

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	令和元年11月29日
【計算期間】	第8期中(自 平成31年3月1日 至 令和元年8月31日)
【ファンド名】	東京海上ストラテジック・トラスト - 東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド (Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund)
【発行者名】	ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)
【代表者の役職氏名】	デュプティ・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 小林 央明
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通り 287 - 289番 (287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三浦 健 同 下瀬 伸彦
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三浦 健 同 下瀬 伸彦 同 大西 信治
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03(6212)8316
【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

（2019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	11,201,294,617	29.81
	英国	4,350,550,244	11.58
	フランス	4,287,544,680	11.41
	オランダ	2,988,007,023	7.95
	日本	2,375,773,519	6.32
	カナダ	1,541,318,238	4.10
	ベルギー	1,081,748,336	2.88
	シンガポール	886,110,696	2.36
	ドイツ	848,700,767	2.26
	アイルランド	830,042,106	2.21
	ノルウェー	698,347,820	1.86
	スペイン	677,664,610	1.80
	オーストリア	650,321,342	1.73
	イタリア	438,579,488	1.17
	ジャージー	428,915,011	1.14
	ルクセンブルグ	425,419,059	1.13
	オーストラリア	367,870,208	0.98
	ケイマン諸島	365,331,086	0.97
	バーミューダ	355,806,881	0.95
小計		34,799,345,731	92.61
現金・その他の資産 （負債控除後）		2,776,382,861	7.39
合計（純資産総額）		37,575,728,592	100.00

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

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）およびオーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、2019年9月30日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝107.92円および１豪ドル＝72.88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】

2019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
2018年10月末日	92,345,545.67	9,965,931	0.008921	0.9628
11月末日	90,421,396.10	9,758,277	0.008798	0.9495
12月末日	89,759,429.73	9,686,838	0.008783	0.9479
2019年１月末日	92,170,761.42	9,947,069	0.008988	0.9700
２月末日	91,788,317.14	9,905,795	0.009007	0.9720
３月末日	94,734,276.04	10,223,723	0.009127	0.9850
４月末日	94,742,534.71	10,224,614	0.009181	0.9908
５月末日	94,392,012.16	10,186,786	0.009170	0.9896
６月末日	96,006,805.62	10,361,054	0.009351	1.0092
７月末日	95,910,123.12	10,350,620	0.009393	1.0137
８月末日	100,909,122.83	10,890,113	0.009521	1.0275
９月末日	107,709,679.04	11,624,029	0.009425	1.0171

< 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス >

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2018年10月末日	29,716,070.17	2,165,707	0.007932	0.5781
11月末日	29,670,488.62	2,162,385	0.007798	0.5683
12月末日	29,507,304.43	2,150,492	0.007762	0.5657
2019年1月末日	29,902,209.51	2,179,273	0.007917	0.5770
2月末日	30,546,951.68	2,226,262	0.007918	0.5771
3月末日	30,130,004.00	2,195,875	0.008003	0.5833
4月末日	30,115,847.50	2,194,843	0.008028	0.5851
5月末日	30,195,638.31	2,200,658	0.007995	0.5827
6月末日	31,536,517.15	2,298,381	0.008127	0.5923
7月末日	31,415,349.09	2,289,551	0.008139	0.5932
8月末日	32,372,638.08	2,359,318	0.008224	0.5994
9月末日	32,185,047.62	2,345,646	0.008136	0.5930

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2012年12月13日～2019年9月末日）



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

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

【分配の推移】

2019年9月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
2018年10月1日～2019年9月末日	0.000555	0.059896

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
2018年10月1日～2019年9月末日	0.000712	0.051891

<参考情報>

分配の推移(2019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3会計年度(2014年3月1日～2015年2月28日)	0.000540
第4会計年度(2015年3月1日～2016年2月29日)	0.000540
第5会計年度(2016年3月1日～2017年2月28日)	0.000540
第6会計年度(2017年3月1日～2018年2月28日)	0.000540
第7会計年度(2018年3月1日～2019年2月28日)	0.000540
2019年5月	0.000045
2019年6月	0.000045
2019年7月	0.000045
2019年8月	0.000045
2019年9月	0.000060
直近1年間累計	0.000555
設定来累計	0.003615

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3会計年度(2014年3月1日～2015年2月28日)	0.000960
第4会計年度(2015年3月1日～2016年2月29日)	0.000860
第5会計年度(2016年3月1日～2017年2月28日)	0.000720
第6会計年度(2017年3月1日～2018年2月28日)	0.000720
第7会計年度(2018年3月1日～2019年2月28日)	0.000720
2019年5月	0.000060
2019年6月	0.000060
2019年7月	0.000060
2019年8月	0.000060
2019年9月	0.000052
直近1年間累計	0.000712
設定来累計	0.005432

【収益率の推移】

2019年9月末日までの1年間の収益率は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率(注)
2018年10月1日～2019年9月末日	10.24%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	収益率(注)
2018年10月1日～2019年9月末日	9.64%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<参考情報>

年間収益率の推移



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

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

ただし、2019年については2019年9月末日における課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

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

(注2) 2012年は12月13日(運用開始日)から12月末日までの収益率である。2019年は1月1日から9月末日までの収益率である。

(注3) ファンドおよび各クラスに、ベンチマークはない。

２【販売及び買戻しの実績】

2019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2019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
2018年10月１日～ 2019年９月末日	1,945,975,144 (1,945,975,144)	989,850,799 (989,850,799)	11,428,180,709 (11,428,180,709)

<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
2018年10月１日～ 2019年９月末日	777,940,323 (777,940,323)	681,829,851 (681,829,851)	3,956,008,188 (3,956,008,188)

（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

2019年 8 月末日現在

	円
資産	
現金	1,926,637,995
銀行預金 - 基準通貨	491,920,763
銀行預金 - 外国通貨	1,434,717,232
ブローカーが保有する現金	252,383,202
ブローカーが保有する現金 - 米ドル	252,383,202
有価証券（取得原価）	32,733,140,441
債券（取得原価）	32,733,140,441
未実現評価損益	835,316,181
未実現時価評価損益	2,166,966,042
未実現通貨運用損益	(1,317,980,875)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	2,059,214
未実現通貨繰延損益	(15,728,200)
未収収益	451,061,702
現金に係る未収利息	2,820,472
債券に係る未収利息	448,241,230
資本証券	329,332,850
受益証券販売未収金	329,332,850
資産合計：	36,527,872,371

2019年８月末日現在

		円
負債		
投資有価証券購入未払金		542,313,072
投資有価証券購入未払金		542,313,072
資本証券		31,702,693
受益証券買戻未払金		31,702,693
未払費用		61,253,974
未払監査費用		1,606,676
未払報告費用		93,035
未払投資顧問報酬		36,593,427
未払投資顧問報酬 - 豪ドル	(9,220,379)	
未払受託報酬		580,582
未払管理報酬		7,318,482
未払代行協会員報酬		1,057,393
未払代行協会員報酬 - 豪ドル	(582,381)	
未払販売報酬		12,540,681
未払販売報酬 - 豪ドル	(6,907,044)	
未払副管理報酬		1,463,698
負債合計：		635,269,739
資本		
ファンド受益証券		47,520,000,277
発行済ファンド受益証券（額面価額）		71,696,018,287,500
米ドル建 米ドルヘッジ	41,092,607,325,844	
ブラジル・リアル	7,390,405,365	
米ドル	2,508,702,999	
豪ドル	2,420,473,589	
ユーロ	24,652,470	
日本円	12,172,182,245	
資源国通貨バスケット	135,041,230	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,565,567,279,522	
メキシコ・ペソ	826,791,392	
トルコ・リラ	10,924,751,966	
ロシア・ルーブル	1,440,680,878	

2019年８月末日現在

円

受益証券額面超過額	(71,648,498,287,223)
-----------	----------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(41,086,991,899,473)
-------------	----------------------

ブラジル・レアル	4,880,605,635
----------	---------------

米ドル	(419,777,999)
-----	---------------

豪ドル	(834,425,589)
-----	---------------

ユーロ	(680,470)
-----	-----------

日本円	3,656,173,755
-----	---------------

資源国通貨バスケット	23,809,770
------------	------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,232,144,116)
-------------	----------------------

メキシコ・ペソ	(39,202,892)
---------	--------------

トルコ・リラ	(7,346,203,466)
--------	-----------------

ロシア・ルーブル	(194,542,378)
----------	---------------

分配金支払額	(54,253,065,427)
--------	------------------

配当金支払額	(54,253,065,427)
--------	------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(7,355,828,296)
-------------	-----------------

ブラジル・レアル	(16,121,951,041)
----------	------------------

米ドル	(2,648,447,864)
-----	-----------------

豪ドル	(4,315,737,545)
-----	-----------------

ユーロ	(18,088,238)
-----	--------------

日本円	(18,080,112,118)
-----	------------------

資源国通貨バスケット	(295,235,716)
------------	---------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(3,206,272,363)
-------------	-----------------

メキシコ・ペソ	(388,674,815)
---------	---------------

トルコ・リラ	(890,724,638)
--------	---------------

ロシア・ルーブル	(931,992,793)
----------	---------------

2019年 8 月末日現在

		円
利益剰余金		41,310,376,489
利益剰余金		41,310,376,489
米ドル建 米ドルヘッジ	32,752,599,331	
ブラジル・リアル	26,225,479,894	
米ドル	10,951,020,247	
豪ドル	15,801,064,279	
ユーロ	60,395,349	
日本円	37,094,725,854	
資源国通貨バスケット	664,481,176	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	5,004,580,515	
メキシコ・ペソ	298,837,352	
トルコ・リラ	(199,332,508)	
ロシア・ルーブル	1,429,157,174	
中間純利益		1,315,291,293
資本合計：		35,892,602,632
負債および資本合計		36,527,872,371
純資産額合計		35,892,602,632
発行済受益証券総数		14,538,499,893.21340口
受益証券 1 口当たり純資産額合計		2.468797

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

2019年３月１日から2019年８月末日までの期間

円

収益

実現損益

208,488,637

為替取引に係る実現利益

3,643,969,083

ブラジル・レアル

588,726,801

豪ドル

241,539,474

ユーロ

2,470,096

日本円

507,837,311

資源国通貨バスケット

18,495,692

豪ドル建 豪ドルヘッジ

298,700,801

メキシコ・ペソ

81,644,811

トルコ・リラ

617,992,142

ロシア・ルーブル

138,867,632

為替取引に係る実現損失

(3,284,215,127)

ブラジル・レアル

(563,879,095)

豪ドル

(307,369,274)

ユーロ

(3,389,955)

日本円

(558,164,419)

資源国通貨バスケット

(19,711,211)

豪ドル建 豪ドルヘッジ

(375,621,177)

メキシコ・ペソ

(69,944,816)

トルコ・リラ

(485,228,695)

ロシア・ルーブル

(96,923,975)

市場に係る実現利益

100,731,519

市場に係る実現損失

(59,798,366)

2019年３月１日から2019年８月末日までの期間

円

通貨に係る実現利益		207,323,461
米ドル建 米ドルヘッジ	2,681,880	
豪ドル	2	
ユーロ	1	
資源国通貨バスケット	3	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	1,853,058	
メキシコ・ペソ	2	
トルコ・リラ	5	
通貨に係る実現損失		(399,522,607)
米ドル建 米ドルヘッジ	(5,263,894)	
ブラジル・レアル	(1)	
豪ドル	(1)	
ユーロ	(1)	
資源国通貨バスケット	(5)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(1,473,951)	
メキシコ・ペソ	(1)	
トルコ・リラ	(3)	
ロシア・ルーブル	(4)	
その他の利益		674
受取利息		674,859,324
現金に係る受取利息		10,388,198
債券に係る受取利息		664,471,126
未実現評価損益		612,216,485
未実現時価評価損益		2,285,948,979
未実現通貨運用損益		(1,658,492,716)
ブラジル・レアル	(250,977,098)	
豪ドル	(44,488,204)	
ユーロ	(416,144)	
日本円	406,585,342	
資源国通貨バスケット	(3,980,360)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(55,275,965)	
メキシコ・ペソ	(19,320,568)	
トルコ・リラ	(111,305,312)	
ロシア・ルーブル	(31,982,834)	

2019年３月１日から2019年８月末日までの期間

円

未決済取引にかかる未実現為替差損益		1,681,163
米ドル建 米ドルヘッジ	593,508	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(35,180)	
未実現通貨繰延損益		(16,920,941)
収益合計：		1,495,564,446

2019年３月１日から2019年８月末日までの期間

円

費用		
費用 - 報酬		179,713,868
監査費用		921,534
報告費用		101,008
弁護士費用		198,080
投資顧問報酬		108,110,731
米ドル建 米ドルヘッジ	41,311,708	
ブラジル・レアル	7,056,322	
米ドル	9,149,826	
豪ドル	4,948,137	
ユーロ	71,336	
日本円	27,786,618	
資源国通貨バスケット	213,594	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	9,325,263	
メキシコ・ペソ	1,158,141	
トルコ・リラ	4,647,717	
ロシア・ルーブル	1,814,390	
受託報酬		1,747,363
印刷費		367,200
現金支出費用		253,894
未払管理報酬		21,686,018
代行協会員報酬		3,186,266
米ドル建 米ドルヘッジ	2,591,706	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	585,020	
販売報酬		37,803,865
米ドル建 米ドルヘッジ	30,737,565	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	6,938,384	
副保管報酬		784,836
ケイマン諸島年間報酬		123,716
副管理報酬		4,337,211
報告書作成報酬		92,146
支払利息		559,285
当座借越利息		387,815
支払利息		171,470
費用合計：		180,273,153
投資純利益		1,315,291,293

(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 2019年8月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
豪ドルクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
非グループ化の有価証券											
31,472,620.08000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/29/2019	AUD	31,472,620.08	2,254,787,588	1.000000000F 71.385566724	31,472,620.08	2,246,690,821	0	-8,096,767	-8,096,767
30,862,617.49000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	7/31/2019	AUD	30,862,617.49	2,309,614,669	1.000000000F 71.477916719	30,862,617.49	2,205,995,603	0	-103,619,066	-103,619,066
946,365.26000		8/16/2019	AUD	946,365.26	68,225,181	1.000000000F 71.477916719	946,365.26	67,644,217	0	-580,964	-580,964
-31,808,982.75000		8/29/2019	AUD	-31,808,982.75	-2,284,885,384	1.000000000F 71.477916719	-31,808,982.75	-2,273,639,820	0	11,245,564	11,245,564
0.00000	合計 -----			0	92,954,466		0	0	0	-92,954,466	-92,954,466
-21,257,300.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	AUD	-21,257,300.00	-2,254,787,593	1.000000000F 0.009450155	-21,257,300.00	-2,249,412,840	0	5,374,753	5,374,753
21,465,401.36000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	AUD	21,465,401.36	2,284,885,376	1.000000000F 0.009429488	21,465,401.36	2,276,412,183	0	-8,473,193	-8,473,193
-21,293,200.00000		7/31/2019	AUD	-21,293,200.00	-2,309,614,664	1.000000000F 0.009429488	-21,293,200.00	-2,258,150,177	0	51,464,487	51,464,487
-642,000.00000		8/16/2019	AUD	-642,000.00	-68,225,181	1.000000000F 0.009429488	-642,000.00	-68,084,290	0	140,891	140,891
-469,798.64000	合計 -----			-469,799	-92,954,469		-469,799	-49,822,284	0	43,132,185	43,132,185
0.00000											
9,745,521.44000	非グループ化の有価証券小計			9,745,521	-8		9,745,521	-52,544,303	0	-52,544,295	-52,544,295
9,745,521.44000	先物 (ポジション) 合計			9,745,521	-8		9,745,521	-52,544,303	0	-52,544,295	-52,544,295
9,745,521.44000	豪ドルクラス受益証券合計			9,745,521	-8		9,745,521	-52,544,303	0	-52,544,295	-52,544,295

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券											
先物(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
25,308,769.92000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/29/2019	AUH	25,308,769.92	1,813,191,915	1.000000000F 71.385566724	25,308,769.92	1,806,680,884	0	-6,511,031	-6,511,031
24,930,464.46000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	7/31/2019	AUH	24,930,464.46	1,865,679,942	1.000000000F 71.477916719	24,930,464.46	1,781,977,662	0	-83,702,280	-83,702,280
-24,930,464.46000		8/29/2019	AUH	-24,930,464.46	-1,790,791,435	1.000000000F 71.477916719	-24,930,464.46	-1,781,977,662	0	8,813,773	8,813,773
0.00000	合計 -----			0	74,888,507		0	0	0	-74,888,507	-74,888,507
-17,094,100.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	AUH	-17,094,100.00	-1,813,191,920	1.000000000F 0.009450155	-17,094,100.00	-1,808,869,802	0	4,322,118	4,322,118
16,823,625.89000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	AUH	16,823,625.89	1,790,791,428	1.000000000F 0.009429488	16,823,625.89	1,784,150,517	0	-6,640,911	-6,640,911
-17,200,400.00000		7/31/2019	AUH	-17,200,400.00	-1,865,679,939	1.000000000F 0.009429488	-17,200,400.00	-1,824,107,523	0	41,572,416	41,572,416
-376,774.11000	合計 -----			-376,774	-74,888,511		-376,774	-39,957,006	0	34,931,505	34,931,505
7,837,895.81000	非グループ化の有価証券小計			7,837,896	-9		7,837,896	-42,145,924	0	-42,145,915	-42,145,915
7,837,895.81000	先物(ポジション)合計			7,837,896	-9		7,837,896	-42,145,924	0	-42,145,915	-42,145,915
7,837,895.81000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			7,837,896	-9		7,837,896	-42,145,924	0	-42,145,915	-42,145,915

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>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>											
346,302.02000	AUD FORWARD 11 OCT FAU11OCT	8/29/2019	BKH	346,302.02	24,810,057	1.000000000F 71.385566724	346,302.02	24,720,966	0	-89,091	-89,091
367,860.74000	AUD FORWARD 11 SEP FAU11SEP	7/31/2019	BKH	367,860.74	27,528,986	1.000000000F 71.477916719	367,860.74	26,293,919	0	-1,235,067	-1,235,067
-367,860.74000		8/29/2019	BKH	-367,860.74	-26,423,971	1.000000000F 71.477916719	-367,860.74	-26,293,919	0	130,052	130,052
0.00000	合計 -----			0	1,105,015		0	0	0	-1,105,015	-1,105,015
0.00000											
977,631.83000	BRL FORWARD 11 OCT FBR11OCT	8/29/2019	BKH	977,631.83	24,966,527	1.000000000F 0.039165848	977,631.83	24,961,334	0	-5,193	-5,193
957,638.16000	BRL FORWARD 11 SEP FBR11SEP	7/31/2019	BKH	957,638.16	27,634,011	1.000000000F 0.038995124	957,638.16	24,557,895	0	-3,076,116	-3,076,116
-957,638.16000		8/29/2019	BKH	-957,638.16	-24,437,424	1.000000000F 0.038995124	-957,638.16	-24,557,895	0	-120,471	-120,471
0.00000	合計 -----			0	3,196,587		0	0	0	-3,196,587	-3,196,587
0.00000											
-233,900.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	BKH	-233,900.00	-24,966,528	1.000000000F 0.009450155	-233,900.00	-24,750,917	0	215,611	215,611
-233,900.00000		8/29/2019	BKH	-233,900.00	-24,810,057	1.000000000F 0.009450155	-233,900.00	-24,750,917	0	59,140	59,140
-233,900.00000		8/29/2019	BKH	-233,900.00	-25,101,869	1.000000000F 0.009450155	-233,900.00	-24,750,917	0	350,952	350,952
-701,700.00000	合計 -----			-701,700	-74,878,454		-701,700	-74,252,751	0	625,703	625,703
0.00000											
229,577.87000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	BKH	229,577.87	24,437,424	1.000000000F 0.009429488	229,577.87	24,346,801	0	-90,623	-90,623
234,987.93000		8/29/2019	BKH	234,987.93	25,013,298	1.000000000F 0.009429488	234,987.93	24,920,540	0	-92,758	-92,758
248,240.52000		8/29/2019	BKH	248,240.52	26,423,971	1.000000000F 0.009429488	248,240.52	26,325,981	0	-97,990	-97,990

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>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>											
-253,800.00000		7/31/2019		-253,800.00	-27,528,986	1.000000000F 0.009429488	-253,800.00	-26,915,565	0	613,421	613,421
			BKH								
-253,800.00000		7/31/2019		-253,800.00	-27,695,856	1.000000000F 0.009429488	-253,800.00	-26,915,565	0	780,291	780,291
			BKH								
-253,800.00000		7/31/2019		-253,800.00	-27,634,012	1.000000000F 0.009429488	-253,800.00	-26,915,565	0	718,447	718,447
-48,593.68000 0.00000	合計 -----		BKH	-48,594	-6,984,161		-48,594	-5,153,373	0	1,830,788	1,830,788
3,612,328.21000	ZAR FORWARD 11 OCT FZA11OCT	8/29/2019		3,612,328.21	25,101,869	1.000000000F 0.144281664	3,612,328.21	25,036,641	0	-65,228	-65,228
			BKH								
3,615,507.90000	ZAR FORWARD 11 SEP FZA11SEP	7/31/2019		3,615,507.90	27,695,856	1.000000000F 0.143404361	3,615,507.90	25,211,980	0	-2,483,876	-2,483,876
			BKH								
-3,615,507.90000		8/29/2019		-3,615,507.90	-25,013,298	1.000000000F 0.143404361	-3,615,507.90	-25,211,980	0	-198,682	-198,682
			BKH								
0.00000 0.00000	合計 -----			0	2,682,558		0	0	0	-2,682,558	-2,682,558
4,185,968.38000	非グループ化の有価証券小計			4,185,968	-2		4,185,968	-4,687,183	0	-4,687,181	-4,687,181
4,185,968.38000	先物(ポジション)合計			4,185,968	-2		4,185,968	-4,687,183	0	-4,687,181	-4,687,181
4,185,968.38000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			4,185,968	-2		4,185,968	-4,687,183	0	-4,687,181	-4,687,181

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
ブラジル・レアルクラス受益証券											
先物(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
94,961,530.09000	BRL FORWARD 11 OCT FBR11OCT	8/29/2019	BRH	94,961,530.09	2,425,104,800	1.000000000F 0.039165848	94,961,530.09	2,424,600,384	0	-504,416	-504,416
96,304,515.56000	BRL FORWARD 11 SEP FBR11SEP	7/31/2019	BRH	96,304,515.56	2,779,003,799	1.000000000F 0.038995124	96,304,515.56	2,469,655,323	0	-309,348,476	-309,348,476
-96,304,515.56000		8/29/2019	BRH	-96,304,515.56	-2,457,540,202	1.000000000F 0.038995124	-96,304,515.56	-2,469,655,323	0	-12,115,121	-12,115,121
0.00000	合計 -----			0	321,463,597		0	0	0	-321,463,597	-321,463,597
-22,719,700.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	BRH	-22,719,700.00	-2,425,104,820	1.000000000F 0.009450155	-22,719,700.00	-2,404,161,625	0	20,943,195	20,943,195
23,087,410.53000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	BRH	23,087,410.53	2,457,540,197	1.000000000F 0.009429488	23,087,410.53	2,448,426,736	0	-9,113,461	-9,113,461
-25,523,300.00000		7/31/2019	BRH	-25,523,300.00	-2,779,003,809	1.000000000F 0.009429488	-25,523,300.00	-2,706,753,537	0	72,250,272	72,250,272
-2,435,889.47000	合計 -----			-2,435,889	-321,463,612		-2,435,889	-258,326,801	0	63,136,811	63,136,811
0.00000											
69,805,940.62000	非グループ化の有価証券小計			69,805,941	-35		69,805,941	-237,888,042	0	-237,888,007	-237,888,007
69,805,940.62000	先物(ポジション)合計			69,805,941	-35		69,805,941	-237,888,042	0	-237,888,007	-237,888,007
69,805,940.62000	ブラジル・レアルクラス受益証券合計			69,805,941	-35		69,805,941	-237,888,042	0	-237,888,007	-237,888,007

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>ユーロクラス受益証券</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
224,872.44000	EUR FORWARD 11 OCT FEU11OCT	8/29/2019	EUH	224,872.44	26,489,388	1.000000000F 116.920952200	224,872.44	26,292,300	0	-197,088	-197,088
219,510.01000	EUR FORWARD 11 SEP FEU11SEP	7/31/2019		219,510.01	26,536,005	1.000000000F 116.898591524	219,510.01	25,660,411	0	-875,594	-875,594
-219,510.01000		8/29/2019	EUH	-219,510.01	-25,895,234	1.000000000F 116.898591524	-219,510.01	-25,660,411	0	234,823	234,823
0.00000	合計 -----			0	640,771		0	0	0	-640,771	-640,771
0.00000											
-249,800.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	EUH	-249,800.00	-26,489,388	1.000000000F 0.009450155	-249,800.00	-26,433,429	0	55,959	55,959
243,273.29000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	EUH	243,273.29	25,895,234	1.000000000F 0.009429488	243,273.29	25,799,205	0	-96,029	-96,029
-245,500.00000		7/31/2019		-245,500.00	-26,536,005	1.000000000F 0.009429488	-245,500.00	-26,035,348	0	500,657	500,657
-2,226.71000	合計 -----			-2,227	-640,771		-2,227	-236,143	0	404,628	404,628
0.00000											
-27,154.27000	非グループ化の有価証券小計			-27,154	0		-27,154	-377,272	0	-377,272	-377,272
-27,154.27000	先物(ポジション)合計			-27,154	0		-27,154	-377,272	0	-377,272	-377,272
-27,154.27000	ユーロクラス受益証券合計			-27,154	0		-27,154	-377,272	0	-377,272	-377,272

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>日本円クラス受益証券</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-2,177,000.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/27/2019		-2,177,000.00	-229,836,777	1.000000000F 0.009450155	-2,177,000.00	-230,366,592	0	-529,815	-529,815
-101,175,500.00000		8/29/2019	JPH	-101,175,500.00	-10,719,039,240	1.000000000F 0.009450155	-101,175,500.00	-10,706,226,512	0	12,812,728	12,812,728
-103,352,500.00000	合計 -----		JPH	-103,352,500	-10,948,876,017		-103,352,500	-10,936,593,104	0	12,282,913	12,282,913
0.00000											
101,392,942.67000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019		101,392,942.67	10,766,207,287	1.000000000F 0.009429488	101,392,942.67	10,752,751,652	0	-13,455,635	-13,455,635
-99,470,200.00000		7/31/2019	JPH	-99,470,200.00	-10,766,207,835	1.000000000F 0.009429488	-99,470,200.00	-10,548,844,221	0	217,363,614	217,363,614
1,922,742.67000	合計 -----		JPH	1,922,743	-548		1,922,743	203,907,431	0	203,907,979	203,907,979
0.00000											
-101,429,757.33000	非グループ化の有価証券小計			-101,429,757	-10,948,876,565		-101,429,757	-10,732,685,673	0	216,190,892	216,190,892
-101,429,757.33000	先物(ポジション)合計			-101,429,757	-10,948,876,565		-101,429,757	-10,732,685,673	0	216,190,892	216,190,892
-101,429,757.33000	日本円クラス受益証券合計			-101,429,757	-10,948,876,565		-101,429,757	-10,732,685,673	0	216,190,892	216,190,892

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>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>											
90,463,135.35	MXN FORWARD 11 OCT FMX11OCT	8/29/2019	MXH	90,463,135.35	478,838,763	1.000000000F 0.191014111	90,463,135.35	473,593,992	0	-5,244,771	-5,244,771
91,217,147.70	MXN FORWARD 11 SEP FMX11SEP	7/31/2019	MXH	91,217,147.70	521,747,641	1.000000000F 0.189617636	91,217,147.70	481,058,353	0	-40,689,288	-40,689,288
-91,217,147.70		8/29/2019	MXH	-91,217,147.70	-480,635,810	1.000000000F 0.189617636	-91,217,147.70	-481,058,353	0	-422,543	-422,543
0.00000	合計 -----			0	41,111,831		0	0	0	-41,111,831	-41,111,831
-4,455,500.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	MXH	-4,455,500.00	-478,838,766	1.000000000F 0.009450155	-4,455,500.00	-471,473,748	0	7,365,018	7,365,018
4,515,342.73000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	MXH	4,515,342.73	480,635,810	1.000000000F 0.009429488	4,515,342.73	478,853,436	0	-1,782,374	-1,782,374
-4,755,500.00000		7/31/2019	MXH	-4,755,500.00	-521,747,644	1.000000000F 0.009429488	-4,755,500.00	-504,322,186	0	17,425,458	17,425,458
-240,157.27000	合計 -----			-240,157	-41,111,834		-240,157	-25,468,750	0	15,643,084	15,643,084
0.00000											
85,767,478.08000	非グループ化の有価証券小計			85,767,478	-6		85,767,478	-23,348,506	0	-23,348,500	-23,348,500
85,767,478.08000	先物(ポジション)合計			85,767,478	-6		85,767,478	-23,348,506	0	-23,348,500	-23,348,500
85,767,478.08000	メキシコ・ペソクラス受益証券合計			85,767,478	-6		85,767,478	-23,348,506	0	-23,348,500	-23,348,500

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
ロシア・ルーブルクラス受益証券											
先物(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
403,628,807.80	RUB FORWARD 11 OCT FRU11OCT	8/29/2019	RUH	403,628,807.80	644,249,411	1.000000000F 0.633194992	403,628,807.80	637,447,884	0	-6,801,527	-6,801,527
407,075,801.40	RUB FORWARD 11 SEP FRU11SEP	7/31/2019	RUH	407,075,801.40	696,829,944	1.000000000F 0.629131638	407,075,801.40	647,043,920	0	-49,786,024	-49,786,024
-407,075,801.40		8/29/2019	RUH	-407,075,801.40	-648,670,621	1.000000000F 0.629131638	-407,075,801.40	-647,043,920	0	1,626,701	1,626,701
0.00000	合計 -----			0	48,159,323		0	0	0	-48,159,323	-48,159,323
-6,019,100.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/29/2019	RUH	-6,019,100.00	-644,249,414	1.000000000F 0.009450155	-6,019,100.00	-636,931,352	0	7,318,062	7,318,062
6,093,949.12000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	RUH	6,093,949.12	648,670,621	1.000000000F 0.009429488	6,093,949.12	646,265,112	0	-2,405,509	-2,405,509
-6,383,400.00000		7/31/2019	RUH	-6,383,400.00	-696,829,948	1.000000000F 0.009429488	-6,383,400.00	-676,961,464	0	19,868,484	19,868,484
-289,450.88000	合計 -----			-289,451	-48,159,327		-289,451	-30,696,352	0	17,462,975	17,462,975
397,320,256.92000	非グループ化の有価証券小計			397,320,257	-7		397,320,257	-30,179,820	0	-30,179,813	-30,179,813
397,320,256.92000	先物(ポジション)合計			397,320,257	-7		397,320,257	-30,179,820	0	-30,179,813	-30,179,813
397,320,256.92000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			397,320,257	-7		397,320,257	-30,179,820	0	-30,179,813	-30,179,813

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
トルコ・リラクラス受益証券											
先物(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
-1,004,500.00000		8/6/2019	TRH	-1,004,500.00	-108,398,002	1.000000000F 0.009429488	-1,004,500.00	-106,527,523	0	1,870,479	1,870,479
-1,370,600.00000		8/14/2019	TRH	-1,370,600.00	-146,443,197	1.000000000F 0.009429488	-1,370,600.00	-145,352,537	0	1,090,660	1,090,660
-739,700.00000		8/22/2019	TRH	-739,700.00	-79,354,848	1.000000000F 0.009429488	-739,700.00	-78,445,404	0	909,444	909,444
-943,996.52000 0.00000	合計 -----			-943,997	-172,941,903		-943,997	-100,111,111	0	72,830,792	72,830,792
115,212,505.83000	非グループ化の有価証券小計			115,212,506	-10		115,212,506	-102,890,108	0	-102,890,098	-102,890,098
115,212,505.83000	先物(ポジション)合計			115,212,506	-10		115,212,506	-102,890,108	0	-102,890,098	-102,890,098
115,212,505.83000	トルコ・リラクラス受益証券合計			115,212,506	-10		115,212,506	-102,890,108	0	-102,890,098	-102,890,098

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年８月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
現金											
基準通貨現金											
491,920,763.00000	JPY CASH	8/30/2019		491,920,763	491,920,763	1.000000000	491,920,763	491,920,763	0	0	0
	CASHJPY					1.000000000					
491,920,763.00000	基準通貨現金小計			491,920,763	491,920,763		491,920,763	491,920,763	0	0	0
491,920,763.00000	現金合計			491,920,763	491,920,763		491,920,763	491,920,763	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
3,800,000.00000	ABN AMRO BANK NV FRN 03272028 BNLD12GQ XS1586330604	8/14/2018		3,761,180.00	416,569,479	104.252998352 ^C 0.009421075	3,961,613.94	420,505,509	21,275,060	-17,339,030	3,936,030
3,000,000.00000	AGEAS FRN 07022049 BBEL017Z BE0002644251	4/4/2019		3,056,250.00	379,730,283	109.616996765 ^C 116.892181246	3,288,509.90	384,401,096	27,149,367	-22,478,554	4,670,813
2,250,000.00000	ASR NEDERLAND NV FRN 05022049 BNLD12IA XS1989708836	4/25/2019		2,298,401.00	283,695,075	109.688003540 ^C 116.892181246	2,467,980.08	288,487,575	19,822,469	-15,029,969	4,792,500
4,700,000.00	AXA SA FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561	5/24/2013		5,063,974.18	854,967,509	112.894996643 ^C 129.268688244	5,306,064.84	685,908,042	31,294,742	-200,354,209	-169,059,467
6,350,000.00000	BANK OF MONTREAL FRN 12152032 BCAN10EN US06368BGS16	12/7/2017		6,350,000.00	715,867,225	105.050003052 ^C 0.009421075	6,670,675.19	708,058,814	34,038,068	-41,846,479	-7,808,411
4,000,000.00000	BAWAG GROUP AG FRN 03262029 BAUT016H XS1968814332	3/19/2019		3,995,520.00	504,988,434	104.158996582 ^C 116.892181246	4,166,359.86	487,014,892	19,969,844	-37,943,386	-17,973,542
2,000,000.00000	CRDT AGR ASSR FRN 01292048 BFRA10L9 FR0013312154	1/22/2018		2,007,829.00	272,543,704	103.029998779 ^C 116.892181246	2,060,599.98	240,868,026	6,168,514	-37,844,193	-31,675,679
6,910,000.00000	DAI - ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		7,095,133.09	796,992,374	109.336997986 ^C 0.009421075	7,555,186.56	801,945,273	48,832,375	-43,879,477	4,952,898

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
5,500,000.00000	DBS GROUP HLDGS FRN 04112028 BSGP00AP XS1802465846	4/4/2018		5,484,490.00	718,652,173	102.794998169 ^C 116.892181246	5,653,724.90	660,876,236	19,782,237	-77,558,174	-57,775,937
5,250,000.00000	DISCOVER BANK FRN 08092028 BUSA9CU3 US25466AAN19	2/28/2019		5,244,015.00	583,763,733	104.960998535 ^C 0.009421075	5,510,452.42	584,906,969	28,281,000	-27,137,764	1,143,236
2,100,000.00000	DNB BANK ASA FRN PERP/CALL BNOR023W XS1207306652	9/21/2017		2,173,500.00	244,355,731	101.093002319 ^C 0.009421075	2,122,953.05	225,340,850	-5,365,306	-13,649,575	-19,014,881
3,900,000.00000	DNB BANK ASA FRN 03012027 BNOR0242 XS1571331955	2/20/2017		3,893,799.00	467,819,516	102.610000610 ^C 116.892181246	4,001,790.02	467,777,965	12,623,306	-12,664,858	-41,552
3,700,000.00000	ELM BV FOR HELVE FRN 09292047 BNLD12E4 XS1587893451	3/30/2017		3,789,961.00	451,293,194	112.047996521 ^C 116.892181246	4,145,775.87	484,608,785	41,591,976	-8,276,386	33,315,590
1,200,000.00000	ERSTE GROUP FRN PERP/CALL BAUT0160 XS1425367494	8/8/2019		1,380,000.00	164,173,234	115.211997986 ^C 116.892181246	1,382,543.98	161,608,581	297,371	-2,862,024	-2,564,653
4,300,000.00000	FUKOKU MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN3042 XS1262602532	7/22/2015		4,300,000.00	533,393,470	108.550003052 ^C 0.009421075	4,667,650.13	495,447,720	39,024,223	-76,969,973	-37,945,750
2,420,000.00	HISCOX LTD FRN 11242045 BBMU003B XS1323450236	11/17/2015		2,406,709.83	421,099,731	109.978996277 ^C 129.268688244	2,661,491.71	344,047,542	32,935,319	-109,987,508	-77,052,189
2,400,000.00	HSBC HOLDINGS FRN 07222028 GGBR22NL XS1961843171	3/5/2019		2,389,470.00	350,575,214	106.601997375 ^C 129.268688244	2,558,447.94	330,727,209	21,843,556	-41,691,562	-19,848,006
1,850,000.00000	ING GROEP NV FRN PERP/CALL BNLD12D6 XS1497755360	1/26/2018		2,030,375.00	220,468,273	105.640998840 ^C 0.009421075	1,954,358.48	207,445,379	-8,068,774	-4,954,120	-13,022,894

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
5,100,000.00000	JPMORGAN CHASE FRN 07232029 BUSA9CGJ US46647PAV85	7/16/2018		5,100,000.00	573,188,984	113.027000427 ^C 0.009421075	5,764,377.02	611,859,795	70,520,299	-31,849,487	38,670,812
2,800,000.00000	KBC GROUP NV FRN 09182029 BBEL017K BE0002290592	9/11/2017		2,792,664.00	364,426,803	105.452003479 ^C 116.892181246	2,952,656.10	345,142,412	18,701,825	-37,986,217	-19,284,392
3,000,000.00000	KBC GROUP NV FRN 12032029 BBEL0181 BE0002664457	8/27/2019		2,985,303.00	351,000,708	99.763000488 ^C 116.892181246	2,992,890.01	349,845,442	886,863	-2,042,129	-1,155,266
2,000,000.00000	MAPFRE FRN 03312047 BESPO267 ES0224244089	3/22/2017		2,000,000.00	239,987,727	117.288002014 ^C 116.892181246	2,345,760.04	274,201,008	40,416,645	-6,203,365	34,213,280
3,100,000.00000	MITSUMI SUMITOMO FRN PERP/CALL BJPN3074 USJ4517MAA74	2/27/2019		3,100,000.00	343,774,504	112.236000061 ^C 0.009421075	3,479,316.00	369,311,995	40,262,497	-14,725,006	25,537,491
1,200,000.00000	MUNICH RE FRN 05262049 BDEU43C0 XS1843448314	11/15/2018		1,187,280.00	152,187,944	121.245002747 ^C 116.892181246	1,454,940.03	170,071,114	31,287,365	-13,404,195	17,883,170
3,200,000.00000	NATIONWIDE BLDG FRN 07182030 BGBR2209 US63861VAE74	7/12/2019		3,201,216.00	345,779,362	104.777999878 ^C 0.009421075	3,352,896.00	355,893,143	16,100,073	-5,986,292	10,113,781
1,670,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		1,663,536.63	239,555,347	114.472000122 ^C 116.892181246	1,911,682.40	223,460,726	29,006,301	-45,100,922	-16,094,621
1,520,000.00000	PRINCIPAL FINL FRN 05152055 BUSA9BM4 US74251VAL62	6/13/2017		1,573,200.00	172,973,344	99.375000000 ^C 0.009421075	1,510,500.00	160,332,022	-6,655,291	-5,986,031	-12,641,322
4,600,000.00000	RABOBANK FRN PERP/CALL BNLD128M XS1171914515	4/8/2015		4,871,630.00	630,708,708	103.906997681 ^C 116.892181246	4,779,721.89	558,712,118	-10,743,339	-61,253,251	-71,996,590

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年８月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
変動利率											
1,790,000.00000	HARTFORD FINL FRN 02122047 BUSA9COP US416515BC76	12/4/2017		1,713,925.00	193,193,628	85.416200000 ^C 0.009421075	1,528,949.98	162,290,395	-19,634,173	-11,269,060	-30,903,233
9,000,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		9,207,099.97	845,881,683	107.267997742 ^C 0.009421075	9,654,119.80	1,024,736,540	47,448,919	131,405,938	178,854,857
1,290,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	3/22/2013		1,302,286.41	125,730,568	107.892997742 ^C 0.009421075	1,391,819.67	147,734,698	9,503,508	12,500,622	22,004,130
4,070,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	5/3/2012		4,368,780.70	688,268,590	112.642997742 ^C 129.268688244	4,584,570.01	592,641,351	27,894,801	-123,522,040	-95,627,239
16,150,000.00000	変動利率小計			16,592,092	1,853,074,469		17,159,459	1,927,402,984	65,213,055	9,115,460	74,328,515
ミディアム・ターム・ノート											
5,300,000.00000	AIB GROUP PLC 1.5 % 03292023 BIRLO2AW XS1799975765	12/14/2018		5,178,100.00	663,473,054	104.064002991 ^C 116.892181246	5,515,392.16	644,706,220	39,426,816	-58,193,650	-18,766,834
4,350,000.00000	BANK OF NY MELLO 3 % 10302028 BUSA9AYT US06406GAA94	10/24/2016		4,345,215.00	453,184,215	104.899002075 ^C 0.009421075	4,563,106.59	484,350,946	23,128,103	8,038,628	31,166,731
2,400,000.00000	BANQ FED CRD MUT 3 % 09112025 BFRA10FW XS1288858548	3/21/2019		2,632,320.00	331,506,019	115.501998901 ^C 116.892181246	2,772,047.97	324,030,734	16,333,108	-23,808,392	-7,475,284
2,600,000.00000	BANQ FED CRD MUT 2.375 % 03242026 BFRA10NI XS1385945131	8/13/2019		2,887,300.00	341,110,482	111.750999451 ^C 116.892181246	2,905,525.99	339,633,270	2,130,475	-3,607,687	-1,477,212
2,000,000.00000	BELFIUS BANK SA 1 % 10262024 BBEL017V BE6299156735	12/14/2018		1,956,940.00	250,743,891	105.116996765 ^C 116.892181246	2,102,339.94	245,747,101	16,996,116	-21,992,906	-4,996,790

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
私募債											
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64	8/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	104.122001648 ^C 0.009421075	6,195,259.10	657,595,773	29,721,353	33,657,775	63,379,128
26,570,000.00000	私募債小計			26,851,630	2,867,270,687		28,408,662	3,015,437,381	165,271,086	-17,104,391	148,166,695
公募債											
2,300,000.00000	AMERICAN HOMES 4 4.25 % 02152028 BUSA9C4K US02666TAA51	6/6/2019		2,347,380.00	253,951,295	108.730003357 ^C 0.009421075	2,500,790.08	265,446,361	16,283,713	-4,788,646	11,495,067
1,850,000.00000	AXA EQUI TABLE HO 5 % 04202048 BUSA9CRL US054561AM77	7/5/2019		1,905,925.50	206,726,207	108.958999634 ^C 0.009421075	2,015,741.49	213,960,880	11,656,419	-4,421,746	7,234,673
5,320,000.00000	BANK OF AMER CRP 3.95 % 04212025 BUSA99D5 US06051GFP90	4/16/2015		5,253,227.30	615,146,786	106.761001587 ^C 0.009421075	5,679,685.28	602,870,191	45,266,382	-57,542,978	-12,276,596
2,100,000.00000	CAPITAL ONE FINL 1.65 % 06122029 BUSA9D0T XS2010331440	6/5/2019		2,092,713.00	254,547,631	105.654998779 ^C 116.892181246	2,218,754.97	259,355,109	14,733,321	-9,925,844	4,807,477
2,600,000.00000	CHUBB INA HLDGS 2.5 % 03152038 BUSA9C6V XS1785813251	3/1/2018		2,599,974.00	339,008,298	125.200996399 ^C 116.892181246	3,255,225.91	380,510,457	76,593,825	-35,091,666	41,502,159
1,030,000.00000	CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71	5/5/2016		1,581,977.00	169,137,062	167.632003784 ^C 0.009421075	1,726,609.64	183,270,979	15,352,031	-1,218,114	14,133,917
8,450,000.00000	CITIGROUP INC 4.6 % 03092026 BUSA9ACG US172967KJ96	3/1/2016		8,433,269.00	957,935,011	110.331001282 ^C 0.009421075	9,322,969.61	989,586,603	94,437,271	-62,785,678	31,651,593
6,400,000.00000	CRED AGRICOLE SA 4.375 % 03172025 BFRA10ER USF2R125AC99	3/10/2015		6,410,893.72	777,075,880	106.664001465 ^C 0.009421075	6,826,496.09	724,598,424	44,114,114	-96,591,570	-52,477,456

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
71,738.60000		4/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000S 71.515193747	71,738.60	5,130,400	0	-918,628	-918,628
651.99000		4/29/2016		651.99	8	1.000000000S 71.515193747	651.99	46,627	0	46,619	46,619
651.99000		4/29/2016		651.99	53,237	1.000000000S 71.515193747	651.99	46,627	0	-6,610	-6,610
3,199.32000		5/6/2016		3,199.32	256,662	1.000000000S 71.515193747	3,199.32	228,800	0	-27,862	-27,862
37,851.41000		5/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000S 71.515193747	37,851.41	2,706,951	0	-295,815	-295,815
52,780.08000		5/13/2016		52,780.08	4,214,171	1.000000000S 71.515193747	52,780.08	3,774,578	0	-439,593	-439,593
1,000,000.00000		5/18/2016		1,000,000.00	79,969,300	1.000000000S 71.515193747	1,000,000.00	71,515,194	0	-8,454,106	-8,454,106
28,390.46000		5/26/2016		28,390.46	2,250,076	1.000000000S 71.515193747	28,390.46	2,030,349	0	-219,727	-219,727
487.18000		5/31/2016		487.18	39,143	1.000000000S 71.515193747	487.18	34,841	0	-4,302	-4,302
77,920.52000		6/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000S 71.515193747	77,920.52	5,572,501	0	-544,255	-544,255
435,877.61000		6/24/2016		435,877.61	34,923,776	1.000000000S 71.515193747	435,877.61	31,171,872	0	-3,751,904	-3,751,904
193,723.40000		6/27/2016		193,723.40	14,830,685	1.000000000S 71.515193747	193,723.40	13,854,166	0	-976,519	-976,519
51,500.28000		6/28/2016		51,500.28	3,847,670	1.000000000S 71.515193747	51,500.28	3,683,053	0	-164,617	-164,617
370.39000		6/30/2016		370.39	28,294	1.000000000S 71.515193747	370.39	26,489	0	-1,805	-1,805
41,200.23000		6/30/2016		41,200.23	3,144,683	1.000000000S 71.515193747	41,200.23	2,946,442	0	-198,241	-198,241

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
28,419.86000		7/6/2016		28,419.86	2,155,687	1.000000000 ^S 71.515193747	28,419.86	2,032,452	0	-123,235	-123,235
975,728.88000		7/8/2016		975,728.88	73,727,142	1.000000000 ^S 71.515193747	975,728.88	69,779,440	0	-3,947,702	-3,947,702
10,303.13000		7/19/2016		10,303.13	827,218	1.000000000 ^S 71.515193747	10,303.13	736,830	0	-90,388	-90,388
85,548.05000		7/26/2016		85,548.05	6,769,315	1.000000000 ^S 71.515193747	85,548.05	6,117,985	0	-651,330	-651,330
49,430.39000		7/27/2016		49,430.39	3,887,241	1.000000000 ^S 71.515193747	49,430.39	3,535,024	0	-352,217	-352,217
966.37000		7/29/2016		966.37	75,274	1.000000000 ^S 71.515193747	966.37	69,110	0	-6,164	-6,164
279,833.36000		8/18/2016		279,833.36	21,425,498	1.000000000 ^S 71.515193747	279,833.36	20,012,337	0	-1,413,161	-1,413,161
900,000.00000		8/23/2016		900,000.00	68,935,762	1.000000000 ^S 71.515193747	900,000.00	64,363,674	0	-4,572,088	-4,572,088
312.44000		8/31/2016		312.44	24,288	1.000000000 ^S 71.515193747	312.44	22,344	0	-1,944	-1,944
2,905.89000		8/31/2016		2,905.89	224,400	1.000000000 ^S 71.515193747	2,905.89	207,815	0	-16,585	-16,585
244,354.19000		9/6/2016		244,354.19	19,161,904	1.000000000 ^S 71.515193747	244,354.19	17,475,037	0	-1,686,867	-1,686,867
1,000,000.00000		9/8/2016		1,000,000.00	78,053,406	1.000000000 ^S 71.515193747	1,000,000.00	71,515,194	0	-6,538,212	-6,538,212
397,132.94000		9/14/2016		397,132.94	30,405,336	1.000000000 ^S 71.515193747	397,132.94	28,401,039	0	-2,004,297	-2,004,297
74,453.68000		9/20/2016		74,453.68	5,728,229	1.000000000 ^S 71.515193747	74,453.68	5,324,569	0	-403,660	-403,660
109,580.94000		9/26/2016		109,580.94	8,438,525	1.000000000 ^S 71.515193747	109,580.94	7,836,702	0	-601,823	-601,823

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
279,833.36000		12/15/2016		279,833.36	24,213,667	1.000000000 ^S 71.515193747	279,833.36	20,012,337	0	-4,201,330	-4,201,330
829.17000		12/21/2016		829.17	70,900	1.000000000 ^S 71.515193747	829.17	59,298	0	-11,602	-11,602
464.62000		12/30/2016		464.62	39,240	1.000000000 ^S 71.515193747	464.62	33,227	0	-6,013	-6,013
1,226,556.69000		1/5/2017		1,226,556.69	104,711,557	1.000000000 ^S 71.515193747	1,226,556.69	87,717,439	0	-16,994,118	-16,994,118
282,384.02000		1/27/2017		282,384.02	24,408,543	1.000000000 ^S 71.515193747	282,384.02	20,194,748	0	-4,213,795	-4,213,795
1,199,688.72000		1/27/2017		1,199,688.72	103,697,984	1.000000000 ^S 71.515193747	1,199,688.72	85,795,971	0	-17,902,013	-17,902,013
587.10000		1/31/2017		587.10	50,174	1.000000000 ^S 71.515193747	587.10	41,987	0	-8,187	-8,187
277,517.50000		2/15/2017		277,517.50	24,213,142	1.000000000 ^S 71.515193747	277,517.50	19,846,718	0	-4,366,424	-4,366,424
786,360.14000		2/15/2017		786,360.14	68,609,185	1.000000000 ^S 71.515193747	786,360.14	56,236,698	0	-12,372,487	-12,372,487
63,860.76000		2/27/2017		63,860.76	5,510,685	1.000000000 ^S 71.515193747	63,860.76	4,567,015	0	-943,670	-943,670
598.25000		2/28/2017		598.25	51,463	1.000000000 ^S 71.515193747	598.25	42,784	0	-8,679	-8,679
702,000.00000		3/10/2017		702,000.00	60,452,566	1.000000000 ^S 71.515193747	702,000.00	50,203,666	0	-10,248,900	-10,248,900
1,412,000.00000		3/16/2017		1,412,000.00	122,935,970	1.000000000 ^S 71.515193747	1,412,000.00	100,979,454	0	-21,956,516	-21,956,516
62,745.10000		3/27/2017		62,745.10	5,307,406	1.000000000 ^S 71.515193747	62,745.10	4,487,228	0	-820,178	-820,178
470.71000		3/31/2017		470.71	40,012	1.000000000 ^S 71.515193747	470.71	33,663	0	-6,349	-6,349

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
270,000.00000		6/16/2017		270,000.00	22,642,776	1.000000000S 71.515193747	270,000.00	19,309,102	0	-3,333,674	-3,333,674
701,045.96000		6/28/2017		701,045.96	59,720,715	1.000000000S 71.515193747	701,045.96	50,135,438	0	-9,585,277	-9,585,277
1,125,804.00000		6/28/2017		1,125,804.00	95,905,011	1.000000000S 71.515193747	1,125,804.00	80,512,091	0	-15,392,920	-15,392,920
1,347,714.81000		6/28/2017		1,347,714.81	114,809,152	1.000000000S 71.515193747	1,347,714.81	96,382,086	0	-18,427,066	-18,427,066
1,390,000.00000		6/28/2017		1,390,000.00	118,411,344	1.000000000S 71.515193747	1,390,000.00	99,406,119	0	-19,005,225	-19,005,225
754.51000		6/30/2017		754.51	65,028	1.000000000S 71.515193747	754.51	53,959	0	-11,069	-11,069
1,264,000.00000		7/18/2017		1,264,000.00	111,466,230	1.000000000S 71.515193747	1,264,000.00	90,395,205	0	-21,071,025	-21,071,025
118,871.82000		7/25/2017		118,871.82	10,477,503	1.000000000S 71.515193747	118,871.82	8,501,141	0	-1,976,362	-1,976,362
604.28000		7/31/2017		604.28	53,306	1.000000000S 71.515193747	604.28	43,215	0	-10,091	-10,091
1,203,000.00000		8/17/2017		1,203,000.00	105,081,064	1.000000000S 71.515193747	1,203,000.00	86,032,778	0	-19,048,286	-19,048,286
772,000.00000		8/30/2017		772,000.00	66,991,892	1.000000000S 71.515193747	772,000.00	55,209,730	0	-11,782,162	-11,782,162
607.32000		8/31/2017		607.32	53,015	1.000000000S 71.515193747	607.32	43,433	0	-9,582	-9,582
2,039.21000		9/1/2017		2,039.21	178,011	1.000000000S 71.515193747	2,039.21	145,834	0	-32,177	-32,177
1,760,000.00000		9/18/2017		1,760,000.00	156,419,764	1.000000000S 71.515193747	1,760,000.00	125,866,741	0	-30,553,023	-30,553,023
11,349.96000		9/27/2017		11,349.96	1,003,371	1.000000000S 71.515193747	11,349.96	811,695	0	-191,676	-191,676

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
1,305,655.07000		5/16/2018		1,305,655.07	107,677,003	1.000000000S 71.515193747	1,305,655.07	93,374,175	0	-14,302,828	-14,302,828
28,442.03000		5/24/2018		28,442.03	2,361,408	1.000000000S 71.515193747	28,442.03	2,034,037	0	-327,371	-327,371
337.42000		5/31/2018		337.42	27,738	1.000000000S 71.515193747	337.42	24,131	0	-3,607	-3,607
41,255.59000		6/5/2018		41,255.59	3,458,418	1.000000000S 71.515193747	41,255.59	2,950,402	0	-508,016	-508,016
58,915.23000		6/6/2018		58,915.23	4,919,294	1.000000000S 71.515193747	58,915.23	4,213,334	0	-705,960	-705,960
777,655.00000		6/13/2018		777,655.00	65,293,219	1.000000000S 71.515193747	777,655.00	55,614,148	0	-9,679,071	-9,679,071
537.23000		6/29/2018		537.23	43,966	1.000000000S 71.515193747	537.23	38,420	0	-5,546	-5,546
690,000.00000		7/24/2018		690,000.00	56,754,011	1.000000000S 71.515193747	690,000.00	49,345,484	0	-7,408,527	-7,408,527
31,207.59000		7/30/2018		31,207.59	2,564,892	1.000000000S 71.515193747	31,207.59	2,231,817	0	-333,075	-333,075
377.22000		7/31/2018		377.22	31,391	1.000000000S 71.515193747	377.22	26,977	0	-4,414	-4,414
144,861.46000		7/31/2018		144,861.46	11,909,905	1.000000000S 71.515193747	144,861.46	10,359,795	0	-1,550,110	-1,550,110
118,572.90000		8/21/2018		118,572.90	9,567,568	1.000000000S 71.515193747	118,572.90	8,479,764	0	-1,087,804	-1,087,804
110,597.95000		8/28/2018		110,597.95	9,022,493	1.000000000S 71.515193747	110,597.95	7,909,434	0	-1,113,059	-1,113,059
110,062.03000		8/29/2018		110,062.03	8,986,444	1.000000000S 71.515193747	110,062.03	7,871,107	0	-1,115,337	-1,115,337
541.98000		8/31/2018		541.98	43,462	1.000000000S 71.515193747	541.98	38,760	0	-4,702	-4,702

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
344.55000		2/28/2019		344.55	27,288	1.000000000S 71.515193747	344.55	24,641	0	-2,647	-2,647
130,705.64000		2/28/2019		130,705.64	10,352,769	1.000000000S 71.515193747	130,705.64	9,347,439	0	-1,005,330	-1,005,330
122,045.83000		3/5/2019		122,045.83	9,671,860	1.000000000S 71.515193747	122,045.83	8,728,131	0	-943,729	-943,729
6,205.83000		3/8/2019		6,205.83	486,732	1.000000000S 71.515193747	6,205.83	443,811	0	-42,921	-42,921
50,174.39000		3/12/2019		50,174.39	3,937,071	1.000000000S 71.515193747	50,174.39	3,588,231	0	-348,840	-348,840
1,309,616.57000		3/14/2019		1,309,616.57	103,235,373	1.000000000S 71.515193747	1,309,616.57	93,657,483	0	-9,577,890	-9,577,890
817.38000		3/29/2019		817.38	64,267	1.000000000S 71.515193747	817.38	58,455	0	-5,812	-5,812
980,000.00000		3/29/2019		980,000.00	76,680,395	1.000000000S 71.515193747	980,000.00	70,084,890	0	-6,595,505	-6,595,505
348,561.68000		4/3/2019		348,561.68	27,414,241	1.000000000S 71.515193747	348,561.68	24,927,456	0	-2,486,785	-2,486,785
757.42000		4/30/2019		757.42	59,375	1.000000000S 71.515193747	757.42	54,167	0	-5,208	-5,208
225,051.00000		5/22/2019		225,051.00	17,131,923	1.000000000S 71.515193747	225,051.00	16,094,566	0	-1,037,357	-1,037,357
270,321.00000		5/22/2019		270,321.00	20,578,085	1.000000000S 71.515193747	270,321.00	19,332,059	0	-1,246,026	-1,246,026
824,616.57000		5/22/2019		824,616.57	62,773,628	1.000000000S 71.515193747	824,616.57	58,972,614	0	-3,801,014	-3,801,014
969,628.00000		5/22/2019		969,628.00	73,812,569	1.000000000S 71.515193747	969,628.00	69,343,134	0	-4,469,435	-4,469,435
23,246.84000		5/24/2019		23,246.84	1,756,916	1.000000000S 71.515193747	23,246.84	1,662,502	0	-94,414	-94,414

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
9,866.90000		5/28/2019		9,866.90	747,461	1.000000000S 71.515193747	9,866.90	705,633	0	-41,828	-41,828
406.98000		5/31/2019		406.98	30,616	1.000000000S 71.515193747	406.98	29,105	0	-1,511	-1,511
407,039.23000		6/5/2019		407,039.23	30,767,128	1.000000000S 71.515193747	407,039.23	29,109,489	0	-1,657,639	-1,657,639
108,816.91000		6/17/2019		108,816.91	8,116,170	1.000000000S 71.515193747	108,816.91	7,782,062	0	-334,108	-334,108
264,480.03000		6/19/2019		264,480.03	19,708,851	1.000000000S 71.515193747	264,480.03	18,914,341	0	-794,510	-794,510
279,974.49000		6/21/2019		279,974.49	20,833,547	1.000000000S 71.515193747	279,974.49	20,022,430	0	-811,117	-811,117
28,800.40000		6/24/2019		28,800.40	2,145,362	1.000000000S 71.515193747	28,800.40	2,059,666	0	-85,696	-85,696
21,821.41000		6/26/2019		21,821.41	1,626,618	1.000000000S 71.515193747	21,821.41	1,560,562	0	-66,056	-66,056
55,817.33000		6/27/2019		55,817.33	4,195,210	1.000000000S 71.515193747	55,817.33	3,991,787	0	-203,423	-203,423
350.04000		6/28/2019		350.04	26,465	1.000000000S 71.515193747	350.04	25,033	0	-1,432	-1,432
27,908.70000		7/2/2019		27,908.70	2,106,119	1.000000000S 71.515193747	27,908.70	1,995,896	0	-110,223	-110,223
59,549.79000		7/3/2019		59,549.79	4,503,747	1.000000000S 71.515193747	59,549.79	4,258,715	0	-245,032	-245,032
131,731.93000		7/5/2019		131,731.93	9,968,860	1.000000000S 71.515193747	131,731.93	9,420,834	0	-548,026	-548,026
1,131.71000		7/26/2019		1,131.71	85,538	1.000000000S 71.515193747	1,131.71	80,934	0	-4,604	-4,604
114,258.08000		7/29/2019		114,258.08	8,579,187	1.000000000S 71.515193747	114,258.08	8,171,189	0	-407,998	-407,998

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
4.01000		7/31/2019		4.01	300	1.000000000S 71.515193747	4.01	287	0	-13	-13
417.64000		7/31/2019		417.64	31,254	1.000000000S 71.515193747	417.64	29,868	0	-1,386	-1,386
134,803.62000		8/6/2019		134,803.62	9,687,573	1.000000000S 71.515193747	134,803.62	9,640,507	0	-47,066	-47,066
86,380.36000		8/7/2019		86,380.36	6,225,477	1.000000000S 71.515193747	86,380.36	6,177,508	0	-47,969	-47,969
143,214.88000		8/13/2019		143,214.88	10,194,166	1.000000000S 71.515193747	143,214.88	10,242,040	0	47,874	47,874
39,099.81000		8/22/2019		39,099.81	2,826,023	1.000000000S 71.515193747	39,099.81	2,796,230	0	-29,793	-29,793
971.71000		8/23/2019		971.71	69,976	1.000000000S 71.515193747	971.71	69,492	0	-484	-484
121,648.02000		8/27/2019		121,648.02	8,734,737	1.000000000S 71.515193747	121,648.02	8,699,682	0	-35,055	-35,055
61,537.04000		8/29/2019		61,537.04	4,393,490	1.000000000S 71.515193747	61,537.04	4,400,833	0	7,343	7,343
15,452.99000		8/30/2019		15,452.99	1,107,096	1.000000000S 71.515193747	15,452.99	1,105,124	0	-1,972	-1,972
-1,943,105.86000		11/21/2014		-1,943,105.86	-197,922,272	1.000000000S 71.515193747	-1,943,105.86	-138,961,592	0	58,960,680	58,960,680
-89,212.14000		11/25/2014		-89,212.14	-9,098,869	1.000000000S 71.515193747	-89,212.14	-6,380,023	0	2,718,846	2,718,846
-603,479.44000		11/26/2014		-603,479.44	-60,728,438	1.000000000S 71.515193747	-603,479.44	-43,157,949	0	17,570,489	17,570,489
-86,787.10000		11/28/2014		-86,787.10	-8,741,712	1.000000000S 71.515193747	-86,787.10	-6,206,596	0	2,535,116	2,535,116
-336,619.36000		12/1/2014		-336,619.36	-34,098,751	1.000000000S 71.515193747	-336,619.36	-24,073,399	0	10,025,352	10,025,352

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-128,192.28000		2/9/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.000000000S 71.515193747	-128,192.28	-9,167,696	0	2,744,555	2,744,555
-76,498.09000		2/10/2015		-76,498.09	-7,094,696	1.000000000S 71.515193747	-76,498.09	-5,470,776	0	1,623,920	1,623,920
-643,025.87000		2/12/2015		-643,025.87	-59,704,371	1.000000000S 71.515193747	-643,025.87	-45,986,120	0	13,718,251	13,718,251
-195,720.57000		2/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.000000000S 71.515193747	-195,720.57	-13,996,994	0	4,173,323	4,173,323
-12,078.57000		2/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.000000000S 71.515193747	-12,078.57	-863,801	0	256,157	256,157
-203,751.45000		2/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000S 71.515193747	-203,751.45	-14,571,324	0	4,377,757	4,377,757
-16,686.40000		2/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.000000000S 71.515193747	-16,686.40	-1,193,331	0	361,382	361,382
-164,421.91000		3/2/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.000000000S 71.515193747	-164,421.91	-11,758,665	0	3,626,927	3,626,927
-12,405.71000		3/3/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.000000000S 71.515193747	-12,405.71	-887,197	0	272,676	272,676
-125,474.92000		3/6/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000S 71.515193747	-125,474.92	-8,973,363	0	2,750,787	2,750,787
-152,618.80000		3/9/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.000000000S 71.515193747	-152,618.80	-10,914,563	0	3,381,136	3,381,136
-708,611.63000		3/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.000000000S 71.515193747	-708,611.63	-50,676,498	0	14,930,733	14,930,733
-27,978.64000		3/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.000000000S 71.515193747	-27,978.64	-2,000,898	0	589,521	589,521
-174,287.44000		3/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.000000000S 71.515193747	-174,287.44	-12,464,200	0	3,821,635	3,821,635
-7,763.28000		3/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000S 71.515193747	-7,763.28	-555,192	0	165,792	165,792

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-86,093.85000		9/1/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000 ^S 71.515193747	-86,093.85	-6,157,018	0	1,239,658	1,239,658
-93,737.05000		9/2/2015		-93,737.05	-7,905,601	1.000000000 ^S 71.515193747	-93,737.05	-6,703,623	0	1,201,978	1,201,978
-4,157.48000		9/3/2015		-4,157.48	-349,983	1.000000000 ^S 71.515193747	-4,157.48	-297,323	0	52,660	52,660
-102,367.87000		9/4/2015		-102,367.87	-8,650,619	1.000000000 ^S 71.515193747	-102,367.87	-7,320,858	0	1,329,761	1,329,761
-642,283.89000		9/9/2015		-642,283.89	-53,850,984	1.000000000 ^S 71.515193747	-642,283.89	-45,933,057	0	7,917,927	7,917,927
-476,290.57000		9/10/2015		-476,290.57	-40,505,866	1.000000000 ^S 71.515193747	-476,290.57	-34,062,012	0	6,443,854	6,443,854
-107,114.37000		9/11/2015		-107,114.37	-9,136,362	1.000000000 ^S 71.515193747	-107,114.37	-7,660,305	0	1,476,057	1,476,057
-575,423.39000		9/14/2015		-575,423.39	-48,988,118	1.000000000 ^S 71.515193747	-575,423.39	-41,151,515	0	7,836,603	7,836,603
-92,596.64000		9/14/2015		-92,596.64	-7,883,126	1.000000000 ^S 71.515193747	-92,596.64	-6,622,067	0	1,261,059	1,261,059
-636,341.83000		9/15/2015		-636,341.83	-54,620,063	1.000000000 ^S 71.515193747	-636,341.83	-45,508,109	0	9,111,954	9,111,954
-57,680.52000		9/16/2015		-57,680.52	-4,915,496	1.000000000 ^S 71.515193747	-57,680.52	-4,125,034	0	790,462	790,462
-148,138.07000		9/17/2015		-148,138.07	-12,842,800	1.000000000 ^S 71.515193747	-148,138.07	-10,594,123	0	2,248,677	2,248,677
-888,355.94000		9/18/2015		-888,355.94	-76,774,291	1.000000000 ^S 71.515193747	-888,355.94	-63,530,947	0	13,243,344	13,243,344
-252,646.81000		9/24/2015		-252,646.81	-21,364,671	1.000000000 ^S 71.515193747	-252,646.81	-18,068,086	0	3,296,585	3,296,585
-49,056.91000		9/25/2015		-49,056.91	-4,093,695	1.000000000 ^S 71.515193747	-49,056.91	-3,508,314	0	585,381	585,381

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-72,142.91000		9/28/2015		-72,142.91	-6,115,979	1.000000000 ^S 71.515193747	-72,142.91	-5,159,314	0	956,665	956,665
-70,823.93000		9/30/2015		-70,823.93	-5,954,410	1.000000000 ^S 71.515193747	-70,823.93	-5,064,987	0	889,423	889,423
-198,025.63000		10/1/2015		-198,025.63	-16,654,940	1.000000000 ^S 71.515193747	-198,025.63	-14,161,841	0	2,493,099	2,493,099
-122,307.91000		10/6/2015		-122,307.91	-10,416,695	1.000000000 ^S 71.515193747	-122,307.91	-8,746,874	0	1,669,821	1,669,821
-39,456.54000		10/6/2015		-39,456.54	-3,360,426	1.000000000 ^S 71.515193747	-39,456.54	-2,821,742	0	538,684	538,684
-17,998.66000		10/7/2015		-17,998.66	-1,543,637	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,998.66	-1,287,178	0	256,459	256,459
-94,044.65000		10/8/2015		-94,044.65	-8,145,767	1.000000000 ^S 71.515193747	-94,044.65	-6,725,621	0	1,420,146	1,420,146
-413,942.78000		10/9/2015		-413,942.78	-35,732,854	1.000000000 ^S 71.515193747	-413,942.78	-29,603,198	0	6,129,656	6,129,656
-18,029.52000		10/9/2015		-18,029.52	-1,556,365	1.000000000 ^S 71.515193747	-18,029.52	-1,289,385	0	266,980	266,980
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324	1.000000000 ^S 71.515193747	-201,846.72	-14,435,107	0	3,044,217	3,044,217
-106,109.09000		10/15/2015		-106,109.09	-9,188,731	1.000000000 ^S 71.515193747	-106,109.09	-7,588,412	0	1,600,319	1,600,319
-13,046.14000		10/16/2015		-13,046.14	-1,131,560	1.000000000 ^S 71.515193747	-13,046.14	-932,997	0	198,563	198,563
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340	1.000000000 ^S 71.515193747	-938,332.24	-67,105,012	0	14,105,328	14,105,328
-52,217.18000		10/26/2015		-52,217.18	-4,570,998	1.000000000 ^S 71.515193747	-52,217.18	-3,734,322	0	836,676	836,676
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268	1.000000000 ^S 71.515193747	-156,124.38	-11,165,265	0	2,540,003	2,540,003

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000S 71.515193747	-221,516.12	-15,841,768	0	3,155,690	3,155,690
-22,603.85000		11/5/2015		-22,603.85	-1,966,401	1.000000000S 71.515193747	-22,603.85	-1,616,519	0	349,882	349,882
-28,494.89000		11/6/2015		-28,494.89	-2,474,770	1.000000000S 71.515193747	-28,494.89	-2,037,818	0	436,952	436,952
-33,113.93000		11/10/2015		-33,113.93	-2,878,332	1.000000000S 71.515193747	-33,113.93	-2,368,149	0	510,183	510,183
-908,189.06000		11/12/2015		-908,189.06	-78,762,965	1.000000000S 71.515193747	-908,189.06	-64,949,317	0	13,813,648	13,813,648
-377,515.60000		11/12/2015		-377,515.60	-32,740,152	1.000000000S 71.515193747	-377,515.60	-26,998,101	0	5,742,051	5,742,051
-6,155.13000		11/13/2015		-6,155.13	-537,849	1.000000000S 71.515193747	-6,155.13	-440,185	0	97,664	97,664
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000S 71.515193747	-156,394.49	-11,184,582	0	2,452,950	2,452,950
-16,749.47000		11/18/2015		-16,749.47	-1,472,174	1.000000000S 71.515193747	-16,749.47	-1,197,842	0	274,332	274,332
-535,263.52000		11/19/2015		-535,263.52	-46,835,996	1.000000000S 71.515193747	-535,263.52	-38,279,474	0	8,556,522	8,556,522
-171,111.94000		11/20/2015		-171,111.94	-15,132,801	1.000000000S 71.515193747	-171,111.94	-12,237,104	0	2,895,697	2,895,697
-74,491.46000		11/24/2015		-74,491.46	-6,589,055	1.000000000S 71.515193747	-74,491.46	-5,327,271	0	1,261,784	1,261,784
-907,253.22000		11/25/2015		-907,253.22	-80,284,748	1.000000000S 71.515193747	-907,253.22	-64,882,390	0	15,402,358	15,402,358
-124,050.79000		11/27/2015		-124,050.79	-10,988,000	1.000000000S 71.515193747	-124,050.79	-8,871,516	0	2,116,484	2,116,484
-125,483.80000		12/1/2015		-125,483.80	-11,209,303	1.000000000S 71.515193747	-125,483.80	-8,973,998	0	2,235,305	2,235,305

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-29,511.79000		12/3/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000 ^S 71.515193747	-29,511.79	-2,110,541	0	555,899	555,899
-33,063.02000		12/4/2015		-33,063.02	-2,969,898	1.000000000 ^S 71.515193747	-33,063.02	-2,364,508	0	605,390	605,390
-33,111.98000		12/8/2015		-33,111.98	-2,969,410	1.000000000 ^S 71.515193747	-33,111.98	-2,368,010	0	601,400	601,400
-329,209.04000		12/9/2015		-329,209.04	-29,234,099	1.000000000 ^S 71.515193747	-329,209.04	-23,543,448	0	5,690,651	5,690,651
-29,648.06000		12/10/2015		-29,648.06	-2,614,894	1.000000000 ^S 71.515193747	-29,648.06	-2,120,287	0	494,607	494,607
-327,000.00000		12/11/2015		-327,000.00	-28,998,504	1.000000000 ^S 71.515193747	-327,000.00	-23,385,468	0	5,613,036	5,613,036
-92,475.65000		12/11/2015		-92,475.65	-8,200,781	1.000000000 ^S 71.515193747	-92,475.65	-6,613,414	0	1,587,367	1,587,367
-57,766.60000		12/11/2015		-57,766.60	-5,122,768	1.000000000 ^S 71.515193747	-57,766.60	-4,131,190	0	991,578	991,578
-34,992.57000		12/14/2015		-34,992.57	-3,051,138	1.000000000 ^S 71.515193747	-34,992.57	-2,502,500	0	548,638	548,638
-288,079.45000		12/15/2015		-288,079.45	-25,176,774	1.000000000 ^S 71.515193747	-288,079.45	-20,602,058	0	4,574,716	4,574,716
-109,269.69000		12/16/2015		-109,269.69	-9,536,047	1.000000000 ^S 71.515193747	-109,269.69	-7,814,443	0	1,721,604	1,721,604
-26,796.21000		12/18/2015		-26,796.21	-2,338,039	1.000000000 ^S 71.515193747	-26,796.21	-1,916,336	0	421,703	421,703
-35,901.50000		12/30/2015		-35,901.50	-3,154,307	1.000000000 ^S 71.515193747	-35,901.50	-2,567,503	0	586,804	586,804
-191,729.95000		1/4/2016		-191,729.95	-16,780,325	1.000000000 ^S 71.515193747	-191,729.95	-13,711,605	0	3,068,720	3,068,720
-223,008.99000		1/5/2016		-223,008.99	-19,064,056	1.000000000 ^S 71.515193747	-223,008.99	-15,948,531	0	3,115,525	3,115,525

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-17,213.36000		1/7/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,213.36	-1,231,017	0	211,547	211,547
-379,405.26000		1/12/2016		-379,405.26	-31,131,953	1.000000000 ^S 71.515193747	-379,405.26	-27,133,241	0	3,998,712	3,998,712
-189,599.29000		1/15/2016		-189,599.29	-15,584,866	1.000000000 ^S 71.515193747	-189,599.29	-13,559,230	0	2,025,636	2,025,636
-8,880.25000		1/19/2016		-8,880.25	-716,821	1.000000000 ^S 71.515193747	-8,880.25	-635,073	0	81,748	81,748
-90,489.83000		1/21/2016		-90,489.83	-7,198,238	1.000000000 ^S 71.515193747	-90,489.83	-6,471,398	0	726,840	726,840
-57,779.34000		1/21/2016		-57,779.34	-4,596,201	1.000000000 ^S 71.515193747	-57,779.34	-4,132,101	0	464,100	464,100
-7,629.83000		1/21/2016		-7,629.83	-606,934	1.000000000 ^S 71.515193747	-7,629.83	-545,649	0	61,285	61,285
-121,619.56000		1/22/2016		-121,619.56	-9,910,282	1.000000000 ^S 71.515193747	-121,619.56	-8,697,646	0	1,212,636	1,212,636
-214,100.94000		2/1/2016		-214,100.94	-18,334,604	1.000000000 ^S 71.515193747	-214,100.94	-15,311,470	0	3,023,134	3,023,134
-21,646.66000		2/4/2016		-21,646.66	-1,815,370	1.000000000 ^S 71.515193747	-21,646.66	-1,548,065	0	267,305	267,305
-14,653.90000		2/5/2016		-14,653.90	-1,240,675	1.000000000 ^S 71.515193747	-14,653.90	-1,047,976	0	192,699	192,699
-30,116.40000		2/10/2016		-30,116.40	-2,445,030	1.000000000 ^S 71.515193747	-30,116.40	-2,153,780	0	291,250	291,250
-381,805.81000		2/12/2016		-381,805.81	-30,235,477	1.000000000 ^S 71.515193747	-381,805.81	-27,304,916	0	2,930,561	2,930,561
-152,354.76000		2/12/2016		-152,354.76	-12,065,083	1.000000000 ^S 71.515193747	-152,354.76	-10,895,680	0	1,169,403	1,169,403
-16,916.50000		2/17/2016		-16,916.50	-1,364,954	1.000000000 ^S 71.515193747	-16,916.50	-1,209,787	0	155,167	155,167

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-114,575.44000		2/22/2016		-114,575.44	-9,163,101	1.000000000S 71.515193747	-114,575.44	-8,193,885	0	969,216	969,216
-37,349.25000		2/23/2016		-37,349.25	-3,051,565	1.000000000S 71.515193747	-37,349.25	-2,671,039	0	380,526	380,526
-123,804.34000		3/2/2016		-123,804.34	-10,057,811	1.000000000S 71.515193747	-123,804.34	-8,853,891	0	1,203,920	1,203,920
-27,289.30000		3/3/2016		-27,289.30	-2,257,397	1.000000000S 71.515193747	-27,289.30	-1,951,600	0	305,797	305,797
-10,054.65000		3/7/2016		-10,054.65	-847,732	1.000000000S 71.515193747	-10,054.65	-719,060	0	128,672	128,672
-211,885.31000		3/9/2016		-211,885.31	-17,733,243	1.000000000S 71.515193747	-211,885.31	-15,153,019	0	2,580,224	2,580,224
-377,078.03000		3/11/2016		-377,078.03	-31,843,855	1.000000000S 71.515193747	-377,078.03	-26,966,808	0	4,877,047	4,877,047
-74,706.21000		3/14/2016		-74,706.21	-6,403,880	1.000000000S 71.515193747	-74,706.21	-5,342,629	0	1,061,251	1,061,251
-73,687.89000		3/15/2016		-73,687.89	-6,289,651	1.000000000S 71.515193747	-73,687.89	-5,269,804	0	1,019,847	1,019,847
-45,075.31000		3/16/2016		-45,075.31	-3,796,491	1.000000000S 71.515193747	-45,075.31	-3,223,570	0	572,921	572,921
-29,125.30000		3/18/2016		-29,125.30	-2,475,492	1.000000000S 71.515193747	-29,125.30	-2,082,901	0	392,591	392,591
-97,821.68000		3/22/2016		-97,821.68	-8,292,500	1.000000000S 71.515193747	-97,821.68	-6,995,736	0	1,296,764	1,296,764
-112,039.68000		3/23/2016		-112,039.68	-9,552,811	1.000000000S 71.515193747	-112,039.68	-8,012,539	0	1,540,272	1,540,272
-159,202.44000		3/24/2016		-159,202.44	-13,507,411	1.000000000S 71.515193747	-159,202.44	-11,385,393	0	2,122,018	2,122,018
-32,177.14000		3/31/2016		-32,177.14	-2,784,601	1.000000000S 71.515193747	-32,177.14	-2,301,154	0	483,447	483,447

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-64,762.22000		4/5/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000S 71.515193747	-64,762.22	-4,631,483	0	854,136	854,136
-26,208.62000		4/6/2016		-26,208.62	-2,182,406	1.000000000S 71.515193747	-26,208.62	-1,874,315	0	308,091	308,091
-373,765.27000		4/11/2016		-373,765.27	-30,674,974	1.000000000S 71.515193747	-373,765.27	-26,729,896	0	3,945,078	3,945,078
-204,881.37000		4/11/2016		-204,881.37	-16,814,646	1.000000000S 71.515193747	-204,881.37	-14,652,131	0	2,162,515	2,162,515
-43,019.52000		4/12/2016		-43,019.52	-3,527,545	1.000000000S 71.515193747	-43,019.52	-3,076,549	0	450,996	450,996
-33,801.18000		4/13/2016		-33,801.18	-2,800,107	1.000000000S 71.515193747	-33,801.18	-2,417,298	0	382,809	382,809
-141,797.35000		4/14/2016		-141,797.35	-11,838,108	1.000000000S 71.515193747	-141,797.35	-10,140,665	0	1,697,443	1,697,443
-3,319.09000		4/18/2016		-3,319.09	-278,038	1.000000000S 71.515193747	-3,319.09	-237,365	0	40,673	40,673
-83,104.57000		4/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000S 71.515193747	-83,104.57	-5,943,239	0	1,056,597	1,056,597
-7,007.13000		4/19/2016		-7,007.13	-590,205	1.000000000S 71.515193747	-7,007.13	-501,116	0	89,089	89,089
-32,699.55000		4/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000S 71.515193747	-32,699.55	-2,338,515	0	453,567	453,567
-2,677,613.47000		4/21/2016		-2,677,613.47	-228,369,211	1.000000000S 71.515193747	-2,677,613.47	-191,490,046	0	36,879,165	36,879,165
-92,321.29000		4/21/2016		-92,321.29	-7,873,930	1.000000000S 71.515193747	-92,321.29	-6,602,375	0	1,271,555	1,271,555
-51,467.98000		4/26/2016		-51,467.98	-4,411,808	1.000000000S 71.515193747	-51,467.98	-3,680,743	0	731,065	731,065
-15,428.24000		5/9/2016		-15,428.24	-1,209,910	1.000000000S 71.515193747	-15,428.24	-1,103,354	0	106,556	106,556

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-102,314.26000		5/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000S 71.515193747	-102,314.26	-7,317,024	0	905,581	905,581
-352,627.83000		5/12/2016		-352,627.83	-28,284,357	1.000000000S 71.515193747	-352,627.83	-25,218,248	0	3,066,109	3,066,109
-32,453.42000		5/17/2016		-32,453.42	-2,578,702	1.000000000S 71.515193747	-32,453.42	-2,320,913	0	257,789	257,789
-184,519.95000		5/18/2016		-184,519.95	-14,755,931	1.000000000S 71.515193747	-184,519.95	-13,195,980	0	1,559,951	1,559,951
-346,026.04000		5/23/2016		-346,026.04	-27,596,972	1.000000000S 71.515193747	-346,026.04	-24,746,119	0	2,850,853	2,850,853
-349,425.52000		6/10/2016		-349,425.52	-27,668,680	1.000000000S 71.515193747	-349,425.52	-24,989,234	0	2,679,446	2,679,446
-205,061.01000		6/14/2016		-205,061.01	-16,138,898	1.000000000S 71.515193747	-205,061.01	-14,664,978	0	1,473,920	1,473,920
-27,132.00000		6/17/2016		-27,132.00	-2,060,548	1.000000000S 71.515193747	-27,132.00	-1,940,350	0	120,198	120,198
-3,725.24000		7/7/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000S 71.515193747	-3,725.24	-266,411	0	15,145	15,145
-359,882.81000		7/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000S 71.515193747	-359,882.81	-25,737,089	0	1,583,954	1,583,954
-11,042.19000		7/11/2016		-11,042.19	-838,284	1.000000000S 71.515193747	-11,042.19	-789,684	0	48,600	48,600
-123,264.71000		7/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000S 71.515193747	-123,264.71	-8,815,300	0	723,166	723,166
-253,623.43000		7/14/2016		-253,623.43	-20,172,228	1.000000000S 71.515193747	-253,623.43	-18,137,929	0	2,034,299	2,034,299
-78,638.63000		7/14/2016		-78,638.63	-6,254,613	1.000000000S 71.515193747	-78,638.63	-5,623,857	0	630,756	630,756
-6,630.58000		7/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000S 71.515193747	-6,630.58	-474,187	0	53,184	53,184

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-105,691.38000		7/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000S 71.515193747	-105,691.38	-7,558,540	0	862,407	862,407
-26,928.63000		7/22/2016		-26,928.63	-2,148,021	1.000000000S 71.515193747	-26,928.63	-1,925,806	0	222,215	222,215
-11,865.10000		7/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000S 71.515193747	-11,865.10	-848,535	0	85,928	85,928
-64,818.19000		8/2/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000S 71.515193747	-64,818.19	-4,635,485	0	378,916	378,916
-19,853.51000		8/2/2016		-19,853.51	-1,535,888	1.000000000S 71.515193747	-19,853.51	-1,419,828	0	116,060	116,060
-181,375.34000		8/3/2016		-181,375.34	-13,938,155	1.000000000S 71.515193747	-181,375.34	-12,971,093	0	967,062	967,062
-25,260.07000		8/4/2016		-25,260.07	-1,938,997	1.000000000S 71.515193747	-25,260.07	-1,806,479	0	132,518	132,518
-356,084.08000		8/12/2016		-356,084.08	-27,843,105	1.000000000S 71.515193747	-356,084.08	-25,465,422	0	2,377,683	2,377,683
-42,406.06000		8/12/2016		-42,406.06	-3,315,836	1.000000000S 71.515193747	-42,406.06	-3,032,678	0	283,158	283,158
-33,369.43000		8/16/2016		-33,369.43	-2,591,016	1.000000000S 71.515193747	-33,369.43	-2,386,421	0	204,595	204,595
-146,047.78000		8/17/2016		-146,047.78	-11,265,304	1.000000000S 71.515193747	-146,047.78	-10,444,635	0	820,669	820,669
-12,365.22000		8/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000S 71.515193747	-12,365.22	-884,301	0	62,445	62,445
-25,656.87000		8/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000S 71.515193747	-25,656.87	-1,834,856	0	137,943	137,943
-62,280.99000		8/22/2016		-62,280.99	-4,755,276	1.000000000S 71.515193747	-62,280.99	-4,454,037	0	301,239	301,239
-115,979.16000		8/23/2016		-115,979.16	-8,883,458	1.000000000S 71.515193747	-115,979.16	-8,294,272	0	589,186	589,186

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-45,244.15000		8/24/2016		-45,244.15	-3,466,822	1.000000000 ^S 71.515193747	-45,244.15	-3,235,644	0	231,178	231,178
-118,911.22000		8/25/2016		-118,911.22	-9,101,467	1.000000000 ^S 71.515193747	-118,911.22	-8,503,959	0	597,508	597,508
-18,695.42000		9/2/2016		-18,695.42	-1,456,164	1.000000000 ^S 71.515193747	-18,695.42	-1,337,007	0	119,157	119,157
-647,737.56000		9/8/2016		-647,737.56	-50,558,123	1.000000000 ^S 71.515193747	-647,737.56	-46,323,077	0	4,235,046	4,235,046
-349,412.93000		9/12/2016		-349,412.93	-27,165,953	1.000000000 ^S 71.515193747	-349,412.93	-24,988,333	0	2,177,620	2,177,620
-17,748.89000		9/15/2016		-17,748.89	-1,360,703	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,748.89	-1,269,315	0	91,388	91,388
-179,125.75000		9/21/2016		-179,125.75	-13,765,066	1.000000000 ^S 71.515193747	-179,125.75	-12,810,213	0	954,853	954,853
-355,570.37000		10/12/2016		-355,570.37	-27,813,188	1.000000000 ^S 71.515193747	-355,570.37	-25,428,684	0	2,384,504	2,384,504
-87,209.56000		10/14/2016		-87,209.56	-6,810,737	1.000000000 ^S 71.515193747	-87,209.56	-6,236,809	0	573,928	573,928
-49,550.92000		10/20/2016		-49,550.92	-3,937,169	1.000000000 ^S 71.515193747	-49,550.92	-3,543,644	0	393,525	393,525
-108,096.46000		10/26/2016		-108,096.46	-8,631,787	1.000000000 ^S 71.515193747	-108,096.46	-7,730,539	0	901,248	901,248
-6,022.62000		11/9/2016		-6,022.62	-486,973	1.000000000 ^S 71.515193747	-6,022.62	-430,709	0	56,264	56,264
-358,077.71000		11/14/2016		-358,077.71	-28,775,830	1.000000000 ^S 71.515193747	-358,077.71	-25,607,997	0	3,167,833	3,167,833
-105,736.37000		11/15/2016		-105,736.37	-8,633,411	1.000000000 ^S 71.515193747	-105,736.37	-7,561,757	0	1,071,654	1,071,654
-8,950.00000		11/16/2016		-8,950.00	-735,749	1.000000000 ^S 71.515193747	-8,950.00	-640,061	0	95,688	95,688

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-43,039.27000		11/18/2016		-43,039.27	-3,517,706	1.000000000S 71.515193747	-43,039.27	-3,077,962	0	439,744	439,744
-29,290.91000		11/25/2016		-29,290.91	-2,456,555	1.000000000S 71.515193747	-29,290.91	-2,094,745	0	361,810	361,810
-51,254.81000		11/30/2016		-51,254.81	-4,320,135	1.000000000S 71.515193747	-51,254.81	-3,665,498	0	654,637	654,637
-156,086.08000		12/1/2016		-156,086.08	-13,140,616	1.000000000S 71.515193747	-156,086.08	-11,162,526	0	1,978,090	1,978,090
-99,004.27000		12/2/2016		-99,004.27	-8,385,070	1.000000000S 71.515193747	-99,004.27	-7,080,310	0	1,304,760	1,304,760
-241,950.12000		12/6/2016		-241,950.12	-20,677,187	1.000000000S 71.515193747	-241,950.12	-17,303,110	0	3,374,077	3,374,077
-52,956.42000		12/7/2016		-52,956.42	-4,499,736	1.000000000S 71.515193747	-52,956.42	-3,787,189	0	712,547	712,547
-352,726.96000		12/9/2016		-352,726.96	-29,973,125	1.000000000S 71.515193747	-352,726.96	-25,225,337	0	4,747,788	4,747,788
-9,409.35000		12/12/2016		-9,409.35	-807,660	1.000000000S 71.515193747	-9,409.35	-672,911	0	134,749	134,749
-242,673.60000		12/14/2016		-242,673.60	-20,968,061	1.000000000S 71.515193747	-242,673.60	-17,354,850	0	3,613,211	3,613,211
-8,765.00000		12/16/2016		-8,765.00	-764,049	1.000000000S 71.515193747	-8,765.00	-626,831	0	137,218	137,218
-63,041.53000		12/19/2016		-63,041.53	-5,432,127	1.000000000S 71.515193747	-63,041.53	-4,508,427	0	923,700	923,700
-113,105.55000		12/22/2016		-113,105.55	-9,651,835	1.000000000S 71.515193747	-113,105.55	-8,088,765	0	1,563,070	1,563,070
-202,488.26000		12/28/2016		-202,488.26	-17,117,239	1.000000000S 71.515193747	-202,488.26	-14,480,987	0	2,636,252	2,636,252
-17,327.64000		12/29/2016		-17,327.64	-1,462,733	1.000000000S 71.515193747	-17,327.64	-1,239,190	0	223,543	223,543

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-1,900.70000		12/30/2016		-1,900.70	-159,632	1.000000000S 71.515193747	-1,900.70	-135,929	0	23,703	23,703
-17,618.00000		1/4/2017		-17,618.00	-1,501,301	1.000000000S 71.515193747	-17,618.00	-1,259,955	0	241,346	241,346
-550,762.83000		1/5/2017		-550,762.83	-47,018,808	1.000000000S 71.515193747	-550,762.83	-39,387,910	0	7,630,898	7,630,898
-46,205.35000		1/6/2017		-46,205.35	-3,920,910	1.000000000S 71.515193747	-46,205.35	-3,304,385	0	616,525	616,525
-75,551.78000		1/11/2017		-75,551.78	-6,438,078	1.000000000S 71.515193747	-75,551.78	-5,403,100	0	1,034,978	1,034,978
-349,599.06000		1/12/2017		-349,599.06	-30,063,342	1.000000000S 71.515193747	-349,599.06	-25,001,645	0	5,061,697	5,061,697
-11,816.04000		1/12/2017		-11,816.04	-1,016,106	1.000000000S 71.515193747	-11,816.04	-845,026	0	171,080	171,080
-78,835.06000		1/18/2017		-78,835.06	-6,719,133	1.000000000S 71.515193747	-78,835.06	-5,637,905	0	1,081,228	1,081,228
-11,222.99000		1/18/2017		-11,222.99	-956,538	1.000000000S 71.515193747	-11,222.99	-802,614	0	153,924	153,924
-6,647.14000		1/18/2017		-6,647.14	-566,537	1.000000000S 71.515193747	-6,647.14	-475,372	0	91,165	91,165
-57,843.82000		1/20/2017		-57,843.82	-5,033,172	1.000000000S 71.515193747	-57,843.82	-4,136,712	0	896,460	896,460
-59,564.39000		1/23/2017		-59,564.39	-5,172,781	1.000000000S 71.515193747	-59,564.39	-4,259,759	0	913,022	913,022
-120,856.84000		1/24/2017		-120,856.84	-10,353,246	1.000000000S 71.515193747	-120,856.84	-8,643,100	0	1,710,146	1,710,146
-105,955.38000		1/24/2017		-105,955.38	-9,076,707	1.000000000S 71.515193747	-105,955.38	-7,577,420	0	1,499,287	1,499,287
-186,290.44000		1/27/2017		-186,290.44	-16,102,463	1.000000000S 71.515193747	-186,290.44	-13,322,597	0	2,779,866	2,779,866

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-72,198.29000		1/27/2017		-72,198.29	-6,240,633	1.000000000 ^S 71.515193747	-72,198.29	-5,163,275	0	1,077,358	1,077,358
-66,189.39000		2/1/2017		-66,189.39	-5,656,632	1.000000000 ^S 71.515193747	-66,189.39	-4,733,547	0	923,085	923,085
-17,013.34000		2/2/2017		-17,013.34	-1,460,104	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,013.34	-1,216,712	0	243,392	243,392
-10,224.17000		2/7/2017		-10,224.17	-877,520	1.000000000 ^S 71.515193747	-10,224.17	-731,183	0	146,337	146,337
-177,969.53000		2/9/2017		-177,969.53	-15,213,556	1.000000000 ^S 71.515193747	-177,969.53	-12,727,525	0	2,486,031	2,486,031
-344,229.20000		2/10/2017		-344,229.20	-29,662,809	1.000000000 ^S 71.515193747	-344,229.20	-24,617,618	0	5,045,191	5,045,191
-152,291.16000		2/13/2017		-152,291.16	-13,270,154	1.000000000 ^S 71.515193747	-152,291.16	-10,891,132	0	2,379,022	2,379,022
-967,326.20000		2/15/2017		-967,326.20	-84,398,304	1.000000000 ^S 71.515193747	-967,326.20	-69,178,521	0	15,219,783	15,219,783
-71,449.49000		2/16/2017		-71,449.49	-6,292,028	1.000000000 ^S 71.515193747	-71,449.49	-5,109,724	0	1,182,304	1,182,304
-34,639.01000		2/23/2017		-34,639.01	-3,017,462	1.000000000 ^S 71.515193747	-34,639.01	-2,477,216	0	540,246	540,246
-52,248.31000		3/1/2017		-52,248.31	-4,494,545	1.000000000 ^S 71.515193747	-52,248.31	-3,736,548	0	757,997	757,997
-44,953.93000		3/3/2017		-44,953.93	-3,898,960	1.000000000 ^S 71.515193747	-44,953.93	-3,214,889	0	684,071	684,071
-185,905.53000		3/8/2017		-185,905.53	-16,102,616	1.000000000 ^S 71.515193747	-185,905.53	-13,295,070	0	2,807,546	2,807,546
-11,158.43000		3/9/2017		-11,158.43	-965,561	1.000000000 ^S 71.515193747	-11,158.43	-797,997	0	167,564	167,564
-334,340.29000		3/10/2017		-334,340.29	-28,791,636	1.000000000 ^S 71.515193747	-334,340.29	-23,910,411	0	4,881,225	4,881,225

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-189,359.17000		3/14/2017		-189,359.17	-16,457,305	1.000000000 ^S 71.515193747	-189,359.17	-13,542,058	0	2,915,247	2,915,247
-201,782.17000		3/15/2017		-201,782.17	-17,521,607	1.000000000 ^S 71.515193747	-201,782.17	-14,430,491	0	3,091,116	3,091,116
-93,724.51000		3/16/2017		-93,724.51	-8,160,137	1.000000000 ^S 71.515193747	-93,724.51	-6,702,726	0	1,457,411	1,457,411
-951,148.84000		3/17/2017		-951,148.84	-82,485,587	1.000000000 ^S 71.515193747	-951,148.84	-68,021,594	0	14,463,993	14,463,993
-49,845.77000		3/21/2017		-49,845.77	-4,339,671	1.000000000 ^S 71.515193747	-49,845.77	-3,564,730	0	774,941	774,941
-97,972.14000		3/22/2017		-97,972.14	-8,458,699	1.000000000 ^S 71.515193747	-97,972.14	-7,006,497	0	1,452,202	1,452,202
-129,338.35000		3/24/2017		-129,338.35	-10,986,556	1.000000000 ^S 71.515193747	-129,338.35	-9,249,657	0	1,736,899	1,736,899
-35,149.28000		3/29/2017		-35,149.28	-2,959,437	1.000000000 ^S 71.515193747	-35,149.28	-2,513,708	0	445,729	445,729
-121,963.21000		4/3/2017		-121,963.21	-10,367,407	1.000000000 ^S 71.515193747	-121,963.21	-8,722,223	0	1,645,184	1,645,184
-17,011.29000		4/4/2017		-17,011.29	-1,434,849	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,011.29	-1,216,566	0	218,283	218,283
-99,836.86000		4/5/2017		-99,836.86	-8,339,503	1.000000000 ^S 71.515193747	-99,836.86	-7,139,852	0	1,199,651	1,199,651
-321,826.20000		4/11/2017		-321,826.20	-26,821,039	1.000000000 ^S 71.515193747	-321,826.20	-23,015,463	0	3,805,576	3,805,576
-2,535.89000		4/13/2017		-2,535.89	-208,025	1.000000000 ^S 71.515193747	-2,535.89	-181,355	0	26,670	26,670
-17,906.57000		4/24/2017		-17,906.57	-1,469,466	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,906.57	-1,280,592	0	188,874	188,874
-97,737.47000		4/26/2017		-97,737.47	-8,168,487	1.000000000 ^S 71.515193747	-97,737.47	-6,989,714	0	1,178,773	1,178,773

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-72,720.60000		4/26/2017		-72,720.60	-6,077,682	1.000000000S 71.515193747	-72,720.60	-5,200,628	0	877,054	877,054
-6,131.59000		4/26/2017		-6,131.59	-512,453	1.000000000S 71.515193747	-6,131.59	-438,502	0	73,951	73,951
-5,770,905.72000		5/2/2017		-5,770,905.72	-481,079,087	1.000000000S 71.515193747	-5,770,905.72	-412,707,441	0	68,371,646	68,371,646
-757,937.72000		5/8/2017		-757,937.72	-63,229,524	1.000000000S 71.515193747	-757,937.72	-54,204,063	0	9,025,461	9,025,461
-93,372.59000		5/11/2017		-93,372.59	-7,870,999	1.000000000S 71.515193747	-93,372.59	-6,677,559	0	1,193,440	1,193,440
-277,865.98000		5/12/2017		-277,865.98	-23,283,752	1.000000000S 71.515193747	-277,865.98	-19,871,639	0	3,412,113	3,412,113
-83,218.51000		5/12/2017		-83,218.51	-6,973,287	1.000000000S 71.515193747	-83,218.51	-5,951,388	0	1,021,899	1,021,899
-87,633.54000		5/15/2017		-87,633.54	-7,339,187	1.000000000S 71.515193747	-87,633.54	-6,267,130	0	1,072,057	1,072,057
-161,718.79000		5/16/2017		-161,718.79	-13,634,189	1.000000000S 71.515193747	-161,718.79	-11,565,351	0	2,068,838	2,068,838
-51,805.98000		5/17/2017		-51,805.98	-4,351,820	1.000000000S 71.515193747	-51,805.98	-3,704,915	0	646,905	646,905
-215,576.55000		5/19/2017		-215,576.55	-17,787,680	1.000000000S 71.515193747	-215,576.55	-15,416,999	0	2,370,681	2,370,681
-339,293.20000		5/22/2017		-339,293.20	-28,164,073	1.000000000S 71.515193747	-339,293.20	-24,264,619	0	3,899,454	3,899,454
-105,085.63000		5/24/2017		-105,085.63	-8,748,278	1.000000000S 71.515193747	-105,085.63	-7,515,219	0	1,233,059	1,233,059
-35,824.15000		5/26/2017		-35,824.15	-2,994,583	1.000000000S 71.515193747	-35,824.15	-2,561,971	0	432,612	432,612
-85,534.03000		6/1/2017		-85,534.03	-7,041,589	1.000000000S 71.515193747	-85,534.03	-6,116,983	0	924,606	924,606

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-184,424.56000		6/6/2017		-184,424.56	-15,242,969	1.000000000 ^S 71.515193747	-184,424.56	-13,189,158	0	2,053,811	2,053,811
-268,856.14000		6/9/2017		-268,856.14	-22,316,945	1.000000000 ^S 71.515193747	-268,856.14	-19,227,299	0	3,089,646	3,089,646
-48,274.55000		6/16/2017		-48,274.55	-4,048,407	1.000000000 ^S 71.515193747	-48,274.55	-3,452,364	0	596,043	596,043
-28,558.93000		6/19/2017		-28,558.93	-2,409,398	1.000000000 ^S 71.515193747	-28,558.93	-2,042,397	0	367,001	367,001
-32,535.99000		6/22/2017		-32,535.99	-2,741,102	1.000000000 ^S 71.515193747	-32,535.99	-2,326,818	0	414,284	414,284
-36,028.00000		6/27/2017		-36,028.00	-3,046,343	1.000000000 ^S 71.515193747	-36,028.00	-2,576,549	0	469,794	469,794
-85,677.03000		6/28/2017		-85,677.03	-7,298,656	1.000000000 ^S 71.515193747	-85,677.03	-6,127,209	0	1,171,447	1,171,447
-50,207.38000		6/29/2017		-50,207.38	-4,284,996	1.000000000 ^S 71.515193747	-50,207.38	-3,590,591	0	694,405	694,405
-17,179.10000		6/30/2017		-17,179.10	-1,485,268	1.000000000 ^S 71.515193747	-17,179.10	-1,228,567	0	256,701	256,701
-24,916.13000		7/6/2017		-24,916.13	-2,139,501	1.000000000 ^S 71.515193747	-24,916.13	-1,781,882	0	357,619	357,619
-70,337.04000		7/7/2017		-70,337.04	-6,033,979	1.000000000 ^S 71.515193747	-70,337.04	-5,030,167	0	1,003,812	1,003,812
-268,122.83000		7/11/2017		-268,122.83	-23,253,058	1.000000000 ^S 71.515193747	-268,122.83	-19,174,856	0	4,078,202	4,078,202
-94,299.32000		7/12/2017		-94,299.32	-8,216,368	1.000000000 ^S 71.515193747	-94,299.32	-6,743,834	0	1,472,534	1,472,534
-48,129.04000		7/13/2017		-48,129.04	-4,176,056	1.000000000 ^S 71.515193747	-48,129.04	-3,441,958	0	734,098	734,098
-94,307.37000		7/14/2017		-94,307.37	-8,260,227	1.000000000 ^S 71.515193747	-94,307.37	-6,744,410	0	1,515,817	1,515,817

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-224,064.11000		7/18/2017		-224,064.11	-19,759,163	1.000000000S 71.515193747	-224,064.11	-16,023,988	0	3,735,175	3,735,175
-62,985.03000		7/18/2017		-62,985.03	-5,554,354	1.000000000S 71.515193747	-62,985.03	-4,504,387	0	1,049,967	1,049,967
-5,310.71000		7/18/2017		-5,310.71	-468,327	1.000000000S 71.515193747	-5,310.71	-379,796	0	88,531	88,531
-84,652.73000		7/19/2017		-84,652.73	-7,503,258	1.000000000S 71.515193747	-84,652.73	-6,053,956	0	1,449,302	1,449,302
-57,508.35000		7/24/2017		-57,508.35	-5,058,492	1.000000000S 71.515193747	-57,508.35	-4,112,721	0	945,771	945,771
-34,173.40000		7/27/2017		-34,173.40	-3,033,016	1.000000000S 71.515193747	-34,173.40	-2,443,917	0	589,099	589,099
-42,955.96000		7/28/2017		-42,955.96	-3,821,788	1.000000000S 71.515193747	-42,955.96	-3,072,004	0	749,784	749,784
-34,563.35000		8/1/2017		-34,563.35	-3,048,960	1.000000000S 71.515193747	-34,563.35	-2,471,805	0	577,155	577,155
-11,898.68000		8/2/2017		-11,898.68	-1,046,921	1.000000000S 71.515193747	-11,898.68	-850,936	0	195,985	195,985
-251,943.26000		8/8/2017		-251,943.26	-22,077,618	1.000000000S 71.515193747	-251,943.26	-18,017,771	0	4,059,847	4,059,847
-129,223.68000		8/8/2017		-129,223.68	-11,323,784	1.000000000S 71.515193747	-129,223.68	-9,241,457	0	2,082,327	2,082,327
-26,983.86000		8/9/2017		-26,983.86	-2,360,030	1.000000000S 71.515193747	-26,983.86	-1,929,756	0	430,274	430,274
-5,436.08000		8/10/2017		-5,436.08	-470,606	1.000000000S 71.515193747	-5,436.08	-388,762	0	81,844	81,844
-261,862.81000		8/14/2017		-261,862.81	-22,503,263	1.000000000S 71.515193747	-261,862.81	-18,727,170	0	3,776,093	3,776,093
-38,687.10000		8/14/2017		-38,687.10	-3,324,588	1.000000000S 71.515193747	-38,687.10	-2,766,715	0	557,873	557,873

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-234,673.89000		8/16/2017		-234,673.89	-20,287,202	1.000000000 ^S 71.515193747	-234,673.89	-16,782,749	0	3,504,453	3,504,453
-151,106.11000		8/17/2017		-151,106.11	-13,198,995	1.000000000 ^S 71.515193747	-151,106.11	-10,806,383	0	2,392,612	2,392,612
-23,853.89000		8/18/2017		-23,853.89	-2,076,341	1.000000000 ^S 71.515193747	-23,853.89	-1,705,916	0	370,425	370,425
-128,055.35000		8/22/2017		-128,055.35	-11,058,464	1.000000000 ^S 71.515193747	-128,055.35	-9,157,903	0	1,900,561	1,900,561
-20,640.91000		8/23/2017		-20,640.91	-1,790,067	1.000000000 ^S 71.515193747	-20,640.91	-1,476,139	0	313,928	313,928
-47,297.81000		8/29/2017		-47,297.81	-4,106,488	1.000000000 ^S 71.515193747	-47,297.81	-3,382,512	0	723,976	723,976
-1,347,714.81000		8/30/2017		-1,347,714.81	-116,950,732	1.000000000 ^S 71.515193747	-1,347,714.81	-96,382,086	0	20,568,646	20,568,646
-1,203,000.00000		8/30/2017		-1,203,000.00	-104,392,806	1.000000000 ^S 71.515193747	-1,203,000.00	-86,032,778	0	18,360,028	18,360,028
-30,083.55000		8/30/2017		-30,083.55	-2,610,562	1.000000000 ^S 71.515193747	-30,083.55	-2,151,431	0	459,131	459,131
-83,968.93000		9/5/2017		-83,968.93	-7,314,593	1.000000000 ^S 71.515193747	-83,968.93	-6,005,054	0	1,309,539	1,309,539
-61,112.18000		9/8/2017		-61,112.18	-5,325,375	1.000000000 ^S 71.515193747	-61,112.18	-4,370,449	0	954,926	954,926
-245,747.74000		9/11/2017		-245,747.74	-21,382,314	1.000000000 ^S 71.515193747	-245,747.74	-17,574,697	0	3,807,617	3,807,617
-18,460.20000		9/11/2017		-18,460.20	-1,606,207	1.000000000 ^S 71.515193747	-18,460.20	-1,320,185	0	286,022	286,022
-110,577.39000		9/12/2017		-110,577.39	-9,667,378	1.000000000 ^S 71.515193747	-110,577.39	-7,907,963	0	1,759,415	1,759,415
-140,374.85000		9/14/2017		-140,374.85	-12,413,249	1.000000000 ^S 71.515193747	-140,374.85	-10,038,935	0	2,374,314	2,374,314

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-93,807.37000		9/15/2017		-93,807.37	-8,281,886	1.000000000S 71.515193747	-93,807.37	-6,708,652	0	1,573,234	1,573,234
-94,643.60000		9/20/2017		-94,643.60	-8,441,750	1.000000000S 71.515193747	-94,643.60	-6,768,455	0	1,673,295	1,673,295
-37,527.78000		9/26/2017		-37,527.78	-3,332,691	1.000000000S 71.515193747	-37,527.78	-2,683,806	0	648,885	648,885
-20,531.50000		9/28/2017		-20,531.50	-1,818,416	1.000000000S 71.515193747	-20,531.50	-1,468,314	0	350,102	350,102
-233,742.95000		9/29/2017		-233,742.95	-20,642,355	1.000000000S 71.515193747	-233,742.95	-16,716,172	0	3,926,183	3,926,183
-149,591.47000		10/5/2017		-149,591.47	-13,246,493	1.000000000S 71.515193747	-149,591.47	-10,698,063	0	2,548,430	2,548,430
-25,802.59000		10/6/2017		-25,802.59	-2,268,258	1.000000000S 71.515193747	-25,802.59	-1,845,277	0	422,981	422,981
-250,526.60000		10/12/2017		-250,526.60	-21,872,667	1.000000000S 71.515193747	-250,526.60	-17,916,458	0	3,956,209	3,956,209
-150,522.57000		10/12/2017		-150,522.57	-13,141,639	1.000000000S 71.515193747	-150,522.57	-10,764,651	0	2,376,988	2,376,988
-58,012.04000		10/16/2017		-58,012.04	-5,122,230	1.000000000S 71.515193747	-58,012.04	-4,148,742	0	973,488	973,488
-4,891.40000		10/16/2017		-4,891.40	-431,891	1.000000000S 71.515193747	-4,891.40	-349,809	0	82,082	82,082
-8,629.54000		10/19/2017		-8,629.54	-763,983	1.000000000S 71.515193747	-8,629.54	-617,143	0	146,840	146,840
-79,173.19000		10/20/2017		-79,173.19	-7,021,242	1.000000000S 71.515193747	-79,173.19	-5,662,086	0	1,359,156	1,359,156
-73,221.02000		10/24/2017		-73,221.02	-6,498,544	1.000000000S 71.515193747	-73,221.02	-5,236,415	0	1,262,129	1,262,129
-53,753.51000		10/24/2017		-53,753.51	-4,770,755	1.000000000S 71.515193747	-53,753.51	-3,844,193	0	926,562	926,562

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

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

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

[次へ](#)

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-1,778,714.81000		10/25/2017		-1,778,714.81	-157,587,713	1.000000000 ^S 71.515193747	-1,778,714.81	-127,205,134	0	30,382,579	30,382,579
-1,390,000.00000		10/25/2017		-1,390,000.00	-123,148,983	1.000000000 ^S 71.515193747	-1,390,000.00	-99,406,119	0	23,742,864	23,742,864
-59,387.12000		10/25/2017		-59,387.12	-5,261,485	1.000000000 ^S 71.515193747	-59,387.12	-4,247,081	0	1,014,404	1,014,404
-7,958.77000		10/31/2017		-7,958.77	-691,905	1.000000000 ^S 71.515193747	-7,958.77	-569,173	0	122,732	122,732
-30,242.86000		11/2/2017		-30,242.86	-2,647,087	1.000000000 ^S 71.515193747	-30,242.86	-2,162,824	0	484,263	484,263
-98,737.84000		11/8/2017		-98,737.84	-8,600,813	1.000000000 ^S 71.515193747	-98,737.84	-7,061,256	0	1,539,557	1,539,557
-9,009.98000		11/9/2017		-9,009.98	-785,309	1.000000000 ^S 71.515193747	-9,009.98	-644,350	0	140,959	140,959
-247,808.62000		11/10/2017		-247,808.62	-21,573,723	1.000000000 ^S 71.515193747	-247,808.62	-17,722,081	0	3,851,642	3,851,642
-141,305.97000		11/14/2017		-141,305.97	-12,248,394	1.000000000 ^S 71.515193747	-141,305.97	-10,105,524	0	2,142,870	2,142,870
-64,748.95000		11/20/2017		-64,748.95	-5,487,267	1.000000000 ^S 71.515193747	-64,748.95	-4,630,534	0	856,733	856,733
-32,436.77000		11/22/2017		-32,436.77	-2,764,939	1.000000000 ^S 71.515193747	-32,436.77	-2,319,722	0	445,217	445,217
-203,554.78000		11/24/2017		-203,554.78	-17,261,865	1.000000000 ^S 71.515193747	-203,554.78	-14,557,260	0	2,704,605	2,704,605
-42,562.46000		11/28/2017		-42,562.46	-3,600,917	1.000000000 ^S 71.515193747	-42,562.46	-3,043,863	0	557,054	557,054
-99,582.58000		12/1/2017		-99,582.58	-8,459,807	1.000000000 ^S 71.515193747	-99,582.58	-7,121,668	0	1,338,139	1,338,139
-47,244.20000		12/7/2017		-47,244.20	-4,017,059	1.000000000 ^S 71.515193747	-47,244.20	-3,378,678	0	638,381	638,381

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-13,390.76000		12/8/2017		-13,390.76	-1,135,904	1.000000000 ^S 71.515193747	-13,390.76	-957,643	0	178,261	178,261
-246,793.05000		12/11/2017		-246,793.05	-21,044,157	1.000000000 ^S 71.515193747	-246,793.05	-17,649,453	0	3,394,704	3,394,704
-30,330.71000		12/11/2017		-30,330.71	-2,586,314	1.000000000 ^S 71.515193747	-30,330.71	-2,169,107	0	417,207	417,207
-85,954.84000		12/12/2017		-85,954.84	-7,349,616	1.000000000 ^S 71.515193747	-85,954.84	-6,147,077	0	1,202,539	1,202,539
-55,703.20000		12/13/2017		-55,703.20	-4,782,497	1.000000000 ^S 71.515193747	-55,703.20	-3,983,625	0	798,872	798,872
-126,098.54000		12/19/2017		-126,098.54	-10,875,723	1.000000000 ^S 71.515193747	-126,098.54	-9,017,962	0	1,857,761	1,857,761
-39,931.85000		12/20/2017		-39,931.85	-3,451,152	1.000000000 ^S 71.515193747	-39,931.85	-2,855,734	0	595,418	595,418
-28,911.07000		1/5/2018		-28,911.07	-2,563,200	1.000000000 ^S 71.515193747	-28,911.07	-2,067,581	0	495,619	495,619
-245,282.90000		1/12/2018		-245,282.90	-21,514,923	1.000000000 ^S 71.515193747	-245,282.90	-17,541,454	0	3,973,469	3,973,469
-12,441.34000		1/12/2018		-12,441.34	-1,091,289	1.000000000 ^S 71.515193747	-12,441.34	-889,745	0	201,544	201,544
-35,513.33000		1/16/2018		-35,513.33	-3,129,459	1.000000000 ^S 71.515193747	-35,513.33	-2,539,743	0	589,716	589,716
-56,303.33000		1/22/2018		-56,303.33	-4,983,918	1.000000000 ^S 71.515193747	-56,303.33	-4,026,544	0	957,374	957,374
-73,732.89000		1/24/2018		-73,732.89	-6,506,404	1.000000000 ^S 71.515193747	-73,732.89	-5,273,022	0	1,233,382	1,233,382
-54,860.23000		1/24/2018		-54,860.23	-4,841,026	1.000000000 ^S 71.515193747	-54,860.23	-3,923,340	0	917,686	917,686
-4,625.65000		1/24/2018		-4,625.65	-408,181	1.000000000 ^S 71.515193747	-4,625.65	-330,804	0	77,377	77,377

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-104,867.61000		1/29/2018		-104,867.61	-9,216,108	1.000000000S 71.515193747	-104,867.61	-7,499,627	0	1,716,481	1,716,481
-315,218.62000		1/30/2018		-315,218.62	-27,821,128	1.000000000S 71.515193747	-315,218.62	-22,542,921	0	5,278,207	5,278,207
-92,606.37000		1/31/2018		-92,606.37	-8,151,384	1.000000000S 71.515193747	-92,606.37	-6,622,762	0	1,528,622	1,528,622
-42,223.81000		2/8/2018		-42,223.81	-3,622,522	1.000000000S 71.515193747	-42,223.81	-3,019,644	0	602,878	602,878
-240,819.94000		2/9/2018		-240,819.94	-20,510,385	1.000000000S 71.515193747	-240,819.94	-17,222,285	0	3,288,100	3,288,100
-114,626.90000		2/9/2018		-114,626.90	-9,762,655	1.000000000S 71.515193747	-114,626.90	-8,197,565	0	1,565,090	1,565,090
-54,329.53000		2/15/2018		-54,329.53	-4,574,151	1.000000000S 71.515193747	-54,329.53	-3,885,387	0	688,764	688,764
-8,354.61000		2/23/2018		-8,354.61	-701,268	1.000000000S 71.515193747	-8,354.61	-597,482	0	103,786	103,786
-241,131.03000		3/9/2018		-241,131.03	-19,903,757	1.000000000S 71.515193747	-241,131.03	-17,244,532	0	2,659,225	2,659,225
-11,810.63000		3/15/2018		-11,810.63	-987,676	1.000000000S 71.515193747	-11,810.63	-844,639	0	143,037	143,037
-71,875.05000		3/23/2018		-71,875.05	-5,825,270	1.000000000S 71.515193747	-71,875.05	-5,140,158	0	685,112	685,112
-42,568.15000		3/26/2018		-42,568.15	-3,447,582	1.000000000S 71.515193747	-42,568.15	-3,044,269	0	403,313	403,313
-50,297.76000		3/27/2018		-50,297.76	-4,076,366	1.000000000S 71.515193747	-50,297.76	-3,597,054	0	479,312	479,312
-1,535.28000		4/9/2018		-1,535.28	-126,334	1.000000000S 71.515193747	-1,535.28	-109,796	0	16,538	16,538
-88,985.26000		4/10/2018		-88,985.26	-7,326,140	1.000000000S 71.515193747	-88,985.26	-6,363,798	0	962,342	962,342

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-240,542.88000		4/11/2018		-240,542.88	-19,991,243	1.000000000S 71.515193747	-240,542.88	-17,202,471	0	2,788,772	2,788,772
-106,173.13000		4/12/2018		-106,173.13	-8,804,183	1.000000000S 71.515193747	-106,173.13	-7,592,992	0	1,211,191	1,211,191
-160,886.21000		4/16/2018		-160,886.21	-13,449,333	1.000000000S 71.515193747	-160,886.21	-11,505,808	0	1,943,525	1,943,525
-51,033.60000		4/17/2018		-51,033.60	-4,256,750	1.000000000S 71.515193747	-51,033.60	-3,649,678	0	607,072	607,072
-4,303.00000		4/17/2018		-4,303.00	-358,916	1.000000000S 71.515193747	-4,303.00	-307,730	0	51,186	51,186
-103,980.92000		4/18/2018		-103,980.92	-8,658,256	1.000000000S 71.515193747	-103,980.92	-7,436,216	0	1,222,040	1,222,040
-134,354.93000		4/20/2018		-134,354.93	-11,212,243	1.000000000S 71.515193747	-134,354.93	-9,608,419	0	1,603,824	1,603,824
-68,589.85000		4/23/2018		-68,589.85	-5,669,514	1.000000000S 71.515193747	-68,589.85	-4,905,216	0	764,298	764,298
-40,543.60000		5/2/2018		-40,543.60	-3,348,880	1.000000000S 71.515193747	-40,543.60	-2,899,483	0	449,397	449,397
-237,079.40000		5/15/2018		-237,079.40	-19,620,584	1.000000000S 71.515193747	-237,079.40	-16,954,779	0	2,665,805	2,665,805
-104,464.09000		5/16/2018		-104,464.09	-8,615,124	1.000000000S 71.515193747	-104,464.09	-7,470,770	0	1,144,354	1,144,354
-42,940.74000		5/17/2018		-42,940.74	-3,555,049	1.000000000S 71.515193747	-42,940.74	-3,070,915	0	484,134	484,134
-259,940.71000		5/25/2018		-259,940.71	-21,430,186	1.000000000S 71.515193747	-259,940.71	-18,589,710	0	2,840,476	2,840,476
-40,016.55000		5/29/2018		-40,016.55	-3,302,356	1.000000000S 71.515193747	-40,016.55	-2,861,791	0	440,565	440,565
-7,569.94000		6/4/2018		-7,569.94	-627,097	1.000000000S 71.515193747	-7,569.94	-541,366	0	85,731	85,731

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-234,723.65000		6/8/2018		-234,723.65	-19,730,048	1.000000000S 71.515193747	-234,723.65	-16,786,307	0	2,943,741	2,943,741
-354,424.37000		6/13/2018		-354,424.37	-29,758,065	1.000000000S 71.515193747	-354,424.37	-25,346,727	0	4,411,338	4,411,338
-26,321.04000		6/21/2018		-26,321.04	-2,136,994	1.000000000S 71.515193747	-26,321.04	-1,882,354	0	254,640	254,640
-62,568.05000		6/27/2018		-62,568.05	-5,082,558	1.000000000S 71.515193747	-62,568.05	-4,474,566	0	607,992	607,992
-33,424.92000		6/28/2018		-33,424.92	-2,725,829	1.000000000S 71.515193747	-33,424.92	-2,390,390	0	335,439	335,439
-59,587.09000		6/29/2018		-59,587.09	-4,831,738	1.000000000S 71.515193747	-59,587.09	-4,261,382	0	570,356	570,356
-230,807.11000		7/11/2018		-230,807.11	-19,164,246	1.000000000S 71.515193747	-230,807.11	-16,506,215	0	2,658,031	2,658,031
-12,445.25000		7/11/2018		-12,445.25	-1,033,347	1.000000000S 71.515193747	-12,445.25	-890,024	0	143,323	143,323
-48,245.27000		7/13/2018		-48,245.27	-4,015,011	1.000000000S 71.515193747	-48,245.27	-3,450,270	0	564,741	564,741
-31,820.25000		7/13/2018		-31,820.25	-2,648,107	1.000000000S 71.515193747	-31,820.25	-2,275,631	0	372,476	372,476
-4,067.90000		7/13/2018		-4,067.90	-338,534	1.000000000S 71.515193747	-4,067.90	-290,917	0	47,617	47,617
-64,842.30000		7/19/2018		-64,842.30	-5,396,805	1.000000000S 71.515193747	-64,842.30	-4,637,210	0	759,595	759,595
-779,961.50000		7/23/2018		-779,961.50	-64,630,841	1.000000000S 71.515193747	-779,961.50	-55,779,098	0	8,851,743	8,851,743
-71,225.84000		7/24/2018		-71,225.84	-5,858,481	1.000000000S 71.515193747	-71,225.84	-5,093,730	0	764,751	764,751
-38,008.43000		8/2/2018		-38,008.43	-3,151,351	1.000000000S 71.515193747	-38,008.43	-2,718,180	0	433,171	433,171

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日本円です。

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-46,911.01000		8/7/2018		-46,911.01	-3,862,706	1.000000000S 71.515193747	-46,911.01	-3,354,850	0	507,856	507,856
-230,631.58000		8/10/2018		-230,631.58	-18,925,734	1.000000000S 71.515193747	-230,631.58	-16,493,662	0	2,432,072	2,432,072
-32,792.89000		8/17/2018		-32,792.89	-2,641,480	1.000000000S 71.515193747	-32,792.89	-2,345,190	0	296,290	296,290
-27,692.84000		8/20/2018		-27,692.84	-2,226,969	1.000000000S 71.515193747	-27,692.84	-1,980,459	0	246,510	246,510
-9,664.19000		8/22/2018		-9,664.19	-784,528	1.000000000S 71.515193747	-9,664.19	-691,136	0	93,392	93,392
-18,900.99000		8/30/2018		-18,900.99	-1,539,099	1.000000000S 71.515193747	-18,900.99	-1,351,708	0	187,391	187,391
-54,937.84000		8/31/2018		-54,937.84	-4,456,768	1.000000000S 71.515193747	-54,937.84	-3,928,890	0	527,878	527,878
-232,403.15000		9/11/2018		-232,403.15	-18,379,859	1.000000000S 71.515193747	-232,403.15	-16,620,356	0	1,759,503	1,759,503
-31,758.92000		9/19/2018		-31,758.92	-2,571,503	1.000000000S 71.515193747	-31,758.92	-2,271,245	0	300,258	300,258
-12,327.35000		9/25/2018		-12,327.35	-1,007,913	1.000000000S 71.515193747	-12,327.35	-881,593	0	126,320	126,320
-16,004.18000		9/27/2018		-16,004.18	-1,313,144	1.000000000S 71.515193747	-16,004.18	-1,144,542	0	168,602	168,602
-48,724.25000		10/2/2018		-48,724.25	-4,008,359	1.000000000S 71.515193747	-48,724.25	-3,484,524	0	523,835	523,835
-23,470.68000		10/4/2018		-23,470.68	-1,915,543	1.000000000S 71.515193747	-23,470.68	-1,678,510	0	237,033	237,033
-231,419.36000		10/12/2018		-231,419.36	-18,468,092	1.000000000S 71.515193747	-231,419.36	-16,550,000	0	1,918,092	1,918,092
-53,598.82000		10/12/2018		-53,598.82	-4,277,377	1.000000000S 71.515193747	-53,598.82	-3,833,130	0	444,247	444,247

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-46,892.60000		10/12/2018		-46,892.60	-3,742,197	1.000000000 ^S 71.515193747	-46,892.60	-3,353,533	0	388,664	388,664
-3,953.84000		10/12/2018		-3,953.84	-315,531	1.000000000 ^S 71.515193747	-3,953.84	-282,760	0	32,771	32,771
-63,024.29000		10/16/2018		-63,024.29	-5,032,717	1.000000000 ^S 71.515193747	-63,024.29	-4,507,194	0	525,523	525,523
-20,113.75000		10/17/2018		-20,113.75	-1,610,303	1.000000000 ^S 71.515193747	-20,113.75	-1,438,439	0	171,864	171,864
-664,259.35000		10/18/2018		-664,259.35	-53,018,344	1.000000000 ^S 71.515193747	-664,259.35	-47,504,636	0	5,513,708	5,513,708
-18,070.52000		10/24/2018		-18,070.52	-1,429,780	1.000000000 ^S 71.515193747	-18,070.52	-1,292,317	0	137,463	137,463
-30,359.39000		10/26/2018		-30,359.39	-2,418,580	1.000000000 ^S 71.515193747	-30,359.39	-2,171,158	0	247,422	247,422
-104,308.20000		10/31/2018		-104,308.20	-8,365,512	1.000000000 ^S 71.515193747	-104,308.20	-7,459,621	0	905,891	905,891
-50,401.50000		11/8/2018		-50,401.50	-4,159,745	1.000000000 ^S 71.515193747	-50,401.50	-3,604,473	0	555,272	555,272
-224,392.25000		11/9/2018		-224,392.25	-18,614,349	1.000000000 ^S 71.515193747	-224,392.25	-16,047,455	0	2,566,894	2,566,894
-9,986.37000		11/9/2018		-9,986.37	-828,414	1.000000000 ^S 71.515193747	-9,986.37	-714,177	0	114,237	114,237
-10,134.32000		11/19/2018		-10,134.32	-836,189	1.000000000 ^S 71.515193747	-10,134.32	-724,758	0	111,431	111,431
-1,139,616.57000		11/20/2018		-1,139,616.57	-93,691,893	1.000000000 ^S 71.515193747	-1,139,616.57	-81,499,900	0	12,191,993	12,191,993
-42,170.11000		11/20/2018		-42,170.11	-3,466,953	1.000000000 ^S 71.515193747	-42,170.11	-3,015,804	0	451,149	451,149
-38,005.37000		11/21/2018		-38,005.37	-3,108,318	1.000000000 ^S 71.515193747	-38,005.37	-2,717,961	0	390,357	390,357

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-8,931.98000		12/3/2018		-8,931.98	-740,639	1.000000000 ^S 71.515193747	-8,931.98	-638,772	0	101,867	101,867
-73,433.24000		12/5/2018		-73,433.24	-6,104,102	1.000000000 ^S 71.515193747	-73,433.24	-5,251,592	0	852,510	852,510
-190,442.27000		12/11/2018		-190,442.27	-15,458,291	1.000000000 ^S 71.515193747	-190,442.27	-13,619,516	0	1,838,775	1,838,775
-12,136.99000		12/11/2018		-12,136.99	-985,165	1.000000000 ^S 71.515193747	-12,136.99	-867,979	0	117,186	117,186
-76,869.70000		12/13/2018		-76,869.70	-6,289,951	1.000000000 ^S 71.515193747	-76,869.70	-5,497,351	0	792,600	792,600
-459,000.00000		12/19/2018		-459,000.00	-37,076,503	1.000000000 ^S 71.515193747	-459,000.00	-32,825,474	0	4,251,029	4,251,029
-31,261.26000		12/21/2018		-31,261.26	-2,482,585	1.000000000 ^S 71.515193747	-31,261.26	-2,235,655	0	246,930	246,930
-34,959.38000		12/27/2018		-34,959.38	-2,721,231	1.000000000 ^S 71.515193747	-34,959.38	-2,500,127	0	221,104	221,104
-13,486.62000		1/8/2019		-13,486.62	-1,043,413	1.000000000 ^S 71.515193747	-13,486.62	-964,498	0	78,915	78,915
-228,095.44000		1/11/2019		-228,095.44	-17,745,273	1.000000000 ^S 71.515193747	-228,095.44	-16,312,290	0	1,432,983	1,432,983
-31,995.00000		1/16/2019		-31,995.00	-2,501,010	1.000000000 ^S 71.515193747	-31,995.00	-2,288,129	0	212,881	212,881
-44,669.19000		1/17/2019		-44,669.19	-3,490,929	1.000000000 ^S 71.515193747	-44,669.19	-3,194,526	0	296,403	296,403
-60,036.00000		1/22/2019		-60,036.00	-4,709,139	1.000000000 ^S 71.515193747	-60,036.00	-4,293,486	0	415,653	415,653
-25,634.10000		1/22/2019		-25,634.10	-2,010,703	1.000000000 ^S 71.515193747	-25,634.10	-1,833,228	0	177,475	177,475
-254,230.16000		1/31/2019		-254,230.16	-20,035,819	1.000000000 ^S 71.515193747	-254,230.16	-18,181,319	0	1,854,500	1,854,500

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-226,610.05000		2/12/2019		-226,610.05	-17,678,793	1.000000000S 71.515193747	-226,610.05	-16,206,062	0	1,472,731	1,472,731
-46,516.42000		2/12/2019		-46,516.42	-3,628,939	1.000000000S 71.515193747	-46,516.42	-3,326,631	0	302,308	302,308
-221,553.53000		2/20/2019		-221,553.53	-17,494,299	1.000000000S 71.515193747	-221,553.53	-15,844,444	0	1,649,855	1,649,855
-38,774.55000		3/1/2019		-38,774.55	-3,070,891	1.000000000S 71.515193747	-38,774.55	-2,772,969	0	297,922	297,922
-63,764.01000		3/4/2019		-63,764.01	-5,062,062	1.000000000S 71.515193747	-63,764.01	-4,560,096	0	501,966	501,966
-231,531.52000		3/11/2019		-231,531.52	-18,113,517	1.000000000S 71.515193747	-231,531.52	-16,558,022	0	1,555,495	1,555,495
-15,693.27000		3/14/2019		-15,693.27	-1,237,080	1.000000000S 71.515193747	-15,693.27	-1,122,307	0	114,773	114,773
-11,606.00000		3/15/2019		-11,606.00	-915,480	1.000000000S 71.515193747	-11,606.00	-830,005	0	85,475	85,475
-600,999.98000		3/26/2019		-600,999.98	-47,070,099	1.000000000S 71.515193747	-600,999.98	-42,980,630	0	4,089,469	4,089,469
-515,784.59000		3/29/2019		-515,784.59	-40,357,721	1.000000000S 71.515193747	-515,784.59	-36,886,435	0	3,471,286	3,471,286
-73,349.53000		4/8/2019		-73,349.53	-5,822,604	1.000000000S 71.515193747	-73,349.53	-5,245,606	0	576,998	576,998
-225,346.84000		4/11/2019		-225,346.84	-17,858,735	1.000000000S 71.515193747	-225,346.84	-16,115,723	0	1,743,012	1,743,012
-35,132.62000		4/17/2019		-35,132.62	-2,821,296	1.000000000S 71.515193747	-35,132.62	-2,512,516	0	308,780	308,780
-58,870.03000		4/18/2019		-58,870.03	-4,734,422	1.000000000S 71.515193747	-58,870.03	-4,210,102	0	524,320	524,320
-43,801.67000		4/18/2019		-43,801.67	-3,522,600	1.000000000S 71.515193747	-43,801.67	-3,132,485	0	390,115	390,115

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-3,693.23000		4/18/2019		-3,693.23	-297,015	1.000000000S 71.515193747	-3,693.23	-264,122	0	32,893	32,893
-225,082.95000		5/14/2019		-225,082.95	-17,085,005	1.000000000S 71.515193747	-225,082.95	-16,096,851	0	988,154	988,154
-94,910.58000		5/17/2019		-94,910.58	-7,205,523	1.000000000S 71.515193747	-94,910.58	-6,787,549	0	417,974	417,974
-87,834.76000		5/23/2019		-87,834.76	-6,662,312	1.000000000S 71.515193747	-87,834.76	-6,281,520	0	380,792	380,792
-55,793.55000		5/31/2019		-55,793.55	-4,229,298	1.000000000S 71.515193747	-55,793.55	-3,990,087	0	239,211	239,211
-226,601.48000		6/12/2019		-226,601.48	-17,112,794	1.000000000S 71.515193747	-226,601.48	-16,205,449	0	907,345	907,345
-15,197.25000		6/25/2019		-15,197.25	-1,134,949	1.000000000S 71.515193747	-15,197.25	-1,086,834	0	48,115	48,115
-11,644.71000		7/8/2019		-11,644.71	-880,468	1.000000000S 71.515193747	-11,644.71	-832,774	0	47,694	47,694
-121,556.01000		7/11/2019		-121,556.01	-9,176,397	1.000000000S 71.515193747	-121,556.01	-8,693,102	0	483,295	483,295
-44,689.00000		7/18/2019		-44,689.00	-3,384,444	1.000000000S 71.515193747	-44,689.00	-3,195,942	0	188,502	188,502
-3,768.04000		7/18/2019		-3,768.04	-285,366	1.000000000S 71.515193747	-3,768.04	-269,472	0	15,894	15,894
-29,373.95000		7/19/2019		-29,373.95	-2,230,106	1.000000000S 71.515193747	-29,373.95	-2,100,684	0	129,422	129,422
-441,467.63000		7/22/2019		-441,467.63	-33,520,533	1.000000000S 71.515193747	-441,467.63	-31,571,643	0	1,948,890	1,948,890
-175,549.92000		7/30/2019		-175,549.92	-13,177,136	1.000000000S 71.515193747	-175,549.92	-12,554,487	0	622,649	622,649
-60,062.61000		7/31/2019		-60,062.61	-4,485,957	1.000000000S 71.515193747	-60,062.61	-4,295,389	0	190,568	190,568

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-232,223.94000		8/9/2019		-232,223.94	-16,768,953	1.000000000S 71.515193747	-232,223.94	-16,607,540	0	161,413	161,413
1,075,056.35000	合計 -----			1,075,056	-186,975,936		1,075,056	76,882,859	0	263,858,795	263,858,795
0.00000											
385,126.86	BRITISH POUND	7/24/2019		385,126.86	51,789,646	1.000000000S 129.268688244	385,126.86	49,784,844	0	-2,004,802	-2,004,802
	GBP										
0.50		7/31/2019		0.50	66	1.000000000S 129.268688244	0.50	65	0	-1	-1
20.03		7/31/2019		20.03	2,663	1.000000000S 129.268688244	20.03	2,589	0	-74	-74
385,147.39000	合計 -----			385,147	51,792,375		385,147	49,787,498	0	-2,004,877	-2,004,877
0.00000											
50.00	CANADIAN DOLLAR	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000S 0.012518724	50.00	3,994	0	-676	-676
	CAD										
583,420.05000	EURO	8/23/2019		583,420.05	68,825,213	1.000000000S 116.892181246	583,420.05	68,197,242	0	-627,971	-627,971
	EUR										
18,722.86000	UNITED STATES DOLLAR	8/8/2019		18,722.86	1,980,317	1.000000000S 0.009421075	18,722.86	1,987,338	0	7,021	7,021
	USD										
60,856.63000		8/8/2019		60,856.63	6,436,806	1.000000000S 0.009421075	60,856.63	6,459,627	0	22,821	22,821
156,420.08000		8/8/2019		156,420.08	16,544,551	1.000000000S 0.009421075	156,420.08	16,603,209	0	58,658	58,658
252,887.62000		8/8/2019		252,887.62	26,747,923	1.000000000S 0.009421075	252,887.62	26,842,756	0	94,833	94,833
662,878.69000		8/8/2019		662,878.69	70,112,677	1.000000000S 0.009421075	662,878.69	70,361,258	0	248,581	248,581
122,902.50000		8/9/2019		122,902.50	13,054,089	1.000000000S 0.009421075	122,902.50	13,045,486	0	-8,603	-8,603
6,262,657.20000		8/9/2019		6,262,657.20	665,188,140	1.000000000S 0.009421075	6,262,657.20	664,749,745	0	-438,395	-438,395

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
320,000.00000		8/13/2019		320,000.00	33,697,601	1.000000000S 0.009421075	320,000.00	33,966,400	0	268,799	268,799
21,239.15000		8/15/2019		21,239.15	2,254,430	1.000000000S 0.009421075	21,239.15	2,254,430	0	0	0
48,875.00000		8/15/2019		48,875.00	5,187,837	1.000000000S 0.009421075	48,875.00	5,187,837	0	0	0
163,383.75000		8/15/2019		163,383.75	17,342,368	1.000000000S 0.009421075	163,383.75	17,342,368	0	0	0
15,904.69000		8/19/2019		15,904.69	1,692,021	1.000000000S 0.009421075	15,904.69	1,688,203	0	-3,818	-3,818
127,925.00000		8/19/2019		127,925.00	13,609,302	1.000000000S 0.009421075	127,925.00	13,578,599	0	-30,703	-30,703
340,000.00000		8/19/2019		340,000.00	36,170,902	1.000000000S 0.009421075	340,000.00	36,089,300	0	-81,602	-81,602
4,050,000.00000		8/19/2019		4,050,000.00	430,859,268	1.000000000S 0.009421075	4,050,000.00	429,887,247	0	-972,021	-972,021
542,425.48000		8/20/2019		542,425.48	57,765,603	1.000000000S 0.009421075	542,425.48	57,575,752	0	-189,851	-189,851
300,000.00000		8/23/2019		300,000.00	31,939,501	1.000000000S 0.009421075	300,000.00	31,843,500	0	-96,001	-96,001
1,137,459.40000		8/28/2019		1,137,459.40	120,474,016	1.000000000S 0.009421075	1,137,459.40	120,735,627	0	261,611	261,611
6,742.15000		8/29/2019		6,742.15	714,027	1.000000000S 0.009421075	6,742.15	715,646	0	1,619	1,619
730,000.00000		8/29/2019		730,000.00	77,310,648	1.000000000S 0.009421075	730,000.00	77,485,850	0	175,202	175,202
17,982.40000		8/30/2019		17,982.40	1,914,137	1.000000000S 0.009421075	17,982.40	1,908,742	0	-5,395	-5,395
-468,163.37000		8/8/2019		-468,163.37	-49,517,638	1.000000000S 0.009421075	-468,163.37	-49,693,201	0	-175,563	-175,563

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-71,127.50000		8/8/2019		-71,127.50	-7,523,155	1.000000000 ^S 0.009421075	-71,127.50	-7,549,828	0	-26,673	-26,673
-66,627.16000		8/8/2019		-66,627.16	-7,047,154	1.000000000 ^S 0.009421075	-66,627.16	-7,072,140	0	-24,986	-24,986
-4,205.79000		8/8/2019		-4,205.79	-444,846	1.000000000 ^S 0.009421075	-4,205.79	-446,424	0	-1,578	-1,578
-459,615.05000		8/9/2019		-459,615.05	-48,818,013	1.000000000 ^S 0.009421075	-459,615.05	-48,785,839	0	32,174	32,174
-51,451.37000		8/9/2019		-51,451.37	-5,464,907	1.000000000 ^S 0.009421075	-51,451.37	-5,461,306	0	3,601	3,601
-5,245.86000		8/14/2019		-5,245.86	-559,392	1.000000000 ^S 0.009421075	-5,245.86	-556,822	0	2,570	2,570
-1,883.00000		8/19/2019		-1,883.00	-200,323	1.000000000 ^S 0.009421075	-1,883.00	-199,871	0	452	452
-62,704.64000		8/22/2019		-62,704.64	-6,676,163	1.000000000 ^S 0.009421075	-62,704.64	-6,655,784	0	20,379	20,379
-34,665.37000		8/27/2019		-34,665.37	-3,673,663	1.000000000 ^S 0.009421075	-34,665.37	-3,679,556	0	-5,893	-5,893
14,133,573.49000 0.00000	合計 -----			14,133,573	1,501,070,910		14,133,573	1,500,208,149	0	-862,761	-862,761
16,177,247.28000	非グループ化の有価証券小計			16,177,247	1,434,717,232		16,177,247	1,695,079,742	0	260,362,510	260,362,510
16,177,247.28000	外貨建現金勘定合計			16,177,247	1,434,717,232		16,177,247	1,695,079,742	0	260,362,510	260,362,510
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-1,333,616.57000	AUD FORWARD 17 OCT FAU17OCT	7/11/2019		-1,333,616.57	-101,107,330	1.000000000 ^F 71.367083589	-1,333,616.57	-95,176,325	0	5,931,005	5,931,005
3,000,000.00000	EUR FORWARD 03 SEP FEU03SEP	8/28/2019		3,000,000.00	352,728,850	1.000000000 ^F 116.895885861	3,000,000.00	350,687,658	0	-2,041,192	-2,041,192
5,580,000.00000	EUR FORWARD 17 OCT FEU17OCT	8/7/2019		5,580,000.00	664,062,400	1.000000000 ^F 116.925067168	5,580,000.00	652,441,875	0	-11,620,525	-11,620,525

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-26,288,523.42000		7/11/2019		-26,288,523.42	-3,240,599,852	1.000000000F 116.925067168	-26,288,523.42	-3,073,787,367	0	166,812,485	166,812,485
-26,288,523.42000		7/11/2019		-26,288,523.42	-3,239,715,506	1.000000000F 116.925067168	-26,288,523.42	-3,073,787,367	0	165,928,139	165,928,139
-26,288,523.42000		7/11/2019		-26,288,523.42	-3,240,514,527	1.000000000F 116.925067168	-26,288,523.42	-3,073,787,367	0	166,727,160	166,727,160
-1,510,000.00000		8/9/2019		-1,510,000.00	-180,557,756	1.000000000F 116.925067168	-1,510,000.00	-176,556,851	0	4,000,905	4,000,905
-2,383,000.00000		8/13/2019		-2,383,000.00	-282,781,676	1.000000000F 116.925067168	-2,383,000.00	-278,632,435	0	4,149,241	4,149,241
-653,000.00000		8/14/2019		-653,000.00	-77,676,576	1.000000000F 116.925067168	-653,000.00	-76,352,069	0	1,324,507	1,324,507
-1,136,000.00000		8/21/2019		-1,136,000.00	-134,811,828	1.000000000F 116.925067168	-1,136,000.00	-132,826,876	0	1,984,952	1,984,952
-3,000,000.00000		8/28/2019		-3,000,000.00	-353,782,621	1.000000000F 116.925067168	-3,000,000.00	-350,775,202	0	3,007,419	3,007,419
-769,000.00000		8/28/2019		-769,000.00	-90,692,599	1.000000000F 116.925067168	-769,000.00	-89,915,377	0	777,222	777,222
-82,736,570.26000 0.00000	合計 -----			-82,736,570	-10,177,070,541		-82,736,570	-9,673,979,036	0	503,091,505	503,091,505
1,800,000.00	GBP FORWARD 17 OCT FGB17OCT	7/12/2019		1,800,000.00	244,484,939	1.000000000F 129.074144706	1,800,000.00	232,333,460	0	-12,151,479	-12,151,479
-18,532,373.48		7/11/2019		-18,532,373.48	-2,535,107,769	1.000000000F 129.074144706	-18,532,373.48	-2,392,050,256	0	143,057,513	143,057,513
-16,732,373.48000 0.00000	合計 -----			-16,732,373	-2,290,622,830		-16,732,373	-2,159,716,796	0	130,906,034	130,906,034
-3,328,962.00000	USD FORWARD 03 SEP FUS03SEP	8/28/2019		-3,328,962.00	-352,728,849	1.000000000F 0.009423587	-3,328,962.00	-353,258,478	0	-529,629	-529,629
352,376.56000	USD FORWARD 17 OCT FUS17OCT	7/11/2019		352,376.56	37,843,636	1.000000000F 0.009454309	352,376.56	37,271,530	0	-572,106	-572,106

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
933,284.35000		7/11/2019		933,284.35	101,107,330	1.000000000F 0.009454309	933,284.35	98,715,237	0	-2,392,093	-2,392,093
23,354,274.67000		7/11/2019		23,354,274.67	2,535,107,765	1.000000000F 0.009454309	23,354,274.67	2,470,225,446	0	-64,882,319	-64,882,319
29,845,360.64000		7/11/2019		29,845,360.64	3,239,715,495	1.000000000F 0.009454309	29,845,360.64	3,156,799,787	0	-82,915,708	-82,915,708
29,852,721.43000		7/11/2019		29,852,721.43	3,240,514,509	1.000000000F 0.009454309	29,852,721.43	3,157,578,352	0	-82,936,157	-82,936,157
29,853,507.45000		7/11/2019		29,853,507.45	3,240,599,831	1.000000000F 0.009454309	29,853,507.45	3,157,661,491	0	-82,938,340	-82,938,340
1,376,385.33000		7/25/2019		1,376,385.33	147,852,001	1.000000000F 0.009454309	1,376,385.33	145,582,859	0	-2,269,142	-2,269,142
1,614,599.51000		7/29/2019		1,614,599.51	174,357,018	1.000000000F 0.009454309	1,614,599.51	170,779,219	0	-3,577,799	-3,577,799
1,699,927.80000		8/9/2019		1,699,927.80	180,557,756	1.000000000F 0.009454309	1,699,927.80	179,804,553	0	-753,203	-753,203
2,685,359.81000		8/13/2019		2,685,359.81	282,781,673	1.000000000F 0.009454309	2,685,359.81	284,035,545	0	1,253,872	1,253,872
1,370,623.17000		8/14/2019		1,370,623.17	144,840,001	1.000000000F 0.009454309	1,370,623.17	144,973,384	0	133,383	133,383
1,636,000.00000		8/15/2019		1,636,000.00	172,489,043	1.000000000F 0.009454309	1,636,000.00	173,042,789	0	553,746	553,746
1,266,195.82000		8/21/2019		1,266,195.82	134,811,827	1.000000000F 0.009454309	1,266,195.82	133,927,907	0	-883,920	-883,920
856,276.89000		8/28/2019		856,276.89	90,692,599	1.000000000F 0.009454309	856,276.89	90,570,013	0	-122,586	-122,586
1,060,851.43000		8/28/2019		1,060,851.43	111,820,001	1.000000000F 0.009454309	1,060,851.43	112,208,246	0	388,245	388,245
3,340,249.20000	FUS170CT	8/28/2019		3,340,249.20	353,782,618	1.000000000F 0.009454309	3,340,249.20	353,304,424	0	-478,194	-478,194

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2019年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
先物(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
-2,266,002.00000		7/12/2019		-2,266,002.00	-244,484,938	1.000000000F 0.009454309	-2,266,002.00	-239,679,283	0	4,805,655	4,805,655
-1,257,564.00000		8/6/2019		-1,257,564.00	-133,119,619	1.000000000F 0.009454309	-1,257,564.00	-133,014,904	0	104,715	104,715
-378,436.00000		8/6/2019		-378,436.00	-40,060,419	1.000000000F 0.009454309	-378,436.00	-40,027,886	0	32,533	32,533
-6,295,237.15000		8/7/2019		-6,295,237.15	-664,062,404	1.000000000F 0.009454309	-6,295,237.15	-665,859,044	0	-1,796,640	-1,796,640
120,900,754.91000 0.00000	合計 -----			120,900,755	13,107,145,723		120,900,755	12,787,899,665	0	-319,246,058	-319,246,058
19,769,232.60000	非グループ化の有価証券小計			19,769,233	538,345,023		19,769,233	856,456,688	0	318,111,665	318,111,665
19,769,232.60000	先物(ポジション)合計			19,769,233	538,345,023		19,769,233	856,456,688	0	318,111,665	318,111,665
証拠金勘定											
証拠金勘定											
40,000.00	USD MARGIN	8/14/2019		40,000.00	4,265,400	1.000000000S 0.009421075	40,000.00	4,245,800	0	-19,600	-19,600
400,000.00	USDMAR	8/16/2019		400,000.00	42,458,000	1.000000000S 0.009421075	400,000.00	42,458,000	0	0	0
480,000.00		8/21/2019		480,000.00	51,031,202	1.000000000S 0.009421075	480,000.00	50,949,600	0	-81,602	-81,602
730,000.00		8/28/2019		730,000.00	77,317,952	1.000000000S 0.009421075	730,000.00	77,485,850	0	167,898	167,898
730,000.00		8/29/2019		730,000.00	77,310,648	1.000000000S 0.009421075	730,000.00	77,485,850	0	175,202	175,202
2,380,000.00000 0.00000	合計 -----			2,380,000	252,383,202		2,380,000	252,625,100	0	241,898	241,898
2,380,000.00000	証拠金勘定小計			2,380,000	252,383,202		2,380,000	252,625,100	0	241,898	241,898
2,380,000.00000	証拠金勘定合計			2,380,000	252,383,202		2,380,000	252,625,100	0	241,898	241,898
803,677,242.88000	クラスに割当てられていない資産合計			812,402,198	35,450,506,661		831,997,889	36,577,362,016	2,166,966,042	-1,040,110,687	1,126,855,355
1,392,095,898.36000	ポートフォリオ合計			1,400,820,853	24,501,630,019		1,420,416,544	25,350,615,185	2,166,966,042	-1,317,980,876	848,985,166

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

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

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

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（2019年9月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約202億円）

発行済株式総数 5,051,655株

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

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

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

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

管理会社は、2019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	42	4,950,593,120.17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。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2019年9月30日現在における株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝107.92円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2019年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	4,663,736,783	503,310,474
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	3,027,015,686	326,675,533
040	その他の要求払預金	1,636,721,097	176,634,941
050	売買目的で保有される金融資産	18,644,871	2,012,154
060	デリバティブ	18,644,871	2,012,154
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
096	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産	0	0
097	持分証券		
098	債務証券		
099	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産	0	0
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
141	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産	2,823	305
142	持分証券	2,823	305
143	債務証券		
144	ローンおよび貸付金		
181	償却後原価における金融資産	2,675,600,619	288,750,819
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	2,675,600,619	288,750,819
240	デリバティブ - ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	6,210,745	670,264
280	有形固定資産	6,210,745	670,264
290	投資不動産		
300	無形資産	2,603,893	281,012
310	営業権		
320	その他の無形資産	2,603,893	281,012
330	税金資産	762	82
340	現行税金資産	762	82
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	24,427,298	2,636,194
370	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
380	資産合計	7,391,227,793	797,661,303

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2019年6月30日現在

(単位:米ドル)

負債

		米ドル	千円
010	売買目的で保有される金融負債	22,491,813	2,427,316
020	デリバティブ	22,491,813	2,427,316
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した金融負債	0	0
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	6,918,086,851	746,599,933
120	預金	6,912,629,893	746,011,018
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	5,456,958	588,915
150	デリバティブ・ヘッジ会計		
160	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
170	引当金	0	0
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金		
240	税金負債	16,886,312	1,822,371
250	現行税金負債	16,073,020	1,734,600
260	繰延税金負債	813,291	87,770
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	24,020,784	2,592,323
290	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
300	負債合計	6,981,485,760	753,441,943

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2019年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

		米ドル	千円
010	資本	187,117,966	20,193,771
020	払込資本	187,117,966	20,193,771
030	未払込請求資本		
040	株式発行差金		
050	資本を除く発行済みエクイティ商品	0	0
060	複合金融商品のエクイティ部分		
070	その他の発行済みエクイティ商品		
080	その他のエクイティ		
090	その他の累積包括利益	0	0
095	損益に再分類されることがない項目	0	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-) 損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
124	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
320	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動		
330	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性		
340	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕		
350	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕		
360	負債の信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動		
128	損益に再分類されることがある項目	0	0
130	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ準備金〔有効部分〕		
155	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動		
165	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
180	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	(67,376)	(7,271)
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	197,956,757	21,363,493
220	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の準備金または累積損失		
230	その他	197,956,757	21,363,493
240	(-) 自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	24,734,686	2,669,367

米ドル

千円

260	(-) 中間配当		
270	少数株主持分〔非支配持分〕	0	0
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	409,742,033	44,219,360
310	資本および負債合計	7,391,227,793	797,661,303

(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

2019年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

		米ドル	千円
010	利息収益	48,948,146	5,282,484
020	売買目的で保有される金融資産	18,132,356	1,956,844
025	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
030	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産		
041	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
051	償却後原価における金融資産	24,738,564	2,669,786
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	1,532,995	165,441
085	負債に係る利息収益	4,544,232	490,414
090	(支払利息)	28,855,205	3,114,054
100	(売買目的で保有される金融負債)	244,519	26,388
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	20,439,549	2,205,836
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)		
145	(資産に係る支払利息)	8,171,138	881,829
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	0	0
170	売買目的で保有される金融資産		
175	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
191	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	65,063,645	7,021,669
210	(支払手数料)	32,154,727	3,470,138
220	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負 債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額	0	0
231	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
241	償却後原価における金融資産		
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (-)損失、純額	7,431,962	802,057
287	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保 有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額		
290	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した 金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
310	為替差額〔利益または(-)損失〕、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
340	その他の事業収益	835,872	90,207
350	(その他の事業費用)	1,298,939	140,181
355	事業収益合計、純額	59,970,753	6,472,044

米ドル

千円

360	（管理費用）	24,994,294	2,697,384
370	（従業員費用）	10,220,443	1,102,990
380	（その他の管理費用）	14,773,851	1,594,394
390	（減価償却）	1,322,302	142,703
400	（有形固定資産）	676,705	73,030
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	645,598	69,673
425	修正利益または（－）損失、純額	0	0
426	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
427	償却後原価における金融資産		
430	（引当金または（－）引当金の戻入）	0	0
440	（コミットメントおよび保証）		
450	（その他の引当金）		
460	（損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	289,086	31,198
481	（その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産）		
491	（償却後原価における金融資産）	289,086	31,198
510	（子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または（－）減損の戻入）		
520	（非金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	0	0
530	（有形固定資産）		
540	（投資不動産）		
550	（営業権）		
560	（その他の無形資産）		
570	（その他）		
580	損益認識されるマイナスの営業権		
590	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または（－）損失の持分		
600	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される売却グループからの利益または（－）損失		
610	継続事業からの税引前利益または（－）損失	33,365,071	3,600,758
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	8,630,385	931,391
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	24,734,687	2,669,367
640	非継続事業からの税引後利益または（－）損失	0	0
650	非継続事業からの税引前利益または（－）損失		
660	（非継続事業に関する税金費用または（－）収入）		
670	当期利益または（－）損失	24,734,687	2,669,367
680	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
690	親会社株主に帰属する金額	24,734,687	2,669,367