

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	令和元年11月29日
【発行者名】	ルクセンブルク三菱UFJインベスター・サービス銀行S.A. ( Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A. )
【代表者の役職氏名】	デュプティ・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 小林 央明
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L-1150、アーロン通り 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
【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	東京海上ストラテジック・トラスト - 東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド ( Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund )
【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】	米ドル建 米ドルヘッジクラス : 20億アメリカ合衆国ドル(約2,155億8,000万円)を上限とする。 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス : 20億オーストラリアドル(約1,509億8,000万円)を上限とする。 (注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびオーストラリアドル(以下「豪ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2019年6月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=107.79円および1豪ドル=75.49円)による。
【縦覧に供する場所】	該当事項なし。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2019年8月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するため、また、その他一部情報の時点等を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

## 2【訂正の内容】

### (1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

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

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

\* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

## 1 ファンドの運用状況

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

### (1) 投資状況

#### 資産別および地域別の投資状況

(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
	英國	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

## &lt;豪ドル建 豪ドルヘッジクラス&gt;

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
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

## &lt;参考情報&gt;

## 純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移(2012年12月13日~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	買戻し口数	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	買戻し口数	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。

[次へ](#)

### 3 ファンドの経理状況

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

[次へ](#)

## (1) 資産及び負債の状況

貸借対照表

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

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
プローカーが保有する現金	252,383,202
プ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・レアル	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・レアル	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

為替取引に係る実現利益 208,488,637

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

[次へ](#)

## (2) 投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
クラス・カテゴリー・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 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1) (円)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)	
<b>豪ドルクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
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
0.00000											
-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・ファンド計算上の基準通貨をいいます。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)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<b>豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
25,308,769.92000	AUD FORWARD 11 OCT FAU110CT	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
0.00000											
-17,094,100.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS110CT	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
0.00000											
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)
<b>資源国通貨バスケットクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
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)
<b>資源国通貨バスケットクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-253,800.00000		7/31/2019	BKH	-253,800.00	-27,528,986	1.000000000F 0.009429488	-253,800.00	-26,915,565	0	613,421	613,421
-253,800.00000		7/31/2019	BKH	-253,800.00	-27,695,856	1.000000000F 0.009429488	-253,800.00	-26,915,565	0	780,291	780,291
-253,800.00000		7/31/2019	BKH	-253,800.00	-27,634,012	1.000000000F 0.009429488	-253,800.00	-26,915,565	0	718,447	718,447
-48,593.68000	合計 -----		BKH	-48,594	-6,984,161		-48,594	-5,153,373	0	1,830,788	1,830,788
0.00000											
3,612,328.21000	ZAR FORWARD 11 OCT FZA11OCT	8/29/2019	BKH	3,612,328.21	25,101,869	1.000000000F 0.144281664	3,612,328.21	25,036,641	0	-65,228	-65,228
3,615,507.90000	ZAR FORWARD 11 SEP FZA11SEP	7/31/2019	BKH	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
-3,615,507.90000		8/29/2019	BKH	-3,615,507.90	-25,013,298	1.000000000F 0.143404361	-3,615,507.90	-25,211,980	0	-198,682	-198,682
0.00000	合計 -----			0	2,682,558		0	0	0	-2,682,558	-2,682,558
0.00000											
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)
<b>ブラジル・レアルクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
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
0.00000											
-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)
<b>ユーロクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
224,872.44000	EUR FORWARD 11 OCT FEU110CT	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	EUH	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 FUS110CT	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	EUH	-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)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<b>日本円クラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-2,177,000.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/27/2019	JPH	-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 ----- 0.00000			-103,352,500	-10,948,876,017		-103,352,500	-10,936,593,104	0	12,282,913	12,282,913
101,392,942.67000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	JPH	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 0.00000	合計 ----- 0.00000			1,922,743	-548		1,922,743	203,907,431	0	203,907,979	203,907,979
-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)
<b>メキシコ・ペソクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
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
0.00000											
-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)
<b>ロシア・ループルクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
403,628,807.80	RUB FORWARD 11 OCT FRU110CT	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
0.00000											
-6,019,100.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS110CT	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
0.00000											
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・ループ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)
<b>トルコ・リラクラス受益証券</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
4,860,089.30	TRY FORWARD 11 OCT FTR11OCT	8/27/2019	TRH	4,860,089.30	88,241,625	1.000000000F 0.056008492	4,860,089.30	86,774,150	0	-1,467,475	-1,467,475
134,904,813.05		8/29/2019	TRH	134,904,813.05	2,459,112,274	1.000000000F 0.056008492	134,904,813.05	2,408,649,264	0	-50,463,010	-50,463,010
139,764,902.35000	合計 ----- 0.00000			139,764,902	2,547,353,899		139,764,902	2,495,423,414	0	-51,930,485	-51,930,485
120,997,580.76	TRY FORWARD 11 SEP FTR11SEP	7/31/2019	TRH	120,997,580.76	2,362,089,618	1.000000000F 0.055206901	120,997,580.76	2,191,711,155	0	-170,378,463	-170,378,463
5,634,039.60		8/6/2019	TRH	5,634,039.60	108,398,001	1.000000000F 0.055206901	5,634,039.60	102,053,176	0	-6,344,825	-6,344,825
7,778,429.12		8/14/2019	TRH	7,778,429.12	146,443,196	1.000000000F 0.055206901	7,778,429.12	140,895,956	0	-5,547,240	-5,547,240
4,296,177.60		8/22/2019	TRH	4,296,177.60	79,354,848	1.000000000F 0.055206901	4,296,177.60	77,819,575	0	-1,535,273	-1,535,273
-138,706,227.08		8/29/2019	TRH	-138,706,227.08	-2,523,343,767	1.000000000F 0.055206901	-138,706,227.08	-2,512,479,863	0	10,863,904	10,863,904
0.00000	合計 ----- 0.00000			0	172,941,896		0	-1	0	-172,941,897	-172,941,897
-818,500.00000	USD FORWARD 11 OCT FUS11OCT	8/27/2019	TRH	-818,500.00	-88,241,625	1.000000000F 0.009450155	-818,500.00	-86,612,336	0	1,629,289	1,629,289
-22,789,900.00000		8/29/2019	TRH	-22,789,900.00	-2,459,112,277	1.000000000F 0.009450155	-22,789,900.00	-2,411,590,074	0	47,522,203	47,522,203
-23,608,400.00000	合計 ----- 0.00000			-23,608,400	-2,547,353,902		-23,608,400	-2,498,202,410	0	49,151,492	49,151,492
23,705,603.48000	USD FORWARD 11 SEP FUS11SEP	8/29/2019	TRH	23,705,603.48	2,523,343,766	1.000000000F 0.009429488	23,705,603.48	2,513,986,282	0	-9,357,484	-9,357,484
-21,534,800.00000		7/31/2019	TRH	-21,534,800.00	-2,362,089,622	1.000000000F 0.009429488	-21,534,800.00	-2,283,771,929	0	78,317,693	78,317,693

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

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

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

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
5,500,000.00000	DBS GROUP HLDGS FRN 04112028 BSGP00AP XS1802465846	4/4/2018		5,484,490.00	718,652,173 102.794998169C 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 BUS9CU3 US25466AAN19	2/28/2019		5,244,015.00	583,763,733 104.960998535C 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	244,355,731 101.093002319C 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	467,819,516 102.610000610C 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	451,293,194 112.047996521C 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	164,173,234 115.211997986C 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	533,393,470 108.550003052C 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	421,099,731 109.978996277C 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 BGBR22NL XS1961843171	3/5/2019		2,389,470.00	350,575,214 106.601997375C 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	220,468,273 105.640998840C 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
5,100,000.00000	JPMORGAN CHASE FRN 07232029 BUSA9CGJ US46647PAV85	7/16/2018		5,100,000.00	573,188,984 0.009421075	113.027000427C	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	105.452003479C 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	99.763000488C 116.892181246	2,992,890.01	349,845,442	886,863	-2,042,129	-1,155,266
2,000,000.00000	MAPFRE FRN 03312047 BESP0267 ES0224244089	3/22/2017		2,000,000.00	239,987,727	117.288002014C 116.892181246	2,345,760.04	274,201,008	40,416,645	-6,203,365	34,213,280
3,100,000.00000	MITSUI SUMITOMO FRN PERP/CALL BJPN3074 USJ4517MAA74	2/27/2019		3,100,000.00	343,774,504	112.236000061C 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 BDEU43CO XS1843448314	11/15/2018		1,187,280.00	152,187,944	121.245002747C 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	104.777999878C 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	114.472000122C 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	99.375000000C 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	103.906997681C 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
5,500,000.00000	ROYAL BK SCOTLND FRN 05182029 BGBR22MB US780097BG51	5/15/2018		5,500,000.00	606,759,968	109.721000671C 0.009421075	6,034,655.04	640,548,455	56,750,959	-22,962,471	33,788,488
1,850,000.00000	SNS BANK FRN 11052025 BNLD12DR XS1315151388	12/14/2018		1,941,864.50	248,812,258	104.333000183C 116.892181246	1,930,160.50	225,620,671	-1,368,106	-21,823,481	-23,191,587
1,600,000.00000	SUNTRUST BANKS FRN PERP/CALL BUSA9CSN US867914BP72	2/8/2019		1,491,840.00	163,699,604	99.956001282C 0.009421075	1,599,296.02	169,757,275	11,405,919	-5,348,248	6,057,671
1,700,000.00000	SWISS RE FIN FRN 04302050 BLUX02D3 XS1963116964	3/14/2019		1,705,800.00	215,432,091	115.439002991C 116.892181246	1,962,463.05	229,396,587	30,001,904	-16,037,408	13,964,496
1,800,000.00000	SWISS RE FIN FRN PERP/CALL BLUX02DE XS2049422343	8/28/2019		1,806,282.00	191,312,364	100.231002808C 0.009421075	1,804,158.05	191,502,355	-225,447	415,438	189,991
7,400,000.00000	TORONTO DOM BANK FRN 09152031 BCAN10D1 US891160MJ94	9/8/2016		7,373,054.75	758,789,022	104.557998657C 0.009421075	7,737,291.90	821,274,844	38,661,952	23,823,870	62,485,822
2,000,000.00000	UNITED OVERSEAS FRN 04152029 BSGP00AQ US91127KAC62	4/8/2019		1,993,140.00	222,085,615	104.186996460C 0.009421075	2,083,739.93	221,178,573	9,616,729	-10,523,771	-907,042
1,950,000.00000	VOYA FINANCIAL FRN 01232048 BUSA9CPV US929089AF72	1/18/2018		1,950,000.00	216,362,245	92.999000549C 0.009421075	1,813,480.51	192,491,888	-14,490,861	-9,379,496	-23,870,357
1,200,000.00000	XLIT LTD FRN 06292047 BCYMO5AV XS1633784183	6/22/2017		1,188,648.00	147,662,895	112.751998901C 116.892181246	1,353,023.99	158,157,925	19,214,268	-8,719,238	10,495,030
118,820,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			120,146,066	14,565,447,845		126,999,187	14,248,734,811	770,845,902	-1,087,558,941	-316,713,039

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計算上での基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
<b>変動利率</b>											
1,790,000.00000	HARTFORD FINL FRN 02122047 BUSA9COP US416515BC76	12/4/2017		1,713,925.00	193,193,628	85.416200000 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 129.268688244	4,584,570.01	592,641,351	27,894,801	-123,522,040	-95,627,239
16,150,000.00000	<b>変動利率小計</b>			16,592,092	1,853,074,469		17,159,459	1,927,402,984	65,213,055	9,115,460	74,328,515
<b>ミディアム・ターム・ノート</b>											
5,300,000.00000	AIB GROUP PLC 1.5 % 03292023 BIRL02AW XS1799975765	12/14/2018		5,178,100.00	663,473,054	104.064002991 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 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 <sup>C</sup> 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
<b>ミディアム・ターム・ノート</b>											
6,240,000.00000	BPCE 4.5% 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		6,235,382.91	692,056,012 0.009421075	106.819000244C	6,665,505.62	707,510,089	45,655,374	-30,201,297	15,454,077
2,600,000.00000	CNP ASSURANCES 2.75% 02052029 BFRA1008 FR0013399680	1/25/2019		2,570,774.00	321,366,201 116.892181246	115.705001831C	3,008,330.05	351,650,261	51,146,881	-20,862,821	30,284,060
800,000.00	HSBC HLDGS PLC 6% 03292040 BGBR22NX XS0498768315	5/28/2019		1,017,096.00	141,259,280 129.268688244	136.401992798C	1,091,215.94	141,060,053	9,581,388	-9,780,614	-199,226
4,980,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625% 06162025 BDEU4391 XS1246732249	6/9/2015		4,961,125.80	693,886,457 116.892181246	116.838996887C	5,818,582.04	680,146,747	100,229,931	-113,969,641	-13,739,710
3,000,000.00000	SANTANDER ISSUAN 3.125% 01192027 BESP0263 XS1548444816	1/4/2017		2,967,900.00	364,610,750 116.892181246	115.946998596C	3,478,409.96	406,598,927	59,674,623	-17,686,445	41,988,178
34,270,000.00000	<b>ミディアム・ターム・ノート小計</b>			34,752,154	4,253,196,361		37,920,456	4,325,434,348	364,302,815	-292,064,825	72,237,990
<b>私募債</b>											
7,650,000.00000	BNP PARIBAS 4.375% 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97	10/1/2015		7,422,404.41	875,368,671 0.009421075	106.720001221C	8,164,080.09	866,576,276	78,725,165	-87,517,560	-8,792,395
6,670,000.00000	ING BANK NV 5.8% 09252023 BNLD122U US449786AY82	9/16/2013		7,167,897.94	745,141,972 0.009421075	111.388000488C	7,429,579.63	788,612,725	27,776,203	15,694,550	43,470,753
1,500,000.00000	INTESA SANPAOLO 5.017% 06262024 BITA036V US46115HAT41	1/18/2018		1,545,690.00	171,502,030 0.009421075	102.193000793C	1,532,895.01	162,709,140	-1,358,124	-7,434,766	-8,792,890
4,800,000.00000	SANTANDER UK PLC 5% 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		4,800,386.09	481,041,369 0.009421075	105.975997925C	5,086,847.90	539,943,467	30,406,489	28,495,610	58,902,099

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

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

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

## 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
<b>私募債</b>											
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3% 02192027 BGBR22H3 US\$053254BF64	8/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	104.122001648C 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
<b>公募債</b>											
2,300,000.00000	AMERICAN HOMES 4 4.25% 02152028 BUSA9C4K US\$02666TAA51	6/6/2019		2,347,380.00	253,951,295	108.730003357C 0.009421075	2,500,790.08	265,446,361	16,283,713	-4,788,646	11,495,067
1,850,000.00000	AXA EQUITABLE HO 5% 04202048 BUSA9CRL US\$054561AM77	7/5/2019		1,905,925.50	206,726,207	108.958999634C 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 US\$06051GFP90	4/16/2015		5,253,227.30	615,146,786	106.761001587C 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 BUSA9DDT XS2010331440	6/5/2019		2,092,713.00	254,547,631	105.654998779C 116.892181246	2,218,754.97	259,355,109	14,733,321	-9,925,844	4,807,477
2,600,000.00000	CHUBB INA HLDS 2.5% 03152038 BUSA9C6V XS1785813251	3/1/2018		2,599,974.00	339,008,298	125.200996399C 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 US\$172967EW71	5/5/2016		1,581,977.00	169,137,062	167.632003784C 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 US\$172967KJ96	3/1/2016		8,433,269.00	957,935,011	110.331001282C 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 US\$2R125AC99	3/10/2015		6,410,893.72	777,075,880	106.664001465C 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
<b>公募債</b>											
5,100,000.00000	DIGITAL REALTY 4.45% 07152028 BUSA9CDX US25389JAT34	6/14/2018		5,092,452.00	561,519,214 111.600997925C 0.009421075		5,691,650.89	604,140,281	63,601,966	-20,980,900	42,621,066
5,150,000.00000	GOLDMAN SACHS GP 6.345% 02152034 BUSA2420 US38143VAA70	10/20/2017		6,447,248.16	718,749,937 130.783996582C 0.009421075		6,735,375.82	714,926,463	30,583,311	-34,406,785	-3,823,474
3,000,000.00000	HSBC BANK USA NA 7% 01152039 BUSA9CQP US4042Q1AD94	1/11/2019		3,811,320.00	413,185,215 147.264007568C 0.009421075		4,417,920.23	468,940,140	64,387,581	-8,632,656	55,754,925
3,050,000.00000	HSBC HLDGS PLC 6.8% 06012038 BGBR2073 US404280AJ87	5/29/2019		3,937,580.50	430,633,498 141.539100000C 0.009421075		4,316,942.55	458,221,864	40,267,385	-12,679,018	27,588,367
3,000,000.00000	JPMORGAN CHASE 3.625% 12012027 BUSA9B31 US46625HRX07	11/10/2016		2,994,810.00	318,842,453 106.632003784C 0.009421075		3,198,960.11	339,553,619	21,669,514	-958,347	20,711,167
1,500,000.00000	MARSH & MCLENNAN 1.979% 03212030 BUSA9CV6 XS1963837197	3/14/2019		1,504,736.00	190,038,939 113.777999878C 116.892181246		1,706,670.00	199,496,379	23,604,506	-14,147,066	9,457,440
2,950,000.00000	MERRILL LYNCH 7.75% 05142038 BUSA8579 US59023VAA89	10/20/2017		4,374,083.00	496,152,228 156.294006348C 0.009421075		4,610,673.19	489,399,903	25,112,865	-31,865,191	-6,752,326
2,000,000.00000	METLIFE INC 6.4% 12152036 BUSA5773 US59156RAP38	6/13/2017		2,305,000.00	253,434,756 116.6139984113C 0.009421075		2,332,279.97	247,559,856	2,895,632	-8,770,532	-5,874,900
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6% 03272024 BCYMO58L USG6180BAB39	3/20/2014		1,795,572.00	183,857,592 107.379997253C 0.009421075		1,932,839.95	205,161,295	14,570,307	6,733,397	21,303,704
6,010,000.00000	MORGAN STANLEY 3.95% 04232027 BUSA99DZ US61761JZN26	4/20/2015		6,220,590.40	663,862,835 107.014999390C 0.009421075		6,431,601.46	682,682,333	22,397,769	-3,578,271	18,819,498

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

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

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

## 保有有価証券残高明細

## 東京海上ストラテジック・トラスト -

## 東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>社債</b>											
<b>公募債</b>											
3,450,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.1% 06102023 BGBR22LA US780097AY76	1/12/2018		3,791,377.50	422,037,198 0.009421075	108.390998840C 0.009421075	3,739,489.46	396,928,106	-5,507,656	-19,601,436	-25,109,092
1,150,000.00000	STANDARD CHART 5.3% 01092043 BGBR2207 XS0875267394	7/1/2019		1,284,964.00	139,193,730 0.009421075	118.721000671C 0.009421075	1,365,291.51	144,918,866	8,526,363	-2,801,227	5,725,136
3,000,000.00000	UBS GROUP FUND IN 4.125% 09242025 BJEY000Y USG91703AB73	8/4/2016		3,148,644.88	318,506,856 0.009421075	108.708999634C 0.009421075	3,261,269.99	346,167,501	11,954,592	15,706,053	27,660,645
6,410,000.00000	WELLS FARGO CAP 5.95% 12152036 BUSA7946 US94978SAA78	11/10/2011		6,479,274.77	510,608,458 0.009421075	124.425003052C 0.009421075	7,975,642.70	846,574,589	158,831,973	177,134,158	335,966,131
77,620,000.00000	公募債小計			83,813,013	9,194,151,079		91,262,881	9,764,270,199	801,333,184	-231,214,063	570,119,121
273,430,000.00000	社債合計			282,154,955	32,733,140,441		301,750,646	33,281,279,723	2,166,966,042	-1,618,826,760	548,139,282
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
94,219.67000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	4/16/2015		94,219.67	8,562,177 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	94,219.67	6,738,138	0	-1,824,039	-1,824,039
976,983.72000		4/16/2015		976,983.72	88,783,029 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	976,983.72	69,869,180	0	-18,913,849	-18,913,849
95,260.21000		4/22/2015		95,260.21	8,815,560 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	95,260.21	6,812,552	0	-2,003,008	-2,003,008
1,200,000.00000		4/27/2015		1,200,000.00	111,722,034 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	1,200,000.00	85,818,232	0	-25,903,802	-25,903,802
1,624.58000		4/30/2015		1,624.58	153,344 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	1,624.58	116,182	0	-37,162	-37,162
97,398.84000		5/7/2015		97,398.84	9,322,518 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	97,398.84	6,965,497	0	-2,357,021	-2,357,021
1,200,000.00000		5/12/2015		1,200,000.00	113,914,267 71.515193747	1.000000000\$ 71.515193747	1,200,000.00	85,818,232	0	-28,096,035	-28,096,035

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
1,204.66000		5/18/2015		1,204.66	115,742	1.000000000\$ 71.515193747	1,204.66	86,151	0	-29,591	-29,591
102,958.65000		5/21/2015		102,958.65	9,829,791	1.000000000\$ 71.515193747	102,958.65	7,363,108	0	-2,466,683	-2,466,683
240,337.15000		5/27/2015		240,337.15	22,898,966	1.000000000\$ 71.515193747	240,337.15	17,187,758	0	-5,711,208	-5,711,208
1,040.35000		5/29/2015		1,040.35	98,821	1.000000000\$ 71.515193747	1,040.35	74,401	0	-24,420	-24,420
58,140.06000		6/4/2015		58,140.06	5,632,409	1.000000000\$ 71.515193747	58,140.06	4,157,898	0	-1,474,511	-1,474,511
463,495.15000		6/5/2015		463,495.15	44,299,139	1.000000000\$ 71.515193747	463,495.15	33,146,945	0	-11,152,194	-11,152,194
86,583.78000		6/9/2015		86,583.78	8,282,560	1.000000000\$ 71.515193747	86,583.78	6,192,056	0	-2,090,504	-2,090,504
1,000,000.00000		6/11/2015		1,000,000.00	95,109,932	1.000000000\$ 71.515193747	1,000,000.00	71,515,194	0	-23,594,738	-23,594,738
950,000.00000		6/23/2015		950,000.00	90,927,877	1.000000000\$ 71.515193747	950,000.00	67,939,434	0	-22,988,443	-22,988,443
742.88000		6/30/2015		742.88	69,868	1.000000000\$ 71.515193747	742.88	53,127	0	-16,741	-16,741
87,175.55000		7/2/2015		87,175.55	8,216,800	1.000000000\$ 71.515193747	87,175.55	6,234,376	0	-1,982,424	-1,982,424
1,500,000.00000		7/8/2015		1,500,000.00	136,124,157	1.000000000\$ 71.515193747	1,500,000.00	107,272,791	0	-28,851,366	-28,851,366
5,077.27000		7/9/2015		5,077.27	457,130	1.000000000\$ 71.515193747	5,077.27	363,102	0	-94,028	-94,028
100,237.08000		7/17/2015		100,237.08	9,227,204	1.000000000\$ 71.515193747	100,237.08	7,168,474	0	-2,058,730	-2,058,730
945.93000		7/31/2015		945.93	86,063	1.000000000\$ 71.515193747	945.93	67,648	0	-18,415	-18,415

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
88,380.65000		7/31/2015		88,380.65	7,994,358	1.000000000\$ 71.515193747	88,380.65	6,320,559	0	-1,673,799	-1,673,799
1,940,000.00000		8/7/2015		1,940,000.00	177,758,540	1.000000000\$ 71.515193747	1,940,000.00	138,739,476	0	-39,019,064	-39,019,064
7,650,000.00000		8/11/2015		7,650,000.00	704,316,836	1.000000000\$ 71.515193747	7,650,000.00	547,091,232	0	-157,225,604	-157,225,604
479,833.36000		8/13/2015		479,833.36	43,809,780	1.000000000\$ 71.515193747	479,833.36	34,315,376	0	-9,494,404	-9,494,404
75,403.65000		8/18/2015		75,403.65	6,920,738	1.000000000\$ 71.515193747	75,403.65	5,392,507	0	-1,528,231	-1,528,231
1,260,000.00000		8/25/2015		1,260,000.00	107,638,641	1.000000000\$ 71.515193747	1,260,000.00	90,109,144	0	-17,529,497	-17,529,497
20,000.03000		8/28/2015		20,000.03	1,724,493	1.000000000\$ 71.515193747	20,000.03	1,430,306	0	-294,187	-294,187
1,123.56000		8/31/2015		1,123.56	96,530	1.000000000\$ 71.515193747	1,123.56	80,352	0	-16,178	-16,178
1,500,000.00000		9/8/2015		1,500,000.00	124,005,422	1.000000000\$ 71.515193747	1,500,000.00	107,272,791	0	-16,732,631	-16,732,631
1,500,000.00000		9/14/2015		1,500,000.00	127,701,060	1.000000000\$ 71.515193747	1,500,000.00	107,272,791	0	-20,428,269	-20,428,269
1,200,000.00000		9/17/2015		1,200,000.00	104,033,759	1.000000000\$ 71.515193747	1,200,000.00	85,818,232	0	-18,215,527	-18,215,527
4,580.00000		9/29/2015		4,580.00	384,148	1.000000000\$ 71.515193747	4,580.00	327,540	0	-56,608	-56,608
1,050.33000		9/30/2015		1,050.33	88,338	1.000000000\$ 71.515193747	1,050.33	75,115	0	-13,223	-13,223
41,308.36000		10/2/2015		41,308.36	3,484,596	1.000000000\$ 71.515193747	41,308.36	2,954,175	0	-530,421	-530,421
1,200,000.00000		10/7/2015		1,200,000.00	102,916,819	1.000000000\$ 71.515193747	1,200,000.00	85,818,232	0	-17,098,587	-17,098,587

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

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

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

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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
479,833.36000		10/14/2015		479,833.36	41,980,363	1.000000000\$ 71.515193747	479,833.36	34,315,376	0	-7,664,987	-7,664,987
34,504.30000		10/19/2015		34,504.30	2,988,523	1.000000000\$ 71.515193747	34,504.30	2,467,582	0	-520,941	-520,941
1,500,000.00000		10/21/2015		1,500,000.00	130,659,384	1.000000000\$ 71.515193747	1,500,000.00	107,272,791	0	-23,386,593	-23,386,593
146,966.97000		10/23/2015		146,966.97	12,774,602	1.000000000\$ 71.515193747	146,966.97	10,510,371	0	-2,264,231	-2,264,231
33,373.73000		10/28/2015		33,373.73	2,903,788	1.000000000\$ 71.515193747	33,373.73	2,386,729	0	-517,059	-517,059
1,210.89000		10/30/2015		1,210.89	104,252	1.000000000\$ 71.515193747	1,210.89	86,597	0	-17,655	-17,655
191,801.71000		11/2/2015		191,801.71	16,513,279	1.000000000\$ 71.515193747	191,801.71	13,716,736	0	-2,796,543	-2,796,543
1,450.44000		11/9/2015		1,450.44	125,722	1.000000000\$ 71.515193747	1,450.44	103,728	0	-21,994	-21,994
1,100,000.00000		11/10/2015		1,100,000.00	95,614,298	1.000000000\$ 71.515193747	1,100,000.00	78,666,713	0	-16,947,585	-16,947,585
1,370,000.00000		11/20/2015		1,370,000.00	121,160,088	1.000000000\$ 71.515193747	1,370,000.00	97,975,815	0	-23,184,273	-23,184,273
1,241.63000		11/30/2015		1,241.63	110,913	1.000000000\$ 71.515193747	1,241.63	88,795	0	-22,118	-22,118
55,217.71000		11/30/2015		55,217.71	4,875,314	1.000000000\$ 71.515193747	55,217.71	3,948,905	0	-926,409	-926,409
67,803.25000		12/2/2015		67,803.25	6,086,449	1.000000000\$ 71.515193747	67,803.25	4,848,963	0	-1,237,486	-1,237,486
1,200,000.00000		12/8/2015		1,200,000.00	107,613,376	1.000000000\$ 71.515193747	1,200,000.00	85,818,232	0	-21,795,144	-21,795,144
479,833.36000		12/14/2015		479,833.36	41,838,537	1.000000000\$ 71.515193747	479,833.36	34,315,376	0	-7,523,161	-7,523,161

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
1,300,000.00000		12/14/2015		1,300,000.00	113,352,056	1.000000000\$ 71.515193747	1,300,000.00	92,969,752	0	-20,382,304	-20,382,304
920,000.00000		12/18/2015		920,000.00	80,272,386	1.000000000\$ 71.515193747	920,000.00	65,793,978	0	-14,478,408	-14,478,408
7,027.13000		12/21/2015		7,027.13	613,059	1.000000000\$ 71.515193747	7,027.13	502,547	0	-110,512	-110,512
69,609.63000		12/22/2015		69,609.63	6,058,273	1.000000000\$ 71.515193747	69,609.63	4,978,146	0	-1,080,127	-1,080,127
30,652.58000		12/24/2015		30,652.58	2,680,171	1.000000000\$ 71.515193747	30,652.58	2,192,125	0	-488,046	-488,046
31,897.52000		12/29/2015		31,897.52	2,787,126	1.000000000\$ 71.515193747	31,897.52	2,281,157	0	-505,969	-505,969
930.50000		12/31/2015		930.50	81,438	1.000000000\$ 71.515193747	930.50	66,545	0	-14,893	-14,893
64,476.82000		1/6/2016		64,476.82	5,481,018	1.000000000\$ 71.515193747	64,476.82	4,611,072	0	-869,946	-869,946
29,058.54000		1/14/2016		29,058.54	2,404,861	1.000000000\$ 71.515193747	29,058.54	2,078,127	0	-326,734	-326,734
306,365.43000		1/20/2016		306,365.43	24,967,386	1.000000000\$ 71.515193747	306,365.43	21,909,783	0	-3,057,603	-3,057,603
453,323.95000		1/25/2016		453,323.95	37,747,169	1.000000000\$ 71.515193747	453,323.95	32,419,550	0	-5,327,619	-5,327,619
54,860.74000		1/28/2016		54,860.74	4,588,058	1.000000000\$ 71.515193747	54,860.74	3,923,376	0	-664,682	-664,682
778.74000		1/29/2016		778.74	66,688	1.000000000\$ 71.515193747	778.74	55,692	0	-10,996	-10,996
9,624.24000		2/2/2016		9,624.24	825,300	1.000000000\$ 71.515193747	9,624.24	688,279	0	-137,021	-137,021
45,449.01000		2/3/2016		45,449.01	3,852,337	1.000000000\$ 71.515193747	45,449.01	3,250,295	0	-602,042	-602,042

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
900,000.00000		2/19/2016		900,000.00	73,080,576	1.000000000\$ 71.515193747	900,000.00	64,363,674	0	-8,716,902	-8,716,902
549.31000		2/29/2016		549.31	44,286	1.000000000\$ 71.515193747	549.31	39,284	0	-5,002	-5,002
549.31000		2/29/2016		549.31	7	1.000000000\$ 71.515193747	549.31	39,284	0	39,277	39,277
300,000.00000		3/11/2016		300,000.00	25,334,694	1.000000000\$ 71.515193747	300,000.00	21,454,558	0	-3,880,136	-3,880,136
870,000.00000		3/18/2016		870,000.00	73,945,274	1.000000000\$ 71.515193747	870,000.00	62,218,219	0	-11,727,055	-11,727,055
670.89000		3/31/2016		670.89	58,005	1.000000000\$ 71.515193747	670.89	47,979	0	-10,026	-10,026
670.89000		3/31/2016		670.89	8	1.000000000\$ 71.515193747	670.89	47,979	0	47,971	47,971
49,152.02000		4/1/2016		49,152.02	4,249,676	1.000000000\$ 71.515193747	49,152.02	3,515,116	0	-734,560	-734,560
0.11000		4/4/2016		0.11	9	1.000000000\$ 71.515193747	0.11	8	0	-1	-1
118,557.70000		4/4/2016		118,557.70	10,179,618	1.000000000\$ 71.515193747	118,557.70	8,478,677	0	-1,700,941	-1,700,941
54,704.79000		4/7/2016		54,704.79	4,550,661	1.000000000\$ 71.515193747	54,704.79	3,912,224	0	-638,437	-638,437
1,000,000.00000		4/13/2016		1,000,000.00	82,840,523	1.000000000\$ 71.515193747	1,000,000.00	71,515,194	0	-11,325,329	-11,325,329
279,833.36000		4/18/2016		279,833.36	23,441,485	1.000000000\$ 71.515193747	279,833.36	20,012,337	0	-3,429,148	-3,429,148
2,500,000.00000		4/21/2016		2,500,000.00	213,220,853	1.000000000\$ 71.515193747	2,500,000.00	178,787,984	0	-34,432,869	-34,432,869
9,845.91000		4/22/2016		9,845.91	837,399	1.000000000\$ 71.515193747	9,845.91	704,132	0	-133,267	-133,267

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
71,738.60000		4/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000\$ 71.515193747	71,738.60	5,130,400	0	-918,628	-918,628
651.99000		4/29/2016		651.99	8	1.000000000\$ 71.515193747	651.99	46,627	0	46,619	46,619
651.99000		4/29/2016		651.99	53,237	1.000000000\$ 71.515193747	651.99	46,627	0	-6,610	-6,610
3,199.32000		5/6/2016		3,199.32	256,662	1.000000000\$ 71.515193747	3,199.32	228,800	0	-27,862	-27,862
37,851.41000		5/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	28,390.46	2,030,349	0	-219,727	-219,727
487.18000		5/31/2016		487.18	39,143	1.000000000\$ 71.515193747	487.18	34,841	0	-4,302	-4,302
77,920.52000		6/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	51,500.28	3,683,053	0	-164,617	-164,617
370.39000		6/30/2016		370.39	28,294	1.000000000\$ 71.515193747	370.39	26,489	0	-1,805	-1,805
41,200.23000		6/30/2016		41,200.23	3,144,683	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
28,419.86000		7/6/2016		28,419.86	2,155,687	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 71.515193747	49,430.39	3,535,024	0	-352,217	-352,217
966.37000		7/29/2016		966.37	75,274	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 71.515193747	312.44	22,344	0	-1,944	-1,944
2,905.89000		8/31/2016		2,905.89	224,400	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
57,901.38000		9/27/2016		57,901.38	4,441,152	1.000000000\$ 71.515193747	57,901.38	4,140,828	0	-300,324	-300,324
38,744.71000		9/28/2016		38,744.71	2,976,084	1.000000000\$ 71.515193747	38,744.71	2,770,835	0	-205,249	-205,249
205,508.38000		9/29/2016		205,508.38	15,834,834	1.000000000\$ 71.515193747	205,508.38	14,696,972	0	-1,137,862	-1,137,862
556.44000		9/30/2016		556.44	43,120	1.000000000\$ 71.515193747	556.44	39,794	0	-3,326	-3,326
96,868.26000		9/30/2016		96,868.26	7,548,319	1.000000000\$ 71.515193747	96,868.26	6,927,552	0	-620,767	-620,767
10,705.70000		10/4/2016		10,705.70	833,355	1.000000000\$ 71.515193747	10,705.70	765,620	0	-67,735	-67,735
145,292.56000		10/4/2016		145,292.56	11,309,888	1.000000000\$ 71.515193747	145,292.56	10,390,626	0	-919,262	-919,262
279,833.36000		10/18/2016		279,833.36	22,177,198	1.000000000\$ 71.515193747	279,833.36	20,012,337	0	-2,164,861	-2,164,861
83,301.08000		10/27/2016		83,301.08	6,668,666	1.000000000\$ 71.515193747	83,301.08	5,957,293	0	-711,373	-711,373
833.18000		10/31/2016		833.18	66,625	1.000000000\$ 71.515193747	833.18	59,585	0	-7,040	-7,040
74,583.53000		10/31/2016		74,583.53	5,960,068	1.000000000\$ 71.515193747	74,583.53	5,333,856	0	-626,212	-626,212
142,255.95000		11/2/2016		142,255.95	11,375,416	1.000000000\$ 71.515193747	142,255.95	10,173,462	0	-1,201,954	-1,201,954
134,756.68000		11/4/2016		134,756.68	10,678,599	1.000000000\$ 71.515193747	134,756.68	9,637,150	0	-1,041,449	-1,041,449
849.50000		11/30/2016		849.50	71,518	1.000000000\$ 71.515193747	849.50	60,752	0	-10,766	-10,766
885,465.77000		12/13/2016		885,465.77	76,650,084	1.000000000\$ 71.515193747	885,465.77	63,324,256	0	-13,325,828	-13,325,828

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
279,833.36000		12/15/2016		279,833.36	24,213,667	1.000000000\$ 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\$ 71.515193747	829.17	59,298	0	-11,602	-11,602
464.62000		12/30/2016		464.62	39,240	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 71.515193747	63,860.76	4,567,015	0	-943,670	-943,670
598.25000		2/28/2017		598.25	51,463	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 71.515193747	62,745.10	4,487,228	0	-820,178	-820,178
470.71000		3/31/2017		470.71	40,012	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
89,505.17000		3/31/2017		89,505.17	7,644,438	1.000000000\$ 71.515193747	89,505.17	6,400,980	0	-1,243,458	-1,243,458
766,000.00000		4/7/2017		766,000.00	64,145,110	1.000000000\$ 71.515193747	766,000.00	54,780,638	0	-9,364,472	-9,364,472
279,833.36000		4/18/2017		279,833.36	23,068,187	1.000000000\$ 71.515193747	279,833.36	20,012,337	0	-3,055,850	-3,055,850
1,068,505.95000		4/18/2017		1,068,505.95	88,082,762	1.000000000\$ 71.515193747	1,068,505.95	76,414,410	0	-11,668,352	-11,668,352
1,125,804.00000		4/18/2017		1,125,804.00	92,806,152	1.000000000\$ 71.515193747	1,125,804.00	80,512,091	0	-12,294,061	-12,294,061
106,547.89000		4/27/2017		106,547.89	8,885,757	1.000000000\$ 71.515193747	106,547.89	7,619,793	0	-1,265,964	-1,265,964
978.41000		4/28/2017		978.41	81,563	1.000000000\$ 71.515193747	978.41	69,971	0	-11,592	-11,592
5,940,000.00000		4/28/2017		5,940,000.00	492,026,980	1.000000000\$ 71.515193747	5,940,000.00	424,800,251	0	-67,226,729	-67,226,729
1,390,000.00000		5/5/2017		1,390,000.00	115,907,314	1.000000000\$ 71.515193747	1,390,000.00	99,406,119	0	-16,501,195	-16,501,195
1,344,823.25000		5/26/2017		1,344,823.25	112,415,381	1.000000000\$ 71.515193747	1,344,823.25	96,175,295	0	-16,240,086	-16,240,086
895.60000		5/31/2017		895.60	73,730	1.000000000\$ 71.515193747	895.60	64,049	0	-9,681	-9,681
4,843.12000		6/2/2017		4,843.12	397,848	1.000000000\$ 71.515193747	4,843.12	346,357	0	-51,491	-51,491
7,078.68000		6/13/2017		7,078.68	586,390	1.000000000\$ 71.515193747	7,078.68	506,233	0	-80,157	-80,157
275,955.42000		6/14/2017		275,955.42	22,875,822	1.000000000\$ 71.515193747	275,955.42	19,735,005	0	-3,140,817	-3,140,817
320,000.00000		6/14/2017		320,000.00	3,860	1.000000000\$ 71.515193747	320,000.00	22,884,862	0	22,881,002	22,881,002

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
270,000.00000		6/16/2017		270,000.00	22,642,776	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	118,871.82	8,501,141	0	-1,976,362	-1,976,362
604.28000		7/31/2017		604.28	53,306	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	772,000.00	55,209,730	0	-11,782,162	-11,782,162
607.32000		8/31/2017		607.32	53,015	1.000000000\$ 71.515193747	607.32	43,433	0	-9,582	-9,582
2,039.21000		9/1/2017		2,039.21	178,011	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
823.11000		9/29/2017		823.11	72,700	1.000000000\$ 71.515193747	823.11	58,865	0	-13,835	-13,835
27,121.31000		10/3/2017		27,121.31	2,392,132	1.000000000\$ 71.515193747	27,121.31	1,939,586	0	-452,546	-452,546
88,632.36000		10/26/2017		88,632.36	7,758,635	1.000000000\$ 71.515193747	88,632.36	6,338,560	0	-1,420,075	-1,420,075
736.84000		10/31/2017		736.84	64,198	1.000000000\$ 71.515193747	736.84	52,695	0	-11,503	-11,503
8,233.29000		11/16/2017		8,233.29	705,946	1.000000000\$ 71.515193747	8,233.29	588,805	0	-117,141	-117,141
484,308.44000		11/21/2017		484,308.44	41,128,430	1.000000000\$ 71.515193747	484,308.44	34,635,412	0	-6,493,018	-6,493,018
230.45000		11/30/2017		230.45	19,577	1.000000000\$ 71.515193747	230.45	16,481	0	-3,096	-3,096
1,695,000.00000		12/11/2017		1,695,000.00	144,533,433	1.000000000\$ 71.515193747	1,695,000.00	121,218,253	0	-23,315,180	-23,315,180
27,121.31000		12/28/2017		27,121.31	2,386,064	1.000000000\$ 71.515193747	27,121.31	1,939,586	0	-446,478	-446,478
523.56000		12/29/2017		523.56	46,130	1.000000000\$ 71.515193747	523.56	37,442	0	-8,688	-8,688
96,866.03000		12/29/2017		96,866.03	8,518,656	1.000000000\$ 71.515193747	96,866.03	6,927,393	0	-1,591,263	-1,591,263
19,401.29000		1/9/2018		19,401.29	1,717,947	1.000000000\$ 71.515193747	19,401.29	1,387,487	0	-330,460	-330,460
3,712.80000		1/17/2018		3,712.80	327,014	1.000000000\$ 71.515193747	3,712.80	265,522	0	-61,492	-61,492
759,513.00000		1/17/2018		759,513.00	66,896,074	1.000000000\$ 71.515193747	759,513.00	54,316,719	0	-12,579,355	-12,579,355
1,439,655.07000		1/17/2018		1,439,655.07	126,801,347	1.000000000\$ 71.515193747	1,439,655.07	102,957,211	0	-23,844,136	-23,844,136

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
1,571,080.15000		1/17/2018		1,571,080.15	138,376,951	1.000000000\$ 71.515193747	1,571,080.15	112,356,101	0	-26,020,850	-26,020,850
937.46000		1/31/2018		937.46	82,860	1.000000000\$ 71.515193747	937.46	67,043	0	-15,817	-15,817
767,000.00000		2/9/2018		767,000.00	65,324,597	1.000000000\$ 71.515193747	767,000.00	54,852,154	0	-10,472,443	-10,472,443
222,233.52000		2/13/2018		222,233.52	18,878,141	1.000000000\$ 71.515193747	222,233.52	15,893,073	0	-2,985,068	-2,985,068
572.52000		2/28/2018		572.52	47,605	1.000000000\$ 71.515193747	572.52	40,944	0	-6,661	-6,661
184,792.64000		3/16/2018		184,792.64	15,316,445	1.000000000\$ 71.515193747	184,792.64	13,215,481	0	-2,100,964	-2,100,964
116,717.00000		3/22/2018		116,717.00	9,564,337	1.000000000\$ 71.515193747	116,717.00	8,347,039	0	-1,217,298	-1,217,298
730,655.07000		3/22/2018		730,655.07	59,873,294	1.000000000\$ 71.515193747	730,655.07	52,252,939	0	-7,620,355	-7,620,355
1,359,283.00000		3/22/2018		1,359,283.00	111,386,007	1.000000000\$ 71.515193747	1,359,283.00	97,209,387	0	-14,176,620	-14,176,620
548.62000		3/29/2018		548.62	44,754	1.000000000\$ 71.515193747	548.62	39,235	0	-5,519	-5,519
575,000.00000		4/18/2018		575,000.00	47,878,949	1.000000000\$ 71.515193747	575,000.00	41,121,236	0	-6,757,713	-6,757,713
0.04000		4/30/2018		0.04	3	1.000000000\$ 71.515193747	0.04	3	0	0	0
404.67000		4/30/2018		404.67	33,426	1.000000000\$ 71.515193747	404.67	28,940	0	-4,486	-4,486
57,148.43000		5/8/2018		57,148.43	4,695,613	1.000000000\$ 71.515193747	57,148.43	4,086,981	0	-608,632	-608,632
700,000.00000		5/15/2018		700,000.00	57,931,683	1.000000000\$ 71.515193747	700,000.00	50,060,636	0	-7,871,047	-7,871,047

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
1,305,655.07000		5/16/2018		1,305,655.07	107,677,003	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	28,442.03	2,034,037	0	-327,371	-327,371
337.42000		5/31/2018		337.42	27,738	1.000000000\$ 71.515193747	337.42	24,131	0	-3,607	-3,607
41,255.59000		6/5/2018		41,255.59	3,458,418	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	777,655.00	55,614,148	0	-9,679,071	-9,679,071
537.23000		6/29/2018		537.23	43,966	1.000000000\$ 71.515193747	537.23	38,420	0	-5,546	-5,546
690,000.00000		7/24/2018		690,000.00	56,754,011	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	31,207.59	2,231,817	0	-333,075	-333,075
377.22000		7/31/2018		377.22	31,391	1.000000000\$ 71.515193747	377.22	26,977	0	-4,414	-4,414
144,861.46000		7/31/2018		144,861.46	11,909,905	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	110,062.03	7,871,107	0	-1,115,337	-1,115,337
541.98000		8/31/2018		541.98	43,462	1.000000000\$ 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>											
35,715.85000		9/5/2018		35,715.85	2,856,195	1.000000000\$ 71.515193747	35,715.85	2,554,226	0	-301,969	-301,969
10,030.29000		9/6/2018		10,030.29	804,746	1.000000000\$ 71.515193747	10,030.29	717,318	0	-87,428	-87,428
587.18000		9/28/2018		587.18	48,257	1.000000000\$ 71.515193747	587.18	41,992	0	-6,265	-6,265
446,987.00000		10/10/2018		446,987.00	35,791,150	1.000000000\$ 71.515193747	446,987.00	31,966,362	0	-3,824,788	-3,824,788
653,013.00000		10/10/2018		653,013.00	52,288,067	1.000000000\$ 71.515193747	653,013.00	46,700,351	0	-5,587,716	-5,587,716
606.11000		10/31/2018		606.11	48,480	1.000000000\$ 71.515193747	606.11	43,346	0	-5,134	-5,134
9,875.75000		11/5/2018		9,875.75	804,182	1.000000000\$ 71.515193747	9,875.75	706,266	0	-97,916	-97,916
459,000.00000		11/8/2018		459,000.00	37,882,262	1.000000000\$ 71.515193747	459,000.00	32,825,474	0	-5,056,788	-5,056,788
340,876.48000		11/14/2018		340,876.48	27,993,030	1.000000000\$ 71.515193747	340,876.48	24,377,848	0	-3,615,182	-3,615,182
258,427.01000		11/15/2018		258,427.01	21,246,604	1.000000000\$ 71.515193747	258,427.01	18,481,458	0	-2,765,146	-2,765,146
653,013.00000		11/20/2018		653,013.00	53,686,499	1.000000000\$ 71.515193747	653,013.00	46,700,351	0	-6,986,148	-6,986,148
1,657.84000		11/29/2018		1,657.84	136,528	1.000000000\$ 71.515193747	1,657.84	118,561	0	-17,967	-17,967
554.37000		11/30/2018		554.37	45,968	1.000000000\$ 71.515193747	554.37	39,646	0	-6,322	-6,322
94,945.23000		11/30/2018		94,945.23	7,866,272	1.000000000\$ 71.515193747	94,945.23	6,790,027	0	-1,076,245	-1,076,245
56,052.05000		12/6/2018		56,052.05	4,609,486	1.000000000\$ 71.515193747	56,052.05	4,008,573	0	-600,913	-600,913

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
48,583.36000		12/7/2018		48,583.36	3,938,270	1.000000000\$ 71.515193747	48,583.36	3,474,448	0	-463,822	-463,822
722,616.57000		12/19/2018		722,616.57	58,370,578	1.000000000\$ 71.515193747	722,616.57	51,678,064	0	-6,692,514	-6,692,514
748.57000		12/31/2018		748.57	57,819	1.000000000\$ 71.515193747	748.57	53,534	0	-4,285	-4,285
0.09000		1/17/2019		0.09	7	1.000000000\$ 71.515193747	0.09	6	0	-1	-1
44,669.10000		1/17/2019		44,669.10	3,490,922	1.000000000\$ 71.515193747	44,669.10	3,194,519	0	-296,403	-296,403
8,335.47000		1/23/2019		8,335.47	651,153	1.000000000\$ 71.515193747	8,335.47	596,113	0	-55,040	-55,040
48,430.88000		1/29/2019		48,430.88	3,793,245	1.000000000\$ 71.515193747	48,430.88	3,463,544	0	-329,701	-329,701
722,616.57000		1/29/2019		722,616.57	56,597,394	1.000000000\$ 71.515193747	722,616.57	51,678,064	0	-4,919,330	-4,919,330
44,745.30000		1/30/2019		44,745.30	3,497,538	1.000000000\$ 71.515193747	44,745.30	3,199,969	0	-297,569	-297,569
481.63000		1/31/2019		481.63	38,219	1.000000000\$ 71.515193747	481.63	34,444	0	-3,775	-3,775
12,725.41000		2/1/2019		12,725.41	1,009,804	1.000000000\$ 71.515193747	12,725.41	910,060	0	-99,744	-99,744
587,000.00000		2/12/2019		587,000.00	45,794,312	1.000000000\$ 71.515193747	587,000.00	41,979,419	0	-3,814,893	-3,814,893
276,145.36000		2/22/2019		276,145.36	21,664,268	1.000000000\$ 71.515193747	276,145.36	19,748,589	0	-1,915,679	-1,915,679
7,748.98000		2/26/2019		7,748.98	616,211	1.000000000\$ 71.515193747	7,748.98	554,170	0	-62,041	-62,041
474,707.41000		2/27/2019		474,707.41	37,717,403	1.000000000\$ 71.515193747	474,707.41	33,948,792	0	-3,768,611	-3,768,611

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
344.55000		2/28/2019		344.55	27,288	1.000000000\$ 71.515193747	344.55	24,641	0	-2,647	-2,647
130,705.64000		2/28/2019		130,705.64	10,352,769	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	122,045.83	8,728,131	0	-943,729	-943,729
6,205.83000		3/8/2019		6,205.83	486,732	1.000000000\$ 71.515193747	6,205.83	443,811	0	-42,921	-42,921
50,174.39000		3/12/2019		50,174.39	3,937,071	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	817.38	58,455	0	-5,812	-5,812
980,000.00000		3/29/2019		980,000.00	76,680,395	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	348,561.68	24,927,456	0	-2,486,785	-2,486,785
757.42000		4/30/2019		757.42	59,375	1.000000000\$ 71.515193747	757.42	54,167	0	-5,208	-5,208
225,051.00000		5/22/2019		225,051.00	17,131,923	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
9,866.90000		5/28/2019		9,866.90	747,461	1.000000000\$ 71.515193747	9,866.90	705,633	0	-41,828	-41,828
406.98000		5/31/2019		406.98	30,616	1.000000000\$ 71.515193747	406.98	29,105	0	-1,511	-1,511
407,039.23000		6/5/2019		407,039.23	30,767,128	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	55,817.33	3,991,787	0	-203,423	-203,423
350.04000		6/28/2019		350.04	26,465	1.000000000\$ 71.515193747	350.04	25,033	0	-1,432	-1,432
27,908.70000		7/2/2019		27,908.70	2,106,119	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	131,731.93	9,420,834	0	-548,026	-548,026
1,131.71000		7/26/2019		1,131.71	85,538	1.000000000\$ 71.515193747	1,131.71	80,934	0	-4,604	-4,604
114,258.08000		7/29/2019		114,258.08	8,579,187	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
4.01000		7/31/2019		4.01	300	1.000000000\$ 71.515193747	4.01	287	0	-13	-13
417.64000		7/31/2019		417.64	31,254	1.000000000\$ 71.515193747	417.64	29,868	0	-1,386	-1,386
134,803.62000		8/6/2019		134,803.62	9,687,573	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	39,099.81	2,796,230	0	-29,793	-29,793
971.71000		8/23/2019		971.71	69,976	1.000000000\$ 71.515193747	971.71	69,492	0	-484	-484
121,648.02000		8/27/2019		121,648.02	8,734,737	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-93,678.58000		12/2/2014		-93,678.58	-9,411,623	1.000000000\$ 71.515193747	-93,678.58	-6,699,442	0	2,712,181	2,712,181
-214,564.97000		12/3/2014		-214,564.97	-21,617,415	1.000000000\$ 71.515193747	-214,564.97	-15,344,655	0	6,272,760	6,272,760
-435,539.26000		12/4/2014		-435,539.26	-43,903,822	1.000000000\$ 71.515193747	-435,539.26	-31,147,675	0	12,756,147	12,756,147
-301,627.51000		12/9/2014		-301,627.51	-30,314,256	1.000000000\$ 71.515193747	-301,627.51	-21,570,950	0	8,743,306	8,743,306
-128,649.45000		12/10/2014		-128,649.45	-12,782,326	1.000000000\$ 71.515193747	-128,649.45	-9,200,390	0	3,581,936	3,581,936
-701,988.29000		12/11/2014		-701,988.29	-69,264,315	1.000000000\$ 71.515193747	-701,988.29	-50,202,829	0	19,061,486	19,061,486
-69,226.87000		12/11/2014		-69,226.87	-6,830,529	1.000000000\$ 71.515193747	-69,226.87	-4,950,773	0	1,879,756	1,879,756
-233,220.13000		12/12/2014		-233,220.13	-22,988,872	1.000000000\$ 71.515193747	-233,220.13	-16,678,783	0	6,310,089	6,310,089
-1,012,066.41000		12/15/2014		-1,012,066.41	-98,967,724	1.000000000\$ 71.515193747	-1,012,066.41	-72,378,125	0	26,589,599	26,589,599
-882,994.13000		12/15/2014		-882,994.13	-86,346,033	1.000000000\$ 71.515193747	-882,994.13	-63,147,496	0	23,198,537	23,198,537
-667,933.59000		12/15/2014		-667,933.59	-65,315,741	1.000000000\$ 71.515193747	-667,933.59	-47,767,400	0	17,548,341	17,548,341
-230,255.10000		12/16/2014		-230,255.10	-22,377,237	1.000000000\$ 71.515193747	-230,255.10	-16,466,738	0	5,910,499	5,910,499
-67,739.36000		12/17/2014		-67,739.36	-6,523,402	1.000000000\$ 71.515193747	-67,739.36	-4,844,393	0	1,679,009	1,679,009
-244,669.86000		12/19/2014		-244,669.86	-23,723,117	1.000000000\$ 71.515193747	-244,669.86	-17,497,612	0	6,225,505	6,225,505
-148,648.91000		12/22/2014		-148,648.91	-14,467,922	1.000000000\$ 71.515193747	-148,648.91	-10,630,656	0	3,837,266	3,837,266

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-151,043.46000		12/24/2014		-151,043.46	-14,765,543	1.000000000\$ 71.515193747	-151,043.46	-10,801,902	0	3,963,641	3,963,641
-105,843.81000		1/5/2015		-105,843.81	-10,336,129	1.000000000\$ 71.515193747	-105,843.81	-7,569,441	0	2,766,688	2,766,688
-204,027.32000		1/7/2015		-204,027.32	-19,651,794	1.000000000\$ 71.515193747	-204,027.32	-14,591,053	0	5,060,741	5,060,741
-92,171.03000		1/8/2015		-92,171.03	-8,853,375	1.000000000\$ 71.515193747	-92,171.03	-6,591,629	0	2,261,746	2,261,746
-686,560.80000		1/9/2015		-686,560.80	-66,622,818	1.000000000\$ 71.515193747	-686,560.80	-49,099,529	0	17,523,289	17,523,289
-296,399.69000		1/13/2015		-296,399.69	-28,690,461	1.000000000\$ 71.515193747	-296,399.69	-21,197,081	0	7,493,380	7,493,380
-20,527.98000		1/14/2015		-20,527.98	-1,983,598	1.000000000\$ 71.515193747	-20,527.98	-1,468,062	0	515,536	515,536
-39,405.57000		1/15/2015		-39,405.57	-3,758,292	1.000000000\$ 71.515193747	-39,405.57	-2,818,097	0	940,195	940,195
-39,335.92000		1/21/2015		-39,335.92	-3,807,263	1.000000000\$ 71.515193747	-39,335.92	-2,813,116	0	994,147	994,147
-144,341.08000		1/22/2015		-144,341.08	-13,851,088	1.000000000\$ 71.515193747	-144,341.08	-10,322,580	0	3,528,508	3,528,508
-140,447.93000		1/22/2015		-140,447.93	-13,477,498	1.000000000\$ 71.515193747	-140,447.93	-10,044,161	0	3,433,337	3,433,337
-131,846.04000		1/22/2015		-131,846.04	-12,652,054	1.000000000\$ 71.515193747	-131,846.04	-9,428,995	0	3,223,059	3,223,059
-11,116.87000		1/22/2015		-11,116.87	-1,066,784	1.000000000\$ 71.515193747	-11,116.87	-795,025	0	271,759	271,759
-9,303.87000		1/28/2015		-9,303.87	-869,334	1.000000000\$ 71.515193747	-9,303.87	-665,368	0	203,966	203,966
-258,206.95000		2/5/2015		-258,206.95	-23,515,972	1.000000000\$ 71.515193747	-258,206.95	-18,465,720	0	5,050,252	5,050,252

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計算上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-128,192.28000		2/9/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-12,078.57	-863,801	0	256,157	256,157
-203,751.45000		2/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-12,405.71	-887,197	0	272,676	272,676
-125,474.92000		3/6/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-302,844.98000		3/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000\$ 71.515193747	-302,844.98	-21,658,017	0	6,605,831	6,605,831
-97,995.40000		3/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000\$ 71.515193747	-97,995.40	-7,008,160	0	2,240,155	2,240,155
-172,798.05000		3/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000\$ 71.515193747	-172,798.05	-12,357,686	0	3,849,225	3,849,225
-975,466.76000		3/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000\$ 71.515193747	-975,466.76	-69,760,694	0	21,193,928	21,193,928
-256,508.24000		3/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000\$ 71.515193747	-256,508.24	-18,344,236	0	5,350,158	5,350,158
-189,563.24000		3/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000\$ 71.515193747	-189,563.24	-13,556,652	0	3,820,646	3,820,646
-206,250.64000		4/2/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000\$ 71.515193747	-206,250.64	-14,750,054	0	4,048,888	4,048,888
-90,318.63000		4/7/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000\$ 71.515193747	-90,318.63	-6,459,154	0	1,735,527	1,735,527
-74,243.21000		4/8/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000\$ 71.515193747	-74,243.21	-5,309,518	0	1,526,133	1,526,133
-78,171.43000		4/9/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000\$ 71.515193747	-78,171.43	-5,590,445	0	1,628,445	1,628,445
-705,086.17000		4/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000\$ 71.515193747	-705,086.17	-50,424,374	0	14,684,329	14,684,329
-37,651.50000		4/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000\$ 71.515193747	-37,651.50	-2,692,654	0	784,141	784,141
-246,307.80000		4/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000\$ 71.515193747	-246,307.80	-17,614,750	0	4,819,013	4,819,013
-57,294.63000		4/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000\$ 71.515193747	-57,294.63	-4,097,437	0	1,122,687	1,122,687
-39,422.26000		4/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000\$ 71.515193747	-39,422.26	-2,819,291	0	827,331	827,331

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-167,462.13000		4/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000\$ 71.515193747	-167,462.13	-11,976,087	0	3,453,273	3,453,273
-11,204.33000		4/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000\$ 71.515193747	-11,204.33	-801,280	0	231,047	231,047
-58,785.17000		4/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000\$ 71.515193747	-58,785.17	-4,204,033	0	1,264,132	1,264,132
-203,446.05000		4/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000\$ 71.515193747	-203,446.05	-14,549,484	0	4,360,785	4,360,785
-19,719.18000		4/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000\$ 71.515193747	-19,719.18	-1,410,221	0	425,668	425,668
-746,896.35000		4/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000\$ 71.515193747	-746,896.35	-53,414,437	0	16,584,289	16,584,289
-47,545.85000		4/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000\$ 71.515193747	-47,545.85	-3,400,251	0	1,155,792	1,155,792
-35,878.86000		5/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000\$ 71.515193747	-35,878.86	-2,565,884	0	830,060	830,060
-59,220.06000		5/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000\$ 71.515193747	-59,220.06	-4,235,134	0	1,386,541	1,386,541
-684,441.51000		5/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000\$ 71.515193747	-684,441.51	-48,947,967	0	16,513,561	16,513,561
-157,020.19000		5/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000\$ 71.515193747	-157,020.19	-11,229,329	0	3,788,436	3,788,436
-45,251.01000		5/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000\$ 71.515193747	-45,251.01	-3,236,135	0	1,128,381	1,128,381
-518,763.75000		5/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000\$ 71.515193747	-518,763.75	-37,099,490	0	12,424,595	12,424,595
-6,306.57000		5/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000\$ 71.515193747	-6,306.57	-451,016	0	150,844	150,844
-52,113.71000		5/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000\$ 71.515193747	-52,113.71	-3,726,922	0	1,225,685	1,225,685

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-393,354.22000		5/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000\$ 71.515193747	-393,354.22	-28,130,803	0	9,202,182	9,202,182
-245,742.67000		6/1/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000\$ 71.515193747	-245,742.67	-17,574,335	0	5,768,397	5,768,397
-5,170.70000		6/2/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000\$ 71.515193747	-5,170.70	-369,784	0	120,453	120,453
-78,821.02000		6/3/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000\$ 71.515193747	-78,821.02	-5,636,901	0	1,941,279	1,941,279
-113,860.14000		6/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000\$ 71.515193747	-113,860.14	-8,142,730	0	2,726,276	2,726,276
-666,844.90000		6/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000\$ 71.515193747	-666,844.90	-47,689,542	0	15,734,031	15,734,031
-110,710.67000		6/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000\$ 71.515193747	-110,710.67	-7,917,495	0	2,612,189	2,612,189
-54,834.71000		6/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000\$ 71.515193747	-54,834.71	-3,921,515	0	1,313,182	1,313,182
-83,284.46000		6/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000\$ 71.515193747	-83,284.46	-5,956,104	0	1,990,280	1,990,280
-479,833.36000		6/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000\$ 71.515193747	-479,833.36	-34,315,376	0	11,704,729	11,704,729
-17,695.85000		6/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000\$ 71.515193747	-17,695.85	-1,265,522	0	431,661	431,661
-470,587.90000		6/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000\$ 71.515193747	-470,587.90	-33,654,185	0	11,172,261	11,172,261
-156,011.32000		6/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000\$ 71.515193747	-156,011.32	-11,157,180	0	3,857,648	3,857,648
-49,769.29000		6/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000\$ 71.515193747	-49,769.29	-3,559,260	0	1,179,101	1,179,101
-106,347.76000		6/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000\$ 71.515193747	-106,347.76	-7,605,481	0	2,573,441	2,573,441

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-13,612.05000		6/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000\$ 71.515193747	-13,612.05	-973,468	0	327,912	327,912
-255,184.50000		6/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000\$ 71.515193747	-255,184.50	-18,249,569	0	5,926,308	5,926,308
-321,067.80000		6/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000\$ 71.515193747	-321,067.80	-22,961,226	0	7,175,246	7,175,246
-64,733.44000		7/1/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000\$ 71.515193747	-64,733.44	-4,629,425	0	1,458,739	1,458,739
-28,970.18000		7/6/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000\$ 71.515193747	-28,970.18	-2,071,808	0	600,938	600,938
-19,343.07000		7/8/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000\$ 71.515193747	-19,343.07	-1,383,323	0	372,050	372,050
-676,268.27000		7/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000\$ 71.515193747	-676,268.27	-48,363,456	0	12,577,881	12,577,881
-68,449.88000		7/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000\$ 71.515193747	-68,449.88	-4,895,206	0	1,273,096	1,273,096
-275,119.99000		7/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000\$ 71.515193747	-275,119.99	-19,675,259	0	5,367,852	5,367,852
-93,052.47000		7/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000\$ 71.515193747	-93,052.47	-6,654,665	0	1,871,327	1,871,327
-73,784.97000		7/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000\$ 71.515193747	-73,784.97	-5,276,746	0	1,483,849	1,483,849
-110,427.24000		7/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000\$ 71.515193747	-110,427.24	-7,897,225	0	2,275,017	2,275,017
-164,563.52000		7/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000\$ 71.515193747	-164,563.52	-11,768,792	0	3,293,148	3,293,148
-87,873.33000		7/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000\$ 71.515193747	-87,873.33	-6,284,278	0	1,626,634	1,626,634
-13,601.15000		7/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000\$ 71.515193747	-13,601.15	-972,689	0	249,247	249,247

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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-59,933.50000		8/5/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000\$ 71.515193747	-59,933.50	-4,286,156	0	1,223,979	1,223,979
-143,187.55000		8/6/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000\$ 71.515193747	-143,187.55	-10,240,085	0	2,904,902	2,904,902
-158,035.75000		8/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000\$ 71.515193747	-158,035.75	-11,301,957	0	3,227,215	3,227,215
-669,741.07000		8/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000\$ 71.515193747	-669,741.07	-47,896,662	0	13,764,764	13,764,764
-284,337.22000		8/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000\$ 71.515193747	-284,337.22	-20,334,431	0	5,843,803	5,843,803
-7,892,527.01000		8/12/2015		-7,892,527.01	-718,905,956	1.000000000\$ 71.515193747	-7,892,527.01	-564,435,598	0	154,470,358	154,470,358
-156,845.94000		8/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000\$ 71.515193747	-156,845.94	-11,216,868	0	3,103,491	3,103,491
-53,128.21000		8/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000\$ 71.515193747	-53,128.21	-3,799,474	0	1,063,645	1,063,645
-162,199.09000		8/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000\$ 71.515193747	-162,199.09	-11,599,699	0	3,265,673	3,265,673
-21,061.93000		8/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000\$ 71.515193747	-21,061.93	-1,506,248	0	414,913	414,913
-265,076.96000		8/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000\$ 71.515193747	-265,076.96	-18,957,030	0	5,169,044	5,169,044
-19,404.32000		8/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000\$ 71.515193747	-19,404.32	-1,387,704	0	-1,387,491	-1,387,491
-196,668.41000		8/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000\$ 71.515193747	-196,668.41	-14,064,779	0	2,736,110	2,736,110
-462,149.98000		8/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000\$ 71.515193747	-462,149.98	-33,050,745	0	6,708,867	6,708,867
-32,107.10000		8/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000\$ 71.515193747	-32,107.10	-2,296,145	0	422,678	422,678

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

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

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

保有有価証券残高明細  
東京海上ストラテジック・トラスト -  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-86,093.85000		9/1/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-72,142.91000		9/28/2015		-72,142.91	-6,115,979 71.515193747	1.000000000\$	-72,142.91	-5,159,314	0	956,665	956,665
-70,823.93000		9/30/2015		-70,823.93	-5,954,410 71.515193747	1.000000000\$	-70,823.93	-5,064,987	0	889,423	889,423
-198,025.63000		10/1/2015		-198,025.63	-16,654,940 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-39,456.54	-2,821,742	0	538,684	538,684
-17,998.66000		10/7/2015		-17,998.66	-1,543,637 71.515193747	1.000000000\$	-17,998.66	-1,287,178	0	256,459	256,459
-94,044.65000		10/8/2015		-94,044.65	-8,145,767 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-18,029.52	-1,289,385	0	266,980	266,980
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-13,046.14	-932,997	0	198,563	198,563
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340 71.515193747	1.000000000\$	-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 71.515193747	1.000000000\$	-52,217.18	-3,734,322	0	836,676	836,676
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268 71.515193747	1.000000000\$	-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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-6,155.13	-440,185	0	97,664	97,664
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-29,511.79000		12/3/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-17,213.36000		1/7/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-114,575.44000		2/22/2016		-114,575.44	-9,163,101 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 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 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 71.515193747		-27,289.30	-1,951,600	0	305,797	305,797
-10,054.65000		3/7/2016		-10,054.65	-847,732 71.515193747		-10,054.65	-719,060	0	128,672	128,672
-211,885.31000		3/9/2016		-211,885.31	-17,733,243 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-64,762.22000		4/5/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-3,319.09	-237,365	0	40,673	40,673
-83,104.57000		4/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-7,007.13	-501,116	0	89,089	89,089
-32,699.55000		4/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-102,314.26000		5/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-27,132.00	-1,940,350	0	120,198	120,198
-3,725.24000		7/7/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000\$ 71.515193747	-3,725.24	-266,411	0	15,145	15,145
-359,882.81000		7/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-11,042.19	-789,684	0	48,600	48,600
-123,264.71000		7/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-78,638.63	-5,623,857	0	630,756	630,756
-6,630.58000		7/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-105,691.38000		7/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-26,928.63	-1,925,806	0	222,215	222,215
-11,865.10000		7/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000\$ 71.515193747	-11,865.10	-848,535	0	85,928	85,928
-64,818.19000		8/2/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-146,047.78	-10,444,635	0	820,669	820,669
-12,365.22000		8/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000\$ 71.515193747	-12,365.22	-884,301	0	62,445	62,445
-25,656.87000		8/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-45,244.15000		8/24/2016		-45,244.15	-3,466,822 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 71.515193747		-108,096.46	-7,730,539	0	901,248	901,248
-6,022.62000		11/9/2016		-6,022.62	-486,973 71.515193747		-6,022.62	-430,709	0	56,264	56,264
-358,077.71000		11/14/2016		-358,077.71	-28,775,830 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 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 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-43,039.27000		11/18/2016		-43,039.27	-3,517,706	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-9,409.35	-672,911	0	134,749	134,749
-242,673.60000		12/14/2016		-242,673.60	-20,968,061	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-8,765.00	-626,831	0	137,218	137,218
-63,041.53000		12/19/2016		-63,041.53	-5,432,127	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-1,900.70000		12/30/2016		-1,900.70	-159,632	1.000000000\$ 71.515193747	-1,900.70	-135,929	0	23,703	23,703
-17,618.00000		1/4/2017		-17,618.00	-1,501,301	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-11,816.04	-845,026	0	171,080	171,080
-78,835.06000		1/18/2017		-78,835.06	-6,719,133	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-11,222.99	-802,614	0	153,924	153,924
-6,647.14000		1/18/2017		-6,647.14	-566,537	1.000000000\$ 71.515193747	-6,647.14	-475,372	0	91,165	91,165
-57,843.82000		1/20/2017		-57,843.82	-5,033,172	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-72,198.29000		1/27/2017		-72,198.29	-6,240,633 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 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 71.515193747		-17,013.34	-1,216,712	0	243,392	243,392
-10,224.17000		2/7/2017		-10,224.17	-877,520 71.515193747		-10,224.17	-731,183	0	146,337	146,337
-177,969.53000		2/9/2017		-177,969.53	-15,213,556 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 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 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 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 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 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 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 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 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 71.515193747		-11,158.43	-797,997	0	167,564	167,564
-334,340.29000		3/10/2017		-334,340.29	-28,791,636 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-189,359.17000		3/14/2017		-189,359.17	-16,457,305 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 71.515193747		-2,535.89	-181,355	0	26,670	26,670
-17,906.57000		4/24/2017		-17,906.57	-1,469,466 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 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-72,720.60000		4/26/2017		-72,720.60	-6,077,682	1.000000000\$ 71.515193747	-72,720.60	-5,200,628	0	877,054	877,054
-6,131.59000		4/26/2017		-6,131.59	-512,453	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-184,424.56000		6/6/2017		-184,424.56	-15,242,969	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-224,064.11000		7/18/2017		-224,064.11	-19,759,163	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-5,310.71	-379,796	0	88,531	88,531
-84,652.73000		7/19/2017		-84,652.73	-7,503,258	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-11,898.68	-850,936	0	195,985	195,985
-251,943.26000		8/8/2017		-251,943.26	-22,077,618	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-26,983.86	-1,929,756	0	430,274	430,274
-5,436.08000		8/10/2017		-5,436.08	-470,606	1.000000000\$ 71.515193747	-5,436.08	-388,762	0	81,844	81,844
-261,862.81000		8/14/2017		-261,862.81	-22,503,263	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-234,673.89000		8/16/2017		-234,673.89	-20,287,202	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-93,807.37000		9/15/2017		-93,807.37	-8,281,886	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-58,012.04	-4,148,742	0	973,488	973,488
-4,891.40000		10/16/2017		-4,891.40	-431,891	1.000000000\$ 71.515193747	-4,891.40	-349,809	0	82,082	82,082
-8,629.54000		10/19/2017		-8,629.54	-763,983	1.000000000\$ 71.515193747	-8,629.54	-617,143	0	146,840	146,840
-79,173.19000		10/20/2017		-79,173.19	-7,021,242	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<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>											
-1,778,714.81000		10/25/2017		-1,778,714.81	-157,587,713	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-13,390.76000		12/8/2017		-13,390.76	-1,135,904	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-104,867.61000		1/29/2018		-104,867.61	-9,216,108 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 71.515193747	-54,329.53	-3,885,387	0	688,764 688,764
-8,354.61000		2/23/2018		-8,354.61	-701,268 71.515193747		1,000000000\$ 71.515193747	-8,354.61	-597,482	0	103,786 103,786
-241,131.03000		3/9/2018		-241,131.03	-19,903,757 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 71.515193747	-11,810.63	-844,639	0	143,037 143,037
-71,875.05000		3/23/2018		-71,875.05	-5,825,270 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 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 71.515193747		1,000000000\$ 71.515193747	-50,297.76	-3,597,054	0	479,312 479,312
-1,535.28000		4/9/2018		-1,535.28	-126,334 71.515193747		1,000000000\$ 71.515193747	-1,535.28	-109,796	0	16,538 16,538
-88,985.26000		4/10/2018		-88,985.26	-7,326,140 71.515193747		1,000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-240,542.88000		4/11/2018		-240,542.88	-19,991,243	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-51,033.60	-3,649,678	0	607,072	607,072
-4,303.00000		4/17/2018		-4,303.00	-358,916	1.000000000\$ 71.515193747	-4,303.00	-307,730	0	51,186	51,186
-103,980.92000		4/18/2018		-103,980.92	-8,658,256	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-40,016.55	-2,861,791	0	440,565	440,565
-7,569.94000		6/4/2018		-7,569.94	-627,097	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-234,723.65000		6/8/2018		-234,723.65	-19,730,048	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-12,445.25	-890,024	0	143,323	143,323
-48,245.27000		7/13/2018		-48,245.27	-4,015,011	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-31,820.25	-2,275,631	0	372,476	372,476
-4,067.90000		7/13/2018		-4,067.90	-338,534	1.000000000\$ 71.515193747	-4,067.90	-290,917	0	47,617	47,617
-64,842.30000		7/19/2018		-64,842.30	-5,396,805	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-46,911.01000		8/7/2018		-46,911.01	-3,862,706	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-27,692.84	-1,980,459	0	246,510	246,510
-9,664.19000		8/22/2018		-9,664.19	-784,528	1.000000000\$ 71.515193747	-9,664.19	-691,136	0	93,392	93,392
-18,900.99000		8/30/2018		-18,900.99	-1,539,099	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-12,327.35	-881,593	0	126,320	126,320
-16,004.18000		9/27/2018		-16,004.18	-1,313,144	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-46,892.60000		10/12/2018		-46,892.60	-3,742,197	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-8,931.98000		12/3/2018		-8,931.98	-740,639	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-226,610.05000		2/12/2019		-226,610.05	-17,678,793	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-15,693.27	-1,122,307	0	114,773	114,773
-11,606.00000		3/15/2019		-11,606.00	-915,480	1.000000000\$ 71.515193747	-11,606.00	-830,005	0	85,475	85,475
-600,999.98000		3/26/2019		-600,999.98	-47,070,099	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-3,693.23000		4/18/2019		-3,693.23	-297,015	1.000000000\$ 71.515193747	-3,693.23	-264,122	0	32,893	32,893
-225,082.95000		5/14/2019		-225,082.95	-17,085,005	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-15,197.25	-1,086,834	0	48,115	48,115
-11,644.71000		7/8/2019		-11,644.71	-880,468	1.000000000\$ 71.515193747	-11,644.71	-832,774	0	47,694	47,694
-121,556.01000		7/11/2019		-121,556.01	-9,176,397	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 71.515193747	-44,689.00	-3,195,942	0	188,502	188,502
-3,768.04000		7/18/2019		-3,768.04	-285,366	1.000000000\$ 71.515193747	-3,768.04	-269,472	0	15,894	15,894
-29,373.95000		7/19/2019		-29,373.95	-2,230,106	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-232,223.94000		8/9/2019		-232,223.94	-16,768,953	1.000000000\$ 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 GBP	7/24/2019		385,126.86	51,789,646	1.000000000\$ 129.268688244	385,126.86	49,784,844	0	-2,004,802	-2,004,802
0.50		7/31/2019		0.50	66	1.000000000\$ 129.268688244	0.50	65	0	-1	-1
20.03		7/31/2019		20.03	2,663	1.000000000\$ 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 CAD	8/13/2014		50.00	4,670	1.000000000\$ 0.012518724	50.00	3,994	0	-676	-676
583,420.05000	EURO EUR	8/23/2019		583,420.05	68,825,213	1.000000000\$ 116.892181246	583,420.05	68,197,242	0	-627,971	-627,971
18,722.86000	UNITED STATES DOLLAR USD	8/8/2019		18,722.86	1,980,317	1.000000000\$ 0.009421075	18,722.86	1,987,338	0	7,021	7,021
60,856.63000		8/8/2019		60,856.63	6,436,806	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
320,000.00000		8/13/2019		320,000.00	33,697,601	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 0.009421075	21,239.15	2,254,430	0	0	0
48,875.00000		8/15/2019		48,875.00	5,187,837	1.000000000\$ 0.009421075	48,875.00	5,187,837	0	0	0
163,383.75000		8/15/2019		163,383.75	17,342,368	1.000000000\$ 0.009421075	163,383.75	17,342,368	0	0	0
15,904.69000		8/19/2019		15,904.69	1,692,021	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 0.009421075	6,742.15	715,646	0	1,619	1,619
730,000.00000		8/29/2019		730,000.00	77,310,648	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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	1.000000000\$ 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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>外貨建現金勘定</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-71,127.50000		8/8/2019		-71,127.50	-7,523,155	1.000000000\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 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\$ 0.009421075	-1,883.00	-199,871	0	452	452
-62,704.64000		8/22/2019		-62,704.64	-6,676,163	1.000000000\$ 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\$ 0.009421075	-34,665.37	-3,679,556	0	-5,893	-5,893
14,133,573.49000	合計 ----- 0.00000			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
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-1,333,616.57000 AUD FORWARD 17 OCT FAU17OCT		7/11/2019		-1,333,616.57	-101,107,330	1.000000000F 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	1.000000000F 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	1.000000000F 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)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-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	合計 ----- 0.00000			-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	合計 ----- 0.00000			-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)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
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)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<b>クラスに割当てられていない資産</b>											
<b>先物(ポジション)</b>											
<b>非グループ化の有価証券</b>											
-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	合計 -----			120,900,755	13,107,145,723		120,900,755	12,787,899,665	0	-319,246,058	-319,246,058
0.00000											
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
<b>証拠金勘定</b>											
<b>証拠金勘定</b>											
40,000.00 USD MARGIN USDMAR		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		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	合計 -----			2,380,000	252,383,202		2,380,000	252,625,100	0	241,898	241,898
0.00000											
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。

[次へ](#)

## 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( )管理会社の行為に關係し、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關連して、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。

[次へ](#)

## 5 管理会社の経理の概況

- a . 管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . 管理会社の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c . 管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、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		326,675,533
030	中央銀行における現金残高	3,027,015,686	176,634,941
040	その他の要求払預金	1,636,721,097	2,012,154
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	
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、合弁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のない項目	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、合弁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、合弁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、合弁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

		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、合弁会社および 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、合弁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、合弁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

[次へ](#)

## (2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

## 第一部 証券情報

### (5) 申込手数料

<訂正前>

受益証券の取得申込みにあたっては、発行価格の最大3.24%  
(注) (税抜3%)の申込手数料を課すことができる。ただし、税率が変更された場合、変更後の税率が申込手数料に課されるものとする。なお、申込手数料に関する照会先は、後記「(8) 申込取扱場所」に同じ。

(注) 手数料率は、手数料率(税抜)にかかる消費税および地方消費税に相当する料率(8%)を加算した料率を表記している。手数料率は、消費税率に応じて変更となることがある。消費税率が10%となった場合には、3.30%となる。

<訂正後>

受益証券の取得申込みにあたっては、発行価格の最大3.30%  
(税抜3%)の申込手数料を課すことができる。ただし、税率が変更された場合、変更後の税率が申込手数料に課されるものとする。なお、申込手数料に関する照会先は、後記「(8) 申込取扱場所」に同じ。

## 第二部 ファンド情報

### 第1 ファンドの状況

#### 1 ファンドの性格

##### (3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

( ) 資本金の額(2019年6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(一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

( ) 会社の沿革

(後略)

<訂正後>

(前略)

( ) 資本金の額(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(一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(注)米ドルの円貨換算は、便宜上、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)による。

( )会社の沿革

(後略)

#### 4 手数料等及び税金

(1)申込手数料

日本国内における申込手数料

<訂正前>

受益証券の取得申込みにあたっては、発行価格の最大3.24%(注2)（税抜3%）の申込手数料を課すことができる。ただし、税率が変更された場合、変更後の税率が申込手数料に課されるものとする。

(中略)

(注1)上記申込手数料に関わる「税」とは、消費税および地方税を示す。

(注2)手数料率は、手数料率（税抜）にかかる消費税および地方消費税に相当する料率（8%）を加算した料率を表記している。手数料率は、消費税率に応じて変更となることがある。消費税率が10%となった場合には、3.30%となる。

<訂正後>

受益証券の取得申込みにあたっては、発行価格の最大3.30%（税抜3%）の申込手数料を課すことができる。ただし、税率が変更された場合、変更後の税率が申込手数料に課されるものとする。

(中略)

(注)上記申込手数料に関わる「税」とは、消費税および地方税を示す。

(5)課税上の取扱い

<訂正前>

(前略)

(A)日本

2019年7月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

<訂正後>

(前略)

(A)日本

2019年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

## 5 運用状況

### (2) 投資資産

&lt;訂正前&gt;

#### 投資有価証券の主要銘柄

(2019年6月末日現在)

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
1	Prudential Financial Inc	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	9,000,000	93.99	845,881,683	114.10	1,026,918,396	2.92
2	Citigroup Inc	米国	社債	4.600	2026/3/9	8,450,000	113.37	957,935,011	116.64	985,620,491	2.81
3	BNP Paribas SA	フランス	社債	4.375	2025/9/28	7,650,000	114.43	875,368,671	113.35	867,144,135	2.47
4	Wells Fargo Capital X	米国	社債	5.950	2036/12/15	6,410,000	79.66	510,608,458	127.00	814,060,533	2.32
5	Toronto-Dominion Bank	カナダ	社債	3.625 (2026年9月以降変動金利)	2031/9/15	7,400,000	102.54	758,789,022	109.79	812,464,086	2.31
6	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	6,910,000	115.34	796,992,374	116.16	802,694,547	2.29
7	ING Bank NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	6,670,000	111.72	745,141,972	119.22	795,216,905	2.26
8	Bank of Ireland Group PLC	アイルランド	社債	1.375	2023/8/29	5,800,000	127.94	742,053,230	125.53	728,051,351	2.07
9	Credit Agricole SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	6,400,000	121.42	777,075,880	113.13	724,040,355	2.06
10	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年3月以降変動金利)	永久債	4,700,000	181.91	854,967,509	151.91	713,973,100	2.03
11	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	6,240,000	110.91	692,056,012	113.28	706,880,559	2.01
12	Landesbank Baden-Wuerttemberg	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	4,980,000	139.33	693,886,457	139.89	696,657,904	1.98
13	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	134.90	694,719,260	1.98
14	Bank of Montreal	カナダ	社債	3.803 (2027年12月以降変動金利)	2032/12/15	6,350,000	112.73	715,867,225	109.04	692,434,024	1.97
15	DBS Group Holdings Ltd	シンガポール	社債	1.500 (2023年4月以降変動金利)	2028/4/11	5,500,000	130.66	718,652,173	124.56	685,102,967	1.95
16	Morgan Stanley	米国	社債	3.950	2027/4/23	6,010,000	110.46	663,862,835	112.79	677,866,507	1.93
17	AIB Group PLC	アイルランド	社債	1.500	2023/3/29	5,300,000	125.18	663,473,054	126.22	668,942,903	1.90
18	Standard Chartered PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	111.13	661,226,948	1.88
19	Royal Bank of Scotland Group PLC	英国	社債	4.892 (2028年5月以降変動金利)	2029/5/18	5,500,000	110.32	606,759,968	115.02	632,604,000	1.80
20	Zurich Finance UK PLC	英国	社債	6.625 (2022年10月以降変動金利)	永久債	4,070,000	169.11	688,268,590	154.43	628,511,109	1.79

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
21	Bank of America Corp	米国	社債	3.950	2025/4/21	5,320,000	115.63	615,146,786	113.02	601,262,463	1.71
22	JPMorgan Chase & Co	米国	社債	4.203 (2028年7月以降変動金利)	2029/7/23	5,100,000	112.39	573,188,984	117.89	601,239,923	1.71
23	Digital Realty Trust LP	米国	社債	4.450	2028/7/15	5,100,000	110.10	561,519,214	116.75	595,431,988	1.70
24	Cooperatieve Rabobank UA	オランダ	社債	5.500 (2020年6月以降変動金利)	永久債	4,600,000	137.11	630,708,708	128.00	588,820,817	1.68
25	Discover Bank	米国	社債	4.682 (2023年8月以降変動金利)	2028/8/9	5,250,000	111.19	583,763,733	111.54	585,590,593	1.67
26	Santander UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	4,800,000	100.22	481,041,369	114.03	547,364,026	1.56
27	BAWAG Group AG	オーストリア	社債	2.375 (2024年3月以降変動金利)	2029/3/26	4,000,000	126.25	504,988,434	125.03	500,102,023	1.42
28	Fukoku Mutual Life Insurance Co	日本	社債	5.000 (2025年7月以降変動金利)	永久債	4,300,000	124.04	533,393,470	114.58	492,686,502	1.40
29	DNB Bank ASA	ノルウェー	社債	1.250 (2022年3月以降変動金利)	2027/3/1	3,900,000	119.95	467,819,516	124.78	486,637,653	1.39
30	Bank of New York Mellon Corp	米国	社債	3.000	2028/10/30	4,350,000	104.18	453,184,215	108.98	474,058,694	1.35

### 投資不動産物件

該当事項なし。(2019年6月末日現在)

### その他投資資産の主要なものの

該当事項なし。(2019年6月末日現在)

&lt;訂正後&gt;

## 投資有価証券の主要銘柄

(2019年9月末日現在)

	銘柄	地域	種類	利率(%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資比率(%)
							単価	金額	単価	金額	
1	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	9,000,000	93.99	845,881,683	116.20	1,045,839,608	2.78
2	CITIGROUP INC	米国	社債	4.600	2026/3/9	8,450,000	113.37	957,935,011	118.06	997,625,622	2.65
3	BNP PARIBAS SA	フランス	社債	4.375	2025/9/28	7,650,000	114.43	875,368,671	114.90	878,992,765	2.34
4	WELLS FARGO CAPITAL X	米国	社債	5.950	2036/12/15	6,410,000	79.66	510,608,458	133.03	852,712,229	2.27
5	TORONTO-DOMINION BANK	カナダ	社債	3.625 (2026年9月以降変動金利)	2031/9/15	7,400,000	102.54	758,789,022	112.12	829,697,825	2.21
6	DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD	日本	社債	5.100 (2024年10月以降変動金利)	永久債	6,910,000	115.34	796,992,374	117.08	809,051,313	2.15
7	ING BANK NV	オランダ	社債	5.800	2023/9/25	6,670,000	111.72	745,141,972	120.03	800,580,144	2.13
8	CREDIT AGRICOLE SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	6,400,000	121.42	777,075,880	115.02	736,155,001	1.96
9	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	6,240,000	110.91	692,056,012	114.94	717,238,564	1.91
10	BANK OF MONTREAL	カナダ	社債	3.803 (2027年12月以降変動金利)	2032/12/15	6,350,000	112.73	715,867,225	112.07	711,620,413	1.89
11	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	137.93	710,343,177	1.89
12	AXA SA	フランス	社債	5.453 (2026年3月以降変動金利)	永久債	4,700,000	181.91	854,967,509	149.69	703,555,147	1.87
13	MORGAN STANLEY	米国	社債	3.950	2027/4/23	6,010,000	110.46	663,862,835	114.63	688,924,782	1.83
14	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	4,980,000	139.33	693,886,457	136.62	680,348,617	1.81
15	STANDARD CHARTERED PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	112.55	669,655,484	1.78
16	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	社債	1.500 (2023年4月以降変動金利)	2028/4/11	5,500,000	130.66	718,652,173	120.39	662,162,008	1.76
17	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	英国	社債	4.892 (2028年5月以降変動金利)	2029/5/18	5,500,000	110.32	606,759,968	118.86	653,705,115	1.74
18	AIB GROUP PLC	アイルランド	社債	1.250	2024/5/28	5,300,000	120.57	638,997,804	120.47	638,508,030	1.70
19	JPMORGAN CHASE & CO	米国	社債	4.203 (2028年7月以降変動金利)	2029/7/23	5,100,000	112.39	573,188,984	119.93	611,663,732	1.63
20	ZURICH FINANCE UK PLC	英国	社債	6.625 (2022年10月以降変動金利)	永久債	4,070,000	169.11	688,268,590	149.90	610,105,235	1.62
21	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	3.950	2025/4/21	5,320,000	115.63	615,146,786	114.55	609,416,250	1.62

	銘柄	地域	種類	利率 (%)	満期日	数量	取得価格(円)		時価(円)		投資 比率 (%)
							単価	金額	単価	金額	
22	DIGITAL REALTY TRUST LP	米国	社債	4.450	2028/7/15	5,100,000	110.10	561,519,214	119.28	608,318,042	1.62
23	DISCOVER BANK	米国	社債	4.682 (2023年8月以降変動金利)	2028/8/9	5,250,000	111.19	583,763,733	112.57	590,972,912	1.57
24	COOPERATIVE RABOBANK UA	オランダ	社債	5.5% (2020年6月以降変動金利)	永久債	4,600,000	137.11	630,708,708	121.61	559,401,523	1.49
25	SANTANDER UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	4,800,000	100.22	481,041,369	114.95	551,773,859	1.47
26	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	日本	社債	3.202	2029/9/17	5,000,000	107.28	536,424,972	109.04	545,222,162	1.45
27	BRANCH BANKING & TRUST CO	米国	社債	2.636 (2024年9月以降変動金利)	2029/9/17	5,000,000	107.16	535,800,014	107.27	536,338,371	1.43
28	FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO	日本	社債	5.000 (2025年7月以降変動金利)	永久債	4,300,000	124.04	533,393,470	116.33	500,222,634	1.33
29	BAWAG GROUP AG	オーストリア	社債	2.375 (2024年3月以降変動金利)	2029/3/26	4,000,000	126.25	504,988,434	122.05	488,198,747	1.30
30	BANK OF AMERICA CORP	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	165.25	487,490,449	1.30

### 投資不動産物件

該当事項なし。(2019年9月末日現在)

### その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2019年9月末日現在)

## 第2 管理及び運営

### 1 申込(販売)手続等

#### (2) 日本における販売

<訂正前>

(前略)

受益証券の取得申込みにあたっては、発行価格の最大3.24%(注)(税抜3%)の申込手数料を課すことができる。ただし、税率が変更された場合、変更後の税率が申込手数料に課されるものとする。

(注)手数料率は、手数料率(税抜)にかかる消費税および地方消費税に相当する料率(8%)を加算した料率を表記している。手数料率は、消費税率に応じて変更となることがある。消費税率が10%となった場合には、3.30%となる。

ただし、管理会社、日本における販売会社が別途合意する場合にはそれに従うものとし、上記と異なる取扱いとすることができる。

(後略)

<訂正後>

(前略)

受益証券の取得申込みにあたっては、発行価格の最大3.30%(税抜3%)の申込手数料を課すことができる。ただし、税率が変更された場合、変更後の税率が申込手数料に課されるものとする。

ただし、管理会社、日本における販売会社が別途合意する場合にはそれに従うものとし、上記と異なる取扱いとすることができます。

(後略)