/2014  |                   | -214,564.97            | -21,617,415                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -214,564.97          | -16,679,546                 | 0         | 4,937,869          | 4,937,869  |
| -435,539.26000         |    | 12/4/2014  |                   | -435,539.26            | -43,903,822                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -435,539.26          | -33,857,330                 | 0         | 10,046,492         | 10,046,492 |
| -301,627.51000         |    | 12/9/2014  |                   | -301,627.51            | -30,314,256                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -301,627.51          | -23,447,489                 | 0         | 6,866,767          | 6,866,767  |
| -128,649.45000         |    | 12/10/2014 |                   | -128,649.45            | -12,782,326                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -128,649.45          | -10,000,768                 | 0         | 2,781,558          | 2,781,558  |
| -701,988.29000         |    | 12/11/2014 |                   | -701,988.29            | -69,264,315                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -701,988.29          | -54,570,165                 | 0         | 14,694,150         | 14,694,150 |
| -69,226.87000          |    | 12/11/2014 |                   | -69,226.87             | -6,830,529                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -69,226.87           | -5,381,460                  | 0         | 1,449,069          | 1,449,069  |
| -233,220.13000         |    | 12/12/2014 |                   | -233,220.13            | -22,988,872                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -233,220.13          | -18,129,734                 | 0         | 4,859,138          | 4,859,138  |
| -1,012,066.41000       |    | 12/15/2014 |                   | -1,012,066.41          | -98,967,724                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -1,012,066.41        | -78,674,576                 | 0         | 20,293,148         | 20,293,148 |
| -882,994.13000         |    | 12/15/2014 |                   | -882,994.13            | -86,346,033                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -882,994.13          | -68,640,939                 | 0         | 17,705,094         | 17,705,094 |
| -667,933.59000         |    | 12/15/2014 |                   | -667,933.59            | -65,315,741                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -667,933.59          | -51,922,869                 | 0         | 13,392,872         | 13,392,872 |
| -230,255.10000         |    | 12/16/2014 |                   | -230,255.10            | -22,377,237                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -230,255.10          | -17,899,243                 | 0         | 4,477,994          | 4,477,994  |
| -67,739.36000          |    | 12/17/2014 |                   | -67,739.36             | -6,523,402                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -67,739.36           | -5,265,826                  | 0         | 1,257,576          | 1,257,576  |
| -244,669.86000         |    | 12/19/2014 |                   | -244,669.86            | -23,723,117                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -244,669.86          | -19,019,797                 | 0         | 4,703,320          | 4,703,320  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額                  | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| -148,648.91000         |    | 12/22/2014 |                   | -148,648.91            | -14,467,922                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -148,648.91          | -11,555,457                 | 0         | 2,912,465          | 2,912,465  |
| -151,043.46000         |    | 12/24/2014 |                   | -151,043.46            | -14,765,543                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -151,043.46          | -11,741,601                 | 0         | 3,023,942          | 3,023,942  |
| -105,843.81000         |    | 1/5/2015   |                   | -105,843.81            | -10,336,129                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -105,843.81          | -8,227,935                  | 0         | 2,108,194          | 2,108,194  |
| -204,027.32000         |    | 1/7/2015   |                   | -204,027.32            | -19,651,794                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -204,027.32          | -15,860,385                 | 0         | 3,791,409          | 3,791,409  |
| -92,171.03000          |    | 1/8/2015   |                   | -92,171.03             | -8,853,375                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -92,171.03           | -7,165,060                  | 0         | 1,688,315          | 1,688,315  |
| -686,560.80000         |    | 1/9/2015   |                   | -686,560.80            | -66,622,818                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -686,560.80          | -53,370,885                 | 0         | 13,251,933         | 13,251,933 |
| -296,399.69000         |    | 1/13/2015  |                   | -296,399.69            | -28,690,461                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -296,399.69          | -23,041,097                 | 0         | 5,649,364          | 5,649,364  |
| -20,527.98000          |    | 1/14/2015  |                   | -20,527.98             | -1,983,598                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -20,527.98           | -1,595,775                  | 0         | 387,823            | 387,823    |
| -39,405.57000          |    | 1/15/2015  |                   | -39,405.57             | -3,758,292                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -39,405.57           | -3,063,254                  | 0         | 695,038            | 695,038    |
| -39,335.92000          |    | 1/21/2015  |                   | -39,335.92             | -3,807,263                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -39,335.92           | -3,057,840                  | 0         | 749,423            | 749,423    |
| -144,341.08000         |    | 1/22/2015  |                   | -144,341.08            | -13,851,088                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -144,341.08          | -11,220,581                 | 0         | 2,630,507          | 2,630,507  |
| -140,447.93000         |    | 1/22/2015  |                   | -140,447.93            | -13,477,498                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -140,447.93          | -10,917,941                 | 0         | 2,559,557          | 2,559,557  |
| -131,846.04000         |    | 1/22/2015  |                   | -131,846.04            | -12,652,054                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -131,846.04          | -10,249,259                 | 0         | 2,402,795          | 2,402,795  |
| -11,116.87000          |    | 1/22/2015  |                   | -11,116.87             | -1,066,784                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -11,116.87           | -864,187                    | 0         | 202,597            | 202,597    |
| -9,303.87000           |    | 1/28/2015  |                   | -9,303.87              | -869,334                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -9,303.87            | -723,251                    | 0         | 146,083            | 146,083    |

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| -258,206.95000  |    | 2/5/2015  |                   | -258,206.95            | -23,515,972                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -258,206.95          | -20,072,124                 | 0         | 3,443,848          | 3,443,848  |
| -128,192.28000  |    | 2/9/2015  |                   | -128,192.28            | -11,912,251                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -128,192.28          | -9,965,229                  | 0         | 1,947,022          | 1,947,022  |
| -76,498.09000   |    | 2/10/2015 |                   | -76,498.09             | -7,094,696                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -76,498.09           | -5,946,699                  | 0         | 1,147,997          | 1,147,997  |
| -643,025.87000  |    | 2/12/2015 |                   | -643,025.87            | -59,704,371                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -643,025.87          | -49,986,628                 | 0         | 9,717,743          | 9,717,743  |
| -195,720.57000  |    | 2/18/2015 |                   | -195,720.57            | -18,170,317                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -195,720.57          | -15,214,647                 | 0         | 2,955,670          | 2,955,670  |
| -12,078.57000   |    | 2/20/2015 |                   | -12,078.57             | -1,119,958                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -12,078.57           | -938,947                    | 0         | 181,011            | 181,011    |
| -203,751.45000  |    | 2/23/2015 |                   | -203,751.45            | -18,949,081                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -203,751.45          | -15,838,940                 | 0         | 3,110,141          | 3,110,141  |
| -16,686.40000   |    | 2/25/2015 |                   | -16,686.40             | -1,554,713                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -16,686.40           | -1,297,144                  | 0         | 257,569            | 257,569    |
| -164,421.91000  |    | 3/2/2015  |                   | -164,421.91            | -15,385,592                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -164,421.91          | -12,781,596                 | 0         | 2,603,996          | 2,603,996  |
| -12,405.71000   |    | 3/3/2015  |                   | -12,405.71             | -1,159,873                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -12,405.71           | -964,377                    | 0         | 195,496            | 195,496    |
| -125,474.92000  |    | 3/6/2015  |                   | -125,474.92            | -11,724,150                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -125,474.92          | -9,753,990                  | 0         | 1,970,160          | 1,970,160  |
| -152,618.80000  |    | 3/9/2015  |                   | -152,618.80            | -14,295,699                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -152,618.80          | -11,864,063                 | 0         | 2,431,636          | 2,431,636  |
| -708,611.63000  |    | 3/11/2015 |                   | -708,611.63            | -65,607,231                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -708,611.63          | -55,085,041                 | 0         | 10,522,190         | 10,522,190 |
| -27,978.64000   |    | 3/11/2015 |                   | -27,978.64             | -2,590,419                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -27,978.64           | -2,174,964                  | 0         | 415,455            | 415,455    |
| -174,287.44000  |    | 3/13/2015 |                   | -174,287.44            | -16,285,835                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -174,287.44          | -13,548,509                 | 0         | 2,737,326          | 2,737,326  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額                  | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| -7,763.28000           |    | 3/17/2015 |                   | -7,763.28              | -720,984                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -7,763.28            | -603,491                    | 0         | 117,493            | 117,493    |
| -302,844.98000         |    | 3/23/2015 |                   | -302,844.98            | -28,263,848                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -302,844.98          | -23,542,131                 | 0         | 4,721,717          | 4,721,717  |
| -97,995.40000          |    | 3/25/2015 |                   | -97,995.40             | -9,248,315                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -97,995.40           | -7,617,827                  | 0         | 1,630,488          | 1,630,488  |
| -172,798.05000         |    | 3/26/2015 |                   | -172,798.05            | -16,206,911                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -172,798.05          | -13,432,728                 | 0         | 2,774,183          | 2,774,183  |
| -975,466.76000         |    | 3/27/2015 |                   | -975,466.76            | -90,954,622                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -975,466.76          | -75,829,444                 | 0         | 15,125,178         | 15,125,178 |
| -256,508.24000         |    | 3/30/2015 |                   | -256,508.24            | -23,694,394                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -256,508.24          | -19,940,072                 | 0         | 3,754,322          | 3,754,322  |
| -189,563.24000         |    | 3/31/2015 |                   | -189,563.24            | -17,377,298                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -189,563.24          | -14,735,997                 | 0         | 2,641,301          | 2,641,301  |
| -206,250.64000         |    | 4/2/2015  |                   | -206,250.64            | -18,798,942                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -206,250.64          | -16,033,218                 | 0         | 2,765,724          | 2,765,724  |
| -90,318.63000          |    | 4/7/2015  |                   | -90,318.63             | -8,194,681                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -90,318.63           | -7,021,061                  | 0         | 1,173,620          | 1,173,620  |
| -74,243.21000          |    | 4/8/2015  |                   | -74,243.21             | -6,835,651                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -74,243.21           | -5,771,413                  | 0         | 1,064,238          | 1,064,238  |
| -78,171.43000          |    | 4/9/2015  |                   | -78,171.43             | -7,218,890                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -78,171.43           | -6,076,779                  | 0         | 1,142,111          | 1,142,111  |
| -705,086.17000         |    | 4/13/2015 |                   | -705,086.17            | -65,108,703                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -705,086.17          | -54,810,983                 | 0         | 10,297,720         | 10,297,720 |
| -37,651.50000          |    | 4/13/2015 |                   | -37,651.50             | -3,476,795                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -37,651.50           | -2,926,899                  | 0         | 549,896            | 549,896    |
| -246,307.80000         |    | 4/14/2015 |                   | -246,307.80            | -22,433,763                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -246,307.80          | -19,147,125                 | 0         | 3,286,638          | 3,286,638  |
| -57,294.63000          |    | 4/15/2015 |                   | -57,294.63             | -5,220,124                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -57,294.63           | -4,453,888                  | 0         | 766,236            | 766,236    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| -39,422.26000          |    | 4/20/2015 |                   | -39,422.26             | -3,646,622                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -39,422.26           | -3,064,551                  | 0         | 582,071            | 582,071    |
| -167,462.13000         |    | 4/21/2015 |                   | -167,462.13            | -15,429,360                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -167,462.13          | -13,017,932                 | 0         | 2,411,428          | 2,411,428  |
| -11,204.33000          |    | 4/21/2015 |                   | -11,204.33             | -1,032,327                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -11,204.33           | -870,986                    | 0         | 161,341            | 161,341    |
| -58,785.17000          |    | 4/23/2015 |                   | -58,785.17             | -5,468,165                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -58,785.17           | -4,569,758                  | 0         | 898,407            | 898,407    |
| -203,446.05000         |    | 4/24/2015 |                   | -203,446.05            | -18,910,269                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -203,446.05          | -15,815,199                 | 0         | 3,095,070          | 3,095,070  |
| -19,719.18000          |    | 4/27/2015 |                   | -19,719.18             | -1,835,889                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -19,719.18           | -1,532,902                  | 0         | 302,987            | 302,987    |
| -746,896.35000         |    | 4/28/2015 |                   | -746,896.35            | -69,998,726                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -746,896.35          | -58,061,164                 | 0         | 11,937,562         | 11,937,562 |
| -47,545.85000          |    | 4/30/2015 |                   | -47,545.85             | -4,556,043                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -47,545.85           | -3,696,051                  | 0         | 859,992            | 859,992    |
| -35,878.86000          |    | 5/11/2015 |                   | -35,878.86             | -3,395,944                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -35,878.86           | -2,789,100                  | 0         | 606,844            | 606,844    |
| -59,220.06000          |    | 5/12/2015 |                   | -59,220.06             | -5,621,675                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -59,220.06           | -4,603,565                  | 0         | 1,018,110          | 1,018,110  |
| -684,441.51000         |    | 5/13/2015 |                   | -684,441.51            | -65,461,528                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -684,441.51          | -53,206,138                 | 0         | 12,255,390         | 12,255,390 |
| -157,020.19000         |    | 5/13/2015 |                   | -157,020.19            | -15,017,765                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -157,020.19          | -12,206,212                 | 0         | 2,811,553          | 2,811,553  |
| -45,251.01000          |    | 5/15/2015 |                   | -45,251.01             | -4,364,516                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -45,251.01           | -3,517,658                  | 0         | 846,858            | 846,858    |
| -518,763.75000         |    | 5/20/2015 |                   | -518,763.75            | -49,524,085                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -518,763.75          | -40,326,917                 | 0         | 9,197,168          | 9,197,168  |
| -6,306.57000           |    | 5/22/2015 |                   | -6,306.57              | -601,860                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -6,306.57            | -490,251                    | 0         | 111,609            | 111,609    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |            |
| -52,113.71000          |    | 5/26/2015 |                   | -52,113.71             | -4,952,607                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -52,113.71           | -4,051,141                  | 0         | 901,466            | 901,466    |
| -393,354.22000         |    | 5/29/2015 |                   | -393,354.22            | -37,332,985                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -393,354.22          | -30,578,010                 | 0         | 6,754,975          | 6,754,975  |
| -245,742.67000         |    | 6/1/2015  |                   | -245,742.67            | -23,342,732                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -245,742.67          | -19,103,193                 | 0         | 4,239,539          | 4,239,539  |
| -5,170.70000           |    | 6/2/2015  |                   | -5,170.70              | -490,237                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -5,170.70            | -401,953                    | 0         | 88,284             | 88,284     |
| -78,821.02000          |    | 6/3/2015  |                   | -78,821.02             | -7,578,180                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -78,821.02           | -6,127,276                  | 0         | 1,450,904          | 1,450,904  |
| -113,860.14000         |    | 6/10/2015 |                   | -113,860.14            | -10,869,006                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -113,860.14          | -8,851,097                  | 0         | 2,017,909          | 2,017,909  |
| -666,844.90000         |    | 6/11/2015 |                   | -666,844.90            | -63,423,573                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -666,844.90          | -51,838,238                 | 0         | 11,585,335         | 11,585,335 |
| -110,710.67000         |    | 6/11/2015 |                   | -110,710.67            | -10,529,684                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -110,710.67          | -8,606,268                  | 0         | 1,923,416          | 1,923,416  |
| -54,834.71000          |    | 6/12/2015 |                   | -54,834.71             | -5,234,697                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -54,834.71           | -4,262,663                  | 0         | 972,034            | 972,034    |
| -83,284.46000          |    | 6/15/2015 |                   | -83,284.46             | -7,946,384                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -83,284.46           | -6,474,249                  | 0         | 1,472,135          | 1,472,135  |
| -479,833.36000         |    | 6/16/2015 |                   | -479,833.36            | -46,020,105                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -479,833.36          | -37,300,602                 | 0         | 8,719,503          | 8,719,503  |
| -17,695.85000          |    | 6/16/2015 |                   | -17,695.85             | -1,697,183                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -17,695.85           | -1,375,615                  | 0         | 321,568            | 321,568    |
| -470,587.90000         |    | 6/18/2015 |                   | -470,587.90            | -44,826,446                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -470,587.90          | -36,581,891                 | 0         | 8,244,555          | 8,244,555  |
| -156,011.32000         |    | 6/19/2015 |                   | -156,011.32            | -15,014,828                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -156,011.32          | -12,127,786                 | 0         | 2,887,042          | 2,887,042  |
| -49,769.29000          |    | 6/22/2015 |                   | -49,769.29             | -4,738,361                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -49,769.29           | -3,868,894                  | 0         | 869,467            | 869,467    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -106,347.76000         |    | 6/24/2015 |                   | -106,347.76            | -10,178,922                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -106,347.76          | -8,267,111                  | 0         | 1,911,811          | 1,911,811 |
| -13,612.05000          |    | 6/25/2015 |                   | -13,612.05             | -1,301,380                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -13,612.05           | -1,058,154                  | 0         | 243,226            | 243,226   |
| -255,184.50000         |    | 6/29/2015 |                   | -255,184.50            | -24,175,877                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -255,184.50          | -19,837,169                 | 0         | 4,338,708          | 4,338,708 |
| -321,067.80000         |    | 6/30/2015 |                   | -321,067.80            | -30,136,472                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -321,067.80          | -24,958,711                 | 0         | 5,177,761          | 5,177,761 |
| -64,733.44000          |    | 7/1/2015  |                   | -64,733.44             | -6,088,164                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -64,733.44           | -5,032,156                  | 0         | 1,056,008          | 1,056,008 |
| -28,970.18000          |    | 7/6/2015  |                   | -28,970.18             | -2,672,746                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -28,970.18           | -2,252,043                  | 0         | 420,703            | 420,703   |
| -19,343.07000          |    | 7/8/2015  |                   | -19,343.07             | -1,755,373                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -19,343.07           | -1,503,664                  | 0         | 251,709            | 251,709   |
| -676,268.27000         |    | 7/10/2015 |                   | -676,268.27            | -60,941,337                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -676,268.27          | -52,570,779                 | 0         | 8,370,558          | 8,370,558 |
| -68,449.88000          |    | 7/10/2015 |                   | -68,449.88             | -6,168,302                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -68,449.88           | -5,321,059                  | 0         | 847,243            | 847,243   |
| -275,119.99000         |    | 7/13/2015 |                   | -275,119.99            | -25,043,111                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -275,119.99          | -21,386,886                 | 0         | 3,656,225          | 3,656,225 |
| -93,052.47000          |    | 7/21/2015 |                   | -93,052.47             | -8,525,992                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -93,052.47           | -7,233,580                  | 0         | 1,292,412          | 1,292,412 |
| -73,784.97000          |    | 7/21/2015 |                   | -73,784.97             | -6,760,595                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -73,784.97           | -5,735,791                  | 0         | 1,024,804          | 1,024,804 |
| -110,427.24000         |    | 7/22/2015 |                   | -110,427.24            | -10,172,242                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -110,427.24          | -8,584,235                  | 0         | 1,588,007          | 1,588,007 |
| -164,563.52000         |    | 7/23/2015 |                   | -164,563.52            | -15,061,940                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -164,563.52          | -12,792,604                 | 0         | 2,269,336          | 2,269,336 |
| -87,873.33000          |    | 7/27/2015 |                   | -87,873.33             | -7,910,912                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -87,873.33           | -6,830,972                  | 0         | 1,079,940          | 1,079,940 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額          | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産  |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定          |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券      |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |             |
| -13,601.15000    |    | 7/28/2015 |                   | -13,601.15             | -1,221,936                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -13,601.15           | -1,057,307                  | 0         | 164,629            | 164,629     |
| -59,933.50000    |    | 8/5/2015  |                   | -59,933.50             | -5,510,135                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -59,933.50           | -4,659,025                  | 0         | 851,110            | 851,110     |
| -143,187.55000   |    | 8/6/2015  |                   | -143,187.55            | -13,144,987                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -143,187.55          | -11,130,910                 | 0         | 2,014,077          | 2,014,077   |
| -158,035.75000   |    | 8/10/2015 |                   | -158,035.75            | -14,529,172                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -158,035.75          | -12,285,158                 | 0         | 2,244,014          | 2,244,014   |
| -669,741.07000   |    | 8/11/2015 |                   | -669,741.07            | -61,661,426                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -669,741.07          | -52,063,376                 | 0         | 9,598,050          | 9,598,050   |
| -284,337.22000   |    | 8/11/2015 |                   | -284,337.22            | -26,178,234                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -284,337.22          | -22,103,401                 | 0         | 4,074,833          | 4,074,833   |
| -7,892,527.01000 |    | 8/12/2015 |                   | -7,892,527.01          | -718,905,956                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -7,892,527.01        | -613,538,012                | 0         | 105,367,944        | 105,367,944 |
| -156,845.94000   |    | 8/13/2015 |                   | -156,845.94            | -14,320,359                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -156,845.94          | -12,192,666                 | 0         | 2,127,693          | 2,127,693   |
| -53,128.21000    |    | 8/14/2015 |                   | -53,128.21             | -4,863,119                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -53,128.21           | -4,130,005                  | 0         | 733,114            | 733,114     |
| -162,199.09000   |    | 8/17/2015 |                   | -162,199.09            | -14,865,372                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -162,199.09          | -12,608,802                 | 0         | 2,256,570          | 2,256,570   |
| -21,061.93000    |    | 8/19/2015 |                   | -21,061.93             | -1,921,161                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -21,061.93           | -1,637,282                  | 0         | 283,879            | 283,879     |
| -265,076.96000   |    | 8/20/2015 |                   | -265,076.96            | -24,126,074                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -265,076.96          | -20,606,175                 | 0         | 3,519,899          | 3,519,899   |
| -19,404.32000    |    | 8/24/2015 |                   | -19,404.32             | -213                          | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -19,404.32           | -1,508,425                  | 0         | -1,508,212         | -1,508,212  |
| -196,668.41000   |    | 8/25/2015 |                   | -196,668.41            | -16,800,889                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -196,668.41          | -15,288,328                 | 0         | 1,512,561          | 1,512,561   |
| -462,149.98000   |    | 8/26/2015 |                   | -462,149.98            | -39,759,612                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -462,149.98          | -35,925,956                 | 0         | 3,833,656          | 3,833,656   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -32,107.10000          |    | 8/27/2015 |                   | -32,107.10             | -2,718,823                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -32,107.10           | -2,495,896                  | 0         | 222,927            | 222,927   |
| -86,093.85000          |    | 9/1/2015  |                   | -86,093.85             | -7,396,676                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -86,093.85           | -6,692,641                  | 0         | 704,035            | 704,035   |
| -93,737.05000          |    | 9/2/2015  |                   | -93,737.05             | -7,905,601                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -93,737.05           | -7,286,797                  | 0         | 618,804            | 618,804   |
| -4,157.48000           |    | 9/3/2015  |                   | -4,157.48              | -349,983                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -4,157.48            | -323,188                    | 0         | 26,795             | 26,795    |
| -102,367.87000         |    | 9/4/2015  |                   | -102,367.87            | -8,650,619                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -102,367.87          | -7,957,728                  | 0         | 692,891            | 692,891   |
| -642,283.89000         |    | 9/9/2015  |                   | -642,283.89            | -53,850,984                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -642,283.89          | -49,928,949                 | 0         | 3,922,035          | 3,922,035 |
| -476,290.57000         |    | 9/10/2015 |                   | -476,290.57            | -40,505,866                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -476,290.57          | -37,025,197                 | 0         | 3,480,669          | 3,480,669 |
| -107,114.37000         |    | 9/11/2015 |                   | -107,114.37            | -9,136,362                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -107,114.37          | -8,326,704                  | 0         | 809,658            | 809,658   |
| -575,423.39000         |    | 9/14/2015 |                   | -575,423.39            | -48,988,118                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -575,423.39          | -44,731,443                 | 0         | 4,256,675          | 4,256,675 |
| -92,596.64000          |    | 9/14/2015 |                   | -92,596.64             | -7,883,126                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -92,596.64           | -7,198,146                  | 0         | 684,980            | 684,980   |
| -636,341.83000         |    | 9/15/2015 |                   | -636,341.83            | -54,620,063                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -636,341.83          | -49,467,034                 | 0         | 5,153,029          | 5,153,029 |
| -57,680.52000          |    | 9/16/2015 |                   | -57,680.52             | -4,915,496                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -57,680.52           | -4,483,886                  | 0         | 431,610            | 431,610   |
| -148,138.07000         |    | 9/17/2015 |                   | -148,138.07            | -12,842,800                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -148,138.07          | -11,515,746                 | 0         | 1,327,054          | 1,327,054 |
| -888,355.94000         |    | 9/18/2015 |                   | -888,355.94            | -76,774,291                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -888,355.94          | -69,057,747                 | 0         | 7,716,544          | 7,716,544 |
| -252,646.81000         |    | 9/24/2015 |                   | -252,646.81            | -21,364,671                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -252,646.81          | -19,639,898                 | 0         | 1,724,773          | 1,724,773 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -49,056.91000          |    | 9/25/2015  |                   | -49,056.91             | -4,093,695                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -49,056.91           | -3,813,516                  | 0         | 280,179            | 280,179   |
| -72,142.91000          |    | 9/28/2015  |                   | -72,142.91             | -6,115,979                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -72,142.91           | -5,608,143                  | 0         | 507,836            | 507,836   |
| -70,823.93000          |    | 9/30/2015  |                   | -70,823.93             | -5,954,410                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -70,823.93           | -5,505,610                  | 0         | 448,800            | 448,800   |
| -198,025.63000         |    | 10/1/2015  |                   | -198,025.63            | -16,654,940                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -198,025.63          | -15,393,834                 | 0         | 1,261,106          | 1,261,106 |
| -122,307.91000         |    | 10/6/2015  |                   | -122,307.91            | -10,416,695                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -122,307.91          | -9,507,798                  | 0         | 908,897            | 908,897   |
| -39,456.54000          |    | 10/6/2015  |                   | -39,456.54             | -3,360,426                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -39,456.54           | -3,067,216                  | 0         | 293,210            | 293,210   |
| -17,998.66000          |    | 10/7/2015  |                   | -17,998.66             | -1,543,637                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -17,998.66           | -1,399,154                  | 0         | 144,483            | 144,483   |
| -94,044.65000          |    | 10/8/2015  |                   | -94,044.65             | -8,145,767                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -94,044.65           | -7,310,709                  | 0         | 835,058            | 835,058   |
| -413,942.78000         |    | 10/9/2015  |                   | -413,942.78            | -35,732,854                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -413,942.78          | -32,178,494                 | 0         | 3,554,360          | 3,554,360 |
| -18,029.52000          |    | 10/9/2015  |                   | -18,029.52             | -1,556,365                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -18,029.52           | -1,401,553                  | 0         | 154,812            | 154,812   |
| -201,846.72000         |    | 10/15/2015 |                   | -201,846.72            | -17,479,324                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -201,846.72          | -15,690,873                 | 0         | 1,788,451          | 1,788,451 |
| -106,109.09000         |    | 10/15/2015 |                   | -106,109.09            | -9,188,731                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -106,109.09          | -8,248,557                  | 0         | 940,174            | 940,174   |
| -13,046.14000          |    | 10/16/2015 |                   | -13,046.14             | -1,131,560                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -13,046.14           | -1,014,162                  | 0         | 117,398            | 117,398   |
| -938,332.24000         |    | 10/22/2015 |                   | -938,332.24            | -81,210,340                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -938,332.24          | -72,942,734                 | 0         | 8,267,606          | 8,267,606 |
| -52,217.18000          |    | 10/26/2015 |                   | -52,217.18             | -4,570,998                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -52,217.18           | -4,059,185                  | 0         | 511,813            | 511,813   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -156,124.38000         |    | 10/27/2015 |                   | -156,124.38            | -13,705,268                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -156,124.38          | -12,136,574                 | 0         | 1,568,694          | 1,568,694 |
| -221,516.12000         |    | 10/30/2015 |                   | -221,516.12            | -18,997,458                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -221,516.12          | -17,219,904                 | 0         | 1,777,554          | 1,777,554 |
| -22,603.85000          |    | 11/5/2015  |                   | -22,603.85             | -1,966,401                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -22,603.85           | -1,757,146                  | 0         | 209,255            | 209,255   |
| -28,494.89000          |    | 11/6/2015  |                   | -28,494.89             | -2,474,770                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -28,494.89           | -2,215,095                  | 0         | 259,675            | 259,675   |
| -33,113.93000          |    | 11/10/2015 |                   | -33,113.93             | -2,878,332                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -33,113.93           | -2,574,163                  | 0         | 304,169            | 304,169   |
| -908,189.06000         |    | 11/12/2015 |                   | -908,189.06            | -78,762,965                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -908,189.06          | -70,599,506                 | 0         | 8,163,459          | 8,163,459 |
| -377,515.60000         |    | 11/12/2015 |                   | -377,515.60            | -32,740,152                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -377,515.60          | -29,346,769                 | 0         | 3,393,383          | 3,393,383 |
| -6,155.13000           |    | 11/13/2015 |                   | -6,155.13              | -537,849                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -6,155.13            | -478,479                    | 0         | 59,370             | 59,370    |
| -156,394.49000         |    | 11/17/2015 |                   | -156,394.49            | -13,637,532                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -156,394.49          | -12,157,572                 | 0         | 1,479,960          | 1,479,960 |
| -16,749.47000          |    | 11/18/2015 |                   | -16,749.47             | -1,472,174                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -16,749.47           | -1,302,046                  | 0         | 170,128            | 170,128   |
| -535,263.52000         |    | 11/19/2015 |                   | -535,263.52            | -46,835,996                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -535,263.52          | -41,609,552                 | 0         | 5,226,444          | 5,226,444 |
| -171,111.94000         |    | 11/20/2015 |                   | -171,111.94            | -15,132,801                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -171,111.94          | -13,301,656                 | 0         | 1,831,145          | 1,831,145 |
| -74,491.46000          |    | 11/24/2015 |                   | -74,491.46             | -6,589,055                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -74,491.46           | -5,790,711                  | 0         | 798,344            | 798,344   |
| -907,253.22000         |    | 11/25/2015 |                   | -907,253.22            | -80,284,748                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -907,253.22          | -70,526,757                 | 0         | 9,757,991          | 9,757,991 |
| -124,050.79000         |    | 11/27/2015 |                   | -124,050.79            | -10,988,000                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -124,050.79          | -9,643,283                  | 0         | 1,344,717          | 1,344,717 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日        | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |            |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -125,483.80000         |    | 12/1/2015  |                   | -125,483.80            | -11,209,303                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -125,483.80          | -9,754,681                  | 0         | 1,454,622          | 1,454,622 |
| -29,511.79000          |    | 12/3/2015  |                   | -29,511.79             | -2,666,440                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -29,511.79           | -2,294,145                  | 0         | 372,295            | 372,295   |
| -33,063.02000          |    | 12/4/2015  |                   | -33,063.02             | -2,969,898                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -33,063.02           | -2,570,206                  | 0         | 399,692            | 399,692   |
| -33,111.98000          |    | 12/8/2015  |                   | -33,111.98             | -2,969,410                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -33,111.98           | -2,574,012                  | 0         | 395,398            | 395,398   |
| -329,209.04000         |    | 12/9/2015  |                   | -329,209.04            | -29,234,099                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -329,209.04          | -25,591,583                 | 0         | 3,642,516          | 3,642,516 |
| -29,648.06000          |    | 12/10/2015 |                   | -29,648.06             | -2,614,894                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -29,648.06           | -2,304,739                  | 0         | 310,155            | 310,155   |
| -327,000.00000         |    | 12/11/2015 |                   | -327,000.00            | -28,998,504                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -327,000.00          | -25,419,860                 | 0         | 3,578,644          | 3,578,644 |
| -92,475.65000          |    | 12/11/2015 |                   | -92,475.65             | -8,200,781                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -92,475.65           | -7,188,740                  | 0         | 1,012,041          | 1,012,041 |
| -57,766.60000          |    | 12/11/2015 |                   | -57,766.60             | -5,122,768                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -57,766.60           | -4,490,578                  | 0         | 632,190            | 632,190   |
| -34,992.57000          |    | 12/14/2015 |                   | -34,992.57             | -3,051,138                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -34,992.57           | -2,720,203                  | 0         | 330,935            | 330,935   |
| -288,079.45000         |    | 12/15/2015 |                   | -288,079.45            | -25,176,774                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -288,079.45          | -22,394,310                 | 0         | 2,782,464          | 2,782,464 |
| -109,269.69000         |    | 12/16/2015 |                   | -109,269.69            | -9,536,047                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -109,269.69          | -8,494,251                  | 0         | 1,041,796          | 1,041,796 |
| -26,796.21000          |    | 12/18/2015 |                   | -26,796.21             | -2,338,039                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -26,796.21           | -2,083,046                  | 0         | 254,993            | 254,993   |
| -35,901.50000          |    | 12/30/2015 |                   | -35,901.50             | -3,154,307                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -35,901.50           | -2,790,860                  | 0         | 363,447            | 363,447   |
| -191,729.95000         |    | 1/4/2016   |                   | -191,729.95            | -16,780,325                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -191,729.95          | -14,904,429                 | 0         | 1,875,896          | 1,875,896 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |           |
| -223,008.99000         |    | 1/5/2016  |                   | -223,008.99            | -19,064,056                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -223,008.99          | -17,335,955                 | 0         | 1,728,101          | 1,728,101 |
| -17,213.36000          |    | 1/7/2016  |                   | -17,213.36             | -1,442,564                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -17,213.36           | -1,338,108                  | 0         | 104,456            | 104,456   |
| -379,405.26000         |    | 1/12/2016 |                   | -379,405.26            | -31,131,953                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -379,405.26          | -29,493,665                 | 0         | 1,638,288          | 1,638,288 |
| -189,599.29000         |    | 1/15/2016 |                   | -189,599.29            | -15,584,866                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -189,599.29          | -14,738,799                 | 0         | 846,067            | 846,067   |
| -8,880.25000           |    | 1/19/2016 |                   | -8,880.25              | -716,821                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -8,880.25            | -690,320                    | 0         | 26,501             | 26,501    |
| -90,489.83000          |    | 1/21/2016 |                   | -90,489.83             | -7,198,238                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -90,489.83           | -7,034,369                  | 0         | 163,869            | 163,869   |
| -57,779.34000          |    | 1/21/2016 |                   | -57,779.34             | -4,596,201                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -57,779.34           | -4,491,568                  | 0         | 104,633            | 104,633   |
| -7,629.83000           |    | 1/21/2016 |                   | -7,629.83              | -606,934                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -7,629.83            | -593,117                    | 0         | 13,817             | 13,817    |
| -121,619.56000         |    | 1/22/2016 |                   | -121,619.56            | -9,910,282                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -121,619.56          | -9,454,288                  | 0         | 455,994            | 455,994   |
| -214,100.94000         |    | 2/1/2016  |                   | -214,100.94            | -18,334,604                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -214,100.94          | -16,643,474                 | 0         | 1,691,130          | 1,691,130 |
| -21,646.66000          |    | 2/4/2016  |                   | -21,646.66             | -1,815,370                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -21,646.66           | -1,682,737                  | 0         | 132,633            | 132,633   |
| -14,653.90000          |    | 2/5/2016  |                   | -14,653.90             | -1,240,675                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -14,653.90           | -1,139,144                  | 0         | 101,531            | 101,531   |
| -30,116.40000          |    | 2/10/2016 |                   | -30,116.40             | -2,445,030                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -30,116.40           | -2,341,146                  | 0         | 103,884            | 103,884   |
| -381,805.81000         |    | 2/12/2016 |                   | -381,805.81            | -30,235,477                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -381,805.81          | -29,680,276                 | 0         | 555,201            | 555,201   |
| -152,354.76000         |    | 2/12/2016 |                   | -152,354.76            | -12,065,083                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -152,354.76          | -11,843,537                 | 0         | 221,546            | 221,546   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -16,916.50000          |    | 2/17/2016 |                   | -16,916.50             | -1,364,954                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -16,916.50           | -1,315,031                  | 0         | 49,923             | 49,923    |
| -114,575.44000         |    | 2/22/2016 |                   | -114,575.44            | -9,163,101                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -114,575.44          | -8,906,702                  | 0         | 256,399            | 256,399   |
| -37,349.25000          |    | 2/23/2016 |                   | -37,349.25             | -3,051,565                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -37,349.25           | -2,903,403                  | 0         | 148,162            | 148,162   |
| -123,804.34000         |    | 3/2/2016  |                   | -123,804.34            | -10,057,811                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -123,804.34          | -9,624,125                  | 0         | 433,686            | 433,686   |
| -27,289.30000          |    | 3/3/2016  |                   | -27,289.30             | -2,257,397                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -27,289.30           | -2,121,377                  | 0         | 136,020            | 136,020   |
| -10,054.65000          |    | 3/7/2016  |                   | -10,054.65             | -847,732                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -10,054.65           | -781,614                    | 0         | 66,118             | 66,118    |
| -211,885.31000         |    | 3/9/2016  |                   | -211,885.31            | -17,733,243                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -211,885.31          | -16,471,238                 | 0         | 1,262,005          | 1,262,005 |
| -377,078.03000         |    | 3/11/2016 |                   | -377,078.03            | -31,843,855                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -377,078.03          | -29,312,754                 | 0         | 2,531,101          | 2,531,101 |
| -74,706.21000          |    | 3/14/2016 |                   | -74,706.21             | -6,403,880                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -74,706.21           | -5,807,405                  | 0         | 596,475            | 596,475   |
| -73,687.89000          |    | 3/15/2016 |                   | -73,687.89             | -6,289,651                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -73,687.89           | -5,728,244                  | 0         | 561,407            | 561,407   |
| -45,075.31000          |    | 3/16/2016 |                   | -45,075.31             | -3,796,491                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -45,075.31           | -3,504,000                  | 0         | 292,491            | 292,491   |
| -29,125.30000          |    | 3/18/2016 |                   | -29,125.30             | -2,475,492                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -29,125.30           | -2,264,101                  | 0         | 211,391            | 211,391   |
| -97,821.68000          |    | 3/22/2016 |                   | -97,821.68             | -8,292,500                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -97,821.68           | -7,604,322                  | 0         | 688,178            | 688,178   |
| -112,039.68000         |    | 3/23/2016 |                   | -112,039.68            | -9,552,811                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -112,039.68          | -8,709,581                  | 0         | 843,230            | 843,230   |
| -159,202.44000         |    | 3/24/2016 |                   | -159,202.44            | -13,507,411                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -159,202.44          | -12,375,852                 | 0         | 1,131,559          | 1,131,559 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額                  | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |            |
| -32,177.14000          |    | 3/31/2016 |                   | -32,177.14             | -2,784,601                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -32,177.14           | -2,501,341                  | 0         | 283,260            | 283,260    |
| -64,762.22000          |    | 4/5/2016  |                   | -64,762.22             | -5,485,619                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -64,762.22           | -5,034,393                  | 0         | 451,226            | 451,226    |
| -26,208.62000          |    | 4/6/2016  |                   | -26,208.62             | -2,182,406                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -26,208.62           | -2,037,368                  | 0         | 145,038            | 145,038    |
| -373,765.27000         |    | 4/11/2016 |                   | -373,765.27            | -30,674,974                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -373,765.27          | -29,055,232                 | 0         | 1,619,742          | 1,619,742  |
| -204,881.37000         |    | 4/11/2016 |                   | -204,881.37            | -16,814,646                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -204,881.37          | -15,926,776                 | 0         | 887,870            | 887,870    |
| -43,019.52000          |    | 4/12/2016 |                   | -43,019.52             | -3,527,545                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -43,019.52           | -3,344,190                  | 0         | 183,355            | 183,355    |
| -33,801.18000          |    | 4/13/2016 |                   | -33,801.18             | -2,800,107                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -33,801.18           | -2,627,588                  | 0         | 172,519            | 172,519    |
| -141,797.35000         |    | 4/14/2016 |                   | -141,797.35            | -11,838,108                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -141,797.35          | -11,022,840                 | 0         | 815,268            | 815,268    |
| -3,319.09000           |    | 4/18/2016 |                   | -3,319.09              | -278,038                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -3,319.09            | -258,015                    | 0         | 20,023             | 20,023     |
| -83,104.57000          |    | 4/19/2016 |                   | -83,104.57             | -6,999,836                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -83,104.57           | -6,460,265                  | 0         | 539,571            | 539,571    |
| -7,007.13000           |    | 4/19/2016 |                   | -7,007.13              | -590,205                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -7,007.13            | -544,710                    | 0         | 45,495             | 45,495     |
| -32,699.55000          |    | 4/20/2016 |                   | -32,699.55             | -2,792,082                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -32,699.55           | -2,541,951                  | 0         | 250,131            | 250,131    |
| -2,677,613.47000       |    | 4/21/2016 |                   | -2,677,613.47          | -228,369,211                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -2,677,613.47        | -208,148,498                | 0         | 20,220,713         | 20,220,713 |
| -92,321.29000          |    | 4/21/2016 |                   | -92,321.29             | -7,873,930                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -92,321.29           | -7,176,741                  | 0         | 697,189            | 697,189    |
| -51,467.98000          |    | 4/26/2016 |                   | -51,467.98             | -4,411,808                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -51,467.98           | -4,000,944                  | 0         | 410,864            | 410,864    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                     | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |           |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |           |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                                          |                      |                             |           |                    |           |
| -15,428.24000          |    | 5/9/2016  |                   | -15,428.24             | -1,209,910                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -15,428.24           | -1,199,339                  | 0         | 10,571             | 10,571    |
| -102,314.26000         |    | 5/11/2016 |                   | -102,314.26            | -8,222,605                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -102,314.26          | -7,953,560                  | 0         | 269,045            | 269,045   |
| -352,627.83000         |    | 5/12/2016 |                   | -352,627.83            | -28,284,357                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -352,627.83          | -27,412,079                 | 0         | 872,278            | 872,278   |
| -32,453.42000          |    | 5/17/2016 |                   | -32,453.42             | -2,578,702                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -32,453.42           | -2,522,818                  | 0         | 55,884             | 55,884    |
| -184,519.95000         |    | 5/18/2016 |                   | -184,519.95            | -14,755,931                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -184,519.95          | -14,343,949                 | 0         | 411,982            | 411,982   |
| -346,026.04000         |    | 5/23/2016 |                   | -346,026.04            | -27,596,972                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -346,026.04          | -26,898,879                 | 0         | 698,093            | 698,093   |
| -349,425.52000         |    | 6/10/2016 |                   | -349,425.52            | -27,668,680                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -349,425.52          | -27,163,143                 | 0         | 505,537            | 505,537   |
| -205,061.01000         |    | 6/14/2016 |                   | -205,061.01            | -16,138,898                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -205,061.01          | -15,940,740                 | 0         | 198,158            | 198,158   |
| -27,132.00000          |    | 6/17/2016 |                   | -27,132.00             | -2,060,548                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -27,132.00           | -2,109,149                  | 0         | -48,601            | -48,601   |
| -3,725.24000           |    | 7/7/2016  |                   | -3,725.24              | -281,556                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -3,725.24            | -289,587                    | 0         | -8,031             | -8,031    |
| -359,882.81000         |    | 7/11/2016 |                   | -359,882.81            | -27,321,043                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -359,882.81          | -27,976,057                 | 0         | -655,014           | -655,014  |
| -11,042.19000          |    | 7/11/2016 |                   | -11,042.19             | -838,284                      | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -11,042.19           | -858,382                    | 0         | -20,098            | -20,098   |
| -123,264.71000         |    | 7/12/2016 |                   | -123,264.71            | -9,538,466                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -123,264.71          | -9,582,176                  | 0         | -43,710            | -43,710   |
| -253,623.43000         |    | 7/14/2016 |                   | -253,623.43            | -20,172,228                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -253,623.43          | -19,715,817                 | 0         | 456,411            | 456,411   |
| -78,638.63000          |    | 7/14/2016 |                   | -78,638.63             | -6,254,613                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>77.736574249 | -78,638.63           | -6,113,098                  | 0         | 141,515            | 141,515   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円) |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |           |
| -6,630.58000    |    | 7/14/2016 |                   | -6,630.58              | -527,371                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -6,630.58            | -515,439                    | 0         | 11,932             | 11,932    |
| -105,691.38000  |    | 7/20/2016 |                   | -105,691.38            | -8,420,947                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -105,691.38          | -8,216,086                  | 0         | 204,861            | 204,861   |
| -26,928.63000   |    | 7/22/2016 |                   | -26,928.63             | -2,148,021                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -26,928.63           | -2,093,339                  | 0         | 54,682             | 54,682    |
| -11,865.10000   |    | 7/29/2016 |                   | -11,865.10             | -934,463                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -11,865.10           | -922,352                    | 0         | 12,111             | 12,111    |
| -64,818.19000   |    | 8/2/2016  |                   | -64,818.19             | -5,014,401                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -64,818.19           | -5,038,744                  | 0         | -24,343            | -24,343   |
| -19,853.51000   |    | 8/2/2016  |                   | -19,853.51             | -1,535,888                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -19,853.51           | -1,543,344                  | 0         | -7,456             | -7,456    |
| -181,375.34000  |    | 8/3/2016  |                   | -181,375.34            | -13,938,155                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -181,375.34          | -14,099,498                 | 0         | -161,343           | -161,343  |
| -25,260.07000   |    | 8/4/2016  |                   | -25,260.07             | -1,938,997                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -25,260.07           | -1,963,631                  | 0         | -24,634            | -24,634   |
| -356,084.08000  |    | 8/12/2016 |                   | -356,084.08            | -27,843,105                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -356,084.08          | -27,680,757                 | 0         | 162,348            | 162,348   |
| -42,406.06000   |    | 8/12/2016 |                   | -42,406.06             | -3,315,836                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -42,406.06           | -3,296,502                  | 0         | 19,334             | 19,334    |
| -33,369.43000   |    | 8/16/2016 |                   | -33,369.43             | -2,591,016                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -33,369.43           | -2,594,025                  | 0         | -3,009             | -3,009    |
| -146,047.78000  |    | 8/17/2016 |                   | -146,047.78            | -11,265,304                   | 1.000000000S<br>77.736574249 | -146,047.78          | -11,353,254                 | 0         | -87,950            | -87,950   |
| -12,365.22000   |    | 8/18/2016 |                   | -12,365.22             | -946,746                      | 1.000000000S<br>77.736574249 | -12,365.22           | -961,230                    | 0         | -14,484            | -14,484   |
| -25,656.87000   |    | 8/19/2016 |                   | -25,656.87             | -1,972,799                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -25,656.87           | -1,994,477                  | 0         | -21,678            | -21,678   |
| -62,280.99000   |    | 8/22/2016 |                   | -62,280.99             | -4,755,276                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -62,280.99           | -4,841,511                  | 0         | -86,235            | -86,235   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                  | 種類                    | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                         | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)      |
|--------------------------|-----------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|----------------|
| クラスに割当てられていない資産          |                       |           |                       |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |                |
| 外貨建現金勘定                  |                       |           |                       |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |                |
| 非グループ化の有価証券              |                       |           |                       |                        |                               |                              |                      |                             |           |                    |                |
| -115,979.16000           |                       | 8/23/2016 |                       | -115,979.16            | -8,883,458                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -115,979.16          | -9,015,823                  | 0         | -132,365           | -132,365       |
| -45,244.15000            |                       | 8/24/2016 |                       | -45,244.15             | -3,466,822                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -45,244.15           | -3,517,125                  | 0         | -50,303            | -50,303        |
| -118,911.22000           |                       | 8/25/2016 |                       | -118,911.22            | -9,101,467                    | 1.000000000S<br>77.736574249 | -118,911.22          | -9,243,751                  | 0         | -142,284           | -142,284       |
| 700,824.81000<br>0.00000 | 合計 -----              |           |                       | 700,825                | 66,414,387                    |                              | 700,825              | 54,479,709                  | 0         | -11,934,678        | -11,934,678    |
| 68,547.40000             | BRAZILIAN REAL<br>BRL | 5/14/2013 |                       | 68,547.40              | 3,453,934                     | 1.000000000S<br>0.031264079  | 68,547.40            | 2,192,529                   | 0         | -1,261,405         | -1,261,405     |
| 1,056,403.20000          |                       | 5/14/2013 |                       | 1,056,403.20           | 53,229,538                    | 1.000000000S<br>0.031264079  | 1,056,403.20         | 33,789,679                  | 0         | -19,439,859        | -19,439,859    |
| 90,499.50000             |                       | 6/11/2013 |                       | 90,499.50              | 4,158,091                     | 1.000000000S<br>0.031264079  | 90,499.50            | 2,894,680                   | 0         | -1,263,411         | -1,263,411     |
| 184,874.70000            |                       | 6/11/2013 |                       | 184,874.70             | 8,494,255                     | 1.000000000S<br>0.031264079  | 184,874.70           | 5,913,326                   | 0         | -2,580,929         | -2,580,929     |
| 3,892,793.65000          |                       | 6/11/2013 |                       | 3,892,793.65           | 178,858,332                   | 1.000000000S<br>0.031264079  | 3,892,793.65         | 124,513,300                 | 0         | -54,345,032        | -54,345,032    |
| 32,593,600.00000         |                       | 6/11/2013 |                       | 32,593,600.00          | 1,497,545,840                 | 1.000000000S<br>0.031264079  | 32,593,600.00        | 1,042,525,513               | 0         | -455,020,327       | -455,020,327   |
| 369,451,791.10000        |                       | 6/11/2013 |                       | 369,451,791.10         | 16,974,835,330                | 1.000000000S<br>0.031264079  | 369,451,791.10       | 11,817,133,366              | 0         | -5,157,701,964     | -5,157,701,964 |
| -632,326.40000           |                       | 5/14/2013 |                       | -632,326.40            | -31,861,359                   | 1.000000000S<br>0.031264079  | -632,326.40          | -20,225,333                 | 0         | 11,636,026         | 11,636,026     |
| -353,472,791.10000       |                       | 6/11/2013 |                       | -353,472,791.10        | -16,240,664,051               | 1.000000000S<br>0.031264079  | -353,472,791.10      | -11,306,035,630             | 0         | 4,934,628,421      | 4,934,628,421  |
| -32,593,600.00000        |                       | 6/11/2013 |                       | -32,593,600.00         | -1,497,545,840                | 1.000000000S<br>0.031264079  | -32,593,600.00       | -1,042,525,513              | 0         | 455,020,327        | 455,020,327    |
| -4,965,000.00000         |                       | 6/11/2013 |                       | -4,965,000.00          | -228,121,935                  | 1.000000000S<br>0.031264079  | -4,965,000.00        | -158,808,452                | 0         | 69,313,483         | 69,313,483     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類                          | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                      | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|------------------------|-----------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |                             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |             |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |                             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |             |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |                             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |             |
| -4,950,000.00000       |                             | 6/11/2013 |                       | -4,950,000.00          | -227,432,745                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.031264079   | -4,950,000.00        | -158,328,669                | 0         | 69,104,076         | 69,104,076  |
| -4,561,792.05000       |                             | 6/11/2013 |                       | -4,561,792.05          | -209,596,139                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.031264079   | -4,561,792.05        | -145,911,608                | 0         | 63,684,531         | 63,684,531  |
| -4,089,000.00000       |                             | 6/11/2013 |                       | -4,089,000.00          | -187,873,231                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.031264079   | -4,089,000.00        | -130,789,076                | 0         | 57,084,155         | 57,084,155  |
| -1,975,000.00000       |                             | 6/11/2013 |                       | -1,975,000.00          | -90,743,368                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.031264079   | -1,975,000.00        | -63,171,539                 | 0         | 27,571,829         | 27,571,829  |
| -99,000.00000          |                             | 6/11/2013 |                       | -99,000.00             | -4,548,655                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.031264079   | -99,000.00           | -3,166,573                  | 0         | 1,382,082          | 1,382,082   |
| 0.00000                | 合計 -----                    |           |                       | 0                      | 2,187,997                     |                                           | 0                    | 0                           | 0         | -2,187,997         | -2,187,997  |
| 0.00000                |                             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |             |
| 50,398.44              | BRITISH POUND<br>GBP        | 8/18/2016 |                       | 50,398.44              | 6,577,696                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>135.468819497 | 50,398.44            | 6,827,417                   | 0         | 249,721            | 249,721     |
| 50.00                  | CANADIAN DOLLAR<br>CAD      | 8/13/2014 |                       | 50.00                  | 4,670                         | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.012684778   | 50.00                | 3,942                       | 0         | -728               | -728        |
| 65,055.05000           | EURO<br>EUR                 | 8/18/2016 |                       | 65,055.05              | 7,356,921                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>115.200731246 | 65,055.05            | 7,494,389                   | 0         | 137,468            | 137,468     |
| 218,166.67000          | UNITED STATES DOLLAR<br>USD | 3/7/2016  |                       | 218,166.67             | 24,828,458                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | 218,166.67           | 22,566,070                  | 0         | -2,262,388         | -2,262,388  |
| 2,507,645.88000        |                             | 3/7/2016  |                       | 2,507,645.88           | 285,382,644                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | 2,507,645.88         | 259,378,362                 | 0         | -26,004,282        | -26,004,282 |
| 235,625.00000          |                             | 3/10/2016 |                       | 235,625.00             | 26,600,885                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | 235,625.00           | 24,371,873                  | 0         | -2,229,012         | -2,229,012  |
| 1,970,224.89000        |                             | 3/11/2016 |                       | 1,970,224.89           | 223,423,506                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | 1,970,224.89         | 203,790,220                 | 0         | -19,633,286        | -19,633,286 |
| 2,348,579.10000        |                             | 3/11/2016 |                       | 2,348,579.10           | 266,328,875                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | 2,348,579.10         | 242,925,289                 | 0         | -23,403,586        | -23,403,586 |
| 2,878,849.79000        |                             | 3/11/2016 |                       | 2,878,849.79           | 326,461,572                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | 2,878,849.79         | 297,773,840                 | 0         | -28,687,732        | -28,687,732 |

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                    | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |             |
| 3,398,240.37000 |    | 3/11/2016 |                   | 3,398,240.37           | 385,360,465                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,398,240.37         | 351,497,007                 | 0         | -33,863,458        | -33,863,458 |
| 408,375.00000   |    | 3/15/2016 |                   | 408,375.00             | 46,389,360                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 408,375.00           | 42,240,270                  | 0         | -4,149,090         | -4,149,090  |
| 588,000.00000   |    | 3/15/2016 |                   | 588,000.00             | 66,793,863                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 588,000.00           | 60,819,782                  | 0         | -5,974,081         | -5,974,081  |
| 121,000.00000   |    | 3/17/2016 |                   | 121,000.00             | 13,752,860                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 121,000.00           | 12,515,635                  | 0         | -1,237,225         | -1,237,225  |
| 525,000.00000   |    | 3/17/2016 |                   | 525,000.00             | 59,671,500                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 525,000.00           | 54,303,377                  | 0         | -5,368,123         | -5,368,123  |
| 150,377.30000   |    | 3/18/2016 |                   | 150,377.30             | 16,739,250                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 150,377.30           | 15,554,277                  | 0         | -1,184,973         | -1,184,973  |
| 92,841.37000    |    | 3/24/2016 |                   | 92,841.37              | 10,459,508                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 92,841.37            | 9,603,047                   | 0         | -856,461           | -856,461    |
| 551,000.00000   |    | 3/25/2016 |                   | 551,000.00             | 62,070,149                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 551,000.00           | 56,992,687                  | 0         | -5,077,462         | -5,077,462  |
| 41,400.00000    |    | 3/27/2016 |                   | 41,400.00              | 4,663,710                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 41,400.00            | 4,282,209                   | 0         | -381,501           | -381,501    |
| 434,218.75000   |    | 3/28/2016 |                   | 434,218.75             | 49,177,446                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 434,218.75           | 44,913,418                  | 0         | -4,264,028         | -4,264,028  |
| 543,150.00000   |    | 3/28/2016 |                   | 543,150.00             | 61,514,455                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 543,150.00           | 56,180,722                  | 0         | -5,333,733         | -5,333,733  |
| 263,958.33000   |    | 3/31/2016 |                   | 263,958.33             | 29,683,434                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 263,958.33           | 27,302,531                  | 0         | -2,380,903         | -2,380,903  |
| 15,698.36000    |    | 4/1/2016  |                   | 15,698.36              | 1,764,417                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 15,698.36            | 1,623,760                   | 0         | -140,657           | -140,657    |
| 2,607,332.00000 |    | 4/5/2016  |                   | 2,607,332.00           | 290,078,724                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 2,607,332.00         | 269,689,396                 | 0         | -20,389,328        | -20,389,328 |
| 341,978.39000   |    | 4/7/2016  |                   | 341,978.39             | 37,619,332                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 341,978.39           | 35,372,536                  | 0         | -2,246,796         | -2,246,796  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| 20,927.08000           |    | 4/8/2016  |                   | 20,927.08              | 2,258,137                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 20,927.08            | 2,164,593                   | 0         | -93,544            | -93,544    |
| 661,500.00000          |    | 4/8/2016  |                   | 661,500.00             | 71,379,159                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 661,500.00           | 68,422,255                  | 0         | -2,956,904         | -2,956,904 |
| 6,356.16000            |    | 4/11/2016 |                   | 6,356.16               | 689,103                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | 6,356.16             | 657,449                     | 0         | -31,654            | -31,654    |
| 6,388.05000            |    | 4/11/2016 |                   | 6,388.05               | 692,560                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | 6,388.05             | 660,748                     | 0         | -31,812            | -31,812    |
| 6,668.64000            |    | 4/11/2016 |                   | 6,668.64               | 722,981                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | 6,668.64             | 689,771                     | 0         | -33,210            | -33,210    |
| 6,862.48000            |    | 4/11/2016 |                   | 6,862.48               | 743,996                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | 6,862.48             | 709,821                     | 0         | -34,175            | -34,175    |
| 47,058.82000           |    | 4/11/2016 |                   | 47,058.82              | 5,101,882                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 47,058.82            | 4,867,529                   | 0         | -234,353           | -234,353   |
| 55,531.88000           |    | 4/11/2016 |                   | 55,531.88              | 6,020,489                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 55,531.88            | 5,743,940                   | 0         | -276,549           | -276,549   |
| 92,811.98000           |    | 4/11/2016 |                   | 92,811.98              | 10,062,211                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 92,811.98            | 9,600,008                   | 0         | -462,203           | -462,203   |
| 98,713.79000           |    | 4/11/2016 |                   | 98,713.79              | 10,702,055                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 98,713.79            | 10,210,461                  | 0         | -491,594           | -491,594   |
| 133,223.56000          |    | 4/11/2016 |                   | 133,223.56             | 14,443,432                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 133,223.56           | 13,779,979                  | 0         | -663,453           | -663,453   |
| 148,908.46000          |    | 4/11/2016 |                   | 148,908.46             | 16,143,911                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 148,908.46           | 15,402,347                  | 0         | -741,564           | -741,564   |
| 173,704.45000          |    | 4/11/2016 |                   | 173,704.45             | 18,832,168                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 173,704.45           | 17,967,120                  | 0         | -865,048           | -865,048   |
| 200,947.63000          |    | 4/11/2016 |                   | 200,947.63             | 21,785,737                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 200,947.63           | 20,785,019                  | 0         | -1,000,718         | -1,000,718 |
| 341,931.71000          |    | 4/11/2016 |                   | 341,931.71             | 37,070,526                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 341,931.71           | 35,367,708                  | 0         | -1,702,818         | -1,702,818 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 601,230.84000   |    | 4/11/2016 |                   | 601,230.84             | 65,182,441                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 601,230.84           | 62,188,314                  | 0         | -2,994,127         | -2,994,127  |
| 1,265,579.38000 |    | 4/11/2016 |                   | 1,265,579.38           | 137,207,787                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,265,579.38         | 130,905,208                 | 0         | -6,302,579         | -6,302,579  |
| 3,284,212.22000 |    | 4/11/2016 |                   | 3,284,212.22           | 356,057,864                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 3,284,212.22         | 339,702,504                 | 0         | -16,355,360        | -16,355,360 |
| 4,014,405.35000 |    | 4/11/2016 |                   | 4,014,405.35           | 435,221,751                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 4,014,405.35         | 415,230,034                 | 0         | -19,991,717        | -19,991,717 |
| 6,399,976.39000 |    | 4/11/2016 |                   | 6,399,976.39           | 693,853,432                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 6,399,976.39         | 661,981,584                 | 0         | -31,871,848        | -31,871,848 |
| 211,162.25000   |    | 4/18/2016 |                   | 211,162.25             | 22,960,727                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 211,162.25           | 21,841,568                  | 0         | -1,119,159         | -1,119,159  |
| 550,000.00000   |    | 4/18/2016 |                   | 550,000.00             | 59,804,249                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 550,000.00           | 56,889,252                  | 0         | -2,914,997         | -2,914,997  |
| 819,177.81000   |    | 4/18/2016 |                   | 819,177.81             | 89,073,297                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 819,177.81           | 84,731,660                  | 0         | -4,341,637         | -4,341,637  |
| 1,186,397.09000 |    | 4/18/2016 |                   | 1,186,397.09           | 129,002,885                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,186,397.09         | 122,714,988                 | 0         | -6,287,897         | -6,287,897  |
| 1,227,073.51000 |    | 4/18/2016 |                   | 1,227,073.51           | 133,425,835                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,227,073.51         | 126,922,354                 | 0         | -6,503,481         | -6,503,481  |
| 1,613,815.45000 |    | 4/18/2016 |                   | 1,613,815.45           | 175,478,219                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,613,815.45         | 166,925,008                 | 0         | -8,553,211         | -8,553,211  |
| 1,734,449.70000 |    | 4/18/2016 |                   | 1,734,449.70           | 188,595,384                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,734,449.70         | 179,402,812                 | 0         | -9,192,572         | -9,192,572  |
| 1,870,148.58000 |    | 4/18/2016 |                   | 1,870,148.58           | 203,350,602                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,870,148.58         | 193,438,826                 | 0         | -9,911,776         | -9,911,776  |
| 1,884,696.84000 |    | 4/18/2016 |                   | 1,884,696.84           | 204,932,507                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,884,696.84         | 194,943,625                 | 0         | -9,988,882         | -9,988,882  |
| 2,657,433.65000 |    | 4/18/2016 |                   | 2,657,433.65           | 288,956,042                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 2,657,433.65         | 274,871,660                 | 0         | -14,084,382        | -14,084,382 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額          | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                    | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|------------------|----|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|--------------|
| クラスに割当てられていない資産  |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |              |
| 外貨建現金勘定          |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |              |
| 非グループ化の有価証券      |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |              |
| 2,852,415.62000  |    | 4/18/2016 |                       | 2,852,415.62           | 310,157,406                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 2,852,415.62         | 295,039,621                 | 0         | -15,117,785        | -15,117,785  |
| 3,012,663.64000  |    | 4/18/2016 |                       | 3,012,663.64           | 327,581,974                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,012,663.64         | 311,614,876                 | 0         | -15,967,098        | -15,967,098  |
| 4,357,207.34000  |    | 4/18/2016 |                       | 4,357,207.34           | 473,780,930                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 4,357,207.34         | 450,687,759                 | 0         | -23,093,171        | -23,093,171  |
| 4,398,062.67000  |    | 4/18/2016 |                       | 4,398,062.67           | 478,223,334                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 4,398,062.67         | 454,913,630                 | 0         | -23,309,704        | -23,309,704  |
| 15,375,952.15000 |    | 4/18/2016 |                       | 15,375,952.15          | 1,671,904,122                 | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 15,375,952.15        | 1,590,411,673               | 0         | -81,492,449        | -81,492,449  |
| 50,270,895.78000 |    | 4/18/2016 |                       | 50,270,895.78          | 5,466,205,737                 | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 50,270,895.78        | 5,199,770,310               | 0         | -266,435,427       | -266,435,427 |
| 76,194,574.86000 |    | 4/18/2016 |                       | 76,194,574.86          | 8,285,016,922                 | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 76,194,574.86        | 7,881,186,162               | 0         | -403,830,760       | -403,830,760 |
| 84,546,932.70000 |    | 4/18/2016 |                       | 84,546,932.70          | 9,193,210,532                 | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 84,546,932.70        | 8,745,112,329               | 0         | -448,098,203       | -448,098,203 |
| 84,670,037.60000 |    | 4/18/2016 |                       | 84,670,037.60          | 9,206,596,343                 | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 84,670,037.60        | 8,757,845,685               | 0         | -448,750,658       | -448,750,658 |
| 282,425.00000    |    | 4/21/2016 |                       | 282,425.00             | 30,847,871                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 282,425.00           | 29,212,631                  | 0         | -1,635,240         | -1,635,240   |
| 412,162.50000    |    | 4/22/2016 |                       | 412,162.50             | 45,115,309                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 412,162.50           | 42,632,030                  | 0         | -2,483,279         | -2,483,279   |
| 59,250.00000     |    | 4/23/2016 |                       | 59,250.00              | 6,604,894                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 59,250.00            | 6,128,524                   | 0         | -476,370           | -476,370     |
| 33,541.72000     |    | 4/26/2016 |                       | 33,541.72              | 3,720,951                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 33,541.72            | 3,469,388                   | 0         | -251,563           | -251,563     |
| 102,673.08000    |    | 4/27/2016 |                       | 102,673.08             | 11,413,653                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 102,673.08           | 10,619,990                  | 0         | -793,663           | -793,663     |
| 288,405.00000    |    | 4/28/2016 |                       | 288,405.00             | 32,090,826                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 288,405.00           | 29,831,172                  | 0         | -2,259,654         | -2,259,654   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額         | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)   |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |             |
| 575,000.00000   |    | 5/7/2016  |                   | 575,000.00             | 61,329,500                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 575,000.00           | 59,475,127                  | 0         | -1,854,373         | -1,854,373  |
| 59,841.38000    |    | 5/10/2016 |                   | 59,841.38              | 6,484,412                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 59,841.38            | 6,189,693                   | 0         | -294,719           | -294,719    |
| 5,313.29000     |    | 5/12/2016 |                   | 5,313.29               | 577,050                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | 5,313.29             | 549,580                     | 0         | -27,470            | -27,470     |
| 9,801.52000     |    | 5/12/2016 |                   | 9,801.52               | 1,064,494                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 9,801.52             | 1,013,820                   | 0         | -50,674            | -50,674     |
| 48,245.45000    |    | 5/12/2016 |                   | 48,245.45              | 5,239,697                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 48,245.45            | 4,990,268                   | 0         | -249,429           | -249,429    |
| 123,965.08000   |    | 5/12/2016 |                   | 123,965.08             | 13,463,228                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 123,965.08           | 12,822,329                  | 0         | -640,899           | -640,899    |
| 1,178,722.21000 |    | 5/12/2016 |                   | 1,178,722.21           | 128,015,128                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,178,722.21         | 121,921,137                 | 0         | -6,093,991         | -6,093,991  |
| 1,241,567.26000 |    | 5/12/2016 |                   | 1,241,567.26           | 134,840,415                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,241,567.26         | 128,421,515                 | 0         | -6,418,900         | -6,418,900  |
| 1,417,278.22000 |    | 5/12/2016 |                   | 1,417,278.22           | 153,923,505                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,417,278.22         | 146,596,178                 | 0         | -7,327,327         | -7,327,327  |
| 2,313,610.63000 |    | 5/12/2016 |                   | 2,313,610.63           | 251,269,688                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 2,313,610.63         | 239,308,325                 | 0         | -11,961,363        | -11,961,363 |
| 4,922,379.65000 |    | 5/12/2016 |                   | 4,922,379.65           | 534,595,054                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 4,922,379.65         | 509,146,359                 | 0         | -25,448,695        | -25,448,695 |
| 5,619,210.93000 |    | 5/12/2016 |                   | 5,619,210.93           | 610,274,417                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 5,619,210.93         | 581,223,105                 | 0         | -29,051,312        | -29,051,312 |
| 29,058.54000    |    | 5/17/2016 |                   | 29,058.54              | 3,162,296                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 29,058.54            | 3,005,670                   | 0         | -156,626           | -156,626    |
| 416,926.42000   |    | 5/19/2016 |                   | 416,926.42             | 45,693,051                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 416,926.42           | 43,124,786                  | 0         | -2,568,265         | -2,568,265  |
| 8,843.34000     |    | 5/20/2016 |                   | 8,843.34               | 972,104                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | 8,843.34             | 914,711                     | 0         | -57,393            | -57,393     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額           | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| クラスに割当てられていない資産 |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| 外貨建現金勘定         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| 非グループ化の有価証券     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| 164,396.98000   |    | 5/27/2016 |                   | 164,396.98             | 18,030,239                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 164,396.98           | 17,004,402                  | 0         | -1,025,837         | -1,025,837 |
| 116,245.20000   |    | 6/3/2016  |                   | 116,245.20             | 12,620,160                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 116,245.20           | 12,023,823                  | 0         | -596,337           | -596,337   |
| 45,263.96000    |    | 6/10/2016 |                   | 45,263.96              | 4,819,028                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 45,263.96            | 4,681,878                   | 0         | -137,150           | -137,150   |
| 394,428.56000   |    | 6/10/2016 |                   | 394,428.56             | 41,992,837                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 394,428.56           | 40,797,720                  | 0         | -1,195,117         | -1,195,117 |
| 2,009,036.98000 |    | 6/10/2016 |                   | 2,009,036.98           | 213,892,126                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 2,009,036.98         | 207,804,748                 | 0         | -6,087,378         | -6,087,378 |
| 302,585.37000   |    | 6/15/2016 |                   | 302,585.37             | 32,049,841                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 302,585.37           | 31,297,919                  | 0         | -751,922           | -751,922   |
| 375,147.50000   |    | 6/15/2016 |                   | 375,147.50             | 39,735,622                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 375,147.50           | 38,803,383                  | 0         | -932,239           | -932,239   |
| 389,531.25000   |    | 6/15/2016 |                   | 389,531.25             | 41,259,148                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 389,531.25           | 40,291,166                  | 0         | -967,982           | -967,982   |
| 526,250.00000   |    | 6/15/2016 |                   | 526,250.00             | 55,740,398                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 526,250.00           | 54,432,671                  | 0         | -1,307,727         | -1,307,727 |
| 698,250.00000   |    | 6/15/2016 |                   | 698,250.00             | 73,958,637                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 698,250.00           | 72,223,492                  | 0         | -1,735,145         | -1,735,145 |
| 1,365,000.00000 |    | 6/15/2016 |                   | 1,365,000.00           | 144,580,794                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,365,000.00         | 141,188,781                 | 0         | -3,392,013         | -3,392,013 |
| 139,473.24000   |    | 6/24/2016 |                   | 139,473.24             | 14,743,716                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 139,473.24           | 14,426,415                  | 0         | -317,301           | -317,301   |
| 709,841.82000   |    | 6/27/2016 |                   | 709,841.82             | 72,524,538                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 709,841.82           | 73,422,492                  | 0         | 897,954            | 897,954    |
| 195,833.33000   |    | 6/28/2016 |                   | 195,833.33             | 19,914,291                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 195,833.33           | 20,256,021                  | 0         | 341,730            | 341,730    |
| 29,058.54000    |    | 6/29/2016 |                   | 29,058.54              | 2,986,782                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 29,058.54            | 3,005,670                   | 0         | 18,888             | 18,888     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                    | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |            |
| 195,833.33000          |    | 6/29/2016 |                       | 195,833.33             | 19,914,291                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 195,833.33           | 20,256,021                  | 0         | 341,730            | 341,730    |
| 105,342.70000          |    | 6/30/2016 |                       | 105,342.70             | 10,812,901                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 105,342.70           | 10,896,123                  | 0         | 83,222             | 83,222     |
| 2,687.78000            |    | 7/11/2016 |                       | 2,687.78               | 270,243                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 2,687.78             | 278,011                     | 0         | 7,768              | 7,768      |
| 96,149.75000           |    | 7/11/2016 |                       | 96,149.75              | 9,667,377                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 96,149.75            | 9,945,250                   | 0         | 277,873            | 277,873    |
| 192,130.14000          |    | 7/11/2016 |                       | 192,130.14             | 19,317,726                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 192,130.14           | 19,872,982                  | 0         | 555,256            | 555,256    |
| 4,924,474.08000        |    | 7/11/2016 |                       | 4,924,474.08           | 495,131,267                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 4,924,474.08         | 509,362,997                 | 0         | 14,231,730         | 14,231,730 |
| 16,353,434.85000       |    | 7/11/2016 |                       | 16,353,434.85          | 1,644,256,176                 | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 16,353,434.85        | 1,691,517,600               | 0         | 47,261,424         | 47,261,424 |
| 41,843.75000           |    | 7/15/2016 |                       | 41,843.75              | 4,408,449                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 41,843.75            | 4,328,108                   | 0         | -80,341            | -80,341    |
| 50,237.98000           |    | 7/21/2016 |                       | 50,237.98              | 5,361,648                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 50,237.98            | 5,196,366                   | 0         | -165,282           | -165,282   |
| 21,177.13000           |    | 7/25/2016 |                       | 21,177.13              | 2,250,388                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 21,177.13            | 2,190,457                   | 0         | -59,931            | -59,931    |
| 235,000.00000          |    | 7/28/2016 |                       | 235,000.00             | 24,827,751                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 235,000.00           | 24,307,226                  | 0         | -520,525           | -520,525   |
| 311,519.33000          |    | 7/28/2016 |                       | 311,519.33             | 32,912,019                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 311,519.33           | 32,222,003                  | 0         | -690,016           | -690,016   |
| 42,619.18000           |    | 7/29/2016 |                       | 42,619.18              | 4,467,982                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 42,619.18            | 4,408,315                   | 0         | -59,667            | -59,667    |
| 58,693.33000           |    | 8/2/2016  |                       | 58,693.33              | 6,008,436                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 58,693.33            | 6,070,945                   | 0         | 62,509             | 62,509     |
| 3,560,000.00000        |    | 8/2/2016  |                       | 3,560,000.00           | 364,437,195                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,560,000.00         | 368,228,615                 | 0         | 3,791,420          | 3,791,420  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                    | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |            |
| 88,333.33000           |    | 8/4/2016  |                   | 88,333.33              | 8,947,724                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 88,333.33            | 9,136,758                   | 0         | 189,034            | 189,034    |
| 6,555,000.00000        |    | 8/4/2016  |                   | 6,555,000.00           | 663,988,697                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 6,555,000.00         | 678,016,452                 | 0         | 14,027,755         | 14,027,755 |
| 77,083.33000           |    | 8/9/2016  |                   | 77,083.33              | 7,903,740                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 77,083.33            | 7,973,115                   | 0         | 69,375             | 69,375     |
| 5,462,500.00000        |    | 8/9/2016  |                   | 5,462,500.00           | 560,097,457                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 5,462,500.00         | 565,013,710                 | 0         | 4,916,253          | 4,916,253  |
| 171,111.11000          |    | 8/10/2016 |                   | 171,111.11             | 17,435,367                    | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 171,111.11           | 17,698,878                  | 0         | 263,511            | 263,511    |
| 26,687.50000           |    | 8/11/2016 |                   | 26,687.50              | 2,702,510                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 26,687.50            | 2,760,422                   | 0         | 57,912             | 57,912     |
| 64,203.33000           |    | 8/11/2016 |                   | 64,203.33              | 6,501,550                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 64,203.33            | 6,640,872                   | 0         | 139,322            | 139,322    |
| 3,248,250.00000        |    | 8/11/2016 |                   | 3,248,250.00           | 328,934,044                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,248,250.00         | 335,982,752                 | 0         | 7,048,708          | 7,048,708  |
| 3,327,720.00000        |    | 8/11/2016 |                   | 3,327,720.00           | 336,981,574                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,327,720.00         | 344,202,732                 | 0         | 7,221,158          | 7,221,158  |
| 4,862,000.00000        |    | 8/11/2016 |                   | 4,862,000.00           | 492,350,442                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 4,862,000.00         | 502,900,990                 | 0         | 10,550,548         | 10,550,548 |
| 3,101.17000            |    | 8/12/2016 |                   | 3,101.17               | 314,226                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,101.17             | 320,770                     | 0         | 6,544              | 6,544      |
| 3,728.53000            |    | 8/12/2016 |                   | 3,728.53               | 377,793                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,728.53             | 385,661                     | 0         | 7,868              | 7,868      |
| 3,900.74000            |    | 8/12/2016 |                   | 3,900.74               | 395,242                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,900.74             | 403,473                     | 0         | 8,231              | 8,231      |
| 3,959.12000            |    | 8/12/2016 |                   | 3,959.12               | 401,158                       | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 3,959.12             | 409,512                     | 0         | 8,354              | 8,354      |
| 64,461.67000           |    | 8/12/2016 |                   | 64,461.67              | 6,531,578                     | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | 64,461.67            | 6,667,593                   | 0         | 136,015            | 136,015    |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                       |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| 135,569.52000          |    | 8/12/2016 |                       | 135,569.52             | 13,736,581                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 135,569.52           | 14,022,634                  | 0         | 286,053            | 286,053    |
| 939,307.54000          |    | 8/12/2016 |                       | 939,307.54             | 95,175,333                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | 939,307.54           | 97,157,279                  | 0         | 1,981,946          | 1,981,946  |
| 1,806,958.73000        |    | 8/12/2016 |                       | 1,806,958.73           | 183,090,087                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 1,806,958.73         | 186,902,784                 | 0         | 3,812,697          | 3,812,697  |
| 3,063,097.79000        |    | 8/12/2016 |                       | 3,063,097.79           | 310,368,373                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 3,063,097.79         | 316,831,532                 | 0         | 6,463,159          | 6,463,159  |
| 4,250,983.65000        |    | 8/12/2016 |                       | 4,250,983.65           | 430,730,904                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | 4,250,983.65         | 439,700,511                 | 0         | 8,969,607          | 8,969,607  |
| 30,567.22000           |    | 8/26/2016 |                       | 30,567.22              | 3,073,075                     | 1.000000000S<br>0.009667907 | 30,567.22            | 3,161,721                   | 0         | 88,646             | 88,646     |
| -60,833,880.49000      |    | 6/20/2016 |                       | -60,833,880.49         | -6,344,061,078                | 1.000000000S<br>0.009667907 | -60,833,880.49       | -6,292,352,677              | 0         | 51,708,401         | 51,708,401 |
| -52,690,077.84000      |    | 6/20/2016 |                       | -52,690,077.84         | -5,494,784,639                | 1.000000000S<br>0.009667907 | -52,690,077.84       | -5,449,998,416              | 0         | 44,786,223         | 44,786,223 |
| -48,437,929.35000      |    | 6/20/2016 |                       | -48,437,929.35         | -5,051,349,344                | 1.000000000S<br>0.009667907 | -48,437,929.35       | -5,010,177,420              | 0         | 41,171,924         | 41,171,924 |
| -3,940,516.96000       |    | 6/20/2016 |                       | -3,940,516.96          | -410,936,802                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -3,940,516.96        | -407,587,388                | 0         | 3,349,414          | 3,349,414  |
| -2,698,114.18000       |    | 6/20/2016 |                       | -2,698,114.18          | -281,372,831                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -2,698,114.18        | -279,079,451                | 0         | 2,293,380          | 2,293,380  |
| -2,657,433.65000       |    | 6/20/2016 |                       | -2,657,433.65          | -277,130,462                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -2,657,433.65        | -274,871,660                | 0         | 2,258,802          | 2,258,802  |
| -1,884,696.84000       |    | 6/20/2016 |                       | -1,884,696.84          | -196,545,605                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,884,696.84        | -194,943,625                | 0         | 1,601,980          | 1,601,980  |
| -1,351,270.85000       |    | 6/20/2016 |                       | -1,351,270.85          | -140,917,277                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,351,270.85        | -139,768,706                | 0         | 1,148,571          | 1,148,571  |
| -1,265,772.52000       |    | 6/20/2016 |                       | -1,265,772.52          | -132,001,084                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,265,772.52        | -130,925,186                | 0         | 1,075,898          | 1,075,898  |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| -1,227,243.90000       |    | 6/20/2016 |                   | -1,227,243.90          | -127,983,127                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,227,243.90        | -126,939,978                | 0         | 1,043,149          | 1,043,149  |
| -976,000.00000         |    | 6/20/2016 |                   | -976,000.00            | -101,782,158                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -976,000.00          | -100,952,564                | 0         | 829,594            | 829,594    |
| -529,330.11000         |    | 6/20/2016 |                   | -529,330.11            | -55,201,189                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -529,330.11          | -54,751,262                 | 0         | 449,927            | 449,927    |
| -272,221.97000         |    | 6/20/2016 |                   | -272,221.97            | -28,388,667                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -272,221.97          | -28,157,281                 | 0         | 231,386            | 231,386    |
| -210,571.81000         |    | 6/20/2016 |                   | -210,571.81            | -21,959,481                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -210,571.81          | -21,780,496                 | 0         | 178,985            | 178,985    |
| -70,731.88000          |    | 6/20/2016 |                   | -70,731.88             | -7,376,274                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -70,731.88           | -7,316,152                  | 0         | 60,122             | 60,122     |
| -176,408.29000         |    | 6/21/2016 |                   | -176,408.29            | -18,418,789                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -176,408.29          | -18,246,792                 | 0         | 171,997            | 171,997    |
| -159,918.83000         |    | 6/22/2016 |                   | -159,918.83            | -16,717,115                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -159,918.83          | -16,541,205                 | 0         | 175,910            | 175,910    |
| -11,542.80000          |    | 6/28/2016 |                   | -11,542.80             | -1,173,787                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -11,542.80           | -1,193,930                  | 0         | -20,143            | -20,143    |
| -2,193.14000           |    | 6/30/2016 |                   | -2,193.14              | -225,115                      | 1.000000000S<br>0.009667907 | -2,193.14            | -226,847                    | 0         | -1,732             | -1,732     |
| -91,753.37000          |    | 7/1/2016  |                   | -91,753.37             | -9,412,978                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -91,753.37           | -9,490,510                  | 0         | -77,532            | -77,532    |
| -146,965.29000         |    | 7/5/2016  |                   | -146,965.29            | -15,069,087                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -146,965.29          | -15,201,355                 | 0         | -132,268           | -132,268   |
| -261,581.71000         |    | 7/6/2016  |                   | -261,581.71            | -26,564,931                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -261,581.71          | -27,056,705                 | 0         | -491,774           | -491,774   |
| -23,474.72000          |    | 7/7/2016  |                   | -23,474.72             | -2,367,543                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -23,474.72           | -2,428,108                  | 0         | -60,565            | -60,565    |
| -762,949.05000         |    | 7/11/2016 |                   | -762,949.05            | -76,710,715                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -762,949.05          | -78,915,638                 | 0         | -2,204,923         | -2,204,923 |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| -656,883.32000         |    | 7/11/2016 |                   | -656,883.32            | -66,046,336                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -656,883.32          | -67,944,729                 | 0         | -1,898,393         | -1,898,393 |
| -92,090.39000          |    | 7/11/2016 |                   | -92,090.39             | -9,259,229                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -92,090.39           | -9,525,370                  | 0         | -266,141           | -266,141   |
| -68,995.92000          |    | 7/11/2016 |                   | -68,995.92             | -6,937,195                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -68,995.92           | -7,136,593                  | 0         | -199,398           | -199,398   |
| -2,081.50000           |    | 7/11/2016 |                   | -2,081.50              | -209,284                      | 1.000000000S<br>0.009667907 | -2,081.50            | -215,300                    | 0         | -6,016             | -6,016     |
| -323,955.54000         |    | 7/12/2016 |                   | -323,955.54            | -33,242,698                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -323,955.54          | -33,508,343                 | 0         | -265,645           | -265,645   |
| -242,340.33000         |    | 7/14/2016 |                   | -242,340.33            | -25,265,191                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -242,340.33          | -25,066,473                 | 0         | 198,718            | 198,718    |
| -33,165.66000          |    | 7/14/2016 |                   | -33,165.66             | -3,457,686                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -33,165.66           | -3,430,490                  | 0         | 27,196             | 27,196     |
| -20,433.42000          |    | 7/14/2016 |                   | -20,433.42             | -2,130,286                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -20,433.42           | -2,113,531                  | 0         | 16,755             | 16,755     |
| -438,258.13000         |    | 7/15/2016 |                   | -438,258.13            | -46,172,688                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -438,258.13          | -45,331,231                 | 0         | 841,457            | 841,457    |
| -217,245.65000         |    | 7/19/2016 |                   | -217,245.65            | -22,998,710                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -217,245.65          | -22,470,805                 | 0         | 527,905            | 527,905    |
| -559,400.97000         |    | 7/20/2016 |                   | -559,400.97            | -59,506,279                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -559,400.97          | -57,861,642                 | 0         | 1,644,637          | 1,644,637  |
| -325,708.67000         |    | 7/20/2016 |                   | -325,708.67            | -34,647,260                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -325,708.67          | -33,689,678                 | 0         | 957,582            | 957,582    |
| -143,057.85000         |    | 7/22/2016 |                   | -143,057.85            | -15,212,057                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -143,057.85          | -14,797,189                 | 0         | 414,868            | 414,868    |
| -124,920.12000         |    | 7/26/2016 |                   | -124,920.12            | -13,252,151                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -124,920.12          | -12,921,113                 | 0         | 331,038            | 331,038    |
| -12,721.19000          |    | 7/27/2016 |                   | -12,721.19             | -1,331,209                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -12,721.19           | -1,315,816                  | 0         | 15,393             | 15,393     |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| -513,911.38000         |    | 8/1/2016  |                   | -513,911.38            | -52,668,210                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -513,911.38          | -53,156,426                 | 0         | -488,216           | -488,216   |
| -193,888.67000         |    | 8/2/2016  |                   | -193,888.67            | -19,848,383                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -193,888.67          | -20,054,875                 | 0         | -206,492           | -206,492   |
| -32,777.66000          |    | 8/3/2016  |                   | -32,777.66             | -3,309,724                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -32,777.66           | -3,390,357                  | 0         | -80,633            | -80,633    |
| -82,605.05000          |    | 8/4/2016  |                   | -82,605.05             | -8,367,478                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -82,605.05           | -8,544,254                  | 0         | -176,776           | -176,776   |
| -46,979.19000          |    | 8/5/2016  |                   | -46,979.19             | -4,749,361                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -46,979.19           | -4,859,293                  | 0         | -109,932           | -109,932   |
| -11,947.01000          |    | 8/8/2016  |                   | -11,947.01             | -1,217,102                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -11,947.01           | -1,235,739                  | 0         | -18,637            | -18,637    |
| -605,726.14000         |    | 8/9/2016  |                   | -605,726.14            | -62,108,132                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -605,726.14          | -62,653,286                 | 0         | -545,154           | -545,154   |
| -3,048,393.00000       |    | 8/10/2016 |                   | -3,048,393.00          | -310,616,012                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -3,048,393.00        | -315,310,542                | 0         | -4,694,530         | -4,694,530 |
| -93,500.00000          |    | 8/10/2016 |                   | -93,500.00             | -9,527,183                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -93,500.00           | -9,671,173                  | 0         | -143,990           | -143,990   |
| -60,231.48000          |    | 8/10/2016 |                   | -60,231.48             | -6,137,287                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -60,231.48           | -6,230,043                  | 0         | -92,756            | -92,756    |
| -45,191.67000          |    | 8/10/2016 |                   | -45,191.67             | -4,604,805                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -45,191.67           | -4,674,401                  | 0         | -69,596            | -69,596    |
| -626,918.31000         |    | 8/12/2016 |                   | -626,918.31            | -63,522,496                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -626,918.31          | -64,845,298                 | 0         | -1,322,802         | -1,322,802 |
| -11,733.04000          |    | 8/12/2016 |                   | -11,733.04             | -1,188,850                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -11,733.04           | -1,213,607                  | 0         | -24,757            | -24,757    |
| -220.93000             |    | 8/12/2016 |                   | -220.93                | -22,386                       | 1.000000000S<br>0.009667907 | -220.93              | -22,852                     | 0         | -466               | -466       |
| -209,197.56000         |    | 8/16/2016 |                   | -209,197.56            | -21,109,079                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -209,197.56          | -21,638,350                 | 0         | -529,271           | -529,271   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年 8月31日現在

| 口数 / 金額                | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注１) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 基準価格                                    | 価額<br>(表示通貨)<br>(注１) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注２)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|------------------------|----|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|--------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |              |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |              |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                       |                        |                               |                                         |                      |                             |           |                    |              |
| -108,321.12000         |    | 8/17/2016 |                       | -108,321.12            | -10,881,398                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -108,321.12          | -11,204,195                 | 0         | -322,797           | -322,797     |
| -95,443,051.40000      |    | 8/18/2016 |                       | -95,443,051.40         | -9,572,460,618                | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -95,443,051.40       | -9,872,152,411              | 0         | -299,691,793       | -299,691,793 |
| -63,220,371.82000      |    | 8/18/2016 |                       | -63,220,371.82         | -6,340,687,045                | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -63,220,371.82       | -6,539,199,417              | 0         | -198,512,372       | -198,512,372 |
| -48,587,497.66000      |    | 8/18/2016 |                       | -48,587,497.66         | -4,873,082,965                | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -48,587,497.66       | -5,025,648,019              | 0         | -152,565,054       | -152,565,054 |
| -10,062,248.00000      |    | 8/18/2016 |                       | -10,062,248.00         | -1,009,193,140                | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -10,062,248.00       | -1,040,788,663              | 0         | -31,595,523        | -31,595,523  |
| -8,121,038.00000       |    | 8/18/2016 |                       | -8,121,038.00          | -814,499,487                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -8,121,038.00        | -839,999,599                | 0         | -25,500,112        | -25,500,112  |
| -5,693,687.72000       |    | 8/18/2016 |                       | -5,693,687.72          | -571,048,397                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -5,693,687.72        | -588,926,613                | 0         | -17,878,216        | -17,878,216  |
| -3,270,000.00000       |    | 8/18/2016 |                       | -3,270,000.00          | -327,964,642                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -3,270,000.00        | -338,232,463                | 0         | -10,267,821        | -10,267,821  |
| -2,966,869.54000       |    | 8/18/2016 |                       | -2,966,869.54          | -297,562,174                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -2,966,869.54        | -306,878,163                | 0         | -9,315,989         | -9,315,989   |
| -2,881,191.46000       |    | 8/18/2016 |                       | -2,881,191.46          | -288,969,091                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -2,881,191.46        | -298,016,050                | 0         | -9,046,959         | -9,046,959   |
| -1,710,485.40000       |    | 8/18/2016 |                       | -1,710,485.40          | -171,553,129                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -1,710,485.40        | -176,924,064                | 0         | -5,370,935         | -5,370,935   |
| -1,635,377.25000       |    | 8/18/2016 |                       | -1,635,377.25          | -164,020,157                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -1,635,377.25        | -169,155,253                | 0         | -5,135,096         | -5,135,096   |
| -1,530,896.32000       |    | 8/18/2016 |                       | -1,530,896.32          | -153,541,243                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -1,530,896.32        | -158,348,267                | 0         | -4,807,024         | -4,807,024   |
| -1,317,552.21000       |    | 8/18/2016 |                       | -1,317,552.21          | -132,143,896                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -1,317,552.21        | -136,281,018                | 0         | -4,137,122         | -4,137,122   |
| -1,301,561.17000       |    | 8/18/2016 |                       | -1,301,561.17          | -130,540,075                  | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907 | -1,301,561.17        | -134,626,985                | 0         | -4,086,910         | -4,086,910   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数/金額                  | 種類 | 取引日       | サブ<br>ユニット<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                        | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)  |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>外貨建現金勘定</u>         |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| <u>非グループ化の有価証券</u>     |    |           |                   |                        |                               |                             |                      |                             |           |                    |            |
| -1,248,065.68000       |    | 8/18/2016 |                   | -1,248,065.68          | -125,174,744                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,248,065.68        | -129,093,679                | 0         | -3,918,935         | -3,918,935 |
| -1,107,208.00000       |    | 8/18/2016 |                   | -1,107,208.00          | -111,047,424                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,107,208.00        | -114,524,064                | 0         | -3,476,640         | -3,476,640 |
| -1,103,749.50000       |    | 8/18/2016 |                   | -1,103,749.50          | -110,700,554                  | 1.000000000S<br>0.009667907 | -1,103,749.50        | -114,166,334                | 0         | -3,465,780         | -3,465,780 |
| -967,918.16000         |    | 8/18/2016 |                   | -967,918.16            | -97,077,350                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -967,918.16          | -100,116,619                | 0         | -3,039,269         | -3,039,269 |
| -738,098.77000         |    | 8/18/2016 |                   | -738,098.77            | -74,027,614                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -738,098.77          | -76,345,249                 | 0         | -2,317,635         | -2,317,635 |
| -363,006.76000         |    | 8/18/2016 |                   | -363,006.76            | -36,407,762                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -363,006.76          | -37,547,606                 | 0         | -1,139,844         | -1,139,844 |
| -207,882.61000         |    | 8/18/2016 |                   | -207,882.61            | -20,849,586                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -207,882.61          | -21,502,339                 | 0         | -652,753           | -652,753   |
| -105,087.18000         |    | 8/18/2016 |                   | -105,087.18            | -10,539,718                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -105,087.18          | -10,869,693                 | 0         | -329,975           | -329,975   |
| -450,217.02000         |    | 8/19/2016 |                   | -450,217.02            | -45,095,989                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -450,217.02          | -46,568,199                 | 0         | -1,472,210         | -1,472,210 |
| -215,537.86000         |    | 8/22/2016 |                   | -215,537.86            | -21,588,271                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -215,537.86          | -22,294,159                 | 0         | -705,888           | -705,888   |
| -414,169.25000         |    | 8/23/2016 |                   | -414,169.25            | -41,539,104                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -414,169.25          | -42,839,598                 | 0         | -1,300,494         | -1,300,494 |
| -203,287.15000         |    | 8/25/2016 |                   | -203,287.15            | -20,443,573                   | 1.000000000S<br>0.009667907 | -203,287.15          | -21,027,007                 | 0         | -583,434           | -583,434   |
| -95,298.83000          |    | 8/30/2016 |                   | -95,298.83             | -9,734,299                    | 1.000000000S<br>0.009667907 | -95,298.83           | -9,857,235                  | 0         | -122,936           | -122,936   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                       | 種類                   | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                                      | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)      |
|-------------------------------|----------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|----------------|
| <b>クラスに割当てられていない資産</b>        |                      |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
| <b>外貨建現金勘定</b>                |                      |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
| <b>非グループ化の有価証券</b>            |                      |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
| -98,238.03000                 |                      | 8/31/2016 |                       | -98,238.03             | -10,097,396                   | 1.000000000 <sup>S</sup><br>0.009667907   | -98,238.03           | -10,161,251                 | 0         | -63,855            | -63,855        |
| 19,534,955.70000<br>0.00000   | 合計 -----             |           |                       | 19,534,956             | 4,745,234,420                 |                                           | 19,534,956           | 2,020,598,224               | 0         | -2,724,636,196     | -2,724,636,196 |
| 20,351,284.00000              | 非グループ化の有価証券小         |           |                       | 20,351,284             | 4,827,776,091                 |                                           | 20,351,284           | 2,089,403,681               | 0         | -2,738,372,410     | -2,738,372,410 |
| 20,351,284.00000              | 計                    |           |                       | 20,351,284             | 4,827,776,091                 |                                           | 20,351,284           | 2,089,403,681               | 0         | -2,738,372,410     | -2,738,372,410 |
| <b>先物(ポジション)</b>              |                      |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
| <b>非グループ化の有価証券</b>            |                      |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
| 279,833.36000                 | AUD FORWARD 18 OCT   | 8/9/2016  |                       | 279,833.36             | 21,975,743                    | 1.000000000 <sup>F</sup><br>77.480465431  | 279,833.36           | 21,681,619                  | 0         | -294,124           | -294,124       |
| 3,000,000.00000               | FAU18OCT             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
|                               | EUR FORWARD 18 OCT   | 8/9/2016  |                       | 3,000,000.00           | 340,657,067                   | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | 3,000,000.00         | 345,597,156                 | 0         | 4,940,089          | 4,940,089      |
|                               | FEU18OCT             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |
| -86,023,480.31000             |                      | 8/9/2016  |                       | -86,023,480.31         | -9,812,976,514                | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -86,023,480.31       | -9,909,823,370              | 0         | -96,846,856        | -96,846,856    |
| -43,792,246.65000             |                      | 8/9/2016  |                       | -43,792,246.65         | -4,995,163,945                | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -43,792,246.65       | -5,044,825,293              | 0         | -49,661,348        | -49,661,348    |
| -6,354,341.18000              |                      | 8/9/2016  |                       | -6,354,341.18          | -724,814,635                  | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -6,354,341.18        | -732,014,079                | 0         | -7,199,444         | -7,199,444     |
| -5,131,760.00000              |                      | 8/9/2016  |                       | -5,131,760.00          | -585,385,930                  | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -5,131,760.00        | -591,173,886                | 0         | -5,787,956         | -5,787,956     |
| -1,973,150.63000              |                      | 8/9/2016  |                       | -1,973,150.63          | -225,361,886                  | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -1,973,150.63        | -227,305,082                | 0         | -1,943,196         | -1,943,196     |
| -1,473,976.79000              |                      | 8/9/2016  |                       | -1,473,976.79          | -168,129,207                  | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -1,473,976.79        | -169,800,729                | 0         | -1,671,522         | -1,671,522     |
| -691,866.98000                |                      | 8/9/2016  |                       | -691,866.98            | -79,020,594                   | 1.000000000 <sup>F</sup><br>115.199051866 | -691,866.98          | -79,702,420                 | 0         | -681,826           | -681,826       |
| -142,440,822.54000<br>0.00000 | FEU18OCT<br>合計 ----- |           |                       | -142,440,823           | -16,250,195,644               |                                           | -142,440,823         | -16,409,047,703             | 0         | -158,852,059       | -158,852,059   |
| 591,072.34                    | GBP FORWARD 18 OCT   | 8/9/2016  |                       | 591,072.34             | 79,020,593                    | 1.000000000 <sup>F</sup><br>135.328563543 | 591,072.34           | 79,988,971                  | 0         | 968,378            | 968,378        |
|                               | FGB18OCT             |           |                       |                        |                               |                                           |                      |                             |           |                    |                |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

| 口数 / 金額                      | 種類                             | 取引日       | サブ<br>ユニッ<br>ト<br>クラス | 取得原価<br>(表示通貨)<br>(注1) | 取得原価<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 基準価格                          | 価額<br>(表示通貨)<br>(注1) | 価額<br>(基準通貨)<br>(注2)<br>(円) | 市場<br>(円) | 未実現損益<br>通貨<br>(円) | 合計<br>(円)    |
|------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|--------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u>       |                                |           |                       |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |              |
| <u>先物(ポジション)</u>             |                                |           |                       |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |              |
| <u>非グループ化の有価証券</u>           |                                |           |                       |                        |                               |                               |                      |                             |           |                    |              |
| 1,685,702.05                 |                                | 8/9/2016  |                       | 1,685,702.05           | 225,361,884                   | 1.000000000F<br>135.328563543 | 1,685,702.05         | 228,123,637                 | 0         | 2,761,753          | 2,761,753    |
| -48,608,620.50               |                                | 8/9/2016  |                       | -48,608,620.50         | -6,491,021,291                | 1.000000000F<br>135.328563543 | -48,608,620.50       | -6,578,134,788              | 0         | -87,113,497        | -87,113,497  |
| -41,758,759.30               |                                | 8/9/2016  |                       | -41,758,759.30         | -5,576,186,809                | 1.000000000F<br>135.328563543 | -41,758,759.30       | -5,651,152,911              | 0         | -74,966,102        | -74,966,102  |
| -1,070,000.00                |                                | 8/19/2016 |                       | -1,070,000.00          | -140,029,828                  | 1.000000000F<br>135.328563543 | -1,070,000.00        | -144,801,563                | 0         | -4,771,735         | -4,771,735   |
| -89,160,605.41000<br>0.00000 | 合計 -----                       |           |                       | -89,160,605            | -11,902,855,451               |                               | -89,160,605          | -12,065,976,654             | 0         | -163,121,203       | -163,121,203 |
| 738,098.77000                | USD FORWARD 18 OCT<br>FUS18OCT | 8/9/2016  |                       | 738,098.77             | 75,335,159                    | 1.000000000F<br>0.009688187   | 738,098.77           | 76,185,438                  | 0         | 850,279            | 850,279      |
| 1,639,725.48000              |                                | 8/9/2016  |                       | 1,639,725.48           | 168,129,206                   | 1.000000000F<br>0.009688187   | 1,639,725.48         | 169,249,982                 | 0         | 1,120,776          | 1,120,776    |
| 5,709,134.32000              |                                | 8/9/2016  |                       | 5,709,134.32           | 585,385,928                   | 1.000000000F<br>0.009688187   | 5,709,134.32         | 589,288,204                 | 0         | 3,902,276          | 3,902,276    |
| 7,068,950.39000              |                                | 8/9/2016  |                       | 7,068,950.39           | 724,814,631                   | 1.000000000F<br>0.009688187   | 7,068,950.39         | 729,646,361                 | 0         | 4,831,730          | 4,831,730    |
| 48,716,684.79000             |                                | 8/9/2016  |                       | 48,716,684.79          | 4,995,163,917                 | 1.000000000F<br>0.009688187   | 48,716,684.79        | 5,028,462,476               | 0         | 33,298,559         | 33,298,559   |
| 54,383,267.41000             |                                | 8/9/2016  |                       | 54,383,267.41          | 5,576,186,807                 | 1.000000000F<br>0.009688187   | 54,383,267.41        | 5,613,358,558               | 0         | 37,171,751         | 37,171,751   |
| 63,305,436.91000             |                                | 8/9/2016  |                       | 63,305,436.91          | 6,491,021,208                 | 1.000000000F<br>0.009688187   | 63,305,436.91        | 6,534,291,391               | 0         | 43,270,183         | 43,270,183   |
| 95,703,702.55000             |                                | 8/9/2016  |                       | 95,703,702.55          | 9,812,976,472                 | 1.000000000F<br>0.009688187   | 95,703,702.55        | 9,878,391,339               | 0         | 65,414,867         | 65,414,867   |
| 1,398,062.00000              |                                | 8/19/2016 |                       | 1,398,062.00           | 140,029,828                   | 1.000000000F<br>0.009688187   | 1,398,062.00         | 144,305,844                 | 0         | 4,276,016          | 4,276,016    |
| -3,337,548.00000             |                                | 8/9/2016  |                       | -3,337,548.00          | -340,657,067                  | 1.000000000F<br>0.009688187   | -3,337,548.00        | -344,496,654                | 0         | -3,839,587         | -3,839,587   |

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・グループ別 2016年8月31日現在

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

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

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

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

## 4【管理会社の概況】

### （１）【資本金の額】（平成28年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約38億円）

発行済株式総数 1,002,080株

### （２）【事業の内容及び営業の状況】

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

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

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

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

管理会社は、平成28年８月末日現在、以下の投資信託の管理を行っている。

| 国別（設立国） | 種類別（基本的性格）         | 本数 | 純資産価格の合計（通貨別）       |
|---------|--------------------|----|---------------------|
| ケイマン諸島  | アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド | 75 | 6,588,755,740.00米ドル |

### （３）【その他】

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

## 5【管理会社の経理の概況】

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．管理会社の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、平成28年9月30日現在における株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝101.12円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

## ( 1 ) 【資産及び負債の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表

2016年6月30日現在

( 単位：米ドル )

## 資産

米ドル

千円

|         |                                   | 米ドル              | 千円          |
|---------|-----------------------------------|------------------|-------------|
| 1.1     | 現金および中央銀行における現金残高                 | 1,899,536,172.00 | 192,081,098 |
| 1.2     | 売買目的で保有される金融資産                    | 51,327,462.00    | 5,190,233   |
| 1.2.1   | 売買目的で保有されるデリバティブ                  | 51,327,462.00    | 5,190,233   |
| 1.2.2   | 持分証券                              |                  |             |
| 1.2.3   | 債務証券                              |                  |             |
| 1.2.4   | ローンおよび貸付金                         |                  |             |
| 1.3     | 損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産           | 0.00             | 0           |
| 1.3.1   | 持分証券                              |                  |             |
| 1.3.2   | 債務証券                              |                  |             |
| 1.3.3   | ローンおよび貸付金                         |                  |             |
| 1.4     | 売却可能金融資産                          | 11,888,375.00    | 1,202,152   |
| 1.4.1   | 持分証券                              | 11,888,375.00    | 1,202,152   |
| 1.4.2   | 債務証券                              |                  |             |
| 1.4.3   | ローンおよび貸付金                         |                  |             |
| 1.5     | ローンおよび未収金(ファイナンス・リースを含む)          | 3,195,536,480.00 | 323,132,649 |
| 1.5.1   | 債務証券                              |                  |             |
| 1.5.2   | ローンおよび貸付金                         | 3,195,536,480.00 | 323,132,649 |
| 1.6     | 満期保有目的投資有価証券                      | 0.00             | 0           |
| 1.6.1   | 債務証券                              |                  |             |
| 1.6.2   | ローンおよび貸付金                         |                  |             |
| 1.7     | デリバティブ・ヘッジ会計                      | 0.00             | 0           |
| 1.7.1   | 公正価値ヘッジ                           |                  |             |
| 1.7.2   | キャッシュ・フロー・ヘッジ                     |                  |             |
| 1.7.3   | 外国事業純投資のヘッジ                       |                  |             |
| 1.7.4   | 金利リスクの公正価値ヘッジ                     |                  |             |
| 1.7.5   | 金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ               |                  |             |
| 1.8     | 金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動 |                  |             |
| 1.9     | 有形資産                              | 1,343,232.00     | 135,828     |
| 1.9.1   | 有形固定資産                            | 1,343,232.00     | 135,828     |
| 1.9.2   | 投資不動産                             |                  |             |
| 1.10    | 無形資産                              | 3,743,860.00     | 378,579     |
| 1.10.1  | 営業権                               |                  |             |
| 1.10.99 | その他の無形資産                          | 3,743,860.00     | 378,579     |
| 1.12    | 税金資産                              | 124,840.00       | 12,624      |
| 1.12.1  | 現行税金資産                            | 124,840.00       | 12,624      |
| 1.12.2  | 繰延税金資産                            | 0.00             | 0           |
| 1.13    | その他の資産                            | 21,344,120.00    | 2,158,317   |
| 1.14    | 売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ        |                  |             |
| 1.15    | 資産合計                              | 5,184,844,541.00 | 524,291,480 |

## ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

## 貸借対照表

2016年6月30日現在

(単位:米ドル)

## 負債

|        |                                   | 米ドル              | 千円          |
|--------|-----------------------------------|------------------|-------------|
| 2.1    | 中央銀行預金                            |                  |             |
| 2.2    | 売買目的で保有される金融負債                    | 43,298,019.00    | 4,378,296   |
| 2.2.1  | 売買目的で保有されるデリバティブ                  | 43,298,019.00    | 4,378,296   |
| 2.2.2  | ショート・ポジション                        |                  |             |
| 2.2.3  | 金融機関からの預金                         |                  |             |
| 2.2.4  | 金融機関以外からの預金                       |                  |             |
| 2.2.5  | 債務証書(短期間で買戻す予定の債券を含む)             |                  |             |
| 2.2.99 | その他の金融負債                          |                  |             |
| 2.3    | 損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債           | 0.00             | 0           |
| 2.3.1  | 金融機関からの預金                         |                  |             |
| 2.3.2  | 金融機関以外からの預金                       |                  |             |
| 2.3.3  | 債務証書(債券を含む)                       |                  |             |
| 2.3.4  | 劣後債務                              |                  |             |
| 2.3.99 | その他の金融負債                          |                  |             |
| 2.4    | 償却後原価で測定される金融負債                   | 4,949,902,146.00 | 500,534,105 |
| 2.4.1  | 金融機関からの預金                         | 1,525,457,379.00 | 154,254,250 |
| 2.4.2  | 金融機関以外からの預金                       | 3,424,444,767.00 | 346,279,855 |
| 2.4.3  | 債務証書(債券を含む)                       |                  |             |
| 2.4.4  | 劣後債務                              |                  |             |
| 2.4.99 | その他の金融負債                          |                  |             |
| 2.5    | 譲渡された金融資産に関連する金融負債                |                  |             |
| 2.6    | デリバティブ・ヘッジ会計                      | 0.00             | 0           |
| 2.6.1  | 公正価値ヘッジ                           |                  |             |
| 2.6.2  | キャッシュ・フロー・ヘッジ                     |                  |             |
| 2.6.3  | 外国事業純投資のヘッジ                       |                  |             |
| 2.6.4  | 金利リスクの公正価値ヘッジ                     |                  |             |
| 2.6.5  | 金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ               |                  |             |
| 2.7    | 金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動 |                  |             |
| 2.8    | 引当金                               | 274,539.00       | 27,761      |
| 2.8.1  | 再編                                |                  |             |
| 2.8.2  | 係属中の法的問題および租税訟務                   | 274,539.00       | 27,761      |
| 2.8.3  | 年金およびその他の退職後給付金債務                 |                  |             |
| 2.8.4  | ローン契約および保証                        |                  |             |
| 2.8.5  | 有償契約                              |                  |             |
| 2.8.99 | その他の引当金                           |                  |             |
| 2.9    | 税金負債                              | 11,045,467.00    | 1,116,918   |
| 2.9.1  | 現行税金負債                            | 11,045,467.00    | 1,116,918   |
| 2.9.2  | 繰延税金負債                            | 0.00             | 0           |
| 2.10   | その他の負債                            | 15,048,412.00    | 1,521,695   |
| 2.11   | 要求払株式資本(例えば、共同株式)                 |                  |             |
| 2.12   | 売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債         |                  |             |
| 2.13   | 負債合計                              | 5,019,568,583.00 | 507,578,775 |

## ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

## 貸借対照表

2016年6月30日現在

(単位:米ドル)

## 資本

|        |                          | 米ドル              | 千円          |
|--------|--------------------------|------------------|-------------|
| 3.1    | 発行済み資本                   | 37,117,969.00    | 3,753,369   |
| 3.1.1  | 払込資本                     | 37,117,969.00    | 3,753,369   |
| 3.1.2  | 未払込請求資本                  |                  |             |
| 3.2    | 株式発行差金                   |                  |             |
| 3.3    | その他のエクイティ                | 0.00             | 0           |
| 3.3.1  | 複合金融商品のエクイティ部分           |                  |             |
| 3.3.99 | その他のエクイティ商品              |                  |             |
| 3.4    | 再評価準備金およびその他の評価差額:       | 3,388,782.00     | 342,674     |
| 3.4.1  | 有形資産                     |                  |             |
| 3.4.2  | 無形資産                     |                  |             |
| 3.4.3  | 外国事業純投資のヘッジ(有効部分)        |                  |             |
| 3.4.4  | 外貨換算                     |                  |             |
| 3.4.5  | キャッシュ・フロー・ヘッジ(有効部分)      |                  |             |
| 3.4.6  | 売却可能金融資産                 | 3,388,782.00     | 342,674     |
| 3.4.7  | 売却目的で保有される非流動資産および売却グループ | 0.00             | 0           |
| 3.4.99 | その他の項目                   |                  |             |
| 3.5    | 準備金(利益剰余金を含む)            | 110,531,939.00   | 11,176,990  |
| 3.6    | <自己株式>                   |                  |             |
| 3.7    | 当期利益                     | 14,237,268.00    | 1,439,673   |
| 3.8    | <中間配当>                   |                  |             |
| 3.10   | 資本合計                     | 165,275,958.00   | 16,712,705  |
| 3.11   | 負債および資本合計                | 5,184,844,541.00 | 524,291,480 |

## (2)【損益の状況】

## ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

## 損益計算書

2016年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

|        |                                                  | 米ドル           | 千円        |
|--------|--------------------------------------------------|---------------|-----------|
| 5.1    | 金融および運用収益および費用(+/-)                              | 39,434,012.00 | 3,987,567 |
| 5.2    | 利息収益                                             | 12,948,861.00 | 1,309,389 |
| 5.2.1  | 現金および中央銀行における現金残高                                | 2,800.00      | 283       |
| 5.2.2  | 売買目的で保有される金融資産(区別して計上される場合)                      | 6,627,225.00  | 670,145   |
| 5.2.3  | 損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産                          |               |           |
| 5.2.4  | 売却可能金融資産                                         |               |           |
| 5.2.5  | ローンおよび未収金(ファイナンス・リースを含む。)                        | 6,318,836.00  | 638,961   |
| 5.2.6  | 満期保有目的投資有価証券                                     |               |           |
| 5.2.7  | デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク                               |               |           |
| 5.2.99 | その他の資産                                           |               |           |
| 5.3    | (支払利息)(-)                                        | 3,570,906.00  | 361,090   |
| 5.3.1  | 中央銀行からの預金                                        | 2,427,476.00  | 245,466   |
| 5.3.2  | 売買目的で保有される金融負債(区別して計上される場合)                      | 86,859.00     | 8,783     |
| 5.3.3  | 損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債                          |               |           |
| 5.3.4  | 償却後原価で測定される金融負債                                  | 1,056,571.00  | 106,840   |
| 5.3.5  | デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク                               |               |           |
| 5.3.99 | その他の負債                                           |               |           |
| 5.4    | 要求払株式資本に係る費用(-)                                  |               |           |
| 5.5    | 受取配当(+)                                          | 1,540,573.00  | 155,783   |
| 5.5.1  | 売買目的で保有される金融資産(区別して計上される場合)                      |               |           |
| 5.5.2  | 損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産                          |               |           |
| 5.5.3  | 売却可能金融資産                                         | 1,540,573.00  | 155,783   |
| 5.6    | 受取手数料(+)                                         | 50,949,549.00 | 5,152,018 |
| 5.7    | (支払手数料)(-)                                       | 24,944,611.00 | 2,522,399 |
| 5.8    | 損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負債に係る実現利益(損失)、純額(+/-) | 0.00          | 0         |
| 5.8.1  | 売却可能金融資産                                         | 0.00          | 0         |
| 5.8.2  | ローンおよび未収金(ファイナンス・リースを含む。)                        |               |           |
| 5.8.3  | 満期保有目的投資有価証券                                     |               |           |
| 5.8.4  | 償却後原価で測定される金融負債                                  |               |           |
| 5.8.99 | その他                                              |               |           |
| 5.9    | 売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益(損失)、純額(+/-)             | 2,533,259.00  | 256,163   |
| 5.9.1  | デリバティブに関するエクイティ商品                                |               |           |
| 5.9.2  | 金利商品およびデリバティブ関連                                  |               |           |
| 5.9.3  | 為替取引                                             | 2,533,259.00  | 256,163   |
| 5.9.4  | 信用リスク商品およびデリバティブ関連                               |               |           |
| 5.9.5  | 商品およびデリバティブ関連                                    |               |           |
| 5.9.99 | その他(ハイブリッド・デリバティブを含む。)                           |               |           |
| 5.10   | 損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産および負債に係る利益(損失)、純額(+/-)    |               |           |
| 5.11   | ヘッジ会計からの利益(損失)、純額(+/-)                           |               |           |
| 5.12   | 為替差額、純額(+/-)                                     |               |           |
| 5.13   | 売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る利益(損失)、純額(+/-)             |               |           |
| 5.14   | その他の事業収益(+)                                      | 650,711.00    | 65,800    |

米ドル

千円

|           |                                                    |                |           |
|-----------|----------------------------------------------------|----------------|-----------|
| 5.15      | その他の事業費用（－）                                        | 673,424.00     | 68,097    |
| 5.16      | 一般管理費（－）                                           | 22,071,208.00  | 2,231,841 |
| 5.16.1    | 従業員費用（－）                                           | 9,275,931.00   | 937,982   |
| 5.16.2    | 一般管理費用（－）                                          | 12,795,277.00  | 1,293,858 |
| 5.17      | 減価償却（＋／－）                                          | 1,091,868.00   | 110,410   |
| 5.17.1    | 有形固定資産                                             | 190,017.00     | 19,215    |
| 5.17.2    | 投資不動産                                              |                |           |
| 5.17.3    | 無形資産（営業権を除く）                                       | 901,851.00     | 91,195    |
| 5.18      | 引当金（＋／－）                                           | (2,237,832.00) | (226,290) |
| 5.19      | 減損（＋／－）                                            | 0.00           | 0         |
| 5.19.1    | 損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損（＋／－）                 | 0.00           | 0         |
| 5.19.1.1  | 取得原価で測定される金融資産（値付けされていないエクイティ）                     |                |           |
| 5.19.1.2  | 売却可能金融資産                                           |                |           |
| 5.19.1.3  | 償却後原価で測定されるローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）                |                |           |
| 5.19.1.4  | 償却後原価で測定される満期保有目的投資証券                              |                |           |
| 5.19.2    | 非金融資産に係る減損、純額（＋／－）                                 | 0.00           | 0         |
| 5.19.2.1  | 有形固定資産                                             |                |           |
| 5.19.2.2  | 投資不動産                                              |                |           |
| 5.19.2.3  | 営業権                                                |                |           |
| 5.19.2.4  | その他の無形資産                                           |                |           |
| 5.19.2.99 | その他                                                |                |           |
| 5.20      | 直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）                              |                |           |
| 5.22      | 非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される除却グループからの損益（＋／－） | 0.00           | 0         |
| 5.23      | 継続事業からの税引前損益合計（＋／－）                                | 18,508,768.00  | 1,871,607 |
| 5.24      | 継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）                         | 4,271,500.00   | 431,934   |
| 5.25      | 継続事業からの税引後損益合計（＋／－）                                | 14,237,268.00  | 1,439,673 |
| 5.26      | 非継続事業からの税引後損益（＋／－）                                 |                |           |
| 5.27      | 当期利益または損失（＋／－）                                     | 14,237,268.00  | 1,439,673 |