

【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2年11月30日

【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)

【代表者の役職氏名】 デュプティ・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 小林 央明

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アールン通
り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦
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2,154億8,000万円)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1,477億6,000万円)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、2020年6月30
日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ド
ル=107.74円および1豪ドル=73.88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、2020年8月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するため、また、その他一部情報の時点等を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

２【訂正の内容】

（１）半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

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

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 第15 ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第31 ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第11 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
	2 事業の内容及び営業の概況		(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
3 管理会社の経理状況		5 管理会社の経理の概況		追加

＊ 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

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

（１）投資状況

資産別および地域別の投資状況

（2020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	10,503,858,704	28.28
	英国	5,420,177,778	14.60
	フランス	4,206,197,108	11.33
	オランダ	2,719,582,591	7.32
	日本	1,926,360,146	5.19
	オーストリア	1,284,918,563	3.46
	オーストラリア	1,201,665,414	3.24
	ドイツ	1,134,476,311	3.05
	ベルギー	1,122,721,374	3.02
	アイルランド	1,028,295,370	2.77
	ケイマン諸島	952,226,515	2.56
	シンガポール	882,017,581	2.38
	スイス	577,147,138	1.55
	メキシコ	570,198,761	1.54
	中国	557,705,770	1.50
	カナダ	508,578,438	1.37
	スペイン	495,615,535	1.33
	ジャージー	414,639,937	1.12
	デンマーク	290,315,065	0.78
	イタリア	247,705,063	0.67
	ノルウェー	215,228,441	0.58
	ルクセンブルグ	194,928,910	0.52
	フィンランド	194,453,370	0.52
	英領ヴァージン諸島	139,043,797	0.37
	ペルー	100,558,276	0.27
小計		36,888,615,956	99.33
現金・その他の資産 （負債控除後）		248,328,837	0.67
合計（純資産総額）		37,136,944,793	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、2020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＝105.80円および１豪ドル＝75.49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

2020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
2019年10月末日	107,957,022.75	11,421,853	0.009431	0.9978
11月末日	109,218,158.20	11,555,281	0.009391	0.9936
12月末日	110,390,518.49	11,679,317	0.009385	0.9929
2020年１月末日	111,266,890.66	11,772,037	0.009487	1.0037
２月末日	118,285,726.45	12,514,630	0.009432	0.9979
３月末日	116,838,649.01	12,361,529	0.008545	0.9041
４月末日	122,781,766.62	12,990,311	0.008916	0.9433
５月末日	123,420,995.74	13,057,941	0.008967	0.9487
６月末日	122,816,673.69	12,994,004	0.009096	0.9624
７月末日	127,359,732.06	13,474,660	0.009250	0.9787
８月末日	130,123,992.59	13,767,118	0.009224	0.9759
９月末日	130,107,652.78	13,765,390	0.009143	0.9673

< 豪ドル建 豪ドルヘッジクラス >

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2019年10月末日	31,320,075.27	2,364,352	0.008133	0.6140
11月末日	31,349,928.64	2,366,606	0.008093	0.6109
12月末日	30,739,346.61	2,320,513	0.008077	0.6097
2020年1月末日	31,236,082.33	2,358,012	0.008164	0.6163
2月末日	31,273,148.44	2,360,810	0.008135	0.6141
3月末日	27,989,122.93	2,112,899	0.007345	0.5545
4月末日	29,184,599.61	2,203,145	0.007639	0.5767
5月末日	29,379,144.42	2,217,832	0.007683	0.5800
6月末日	28,876,797.74	2,179,909	0.007785	0.5877
7月末日	29,161,860.87	2,201,429	0.007909	0.5971
8月末日	28,609,080.83	2,159,700	0.007888	0.5955
9月末日	28,089,740.14	2,120,494	0.007820	0.5903

< 参考情報 >

純資産総額および1口当たりの純資産価格の推移（2012年12月13日～2020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

2020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
2019年10月１日～2020年９月末日	0.000720	0.076176

<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
2019年10月１日～2020年９月末日	0.000624	0.047106

<参考情報>

分配の推移（2020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
第8会計年度(2019年３月１日～2020年２月29日)	0.000630
2020年5月	0.000060
2020年6月	0.000060
2020年7月	0.000060
2020年8月	0.000060
2020年9月	0.000060
直近1年間累計	0.000720
設定来累計	0.004335

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
第8会計年度(2019年３月１日～2020年２月29日)	0.000672
2020年5月	0.000052
2020年6月	0.000052
2020年7月	0.000052
2020年8月	0.000052
2020年9月	0.000052
直近1年間累計	0.000624
設定来累計	0.006056

収益率の推移

2020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）
2019年10月１日～2020年９月末日	4.65%

（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）
2019年10月１日～2020年９月末日	3.79%

（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、2020年については2020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。2020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

2020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2020年９月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

<米ドル建 米ドルヘッジクラス>

計算期間	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年10月１日～ 2020年９月末日	3,776,022,145 (3,776,022,145)	973,963,678 (973,963,678)	14,230,239,176 (14,230,239,176)

<豪ドル建 豪ドルヘッジクラス>

計算期間	販売口数	買戻口数	発行済口数
2019年10月１日～ 2020年９月末日	308,292,732 (308,292,732)	672,262,967 (672,262,967)	3,592,037,953 (3,592,037,953)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

３ ファンドの経理状況

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

[次へ](#)

(１) 資産及び負債の状況

貸借対照表

東京海上ストラテジック・トラスト -

東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド

2020年 8 月末日現在

	円
資産	
現金	148,359,611
銀行預金 - 基準通貨	53,148,488
銀行預金 - 外国通貨	95,211,123
ブローカーが保有する現金	65,857,499
ブローカーが保有する現金 - 米ドル	65,857,499
有価証券（取得原価）	35,829,977,885
債券（取得原価）	35,829,977,885
未実現評価損益	1,550,345,227
未実現時価評価損益	2,388,912,253
未実現通貨運用損益	(833,263,511)
未決済取引にかかる未実現為替差損益	(7,765,721)
未実現通貨繰延損益	2,462,206
未収収益	405,282,309
期日経過の未収利息	(2)
現金に係る未収利息	118,420
債券に係る未収利息	405,163,891
投資有価証券売却未収金	832,568,552
投資有価証券売却未収金	832,568,552
資本証券	406,463,664
受益証券販売未収金	406,463,664
資産合計：	39,238,854,747

2020年８月末日現在

		円
負債		
投資有価証券購入未払金		1,048,355,765
投資有価証券購入未払金		1,048,355,765
資本証券		60,549,759
受益証券買戻未払金		60,549,759
未払費用		66,553,014
未払監査費用		1,290,311
未払報告費用		297,165
未払投資顧問報酬		38,939,232
未払投資顧問報酬 - 豪ドル	(17,829,897)	
未払受託報酬		611,616
未払管理報酬		7,687,358
未払代行協会員報酬		1,258,931
未払代行協会員報酬 - 豪ドル	(819,958)	
未払販売報酬		14,930,924
未払販売報酬 - 豪ドル	(9,724,707)	
未払副管理報酬		1,537,477
負債合計：		1,175,458,538
資本		
ファンド受益証券		52,613,663,977
発行済ファンド受益証券（額面価額）		71,705,429,391,372
米ドル建 米ドルヘッジ	41,095,694,741,469	
ブラジル・レアル	6,177,869,115	
米ドル	3,269,601,315	
豪ドル	2,062,817,268	
ユーロ	20,720,097	
日本円	11,289,469,914	
資源国通貨バスケット	67,335,230	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	30,565,294,420,662	
メキシコ・ペソ	1,110,145,416	
トルコ・リラ	19,178,775,301	
ロシア・ルーブル	1,263,495,585	

2020年８月末日現在

円

受益証券額面超過額	(71,652,815,727,395)
-----------	----------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(41,086,558,587,512)
-------------	----------------------

ブラジル・レアル	5,730,641,885
----------	---------------

米ドル	(43,376,315)
-----	--------------

豪ドル	(742,769,268)
-----	---------------

ユーロ	(1,148,097)
-----	-------------

日本円	3,750,086,086
-----	---------------

資源国通貨バスケット	59,315,770
------------	------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(30,561,142,949,142)
-------------	----------------------

メキシコ・ペソ	(151,056,916)
---------	---------------

トルコ・リラ	(13,620,026,801)
--------	------------------

ロシア・ルーブル	(95,857,085)
----------	--------------

分配金支払額	(57,931,427,575)
--------	------------------

配当金支払額	(57,931,427,575)
--------	------------------

米ドル建 米ドルヘッジ	(8,326,464,249)
-------------	-----------------

ブラジル・レアル	(16,417,952,505)
----------	------------------

米ドル	(2,917,080,382)
-----	-----------------

豪ドル	(4,442,706,603)
-----	-----------------

ユーロ	(19,397,393)
-----	--------------

日本円	(18,635,660,465)
-----	------------------

資源国通貨バスケット	(304,924,325)
------------	---------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(3,380,297,501)
-------------	-----------------

メキシコ・ペソ	(480,076,125)
---------	---------------

トルコ・リラ	(1,972,907,741)
--------	-----------------

ロシア・ルーブル	(1,033,960,286)
----------	-----------------

2020年 8 月末日現在

		円
利益剰余金		43,683,848,842
利益剰余金		43,683,848,842
米ドル建 米ドルヘッジ	35,502,882,596	
ブラジル・リアル	29,649,738,116	
米ドル	12,004,736,374	
豪ドル	16,537,697,452	
ユーロ	64,695,937	
日本円	40,987,305,810	
資源国通貨バスケット	692,041,947	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	5,601,211,208	
メキシコ・ペソ	459,547,592	
トルコ・リラ	(231,234,899)	
ロシア・ルーブル	2,080,134,486	
中間純利益		(302,689,035)
資本合計：		38,063,396,209
負債および資本合計		39,238,854,747
純資産額合計		38,063,396,209
発行済受益証券総数		17,738,152,446.92410口
受益証券 1 口当たり純資産額合計		2.145849

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

2020年３月１日から2020年８月末日までの期間

円

収益

実現損益	(727,696,117)
------	---------------

為替取引に係る実現利益	7,249,241,072
-------------	---------------

ブラジル・レアル	709,141,777
----------	-------------

豪ドル	550,333,722
-----	-------------

ユーロ	5,065,040
-----	-----------

日本円	859,128,492
-----	-------------

資源国通貨バスケット	23,861,122
------------	------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	714,857,113
-------------	-------------

メキシコ・ペソ	202,988,517
---------	-------------

トルコ・リラ	929,940,831
--------	-------------

ロシア・ルーブル	209,026,047
----------	-------------

為替取引に係る実現損失	(7,959,043,503)
-------------	-----------------

ブラジル・レアル	(1,148,203,466)
----------	-----------------

豪ドル	(526,150,310)
-----	---------------

ユーロ	(3,884,907)
-----	-------------

日本円	(550,916,321)
-----	---------------

資源国通貨バスケット	(32,371,870)
------------	--------------

豪ドル建 豪ドルヘッジ	(670,853,005)
-------------	---------------

メキシコ・ペソ	(301,646,544)
---------	---------------

トルコ・リラ	(1,424,970,081)
--------	-----------------

ロシア・ルーブル	(301,042,147)
----------	---------------

市場に係る実現利益	533,977,920
-----------	-------------

市場に係る実現損失	(198,789,037)
-----------	---------------

2020年３月１日から2020年８月末日までの期間

円

通貨に係る実現利益		547,362,012
米ドル建 米ドルヘッジ	7,615,954	
ブラジル・レアル	1	
豪ドル	2	
ユーロ	3	
日本円	1	
資源国通貨バスケット	6	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	2,720,061	
メキシコ・ペソ	2	
トルコ・リラ	2	
ロシア・ルーブル	2	
通貨に係る実現損失		(900,924,804)
米ドル建 米ドルヘッジ	(48,278,248)	
豪ドル	(1)	
ユーロ	(1)	
日本円	(1)	
資源国通貨バスケット	(6)	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	(1,498,315)	
メキシコ・ペソ	(3)	
ロシア・ルーブル	(1)	
その他の利益		480,223
受取利息		652,893,777
現金に係る受取利息		790,237
債券に係る受取利息		652,103,540
未実現評価損益		(29,247,441)
未実現時価評価損益		(137,745,141)

2020年３月１日から2020年８月末日までの期間

円

未実現通貨運用損益		103,337,721
ブラジル・レアル	122,855,907	
豪ドル	172,012,868	
ユーロ	700,395	
日本円	(126,572,901)	
資源国通貨バスケット	5,679,281	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	217,804,747	
メキシコ・ペソ	50,611,004	
トルコ・リラ	153,316,771	
ロシア・ルーブル	47,607,320	
未決済取引にかかる未実現為替差損益		(4,140,469)
米ドル建 米ドルヘッジ	11,004,864	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	158,319	
未実現通貨繰延損益		9,300,448
収益合計：		(104,049,781)

2020年３月１日から2020年８月末日までの期間

円

費用		
費用 - 報酬		196,884,222
監査費用		960,511
報告費用		112,053
投資顧問報酬		116,707,988
米ドル建 米ドルヘッジ	51,977,421	
ブラジル・レアル	4,069,644	
米ドル	11,581,059	
豪ドル	4,034,213	
ユーロ	64,041	
日本円	25,062,922	
資源国通貨バスケット	158,175	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	8,239,849	
メキシコ・ペソ	1,360,168	
トルコ・リラ	8,878,023	
ロシア・ルーブル	1,282,473	
受託報酬		1,820,746
現金支出費用		404,063
未払管理報酬		23,102,669
代行協会員報酬		3,755,171
米ドル建 米ドルヘッジ	3,241,384	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	513,787	
販売報酬		44,536,443
米ドル建 米ドルヘッジ	38,442,947	
豪ドル建 豪ドルヘッジ	6,093,496	
副保管報酬		864,049
副管理報酬		4,620,529
源泉徴収税費用		1,518,898
源泉徴収税		1,518,898
支払利息		236,134
当座借越利息		6,735
支払利息		229,399
費用合計：		198,639,254
投資純利益		(302,689,035)

[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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
豪ドルクラス受益証券											
先物 (ポジション)											
非グループ化の有価証券											
28,556,908.86000	AUD FORWARD 14 SEP	08/04/2020		28,556,908.86	2,163,053,804	1.0000000000F	28,556,908.86	2,209,139,747	0	46,085,943	46,085,943
	FAU14SEP		AUD			77.359204314					
-20,398,200.00000	USD FORWARD 14 SEP	08/04/2020		-20,398,200.00	-2,163,053,804	1.0000000000F	-20,398,200.00	-2,147,562,570	0	15,491,234	15,491,234
	FUS14SEP		AUD			0.009498303					
8,158,708.86000	非グループ化の有価証券小計			8,158,709	0		8,158,709	61,577,177	0	61,577,177	61,577,177
8,158,708.86000	先物 (ポジション) 合計			8,158,709	0		8,158,709	61,577,177	0	61,577,177	61,577,177
8,158,708.86000	豪ドルクラス受益証券合計			8,158,709	0		8,158,709	61,577,177	0	61,577,177	61,577,177

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

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

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
21,506,789.86000	AUD FORWARD 14 SEP FAU14SEP	08/04/2020	AUH	21,506,789.86	1,629,039,888	1.0000000000F 77.359204314	21,506,789.86	1,663,748,151	0	34,708,263	34,708,263
-15,362,300.00000	USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP	08/04/2020	AUH	-15,362,300.00	-1,629,039,889	1.0000000000F 0.009498303	-15,362,300.00	-1,617,373,124	0	11,666,765	11,666,765
6,144,489.86000	非グループ化の有価証券小計			6,144,490	-1		6,144,490	46,375,027	0	46,375,028	46,375,028
6,144,489.86000	先物（ポジション）合計			6,144,490	-1		6,144,490	46,375,027	0	46,375,028	46,375,028
6,144,489.86000	豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計			6,144,490	-1		6,144,490	46,375,027	0	46,375,028	46,375,028

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

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

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
275,094.50000	AUD FORWARD 14 SEP FAU14SEP	08/04/2020		275,094.50	20,837,136	1.000000000F 77.359204314	275,094.50	21,281,092	0	443,956	443,956
-130,200.00000		08/21/2020	BKH	-130,200.00	-9,868,427	1.000000000F 77.359204314	-130,200.00	-10,072,168	0	-203,741	-203,741
144,894.50000	合計 -----			144,895	10,968,709		144,895	11,208,924	0	240,215	240,215
0.00000											
1,046,755.50000	BRL FORWARD 14 SEP FBR14SEP	08/04/2020		1,046,755.50	20,842,599	1.000000000F 0.051833877	1,046,755.50	20,194,428	0	-648,171	-648,171
-520,800.00000		08/21/2020	BKH	-520,800.00	-9,819,620	1.000000000F 0.051833877	-520,800.00	-10,047,483	0	-227,863	-227,863
525,955.50000	合計 -----			525,956	11,022,979		525,956	10,146,945	0	-876,034	-876,034
0.00000											
92,677.28000	USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP	08/21/2020		92,677.28	9,819,620	1.000000000F 0.009498303	92,677.28	9,757,246	0	-62,374	-62,374
93,137.92000		08/21/2020	BKH	93,137.92	9,868,427	1.000000000F 0.009498303	93,137.92	9,805,743	0	-62,684	-62,684
94,107.80000		08/21/2020	BKH	94,107.80	9,971,191	1.000000000F 0.009498303	94,107.80	9,907,854	0	-63,337	-63,337
-196,500.00000		08/04/2020	BKH	-196,500.00	-20,700,282	1.000000000F 0.009498303	-196,500.00	-20,687,906	0	12,376	12,376
-196,500.00000		08/04/2020	BKH	-196,500.00	-20,842,598	1.000000000F 0.009498303	-196,500.00	-20,687,906	0	154,692	154,692
-196,500.00000		08/04/2020	BKH	-196,500.00	-20,837,136	1.000000000F 0.009498303	-196,500.00	-20,687,906	0	149,230	149,230
-309,577.00000	合計 -----			-309,577	-32,720,778		-309,577	-32,592,875	0	127,903	127,903
0.00000											

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

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

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

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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>資源国通貨バスケットクラス受益証券</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
3,402,888.75000	ZAR FORWARD 14 SEP	08/04/2020		3,402,888.75	20,700,282	1.000000000F	3,402,888.75	21,492,438	0	792,156	792,156
	FZA14SEP		BKH			0.158329583					
-1,617,300.00000		08/21/2020		-1,617,300.00	-9,971,191	1.000000000F	-1,617,300.00	-10,214,768	0	-243,577	-243,577
			BKH			0.158329583					
1,785,588.75000	合計 -----			1,785,589	10,729,091		1,785,589	11,277,670	0	548,579	548,579
0.00000											
2,146,861.75000	非グループ化の有価証券小計			2,146,862	1		2,146,862	40,664	0	40,663	40,663
2,146,861.75000	先物（ポジション）合計			2,146,862	1		2,146,862	40,664	0	40,663	40,663
2,146,861.75000	資源国通貨バスケットクラス受益証券合計			2,146,862	1		2,146,862	40,664	0	40,663	40,663

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>ブラジル・リアルクラス受益証券</u>											
<u>先物 (ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
76,806,816.80000	BRL FORWARD 14 SEP FBR14SEP	08/04/2020	BRH	76,806,816.80	1,529,348,205	1.0000000000 ^F 0.051833877	76,806,816.80	1,481,787,997	0	-47,560,208	-47,560,208
-14,418,400.00000	USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP	08/04/2020		-14,418,400.00	-1,529,348,203	1.0000000000 ^F 0.009498303	-14,418,400.00	-1,517,997,478	0	11,350,725	11,350,725
62,388,416.80000	非グループ化の有価証券小計			62,388,417	2		62,388,417	-36,209,481	0	-36,209,483	-36,209,483
62,388,416.80000	先物 (ポジション) 合計			62,388,417	2		62,388,417	-36,209,481	0	-36,209,483	-36,209,483
62,388,416.80000	ブラジル・リアルクラス受益証券合計			62,388,417	2		62,388,417	-36,209,481	0	-36,209,483	-36,209,483

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

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

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

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 2020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)
ユーロクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
212,587.41000	EUR FORWARD 14 SEP FEU14SEP	08/04/2020	EUH	212,587.41	26,476,410	1.000000000F 125.311901322	212,587.41	26,639,733	0	163,323	163,323
-24,400.00000		08/26/2020		-24,400.00	-3,061,490	1.000000000F 125.311901322	-24,400.00	-3,057,610	0	3,880	3,880
188,187.41000	合計 -----		EUH	188,187	23,414,920		188,187	23,582,123	0	167,203	167,203
0.00000											
28,842.51000	USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP	08/26/2020	EUH	28,842.51	3,061,490	1.000000000F 0.009498303	28,842.51	3,036,596	0	-24,894	-24,894
-250,800.00000		08/04/2020		-250,800.00	-26,476,410	1.000000000F 0.009498303	-250,800.00	-26,404,717	0	71,693	71,693
-221,957.49000	合計 -----		EUH	-221,957	-23,414,920		-221,957	-23,368,121	0	46,799	46,799
0.00000											
-33,770.08000	非グループ化の有価証券小計			-33,770	0		-33,770	214,002	0	214,002	214,002
-33,770.08000	先物（ポジション）合計			-33,770	0		-33,770	214,002	0	214,002	214,002
-33,770.08000	ユーロクラス受益証券合計			-33,770	0		-33,770	214,002	0	214,002	214,002

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 2020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)
日本円クラス受益証券											
先物 (ポジション)											
非グループ化の有価証券											
-94,493,000.00000	USD FORWARD 14 SEP	08/04/2020		-94,493,000.00	-10,007,376,353	1.0000000000 ^F	-94,493,000.00	-9,948,408,679	0	58,967,674	58,967,674
	FUS14SEP		JPH			0.009498303					
-94,493,000.00000	非グループ化の有価証券小計			-94,493,000	-10,007,376,353		-94,493,000	-9,948,408,679	0	58,967,674	58,967,674
-94,493,000.00000	先物 (ポジション) 合計			-94,493,000	-10,007,376,353		-94,493,000	-9,948,408,679	0	58,967,674	58,967,674
-94,493,000.00000	日本円クラス受益証券合計			-94,493,000	-10,007,376,353		-94,493,000	-9,948,408,679	0	58,967,674	58,967,674

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

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

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>メキシコ・ペソクラス受益証券</u>											
<u>先物 (ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
115,029,452.40	MXN FORWARD 14 SEP	08/04/2020		115,029,452.40	534,817,501	1.000000000F	115,029,452.40	552,947,942	0	18,130,441	18,130,441
	FMX14SEP		MXH			0.208029443					
-5,067,600.00000	USD FORWARD 14 SEP	08/04/2020		-5,067,600.00	-534,817,505	1.000000000F	-5,067,600.00	-533,526,884	0	1,290,621	1,290,621
	FUS14SEP		MXH			0.009498303					
109,961,852.40000	非グループ化の有価証券小計			109,961,852	-4		109,961,852	19,421,058	0	19,421,062	19,421,062
109,961,852.40000	先物 (ポジション) 合計			109,961,852	-4		109,961,852	19,421,058	0	19,421,062	19,421,062
109,961,852.40000	メキシコ・ペソクラス受益証券合計			109,961,852	-4		109,961,852	19,421,058	0	19,421,062	19,421,062

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

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

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
ロシア・ルーブルクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
328,810,735.50	RUB FORWARD 14 SEP	08/04/2020		328,810,735.50	472,408,997	1.000000000F	328,810,735.50	465,031,242	0	-7,377,755	-7,377,755
	FRU14SEP		RUH			0.707072355					
-4,449,100.00000	USD FORWARD 14 SEP	08/04/2020		-4,449,100.00	-472,408,999	1.000000000F	-4,449,100.00	-468,409,989	0	3,999,010	3,999,010
	FUS14SEP		RUH			0.009498303					
324,361,635.50000	非グループ化の有価証券小計			324,361,636	-2		324,361,636	-3,378,747	0	-3,378,745	-3,378,745
324,361,635.50000	先物（ポジション）合計			324,361,636	-2		324,361,636	-3,378,747	0	-3,378,745	-3,378,745
324,361,635.50000	ロシア・ルーブルクラス受益証券合計			324,361,636	-2		324,361,636	-3,378,747	0	-3,378,745	-3,378,745

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

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

（注2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
トルコ・リラクラス受益証券											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
225,751,347.30	TRY FORWARD 14 SEP	08/04/2020		225,751,347.30	3,429,730,206	1.0000000000 ^F	225,751,347.30	3,217,818,092	0	-211,912,114	-211,912,114
	FTR14SEP		TRH			0.070156653					
-31,323,900.00000	USD FORWARD 14 SEP	08/04/2020		-31,323,900.00	-3,429,730,221	1.0000000000 ^F	-31,323,900.00	-3,297,841,730	0	131,888,491	131,888,491
	FUS14SEP		TRH			0.009498303					
194,427,447.30000	非グループ化の有価証券小計			194,427,447	-15		194,427,447	-80,023,638	0	-80,023,623	-80,023,623
194,427,447.30000	先物（ポジション）合計			194,427,447	-15		194,427,447	-80,023,638	0	-80,023,623	-80,023,623
194,427,447.30000	トルコ・リラクラス受益証券合計			194,427,447	-15		194,427,447	-80,023,638	0	-80,023,623	-80,023,623

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

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

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
現金											
基準通貨現金											
53,148,488.00000	JPY CASH	08/28/2020		53,148,488	53,148,488	1.000000000	53,148,488	53,148,488	0	0	0
	CASHJPY					1.000000000					
53,148,488.00000	基準通貨現金小計			53,148,488	53,148,488		53,148,488	53,148,488	0	0	0
53,148,488.00000	現金合計			53,148,488	53,148,488		53,148,488	53,148,488	0	0	0
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
3,000,000.00000	AGEAS	04/04/2019		3,056,250.00	379,730,283	109.027999878 ^C 125.291889006	3,270,840.00	409,809,722	26,886,386	3,193,053	30,079,439
	FRN 07022049 BBEL017Z BE0002644251										
1,800,000.00000	ARGENTUM NETH	08/12/2020		1,807,920.00	192,480,207	100.480003357 ^C 0.009496225	1,808,640.06	190,458,847	75,826	-2,097,186	-2,021,360
	FRN PERP/CALL BNLDTEUZ XS1640851983										
2,250,000.00000	ASR NEDERLAND NV	04/25/2019		2,298,401.00	283,695,075	108.125999451 ^C 125.291889006	2,432,834.99	304,814,491	16,843,488	4,275,928	21,119,416
	FRN 05022049 BNLD121A XS1989708836										
3,500,000.00000	AUST & NZ BANK	11/15/2019		3,499,709.00	420,573,761	100.163002014 ^C 125.291889006	3,505,705.07	439,236,411	751,259	17,911,391	18,662,650
	FRN 11212029 BAUS08BP XS2082818951										
2,000,000.00	AVIVA PLC	06/05/2020		2,042,380.00	285,230,621	106.961997986 ^C 140.382095492	2,139,239.96	300,310,988	13,597,404	1,482,963	15,080,367
	FRN 06032055 BGBR22PZ XS2181348405										
4,700,000.00	AXA SA	05/24/2013		5,063,974.18	854,967,509	115.182998657 ^C 140.382095492	5,413,600.94	759,972,644	49,081,337	-144,076,202	-94,994,865
	FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561										
950,000.00000	BANCO DE CREDITO	06/26/2020		942,913.00	101,207,562	100.773002625 ^C 0.009496225	957,343.52	100,813,063	1,519,606	-1,914,106	-394,500
	FRN 07012030 BPER002V US05971V2C81										

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

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

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
3,600,000.00000	BANK OF IRELAND FRN 10142029 BIRL02BJ XS2065555562	11/18/2019		3,685,123.15	443,282,716	100.161003113 ^C 125.291889006	3,605,796.11	451,777,006	-9,939,034	18,433,325	8,494,291
4,350,000.00000	BANK OF MONTREAL FRN 12152032 BCAN10EN US06368BGS16	12/07/2017		4,350,000.00	490,397,233	110.741996765 ^C 0.009496225	4,817,276.86	507,283,353	49,206,591	-32,320,471	16,886,120
1,550,000.00000	BARCLAYS PLC FRN 02072028 BGBR22K6 XS1678970291	12/18/2019		1,582,286.50	193,290,076	100.668998718 ^C 125.291889006	1,560,369.48	195,501,640	-2,746,025	4,957,589	2,211,564
3,400,000.00000	BARCLAYS PLC FRN 05072026 BGBR22PU US06738EBL83	04/30/2020		3,400,000.00	363,579,008	105.712997437 ^C 0.009496225	3,594,241.91	378,491,655	20,454,645	-5,541,999	14,912,646
4,000,000.00000	BAWAG GROUP AG FRN 03262029 BAUT016H XS1968814332	03/19/2019		3,995,520.00	504,988,434	101.740997314 ^C 125.291889006	4,069,639.89	509,892,870	9,286,621	-4,382,186	4,904,435
5,000,000.00000	BRANCH BKG & TR FRN 09172029 BUSA9D7U US07330MAC10	09/09/2019		5,000,000.00	535,800,014	103.753997803 ^C 0.009496225	5,187,699.89	546,290,751	19,765,737	-9,275,000	10,490,737
5,250,000.00000	CHINA CONST BANK FRN 06242030 BCHN000Y XS2140531950	06/26/2020		5,246,528.80	563,136,140	101.543998718 ^C 0.009496225	5,331,059.93	561,387,281	8,901,551	-10,650,410	-1,748,859
2,300,000.00000	CNP ASSURANCES FRN07272050 BFRA10R8 FR0013463775	11/20/2019		2,285,210.00	274,710,913	100.636001587 ^C 125.291889006	2,314,628.04	290,004,119	3,685,841	11,607,365	15,293,206
3,400,000.00000	COM BK AUSTRALIA FRN 09122034 BAUS08BI USQ2704MAA64	09/05/2019		3,400,000.00	363,970,009	108.632003784 ^C 0.009496225	3,693,488.13	388,942,778	30,905,768	-5,933,000	24,972,768
1,200,000.00000	COOPERATIVE RAB FRN PERP/CALL BNLDTEUU XS2202900424	07/07/2020		1,200,000.00	145,657,442	104.474998474 ^C 125.291889006	1,253,699.98	157,078,439	6,728,172	4,692,825	11,420,997

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

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

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
固定利率から変動利率に転換される社債											
2,000,000.00000	CRDT AGR ASSR FRN 01292048 BFRA10L9 FR0013312154	01/22/2018		2,007,829.00	272,543,704	105.151000977 ^C 125.291889006	2,103,020.02	263,491,351	11,926,663	-20,979,016	-9,052,353
2,800,000.00	CREDIT SUISSE FRN 06092028 BCHE012Q CH0550413337	06/03/2020		2,795,455.00	382,293,772	103.376998901 ^C 140.382095492	2,894,555.97	406,343,832	13,912,002	10,138,059	24,050,061
6,910,000.00000	DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12	10/23/2014		7,095,133.09	796,992,374	112.539001465 ^C 0.009496225	7,776,445.00	818,898,562	71,745,553	-49,839,364	21,906,189
2,250,000.00000	DANSKE BANK A/S FRN 06212029 BDNK024B XS1967697738	06/30/2020		2,309,239.50	279,812,950	104.764999390 ^C 125.291889006	2,357,212.49	295,339,605	6,010,626	9,516,029	15,526,655
3,700,000.00000	DBS GROUP HLDGS FRN 04112028 BSGP00AP XS1802465846	04/04/2018		3,689,566.00	483,456,916	102.069000244 ^C 125.291889006	3,776,553.01	473,171,460	10,898,767	-21,184,222	-10,285,455
1,800,000.00000	DBS GROUP HLDGS FRN PERP/CALL BSGP00AU XS2122408854	02/20/2020		1,800,000.00	201,762,010	100.509002686 ^C 0.009496225	1,809,162.05	190,513,815	964,810	-12,213,005	-11,248,195
3,300,000.00000	DEUTSCHE BANK AG FRN 09032026 BDEU43ED DE000DL19VP0	08/27/2020		3,286,404.00	412,439,286	99.493000000 ^C 125.291889006	3,283,269.00	411,366,975	-392,790	-679,521	-1,072,311
5,250,000.00000	DISCOVER BANK FRN 08092028 BUSA9CU3 US25466AAN19	02/28/2019		5,244,015.00	583,763,733	104.592700000 ^C 0.009496225	5,491,116.75	578,242,065	26,021,050	-31,542,719	-5,521,669
2,000,000.00000	DNB BANK ASA FRN PERP/CALL BNOR024J XS2075280995	11/05/2019		2,001,800.00	218,496,472	102.140998840 ^C 0.009496225	2,042,819.98	215,119,163	4,319,609	-7,696,917	-3,377,308
3,700,000.00000	ELM BV FOR HELVE FRN 09292047 BNLD12E4 XS1587893451	03/30/2017		3,789,961.00	451,293,194	110.072998047 ^C 125.291889006	4,072,700.93	510,276,393	35,425,020	23,558,179	58,983,199

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>社債</u>											
<u>固定利率から変動利率に転換される社債</u>											
1,200,000.00000	ERSTE GROUP FRN PERP/CALL BAUT0160 XS1425367494	08/08/2019		1,380,000.00	164,173,234	107.205001831 ^C 125.291889006	1,286,460.02	161,183,006	-11,719,801	8,729,573	-2,990,228
1,200,000.00000	ERSTE GROUP FRN 06102030 BAUT016Y XS2083210729	11/18/2019		1,193,220.00	143,532,190	96.929000854 ^C 125.291889006	1,163,148.01	145,733,011	-3,767,776	5,968,598	2,200,822
1,700,000.00000	HANNOVER RUECKV FRN 10092039 BDEU43DF XS2063350925	10/01/2019		1,682,354.00	198,098,357	97.932998657 ^C 125.291889006	1,664,860.98	208,593,577	-2,191,734	12,686,954	10,495,220
1,200,000.00000	ING GROEP NV FRN 05262031 BNLDTEUN XS2176621170	05/19/2020		1,198,056.00	141,564,503	105.001998901 ^C 125.291889006	1,260,023.99	157,870,786	7,764,086	8,542,196	16,306,282
3,400,000.00000	JPMORGAN CHASE FRN 05132031 BUSA9EB5 US46647PBP09	05/06/2020		3,400,000.00	360,570,015	107.164001465 ^C 0.009496225	3,643,576.05	383,686,786	25,649,777	-2,533,006	23,116,771
2,800,000.00000	KBC GROUP NV FRN 09182029 BBEL017K BE0002290592	09/11/2017		2,792,664.00	364,426,803	103.484001160 ^C 125.291889006	2,897,552.03	363,039,768	13,141,620	-14,528,655	-1,387,035
3,000,000.00000	KBC GROUP NV FRN 12032029 BBEL0181 BE0002664457	08/27/2019		2,985,303.00	351,000,708	98.449996948 ^C 125.291889006	2,953,499.91	370,049,583	-3,984,669	23,033,544	19,048,875
1,250,000.00	M&G PLC FRN 10202051 GBR22PY XS1888920276	06/04/2020		1,373,600.00	188,771,192	115.349998474 ^C 140.382095492	1,441,874.98	202,413,431	9,584,585	4,057,654	13,642,239
2,000,000.00000	MAPFRE FRN 03312047 BESP0267 ES0224244089	03/22/2017		2,000,000.00	239,987,727	114.083000183 ^C 125.291889006	2,281,660.00	285,873,492	35,289,714	10,596,051	45,885,765
3,100,000.00000	MITSUMI SUMITOMO FRN PERP/CALL BJPN3074 USJ4517MAA74	02/27/2019		3,100,000.00	343,774,504	120.738998413 ^C 0.009496225	3,742,908.95	394,147,037	67,701,529	-17,328,995	50,372,534

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>社債</u>											
<u>固定利率から変動利率に転換される社債</u>											
1,200,000.00000	MUNICH RE FRN 05262049 BDEU43C0 XS1843448314	11/15/2018		1,187,280.00	152,187,944	115.938003540 ^C 125.291889006	1,391,256.04	174,313,098	25,556,544	-3,431,390	22,125,154
3,200,000.00000	NATIONWIDE BLDG FRN 07182030 BGBR2209 US63861VAE74	07/12/2019		3,201,216.00	345,779,362	114.277000427 ^C 0.009496225	3,656,864.01	385,086,075	47,982,015	-8,675,302	39,306,713
3,300,000.00000	NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290	11/10/2014		3,460,611.63	461,773,159	112.578002930 ^C 125.291889006	3,715,074.10	465,468,651	31,882,083	-28,186,591	3,695,492
1,400,000.00000	NN GROUP NV FRN 01132048 BNLDTEUP XS1550988643	05/20/2020		1,545,250.00	182,589,585	118.253997803 ^C 125.291889006	1,655,555.97	207,427,735	13,820,443	11,017,706	24,838,149
600,000.00000	PHOENIX GRP FRN 09042031 BGBR22PW XS2182954797	05/28/2020		600,000.00	64,575,003	104.723999023 ^C 0.009496225	628,343.99	66,167,766	2,984,764	-1,392,001	1,592,763
1,200,000.00	PRUDENTIAL PLC FRN 07202055 BGBR22DZ XS1243995302	10/28/2019		1,340,712.00	187,906,361	112.762001038 ^C 140.382095492	1,353,144.01	189,957,192	1,745,232	305,599	2,050,831
1,800,000.00000	RAIFFEISEN BK IN FRN 06182032 BAUT0172 XS2189786226	06/09/2020		1,789,776.00	218,898,549	102.903999329 ^C 125.291889006	1,852,271.99	232,074,656	7,830,240	5,345,867	13,176,107
1,200,000.00	RL FINANCE NO 4 FRN 10072049 BGBR22OS XS2061962465	09/30/2019		1,175,712.00	156,582,293	106.314002991 ^C 140.382095492	1,275,768.04	179,094,990	14,046,076	8,466,621	22,512,697
2,500,000.00000	ROYAL BK SCOTLND FRN 05182029 BGBR22MB US780097BG51	05/15/2018		2,500,000.00	275,799,985	118.963996887 ^C 0.009496225	2,974,099.92	313,187,601	49,925,094	-12,537,478	37,387,616
1,100,000.00000	SAMPO OYJ FRN 09032052 BFIN015V Z02005585	08/28/2020		1,101,375.00	138,221,083	100.486000000 ^C 125.291889006	1,105,346.00	138,490,888	497,534	-227,729	269,805

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2020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>社債</u>											
<u>固定利率から変動利率に転換される社債</u>											
1,800,000.00000	SWISS RE FIN FRN PERP/CALL BLUX02DE XS2049422343	08/28/2019		1,806,282.00	191,312,364	102.527999878 ^C 0.009496225	1,845,504.00	194,340,804	4,130,273	-1,101,833	3,028,440
1,700,000.00000	UBS GROUP FRN PERP/CALL BCHE012R CH0558521263	07/23/2020		1,720,400.00	184,074,201	103.918998718 ^C 0.009496225	1,766,622.98	186,034,238	4,867,511	-2,907,474	1,960,037
3,200,000.00000	UNICREDIT SPA FRN 09232029 BITA0386 XS2055089457	09/16/2019		3,173,795.00	380,443,947	96.052001953 ^C 125.291889006	3,073,664.06	385,105,177	-12,545,594	17,206,824	4,661,230
2,000,000.00000	UNITED OVERSEAS FRN 04152029 BSGP00AQ US91127KAC62	04/08/2019		1,993,140.00	222,085,615	106.500999451 ^C 0.009496225	2,130,019.99	224,301,761	14,414,148	-12,198,002	2,216,146
900,000.00000	VOLKSBANK NV FRN 10222030 BNLDTEUY XS2202902636	07/15/2020		899,667.00	109,750,299	102.630996704 ^C 125.291889006	923,678.97	115,729,483	3,008,505	2,970,679	5,979,184
1,200,000.00000	XLIT LTD FRN 06292047 BCYM05AV XS1633784183	06/22/2017		1,188,648.00	147,662,895	110.952003479 ^C 125.291889006	1,331,424.04	166,816,633	17,888,680	1,265,058	19,153,738
2,150,000.00000	ZURICH FINANCE FRN 09172050 BIRL02BU XS2189970317	06/09/2020		2,143,528.50	262,164,247	102.839996338 ^C 125.291889006	2,211,059.92	277,027,874	8,461,139	6,402,488	14,863,627
137,260,000.00000	固定利率から変動利率に転換される社債小計			138,808,208	16,657,257,539		145,788,223	17,228,044,378	799,798,501	-229,011,662	570,786,839
<u>変動利率</u>											
2,000,000.00000	AEGON NV FRN PERP/CALL BNLDTEU9 NL0000116168	02/03/2020		1,715,000.00	186,437,645	72.442001343 ^C 0.009496225	1,448,840.03	152,570,103	-28,027,977	-5,839,565	-33,867,542
1,740,000.00000	HARTFORD FINL FRN 02122047 BUSA9C0P US416515BC76	12/04/2017		1,666,050.00	187,797,158	85.801002502 ^C 0.009496225	1,492,937.44	157,213,782	-18,229,618	-12,353,758	-30,583,376

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
変動利率											
2,300,000.00000	HSBC BANK PLC FRN PERP/CALL BGBR22PB XS0015190423	12/20/2019		1,805,500.00	197,620,996	79.281997681 ^C 0.009496225	1,823,485.95	192,022,193	1,894,010	-7,492,813	-5,598,803
4,150,000.00000	PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42	12/14/2012		4,245,496.10	390,045,442	107.531997681 ^C 0.009496225	4,462,577.90	469,931,779	22,859,800	57,026,537	79,886,337
1,290,000.00000	SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73	03/22/2013		1,302,286.41	125,730,568	108.731002808 ^C 0.009496225	1,402,629.94	147,703,949	10,566,675	11,406,706	21,973,381
1,710,000.00	ZURICH FINANCE FRN 10292049 BGBR2220 XS0177600920	05/03/2012		1,835,531.94	289,174,272	111.225997925 ^C 140.382095492	1,901,964.56	267,001,771	9,325,951	-31,498,452	-22,172,501
13,190,000.00000	変動利率小計			12,569,864	1,376,806,081		12,532,436	1,386,443,577	-1,611,159	11,248,655	9,637,496
ミディアム・ターム・ノート											
1,000,000.00000	AIB GROUP PLC 1.25 % 05282024 BIRL02BE XS2003442436	09/26/2019		1,021,400.00	120,565,623	102.321998596 ^C 125.291889006	1,023,219.99	128,201,165	228,029	7,407,512	7,635,541
800,000.00000	ASSICURAZIONI 2.124 % 10012030 BITA0387 XS2056491587	09/23/2019		800,950.00	94,550,296	101.461997986 ^C 125.291889006	811,695.98	101,698,923	1,346,385	5,802,242	7,148,627
2,400,000.00000	BANQ FED CRD MUT 3 % 09112025 BFRA10FW XS1288858548	03/21/2019		2,632,320.00	331,506,019	111.491996765 ^C 125.291889006	2,675,807.92	335,257,029	5,448,684	-1,697,674	3,751,010
2,600,000.00000	BANQ FED CRD MUT 2.375 % 03242026 BFRA10NI XS1385945131	08/13/2019		2,887,300.00	341,110,482	107.958000183 ^C 125.291889006	2,806,908.00	351,682,806	-10,072,465	20,644,789	10,572,324
6,240,000.00000	BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63	10/14/2014		6,235,382.91	692,056,012	111.532997131 ^C 0.009496225	6,959,659.02	732,886,913	76,269,898	-35,438,997	40,830,901

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
ミディアム・ターム・ノート											
800,000.00000	CNP ASSURANCES 2.75 % 02052029 BFRA1008 FR0013399680	01/25/2019		791,007.38	98,881,908	111.915000916 ^C 125.291889006	895,320.01	112,176,335	13,069,526	224,901	13,294,427
800,000.00	HSBC HLDGS PLC 6 % 03292040 BGBR22NX XS0498768315	05/28/2019		1,017,096.00	141,259,280	133.425994873 ^C 140.382095492	1,067,407.96	149,844,966	7,062,898	1,522,788	8,585,686
4,980,000.00000	LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249	06/09/2015		4,961,125.80	693,886,457	108.308998108 ^C 125.291889006	5,393,788.11	675,797,901	54,209,078	-72,297,634	-18,088,556
3,600,000.00000	NATL AUSTRAL IABK 2.332 % 08212030 BAUS08C5 USG6S94TAC79	08/17/2020		3,600,000.00	381,852,016	99.279998779 ^C 0.009496225	3,574,079.96	376,368,500	-2,729,510	-2,754,006	-5,483,516
2,870,000.00000	PHOENIX GRP 4.375 % 01242029 BGBR22P5 XS1881005117	11/29/2019		3,120,805.50	380,970,967	110.989997864 ^C 125.291889006	3,185,412.94	399,106,404	8,094,788	10,040,649	18,135,437
2,300,000.00000	QNB FINANCE LTD 2.75 % 02122027 BCYM05BU XS2114850949	02/05/2020		2,295,492.00	251,941,731	105.863998413 ^C 0.009496225	2,434,871.96	256,404,199	14,677,407	-10,214,940	4,462,467
3,000,000.00000	SANTANDER ISSUAN 3.125 % 01192027 BESPO263 XS1548444816	01/04/2017		2,967,900.00	364,610,750	110.950996399 ^C 125.291889006	3,328,529.89	417,037,798	45,184,000	7,243,047	52,427,047
31,390,000.00000	ミディアム・ターム・ノート小計			32,330,780	3,893,191,541		34,156,702	4,036,462,939	212,788,718	-69,517,323	143,271,395
私募債											
4,700,000.00000	ATHENE GLOBAL FU 2.45 % 08202027 BUSA9EGK US04685A2P53	08/18/2020		4,693,702.00	494,950,896	100.781997681 ^C 0.009496225	4,736,753.89	498,803,882	4,533,580	-680,594	3,852,986
1,100,000.00000	AVOLON HDGS 3.625 % 05012022 BCYM05BV US05401AAE10	07/08/2020		1,039,500.00	111,767,043	97.016998291 ^C 0.009496225	1,067,186.98	112,380,128	2,915,578	-2,302,493	613,085

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
私募債											
5,650,000.00000	BNP PARIBAS 4.375 % 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97	10/01/2015		5,481,906.53	646,514,116	112.044998169 ^C 0.009496225	6,330,542.40	666,637,785	89,365,602	-69,241,934	20,123,668
1,350,000.00000	INTESA SANPAOLO 3.375 % 01122023 BITA036P US46115HBC07	04/03/2020		1,313,685.00	142,541,393	104.111999512 ^C 0.009496225	1,405,511.99	148,007,444	9,669,842	- 4,203,790	5,466,052
2,700,000.00000	SANTANDER UK PLC 5 % 11072023 BGBR226L US80283LAA17	11/15/2013		2,700,217.18	270,585,770	110.304000854 ^C 0.009496225	2,978,208.02	313,620,204	29,273,827	13,760,608	43,034,435
5,950,000.00000	STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64	08/16/2016		5,915,252.00	594,216,645	107.806999207 ^C 0.009496225	6,414,516.45	675,480,673	52,575,045	28,688,983	81,264,028
21,450,000.00000	私募債小計			21,144,263	2,260,575,863		22,932,720	2,414,930,116	188,333,474	- 33,979,220	154,354,254
公募債											
2,300,000.00000	AMERICAN HOMES 4 4.25 % 02152028 BUSA9C4K US02666TAA51	06/06/2019		2,347,380.00	253,951,295	114.022003174 ^C 0.009496225	2,622,506.07	276,163,009	28,972,152	- 6,760,438	22,211,714
5,050,000.00000	AON CORP 2.8 % 05152030 BUSA9EBL US037389BE22	05/12/2020		5,048,232.50	541,347,187	108.351997375 ^C 0.009496225	5,471,775.87	576,205,373	44,601,235	- 9,743,050	34,858,185
1,850,000.00000	AXA EQUITABLE HO 5 % 04202048 BUSA9CRL US054561AM77	07/05/2019		1,905,925.50	206,726,207	118.241996765 ^C 0.009496225	2,187,476.94	230,352,265	29,648,775	- 6,022,717	23,626,058
2,100,000.00000	CAPITAL ONE FINL 1.65 % 06122029 BUSA9DOT XS2010331440	06/05/2019		2,092,713.00	254,547,631	102.277000427 ^C 125.291889006	2,147,817.01	269,104,050	6,904,085	7,652,334	14,556,419
2,600,000.00000	CHUBB INA HLDGS 2.5 % 03152038 BUSA9C6V XS1785813251	03/01/2018		2,599,974.00	339,008,298	120.693000793 ^C 125.291889006	3,138,018.02	393,168,206	67,412,552	- 13,252,644	54,159,908

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

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

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
公募債											
1,030,000.00000	CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71	05/05/2016		1,581,977.00	169,137,062	175.371002197 ^C 0.009496225	1,806,321.32	190,214,672	23,624,580	-2,546,970	21,077,610
3,800,000.00000	CITIGROUP INC 4.6 % 03092026 BUSA9ACG US172967KJ96	03/01/2016		3,792,476.00	430,787,342	116.137001038 ^C 0.009496225	4,413,206.04	464,732,674	65,365,979	-31,420,646	33,945,333
4,100,000.00000	CNA FINANCIAL 2.05 % 08152030 BUSA9EFU US126117AW05	08/11/2020		4,099,319.00	436,147,216	99.367996216 ^C 0.009496225	4,074,087.84	429,021,832	-2,656,967	-4,468,417	-7,125,384
6,400,000.00000	CRED AGRICOLE SA 4.375 % 03172025 BFRA10ER USF2R125AC99	03/10/2015		6,410,893.72	777,075,880	111.824996948 ^C 0.009496225	7,156,799.80	753,646,823	78,547,642	-101,976,699	-23,429,057
5,100,000.00000	DIGITAL REALTY 4.45 % 07152028 BUSA9CDX US25389JAT34	06/14/2018		5,092,452.00	561,519,214	119.421600000 ^C 0.009496225	6,090,501.60	641,360,288	105,099,616	-25,258,542	79,841,074
1,550,000.00000	FIRST HORIZON 5.75 % 05012030 BUSA9EHA US337158AJ88	08/27/2020		1,755,995.00	186,916,888	113.061600000 ^C 0.009496225	1,752,454.80	184,542,258	-372,801	-2,001,830	-2,374,631
5,150,000.00000	GOLDMAN SACHS GP 6.345% 02152034 BUSA2420 US38143VAA70	10/20/2017		6,447,248.16	718,749,937	140.238998413 ^C 0.009496225	7,222,308.42	760,545,208	81,617,723	-39,822,452	41,795,271
2,800,000.00	HASTINGS GRP FIN 3 % 05242025 BJEY0016 XS1815424202	09/27/2019		2,774,604.00	368,529,829	107.805000305 ^C 140.382095492	3,018,540.01	423,748,972	34,244,248	20,974,895	55,219,143
3,000,000.00000	HSBC BANK USA NA 7 % 01152039 BUSA9CQP US4042Q1AD94	01/11/2019		3,811,320.00	413,185,215	151.794006348 ^C 0.009496225	4,553,820.19	479,540,048	78,188,985	-11,834,152	66,354,833
3,050,000.00000	HSBC HLDGS PLC 6.8% 06012038 BGBR2073 US404280AJ87	05/29/2019		3,937,580.50	430,633,498	143.352005005 ^C 0.009496225	4,372,236.15	460,418,340	45,771,415	-15,986,573	29,784,842

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
公募債											
3,600,000.00000	INTERCONTINENT 1.85 % 09152032 BUSA9EG8 US45866FAN42	08/17/2020		3,590,746.00	380,870,445	100.411003113 ^C 0.009496225	3,614,796.11	380,656,115	2,532,597	-2,746,927	-214,330
3,000,000.00000	JPMORGAN CHASE 3.625 % 12012027 BUSA9B3I US46625HRX07	11/10/2016		2,994,810.00	318,842,453	111.659900000 ^C 0.009496225	3,349,797.00	352,750,382	37,381,907	-3,473,978	33,907,929
1,350,000.00000	LEXINGTON REALTY 2.7 % 09152030 BUSA9EG8 US529043AE19	08/17/2020		1,349,215.50	143,416,924	101.092800000 ^C 0.009496225	1,364,752.80	143,715,297	1,636,155	-1,337,782	298,373
2,000,000.00000	MAR SUKUK LTD 2.21 % 09022025 BCYM05BW XS2225422869	08/26/2020		2,000,000.00	212,289,999	100.970000000 ^C 0.009496225	2,019,400.00	212,652,923	2,042,917	-1,679,993	362,924
1,500,000.00000	MARSH & MCLENNAN 1.979 % 03212030 BUSA9CV6 XS1963837197	03/14/2019		1,504,736.00	190,038,939	113.293998718 ^C 125.291889006	1,699,409.98	212,922,287	24,391,071	-1,507,723	22,883,348
2,950,000.00000	MERRILL LYNCH 7.75 % 05142038 BUSA8579 US59023VAA89	10/20/2017		4,374,083.00	496,152,228	166.018997192 ^C 0.009496225	4,897,560.42	515,737,613	55,124,791	-35,539,406	19,585,385
2,000,000.00000	METLIFE INC 6.4 % 12152036 BUSA5773 US59156RAP38	06/13/2017		2,305,000.00	253,434,756	124.375000000 ^C 0.009496225	2,487,500.00	261,946,194	19,218,163	-10,706,725	8,511,438
1,800,000.00000	MIZUHO FIN GROUP 4.6 % 03272024 BCYM058L USG6180BAB39	03/20/2014		1,795,572.00	183,857,592	109.526200000 ^C 0.009496225	1,971,471.60	207,605,822	18,523,108	5,225,122	23,748,230
6,010,000.00000	MORGAN STANLEY 3.95 % 04232027 BUSA99DZ US61761JZN26	04/20/2015		6,220,590.40	663,862,835	113.089996338 ^C 0.009496225	6,796,708.78	715,727,437	60,668,148	-8,803,546	51,864,602
900,000.00000	NASDAQ INC 3.25 % 04282050 BUSA9EAK US63111XAB73	04/23/2020		882,882.00	95,011,345	106.309997559 ^C 0.009496225	956,789.98	100,754,771	7,782,880	-2,039,454	5,743,426

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
社債											
公募債											
3,450,000.00000	ROYAL BK SCOTLND 6.1 % 06102023 BGBR22LA US780097AY76	01/12/2018		3,791,377.50	422,037,198	110.928001404 ^C 0.009496225	3,827,016.05	403,003,936	3,752,917	-22,786,180	-19,033,263
4,850,000.00000	SANTANDER MEXICO 5.375 % 04172025 BMEX00CF USP1507SAH06	08/11/2020		5,480,500.00	583,481,444	112.785003662 ^C 0.009496225	5,470,072.68	576,026,019	-1,098,049	-6,357,376	-7,455,425
1,500,000.00000	SANTANDER UK GRP 5.625 % 09152045 BGBR220V XS1291352711	10/18/2019		1,794,255.00	194,703,578	124.330000000 ^C 0.009496225	1,864,950.00	196,388,565	7,444,537	-5,759,550	1,684,987
1,150,000.00000	STANDARD CHART 5.3 % 01092043 BGBR2207 XS0875267394	07/01/2019		1,284,964.00	139,193,730	120.706001282 ^C 0.009496225	1,388,119.01	146,175,877	10,862,739	-3,880,592	6,982,147
5,000,000.00000	SUMITOMO MITSUI 3.202 % 09172029 BJPN3070 US86562MBS89	09/10/2019		5,000,000.00	536,424,972	108.338996887 ^C 0.009496225	5,416,949.84	570,431,918	43,906,905	-9,899,958	34,006,947
1,900,000.00000	UNIQA INSURANCE 1.375 % 07092030 BAUT0174 XS2199604096	07/02/2020		1,899,964.00	229,657,266	103.612998962 ^C 125.291889006	1,968,646.98	246,655,499	8,605,420	8,392,813	16,998,233
6,410,000.00000	WELLS FARGO CO 5.95 % 12012086 BUSA9E8S US949746NL15	11/10/2011		6,479,274.77	510,608,458	130.688995361 ^C 0.009496225	8,377,164.60	882,157,342	199,857,294	171,691,590	371,548,884
99,250,000.00000	公募債小計			106,446,061	11,642,146,861		117,498,976	12,658,072,015	1,189,602,719	-173,677,566	1,015,925,153
302,540,000.00000	社債合計			311,299,176	35,829,977,885		332,909,056	37,723,953,025	2,388,912,253	-494,937,116	1,893,975,137
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,427,956.47000	AUSTRALIAN DOLLAR AUD	08/07/2015		1,427,956.47	130,840,957	1.000000000 ^S 77.372848751	1,427,956.47	110,485,060	0	-20,355,897	-20,355,897
7,650,000.00000		08/11/2015		7,650,000.00	704,316,836	1.000000000 ^S 77.372848751	7,650,000.00	591,902,293	0	-112,414,543	-112,414,543

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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
479,833.36000		08/13/2015		479,833.36	43,809,780	1.000000000 ^S 77.372848751	479,833.36	37,126,074	0	-6,683,706	-6,683,706
75,403.65000		08/18/2015		75,403.65	6,920,738	1.000000000 ^S 77.372848751	75,403.65	5,834,195	0	-1,086,543	-1,086,543
1,260,000.00000		08/25/2015		1,260,000.00	107,638,641	1.000000000 ^S 77.372848751	1,260,000.00	97,489,789	0	-10,148,852	-10,148,852
20,000.03000		08/28/2015		20,000.03	1,724,493	1.000000000 ^S 77.372848751	20,000.03	1,547,459	0	-177,034	-177,034
1,123.56000		08/31/2015		1,123.56	96,530	1.000000000 ^S 77.372848751	1,123.56	86,933	0	-9,597	-9,597
1,500,000.00000		09/08/2015		1,500,000.00	124,005,422	1.000000000 ^S 77.372848751	1,500,000.00	116,059,273	0	-7,946,149	-7,946,149
1,500,000.00000		09/14/2015		1,500,000.00	127,701,060	1.000000000 ^S 77.372848751	1,500,000.00	116,059,273	0	-11,641,787	-11,641,787
1,200,000.00000		09/17/2015		1,200,000.00	104,033,759	1.000000000 ^S 77.372848751	1,200,000.00	92,847,419	0	-11,186,340	-11,186,340
4,580.00000		09/29/2015		4,580.00	384,148	1.000000000 ^S 77.372848751	4,580.00	354,368	0	-29,780	-29,780
1,050.33000	AUD	09/30/2015		1,050.33	88,338	1.000000000 ^S 77.372848751	1,050.33	81,267	0	-7,071	-7,071
41,308.36000		10/02/2015		41,308.36	3,484,596	1.000000000 ^S 77.372848751	41,308.36	3,196,145	0	-288,451	-288,451
1,200,000.00000		10/07/2015		1,200,000.00	102,916,819	1.000000000 ^S 77.372848751	1,200,000.00	92,847,419	0	-10,069,400	-10,069,400
479,833.36000		10/14/2015		479,833.36	41,980,363	1.000000000 ^S 77.372848751	479,833.36	37,126,074	0	-4,854,289	-4,854,289
34,504.30000		10/19/2015		34,504.30	2,988,523	1.000000000 ^S 77.372848751	34,504.30	2,669,696	0	-318,827	-318,827
1,500,000.00000		10/21/2015		1,500,000.00	130,659,384	1.000000000 ^S 77.372848751	1,500,000.00	116,059,273	0	-14,600,111	-14,600,111

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
146,966.97000		10/23/2015		146,966.97	12,774,602	1.000000000 ^S 77.372848751	146,966.97	11,371,253	0	-1,403,349	-1,403,349
33,373.73000		10/28/2015		33,373.73	2,903,788	1.000000000 ^S 77.372848751	33,373.73	2,582,221	0	-321,567	-321,567
1,210.89000		10/30/2015		1,210.89	104,252	1.000000000 ^S 77.372848751	1,210.89	93,690	0	-10,562	-10,562
191,801.71000		11/02/2015		191,801.71	16,513,279	1.000000000 ^S 77.372848751	191,801.71	14,840,245	0	-1,673,034	-1,673,034
1,450.44000		11/09/2015		1,450.44	125,722	1.000000000 ^S 77.372848751	1,450.44	112,225	0	-13,497	-13,497
1,100,000.00000		11/10/2015		1,100,000.00	95,614,298	1.000000000 ^S 77.372848751	1,100,000.00	85,110,134	0	-10,504,164	-10,504,164
1,370,000.00000		11/20/2015		1,370,000.00	121,160,088	1.000000000 ^S 77.372848751	1,370,000.00	106,000,803	0	-15,159,285	-15,159,285
1,241.63000		11/30/2015		1,241.63	110,913	1.000000000 ^S 77.372848751	1,241.63	96,068	0	-14,845	-14,845
55,217.71000		11/30/2015		55,217.71	4,875,314	1.000000000 ^S 77.372848751	55,217.71	4,272,352	0	-602,962	-602,962
67,803.25000		12/02/2015		67,803.25	6,086,449	1.000000000 ^S 77.372848751	67,803.25	5,246,131	0	-840,318	-840,318
1,200,000.00000		12/08/2015		1,200,000.00	107,613,376	1.000000000 ^S 77.372848751	1,200,000.00	92,847,419	0	-14,765,957	-14,765,957
479,833.36000		12/14/2015		479,833.36	41,838,537	1.000000000 ^S 77.372848751	479,833.36	37,126,074	0	-4,712,463	-4,712,463
1,300,000.00000		12/14/2015		1,300,000.00	113,352,056	1.000000000 ^S 77.372848751	1,300,000.00	100,584,703	0	-12,767,353	-12,767,353
920,000.00000		12/18/2015		920,000.00	80,272,386	1.000000000 ^S 77.372848751	920,000.00	71,183,021	0	-9,089,365	-9,089,365

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
7,027.13000		12/21/2015		7,027.13	613,059	1.000000000 ^S 77.372848751	7,027.13	543,709	0	-69,350	-69,350
69,609.63000		12/22/2015		69,609.63	6,058,273	1.000000000 ^S 77.372848751	69,609.63	5,385,895	0	-672,378	-672,378
30,652.58000		12/24/2015		30,652.58	2,680,171	1.000000000 ^S 77.372848751	30,652.58	2,371,677	0	-308,494	-308,494
31,897.52000		12/29/2015		31,897.52	2,787,126	1.000000000 ^S 77.372848751	31,897.52	2,468,002	0	-319,124	-319,124
930.50000		12/31/2015		930.50	81,438	1.000000000 ^S 77.372848751	930.50	71,995	0	-9,443	-9,443
64,476.82000		01/06/2016		64,476.82	5,481,018	1.000000000 ^S 77.372848751	64,476.82	4,988,755	0	-492,263	-492,263
29,058.54000		01/14/2016		29,058.54	2,404,861	1.000000000 ^S 77.372848751	29,058.54	2,248,342	0	-156,519	-156,519
306,365.43000		01/20/2016		306,365.43	24,967,386	1.000000000 ^S 77.372848751	306,365.43	23,704,366	0	-1,263,020	-1,263,020
453,323.95000		01/25/2016		453,323.95	37,747,169	1.000000000 ^S 77.372848751	453,323.95	35,074,965	0	-2,672,204	-2,672,204
54,860.74000		01/28/2016		54,860.74	4,588,058	1.000000000 ^S 77.372848751	54,860.74	4,244,732	0	-343,326	-343,326
778.74000		01/29/2016		778.74	66,688	1.000000000 ^S 77.372848751	778.74	60,253	0	-6,435	-6,435
9,624.24000		02/02/2016		9,624.24	825,300	1.000000000 ^S 77.372848751	9,624.24	744,655	0	-80,645	-80,645
45,449.01000		02/03/2016		45,449.01	3,852,337	1.000000000 ^S 77.372848751	45,449.01	3,516,519	0	-335,818	-335,818
900,000.00000		02/19/2016		900,000.00	73,080,576	1.000000000 ^S 77.372848751	900,000.00	69,635,564	0	-3,445,012	-3,445,012

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
549.31000		02/29/2016		549.31	44,286	1.000000000 ^S 77.372848751	549.31	42,502	0	-1,784	-1,784
549.31000		02/29/2016		549.31	7	1.000000000 ^S 77.372848751	549.31	42,502	0	42,495	42,495
300,000.00000		03/11/2016		300,000.00	25,334,694	1.000000000 ^S 77.372848751	300,000.00	23,211,855	0	-2,122,839	-2,122,839
870,000.00000		03/18/2016		870,000.00	73,945,274	1.000000000 ^S 77.372848751	870,000.00	67,314,378	0	-6,630,896	-6,630,896
670.89000		03/31/2016		670.89	58,005	1.000000000 ^S 77.372848751	670.89	51,909	0	-6,096	-6,096
670.89000		03/31/2016		670.89	8	1.000000000 ^S 77.372848751	670.89	51,909	0	51,901	51,901
49,152.02000		04/01/2016		49,152.02	4,249,676	1.000000000 ^S 77.372848751	49,152.02	3,803,032	0	-446,644	-446,644
0.11000		04/04/2016		0.11	9	1.000000000 ^S 77.372848751	0.11	9	0	0	0
118,557.70000		04/04/2016		118,557.70	10,179,618	1.000000000 ^S 77.372848751	118,557.70	9,173,147	0	-1,006,471	-1,006,471
54,704.79000		04/07/2016		54,704.79	4,550,661	1.000000000 ^S 77.372848751	54,704.79	4,232,665	0	-317,996	-317,996
1,000,000.00000		04/13/2016		1,000,000.00	82,840,523	1.000000000 ^S 77.372848751	1,000,000.00	77,372,849	0	-5,467,674	-5,467,674
279,833.36000		04/18/2016		279,833.36	23,441,485	1.000000000 ^S 77.372848751	279,833.36	21,651,504	0	-1,789,981	-1,789,981
2,500,000.00000		04/21/2016		2,500,000.00	213,220,853	1.000000000 ^S 77.372848751	2,500,000.00	193,432,122	0	-19,788,731	-19,788,731
9,845.91000		04/22/2016		9,845.91	837,399	1.000000000 ^S 77.372848751	9,845.91	761,806	0	-75,593	-75,593
71,738.60000		04/28/2016		71,738.60	6,049,028	1.000000000 ^S 77.372848751	71,738.60	5,550,620	0	-498,408	-498,408

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
651.99000		04/29/2016		651.99	8	1.000000000 ^S	651.99	50,446	0	50,438	50,438
						77.372848751					
651.99000		04/29/2016		651.99	53,237	1.000000000 ^S	651.99	50,446	0	-2,791	-2,791
						77.372848751					
3,199.32000		05/06/2016		3,199.32	256,662	1.000000000 ^S	3,199.32	247,541	0	-9,121	-9,121
						77.372848751					
37,851.41000		05/10/2016		37,851.41	3,002,766	1.000000000 ^S	37,851.41	2,928,671	0	-74,095	-74,095
						77.372848751					
52,780.08000		05/13/2016		52,780.08	4,214,171	1.000000000 ^S	52,780.08	4,083,745	0	-130,426	-130,426
						77.372848751					
1,000,000.00000		05/18/2016		1,000,000.00	79,969,300	1.000000000 ^S	1,000,000.00	77,372,849	0	-2,596,451	-2,596,451
						77.372848751					
28,390.46000		05/26/2016		28,390.46	2,250,076	1.000000000 ^S	28,390.46	2,196,651	0	-53,425	-53,425
						77.372848751					
487.18000		05/31/2016		487.18	39,143	1.000000000 ^S	487.18	37,695	0	-1,448	-1,448
						77.372848751					
77,920.52000		06/16/2016		77,920.52	6,116,756	1.000000000 ^S	77,920.52	6,028,933	0	-87,823	-87,823
						77.372848751					
435,877.61000		06/24/2016		435,877.61	34,923,776	1.000000000 ^S	435,877.61	33,725,092	0	-1,198,684	-1,198,684
						77.372848751					
193,723.40000		06/27/2016		193,723.40	14,830,685	1.000000000 ^S	193,723.40	14,988,931	0	158,246	158,246
						77.372848751					
51,500.28000		06/28/2016		51,500.28	3,847,670	1.000000000 ^S	51,500.28	3,984,723	0	137,053	137,053
						77.372848751					
370.39000		06/30/2016		370.39	28,294	1.000000000 ^S	370.39	28,658	0	364	364
						77.372848751					
41,200.23000		06/30/2016		41,200.23	3,144,683	1.000000000 ^S	41,200.23	3,187,779	0	43,096	43,096
						77.372848751					
28,419.86000		07/06/2016		28,419.86	2,155,687	1.000000000 ^S	28,419.86	2,198,926	0	43,239	43,239
						77.372848751					
975,728.88000		07/08/2016		975,728.88	73,727,142	1.000000000 ^S	975,728.88	75,494,923	0	1,767,781	1,767,781
						77.372848751					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
10,303.13000		07/19/2016		10,303.13	827,218	1.000000000S 77.372848751	10,303.13	797,183	0	-30,035	-30,035
85,548.05000		07/26/2016		85,548.05	6,769,315	1.000000000S 77.372848751	85,548.05	6,619,096	0	-150,219	-150,219
49,430.39000		07/27/2016		49,430.39	3,887,241	1.000000000S 77.372848751	49,430.39	3,824,570	0	-62,671	-62,671
966.37000		07/29/2016		966.37	75,274	1.000000000S 77.372848751	966.37	74,771	0	-503	-503
279,833.36000		08/18/2016		279,833.36	21,425,498	1.000000000S 77.372848751	279,833.36	21,651,504	0	226,006	226,006
900,000.00000		08/23/2016		900,000.00	68,935,762	1.000000000S 77.372848751	900,000.00	69,635,564	0	699,802	699,802
312.44000		08/31/2016		312.44	24,288	1.000000000S 77.372848751	312.44	24,174	0	-114	-114
2,905.89000		08/31/2016		2,905.89	224,400	1.000000000S 77.372848751	2,905.89	224,837	0	437	437
244,354.19000		09/06/2016		244,354.19	19,161,904	1.000000000S 77.372848751	244,354.19	18,906,380	0	-255,524	-255,524
1,000,000.00000		09/08/2016		1,000,000.00	78,053,406	1.000000000S 77.372848751	1,000,000.00	77,372,849	0	-680,557	-680,557
397,132.94000		09/14/2016		397,132.94	30,405,336	1.000000000S 77.372848751	397,132.94	30,727,307	0	321,971	321,971
74,453.68000		09/20/2016		74,453.68	5,728,229	1.000000000S 77.372848751	74,453.68	5,760,693	0	32,464	32,464
109,580.94000		09/26/2016		109,580.94	8,438,525	1.000000000S 77.372848751	109,580.94	8,478,589	0	40,064	40,064
57,901.38000		09/27/2016		57,901.38	4,441,152	1.000000000S 77.372848751	57,901.38	4,479,995	0	38,843	38,843
38,744.71000		09/28/2016		38,744.71	2,976,084	1.000000000S 77.372848751	38,744.71	2,997,789	0	21,705	21,705
205,508.38000		09/29/2016		205,508.38	15,834,834	1.000000000S 77.372848751	205,508.38	15,900,769	0	65,935	65,935

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
556.44000		09/30/2016		556.44	43,120	1.000000000S 77.372848751	556.44	43,053	0	-67	-67
96,868.26000		09/30/2016		96,868.26	7,548,319	1.000000000S 77.372848751	96,868.26	7,494,973	0	-53,346	-53,346
10,705.70000		10/04/2016		10,705.70	833,355	1.000000000S 77.372848751	10,705.70	828,331	0	-5,024	-5,024
145,292.56000		10/04/2016		145,292.56	11,309,888	1.000000000S 77.372848751	145,292.56	11,241,699	0	-68,189	-68,189
279,833.36000		10/18/2016		279,833.36	22,177,198	1.000000000S 77.372848751	279,833.36	21,651,504	0	-525,694	-525,694
83,301.08000		10/27/2016		83,301.08	6,668,666	1.000000000S 77.372848751	83,301.08	6,445,242	0	-223,424	-223,424
833.18000		10/31/2016		833.18	66,625	1.000000000S 77.372848751	833.18	64,466	0	-2,159	-2,159
74,583.53000		10/31/2016		74,583.53	5,960,068	1.000000000S 77.372848751	74,583.53	5,770,740	0	-189,328	-189,328
142,255.95000		11/02/2016		142,255.95	11,375,416	1.000000000S 77.372848751	142,255.95	11,006,748	0	-368,668	-368,668
134,756.68000		11/04/2016		134,756.68	10,678,599	1.000000000S 77.372848751	134,756.68	10,426,508	0	-252,091	-252,091
849.50000		11/30/2016		849.50	71,518	1.000000000S 77.372848751	849.50	65,728	0	-5,790	-5,790
885,465.77000		12/13/2016		885,465.77	76,650,084	1.000000000S 77.372848751	885,465.77	68,511,009	0	-8,139,075	-8,139,075
279,833.36000		12/15/2016		279,833.36	24,213,667	1.000000000S 77.372848751	279,833.36	21,651,504	0	-2,562,163	-2,562,163
829.17000		12/21/2016		829.17	70,900	1.000000000S 77.372848751	829.17	64,155	0	-6,745	-6,745
464.62000		12/30/2016		464.62	39,240	1.000000000S 77.372848751	464.62	35,949	0	-3,291	-3,291
1,226,556.69000		01/05/2017		1,226,556.69	104,711,557	1.000000000S 77.372848751	1,226,556.69	94,902,185	0	-9,809,372	-9,809,372

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
282,384.02000		01/27/2017		282,384.02	24,408,543	1.000000000 ^S 77.372848751	282,384.02	21,848,856	0	-2,559,687	-2,559,687
1,199,688.72000		01/27/2017		1,199,688.72	103,697,984	1.000000000 ^S 77.372848751	1,199,688.72	92,823,334	0	-10,874,650	-10,874,650
587.10000		01/31/2017		587.10	50,174	1.000000000 ^S 77.372848751	587.10	45,426	0	-4,748	-4,748
277,517.50000		02/15/2017		277,517.50	24,213,142	1.000000000 ^S 77.372848751	277,517.50	21,472,320	0	-2,740,822	-2,740,822
786,360.14000		02/15/2017		786,360.14	68,609,185	1.000000000 ^S 77.372848751	786,360.14	60,842,924	0	-7,766,261	-7,766,261
63,860.76000		02/27/2017		63,860.76	5,510,685	1.000000000 ^S 77.372848751	63,860.76	4,941,089	0	-569,596	-569,596
598.25000		02/28/2017		598.25	51,463	1.000000000 ^S 77.372848751	598.25	46,288	0	-5,175	-5,175
702,000.00000		03/10/2017		702,000.00	60,452,566	1.000000000 ^S 77.372848751	702,000.00	54,315,740	0	-6,136,826	-6,136,826
1,412,000.00000		03/16/2017		1,412,000.00	122,935,970	1.000000000 ^S 77.372848751	1,412,000.00	109,250,462	0	-13,685,508	-13,685,508
62,745.10000		03/27/2017		62,745.10	5,307,406	1.000000000 ^S 77.372848751	62,745.10	4,854,767	0	-452,639	-452,639
470.71000		03/31/2017		470.71	40,012	1.000000000 ^S 77.372848751	470.71	36,420	0	-3,592	-3,592
89,505.17000		03/31/2017		89,505.17	7,644,438	1.000000000 ^S 77.372848751	89,505.17	6,925,270	0	-719,168	-719,168
766,000.00000		04/07/2017		766,000.00	64,145,110	1.000000000 ^S 77.372848751	766,000.00	59,267,602	0	-4,877,508	-4,877,508
279,833.36000		04/18/2017		279,833.36	23,068,187	1.000000000 ^S 77.372848751	279,833.36	21,651,504	0	-1,416,683	-1,416,683
1,068,505.95000		04/18/2017		1,068,505.95	88,082,762	1.000000000 ^S 77.372848751	1,068,505.95	82,673,349	0	-5,409,413	-5,409,413
1,125,804.00000		04/18/2017		1,125,804.00	92,806,152	1.000000000 ^S 77.372848751	1,125,804.00	87,106,663	0	-5,699,489	-5,699,489

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
106,547.89000		04/27/2017		106,547.89	8,885,757	1.000000000 ^S 77.372848751	106,547.89	8,243,914	0	-641,843	-641,843
978.41000		04/28/2017		978.41	81,563	1.000000000 ^S 77.372848751	978.41	75,702	0	-5,861	-5,861
5,940,000.00000		04/28/2017		5,940,000.00	492,026,980	1.000000000 ^S 77.372848751	5,940,000.00	459,594,722	0	-32,432,258	-32,432,258
1,390,000.00000		05/05/2017		1,390,000.00	115,907,314	1.000000000 ^S 77.372848751	1,390,000.00	107,548,260	0	-8,359,054	-8,359,054
1,344,823.25000		05/26/2017		1,344,823.25	112,415,381	1.000000000 ^S 77.372848751	1,344,823.25	104,052,806	0	-8,362,575	-8,362,575
895.60000		05/31/2017		895.60	73,730	1.000000000 ^S 77.372848751	895.60	69,295	0	-4,435	-4,435
4,843.12000		06/02/2017		4,843.12	397,848	1.000000000 ^S 77.372848751	4,843.12	374,726	0	-23,122	-23,122
7,078.68000		06/13/2017		7,078.68	586,390	1.000000000 ^S 77.372848751	7,078.68	547,698	0	-38,692	-38,692
275,955.42000		06/14/2017		275,955.42	22,875,822	1.000000000 ^S 77.372848751	275,955.42	21,351,457	0	-1,524,365	-1,524,365
320,000.00000		06/14/2017		320,000.00	3,860	1.000000000 ^S 77.372848751	320,000.00	24,759,312	0	24,755,452	24,755,452
270,000.00000		06/16/2017		270,000.00	22,642,776	1.000000000 ^S 77.372848751	270,000.00	20,890,669	0	-1,752,107	-1,752,107
701,045.96000		06/28/2017		701,045.96	59,720,715	1.000000000 ^S 77.372848751	701,045.96	54,241,923	0	-5,478,792	-5,478,792
1,125,804.00000		06/28/2017		1,125,804.00	95,905,011	1.000000000 ^S 77.372848751	1,125,804.00	87,106,663	0	-8,798,348	-8,798,348
1,347,714.81000		06/28/2017		1,347,714.81	114,809,152	1.000000000 ^S 77.372848751	1,347,714.81	104,276,534	0	-10,532,618	-10,532,618
1,390,000.00000		06/28/2017		1,390,000.00	118,411,344	1.000000000 ^S 77.372848751	1,390,000.00	107,548,260	0	-10,863,084	-10,863,084
754.51000		06/30/2017		754.51	65,028	1.000000000 ^S 77.372848751	754.51	58,379	0	-6,649	-6,649

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
1,264,000.00000		07/18/2017		1,264,000.00	111,466,230	1.000000000 ^S 77.372848751	1,264,000.00	97,799,281	0	-13,666,949	-13,666,949
118,871.82000		07/25/2017		118,871.82	10,477,503	1.000000000 ^S 77.372848751	118,871.82	9,197,451	0	-1,280,052	-1,280,052
604.28000		07/31/2017		604.28	53,306	1.000000000 ^S 77.372848751	604.28	46,755	0	-6,551	-6,551
1,203,000.00000		08/17/2017		1,203,000.00	105,081,064	1.000000000 ^S 77.372848751	1,203,000.00	93,079,537	0	-12,001,527	-12,001,527
772,000.00000		08/30/2017		772,000.00	66,991,892	1.000000000 ^S 77.372848751	772,000.00	59,731,839	0	-7,260,053	-7,260,053
607.32000		08/31/2017		607.32	53,015	1.000000000 ^S 77.372848751	607.32	46,990	0	-6,025	-6,025
2,039.21000		09/01/2017		2,039.21	178,011	1.000000000 ^S 77.372848751	2,039.21	157,779	0	-20,232	-20,232
1,760,000.00000		09/18/2017		1,760,000.00	156,419,764	1.000000000 ^S 77.372848751	1,760,000.00	136,176,214	0	-20,243,550	-20,243,550
11,349.96000		09/27/2017		11,349.96	1,003,371	1.000000000 ^S 77.372848751	11,349.96	878,179	0	-125,192	-125,192
823.11000		09/29/2017		823.11	72,700	1.000000000 ^S 77.372848751	823.11	63,686	0	-9,014	-9,014
27,121.31000		10/03/2017		27,121.31	2,392,132	1.000000000 ^S 77.372848751	27,121.31	2,098,453	0	-293,679	-293,679
88,632.36000		10/26/2017		88,632.36	7,758,635	1.000000000 ^S 77.372848751	88,632.36	6,857,738	0	-900,897	-900,897
736.84000		10/31/2017		736.84	64,198	1.000000000 ^S 77.372848751	736.84	57,011	0	-7,187	-7,187
8,233.29000		11/16/2017		8,233.29	705,946	1.000000000 ^S 77.372848751	8,233.29	637,033	0	-68,913	-68,913
484,308.44000		11/21/2017		484,308.44	41,128,430	1.000000000 ^S 77.372848751	484,308.44	37,472,324	0	-3,656,106	-3,656,106
230.45000		11/30/2017		230.45	19,577	1.000000000 ^S 77.372848751	230.45	17,831	0	-1,746	-1,746

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,695,000.00000		12/11/2017		1,695,000.00	144,533,433	1.000000000 ^S	1,695,000.00	131,146,979	0	-13,386,454	-13,386,454
27,121.31000		12/28/2017		27,121.31	2,386,064	77.372848751 1.000000000 ^S	27,121.31	2,098,453	0	-287,611	-287,611
523.56000		12/29/2017		523.56	46,130	77.372848751 1.000000000 ^S	523.56	40,509	0	-5,621	-5,621
96,866.03000		12/29/2017		96,866.03	8,518,656	77.372848751 1.000000000 ^S	96,866.03	7,494,801	0	-1,023,855	-1,023,855
19,401.29000		01/09/2018		19,401.29	1,717,947	77.372848751 1.000000000 ^S	19,401.29	1,501,133	0	-216,814	-216,814
3,712.80000		01/17/2018		3,712.80	327,014	77.372848751 1.000000000 ^S	3,712.80	287,270	0	-39,744	-39,744
759,513.00000		01/17/2018		759,513.00	66,896,074	77.372848751 1.000000000 ^S	759,513.00	58,765,684	0	-8,130,390	-8,130,390
1,439,655.07000		01/17/2018		1,439,655.07	126,801,347	77.372848751 1.000000000 ^S	1,439,655.07	111,390,214	0	-15,411,133	-15,411,133
1,571,080.15000		01/17/2018		1,571,080.15	138,376,951	77.372848751 1.000000000 ^S	1,571,080.15	121,558,947	0	-16,818,004	-16,818,004
937.46000		01/31/2018		937.46	82,860	77.372848751 1.000000000 ^S	937.46	72,534	0	-10,326	-10,326
767,000.00000		02/09/2018		767,000.00	65,324,597	77.372848751 1.000000000 ^S	767,000.00	59,344,975	0	-5,979,622	-5,979,622
222,233.52000		02/13/2018		222,233.52	18,878,141	77.372848751 1.000000000 ^S	222,233.52	17,194,841	0	-1,683,300	-1,683,300
572.52000		02/28/2018		572.52	47,605	77.372848751 1.000000000 ^S	572.52	44,298	0	-3,307	-3,307
184,792.64000		03/16/2018		184,792.64	15,316,445	77.372848751 1.000000000 ^S	184,792.64	14,297,933	0	-1,018,512	-1,018,512
116,717.00000		03/22/2018		116,717.00	9,564,337	77.372848751 1.000000000 ^S	116,717.00	9,030,727	0	-533,610	-533,610
730,655.07000		03/22/2018		730,655.07	59,873,294	77.372848751 1.000000000 ^S	730,655.07	56,532,864	0	-3,340,430	-3,340,430

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,359,283.00000		03/22/2018		1,359,283.00	111,386,007	1.000000000 ^S 77.372848751	1,359,283.00	105,171,598	0	-6,214,409	-6,214,409
548.62000		03/29/2018		548.62	44,754	1.000000000 ^S 77.372848751	548.62	42,448	0	-2,306	-2,306
575,000.00000		04/18/2018		575,000.00	47,878,949	1.000000000 ^S 77.372848751	575,000.00	44,489,388	0	-3,389,561	-3,389,561
0.04000		04/30/2018		0.04	3	1.000000000 ^S 77.372848751	0.04	3	0	0	0
404.67000		04/30/2018		404.67	33,426	1.000000000 ^S 77.372848751	404.67	31,310	0	-2,116	-2,116
57,148.43000		05/08/2018		57,148.43	4,695,613	1.000000000 ^S 77.372848751	57,148.43	4,421,737	0	-273,876	-273,876
700,000.00000		05/15/2018		700,000.00	57,931,683	1.000000000 ^S 77.372848751	700,000.00	54,160,994	0	-3,770,689	-3,770,689
1,305,655.07000		05/16/2018		1,305,655.07	107,677,003	1.000000000 ^S 77.372848751	1,305,655.07	101,022,252	0	-6,654,751	-6,654,751
28,442.03000		05/24/2018		28,442.03	2,361,408	1.000000000 ^S 77.372848751	28,442.03	2,200,641	0	-160,767	-160,767
337.42000		05/31/2018		337.42	27,738	1.000000000 ^S 77.372848751	337.42	26,107	0	-1,631	-1,631
41,255.59000		06/05/2018		41,255.59	3,458,418	1.000000000 ^S 77.372848751	41,255.59	3,192,063	0	-266,355	-266,355
58,915.23000		06/06/2018		58,915.23	4,919,294	1.000000000 ^S 77.372848751	58,915.23	4,558,439	0	-360,855	-360,855
777,655.00000		06/13/2018		777,655.00	65,293,219	1.000000000 ^S 77.372848751	777,655.00	60,169,383	0	-5,123,836	-5,123,836
537.23000		06/29/2018		537.23	43,966	1.000000000 ^S 77.372848751	537.23	41,567	0	-2,399	-2,399
690,000.00000		07/24/2018		690,000.00	56,754,011	1.000000000 ^S 77.372848751	690,000.00	53,387,266	0	-3,366,745	-3,366,745
31,207.59000		07/30/2018		31,207.59	2,564,892	1.000000000 ^S 77.372848751	31,207.59	2,414,620	0	-150,272	-150,272

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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
377.22000		07/31/2018		377.22	31,391	1.000000000 ^S 77.372848751	377.22	29,187	0	-2,204	-2,204
144,861.46000		07/31/2018		144,861.46	11,909,905	1.000000000 ^S 77.372848751	144,861.46	11,208,344	0	-701,561	-701,561
118,572.90000		08/21/2018		118,572.90	9,567,568	1.000000000 ^S 77.372848751	118,572.90	9,174,323	0	-393,245	-393,245
110,597.95000		08/28/2018		110,597.95	9,022,493	1.000000000 ^S 77.372848751	110,597.95	8,557,278	0	-465,215	-465,215
110,062.03000		08/29/2018		110,062.03	8,986,444	1.000000000 ^S 77.372848751	110,062.03	8,515,813	0	-470,631	-470,631
541.98000		08/31/2018		541.98	43,462	1.000000000 ^S 77.372848751	541.98	41,935	0	-1,527	-1,527
35,715.85000		09/05/2018		35,715.85	2,856,195	1.000000000 ^S 77.372848751	35,715.85	2,763,437	0	-92,758	-92,758
10,030.29000		09/06/2018		10,030.29	804,746	1.000000000 ^S 77.372848751	10,030.29	776,072	0	-28,674	-28,674
587.18000		09/28/2018		587.18	48,257	1.000000000 ^S 77.372848751	587.18	45,432	0	-2,825	-2,825
446,987.00000		10/10/2018		446,987.00	35,791,150	1.000000000 ^S 77.372848751	446,987.00	34,584,658	0	-1,206,492	-1,206,492
653,013.00000		10/10/2018		653,013.00	52,288,067	1.000000000 ^S 77.372848751	653,013.00	50,525,476	0	-1,762,591	-1,762,591
606.11000		10/31/2018		606.11	48,480	1.000000000 ^S 77.372848751	606.11	46,896	0	-1,584	-1,584
9,875.75000		11/05/2018		9,875.75	804,182	1.000000000 ^S 77.372848751	9,875.75	764,115	0	-40,067	-40,067
459,000.00000		11/08/2018		459,000.00	37,882,262	1.000000000 ^S 77.372848751	459,000.00	35,514,138	0	-2,368,124	-2,368,124
340,876.48000		11/14/2018		340,876.48	27,993,030	1.000000000 ^S 77.372848751	340,876.48	26,374,584	0	-1,618,446	-1,618,446
258,427.01000		11/15/2018		258,427.01	21,246,604	1.000000000 ^S 77.372848751	258,427.01	19,995,234	0	-1,251,370	-1,251,370

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

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

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

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 2020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>											
653,013.00000		11/20/2018		653,013.00	53,686,499	1.000000000 ^S 77.372848751	653,013.00	50,525,476	0	-3,161,023	-3,161,023
1,657.84000		11/29/2018		1,657.84	136,528	1.000000000 ^S 77.372848751	1,657.84	128,272	0	-8,256	-8,256
554.37000		11/30/2018		554.37	45,968	1.000000000 ^S 77.372848751	554.37	42,893	0	-3,075	-3,075
94,945.23000		11/30/2018		94,945.23	7,866,272	1.000000000 ^S 77.372848751	94,945.23	7,346,183	0	-520,089	-520,089
56,052.05000		12/06/2018		56,052.05	4,609,486	1.000000000 ^S 77.372848751	56,052.05	4,336,907	0	-272,579	-272,579
48,583.36000		12/07/2018		48,583.36	3,938,270	1.000000000 ^S 77.372848751	48,583.36	3,759,033	0	-179,237	-179,237
722,616.57000		12/19/2018		722,616.57	58,370,578	1.000000000 ^S 77.372848751	722,616.57	55,910,903	0	-2,459,675	-2,459,675
748.57000		12/31/2018		748.57	57,819	1.000000000 ^S 77.372848751	748.57	57,919	0	100	100
0.09000		01/17/2019		0.09	7	1.000000000 ^S 77.372848751	0.09	7	0	0	0
44,669.10000		01/17/2019		44,669.10	3,490,922	1.000000000 ^S 77.372848751	44,669.10	3,456,176	0	-34,746	-34,746
8,335.47000		01/23/2019		8,335.47	651,153	1.000000000 ^S 77.372848751	8,335.47	644,939	0	-6,214	-6,214
48,430.88000		01/29/2019		48,430.88	3,793,245	1.000000000 ^S 77.372848751	48,430.88	3,747,235	0	-46,010	-46,010
722,616.57000		01/29/2019		722,616.57	56,597,394	1.000000000 ^S 77.372848751	722,616.57	55,910,903	0	-686,491	-686,491
44,745.30000		01/30/2019		44,745.30	3,497,538	1.000000000 ^S 77.372848751	44,745.30	3,462,071	0	-35,467	-35,467
481.63000		01/31/2019		481.63	38,219	1.000000000 ^S 77.372848751	481.63	37,265	0	-954	-954
12,725.41000		02/01/2019		12,725.41	1,009,804	1.000000000 ^S 77.372848751	12,725.41	984,601	0	-25,203	-25,203

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
587,000.00000		02/12/2019		587,000.00	45,794,312	1.000000000 ^S 77.372848751	587,000.00	45,417,862	0	-376,450	-376,450
276,145.36000		02/22/2019		276,145.36	21,664,268	1.000000000 ^S 77.372848751	276,145.36	21,366,153	0	-298,115	-298,115
7,748.98000		02/26/2019		7,748.98	616,211	1.000000000 ^S 77.372848751	7,748.98	599,561	0	-16,650	-16,650
474,707.41000		02/27/2019		474,707.41	37,717,403	1.000000000 ^S 77.372848751	474,707.41	36,729,465	0	-987,938	-987,938
344.55000		02/28/2019		344.55	27,288	1.000000000 ^S 77.372848751	344.55	26,659	0	-629	-629
130,705.64000		02/28/2019		130,705.64	10,352,769	1.000000000 ^S 77.372848751	130,705.64	10,113,068	0	-239,701	-239,701
122,045.83000		03/05/2019		122,045.83	9,671,860	1.000000000 ^S 77.372848751	122,045.83	9,443,034	0	-228,826	-228,826
6,205.83000		03/08/2019		6,205.83	486,732	1.000000000 ^S 77.372848751	6,205.83	480,163	0	-6,569	-6,569
50,174.39000		03/12/2019		50,174.39	3,937,071	1.000000000 ^S 77.372848751	50,174.39	3,882,135	0	-54,936	-54,936
1,309,616.57000		03/14/2019		1,309,616.57	103,235,373	1.000000000 ^S 77.372848751	1,309,616.57	101,328,765	0	-1,906,608	-1,906,608
817.38000		03/29/2019		817.38	64,267	1.000000000 ^S 77.372848751	817.38	63,243	0	-1,024	-1,024
980,000.00000		03/29/2019		980,000.00	76,680,395	1.000000000 ^S 77.372848751	980,000.00	75,825,392	0	-855,003	-855,003
348,561.68000		04/03/2019		348,561.68	27,414,241	1.000000000 ^S 77.372848751	348,561.68	26,969,210	0	-445,031	-445,031
757.42000		04/30/2019		757.42	59,375	1.000000000 ^S 77.372848751	757.42	58,604	0	-771	-771
225,051.00000		05/22/2019		225,051.00	17,131,923	1.000000000 ^S 77.372848751	225,051.00	17,412,837	0	280,914	280,914
270,321.00000		05/22/2019		270,321.00	20,578,085	1.000000000 ^S 77.372848751	270,321.00	20,915,506	0	337,421	337,421

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
824,616.57000		05/22/2019		824,616.57	62,773,628	1.000000000 ^S 77.372848751	824,616.57	63,802,933	0	1,029,305	1,029,305
969,628.00000		05/22/2019		969,628.00	73,812,569	1.000000000 ^S 77.372848751	969,628.00	75,022,881	0	1,210,312	1,210,312
23,246.84000		05/24/2019		23,246.84	1,756,916	1.000000000 ^S 77.372848751	23,246.84	1,798,674	0	41,758	41,758
9,866.90000		05/28/2019		9,866.90	747,461	1.000000000 ^S 77.372848751	9,866.90	763,430	0	15,969	15,969
406.98000		05/31/2019		406.98	30,616	1.000000000 ^S 77.372848751	406.98	31,489	0	873	873
407,039.23000		06/05/2019		407,039.23	30,767,128	1.000000000 ^S 77.372848751	407,039.23	31,493,785	0	726,657	726,657
108,816.91000		06/17/2019		108,816.91	8,116,170	1.000000000 ^S 77.372848751	108,816.91	8,419,474	0	303,304	303,304
264,480.03000		06/19/2019		264,480.03	19,708,851	1.000000000 ^S 77.372848751	264,480.03	20,463,573	0	754,722	754,722
279,974.49000		06/21/2019		279,974.49	20,833,547	1.000000000 ^S 77.372848751	279,974.49	21,662,424	0	828,877	828,877
28,800.40000		06/24/2019		28,800.40	2,145,362	1.000000000 ^S 77.372848751	28,800.40	2,228,369	0	83,007	83,007
21,821.41000		06/26/2019		21,821.41	1,626,618	1.000000000 ^S 77.372848751	21,821.41	1,688,385	0	61,767	61,767
55,817.33000		06/27/2019		55,817.33	4,195,210	1.000000000 ^S 77.372848751	55,817.33	4,318,746	0	123,536	123,536
350.04000		06/28/2019		350.04	26,465	1.000000000 ^S 77.372848751	350.04	27,084	0	619	619
27,908.70000		07/02/2019		27,908.70	2,106,119	1.000000000 ^S 77.372848751	27,908.70	2,159,376	0	53,257	53,257
59,549.79000		07/03/2019		59,549.79	4,503,747	1.000000000 ^S 77.372848751	59,549.79	4,607,537	0	103,790	103,790
131,731.93000		07/05/2019		131,731.93	9,968,860	1.000000000 ^S 77.372848751	131,731.93	10,192,475	0	223,615	223,615

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
1,131.71000		07/26/2019		1,131.71	85,538	1.000000000 ^S 77.372848751	1,131.71	87,564	0	2,026	2,026
114,258.08000		07/29/2019		114,258.08	8,579,187	1.000000000 ^S 77.372848751	114,258.08	8,840,473	0	261,286	261,286
4.01000		07/31/2019		4.01	300	1.000000000 ^S 77.372848751	4.01	310	0	10	10
417.64000		07/31/2019		417.64	31,254	1.000000000 ^S 77.372848751	417.64	32,314	0	1,060	1,060
134,803.62000		08/06/2019		134,803.62	9,687,573	1.000000000 ^S 77.372848751	134,803.62	10,430,140	0	742,567	742,567
86,380.36000		08/07/2019		86,380.36	6,225,477	1.000000000 ^S 77.372848751	86,380.36	6,683,495	0	458,018	458,018
143,214.88000		08/13/2019		143,214.88	10,194,166	1.000000000 ^S 77.372848751	143,214.88	11,080,943	0	886,777	886,777
39,099.81000		08/22/2019		39,099.81	2,826,023	1.000000000 ^S 77.372848751	39,099.81	3,025,264	0	199,241	199,241
971.71000		08/23/2019		971.71	69,976	1.000000000 ^S 77.372848751	971.71	75,184	0	5,208	5,208
121,648.02000		08/27/2019		121,648.02	8,734,737	1.000000000 ^S 77.372848751	121,648.02	9,412,254	0	677,517	677,517
61,537.04000		08/29/2019		61,537.04	4,393,490	1.000000000 ^S 77.372848751	61,537.04	4,761,296	0	367,806	367,806
153.50000		08/30/2019		153.50	10,978	1.000000000 ^S 77.372848751	153.50	11,877	0	899	899
15,452.99000		08/30/2019		15,452.99	1,107,096	1.000000000 ^S 77.372848751	15,452.99	1,195,642	0	88,546	88,546
55,856.26000		09/03/2019		55,856.26	3,992,855	1.000000000 ^S 77.372848751	55,856.26	4,321,758	0	328,903	328,903
48,430.88000		09/04/2019		48,430.88	3,464,290	1.000000000 ^S 77.372848751	48,430.88	3,747,235	0	282,945	282,945
54,952.37000		09/05/2019		54,952.37	3,962,710	1.000000000 ^S 77.372848751	54,952.37	4,251,821	0	289,111	289,111

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
64,772.08000		09/10/2019		64,772.08	4,770,186	1.000000000 ^S 77.372848751	64,772.08	5,011,600	0	241,414	241,414
153,971.37000		09/12/2019		153,971.37	11,376,349	1.000000000 ^S 77.372848751	153,971.37	11,913,204	0	536,855	536,855
41,554.36000		09/20/2019		41,554.36	3,053,248	1.000000000 ^S 77.372848751	41,554.36	3,215,179	0	161,931	161,931
971.71000		09/27/2019		971.71	70,724	1.000000000 ^S 77.372848751	971.71	75,184	0	4,460	4,460
154.70000		09/30/2019		154.70	11,276	1.000000000 ^S 77.372848751	154.70	11,970	0	694	694
441,818.69000		09/30/2019		441,818.69	32,367,102	1.000000000 ^S 77.372848751	441,818.69	34,184,771	0	1,817,669	1,817,669
252,253.40000		10/01/2019		252,253.40	18,387,049	1.000000000 ^S 77.372848751	252,253.40	19,517,564	0	1,130,515	1,130,515
23,141.04000		10/02/2019		23,141.04	1,670,366	1.000000000 ^S 77.372848751	23,141.04	1,790,488	0	120,122	120,122
14,691.66000		10/08/2019		14,691.66	1,060,324	1.000000000 ^S 77.372848751	14,691.66	1,136,736	0	76,412	76,412
42,474.00000		10/17/2019		42,474.00	3,117,927	1.000000000 ^S 77.372848751	42,474.00	3,286,334	0	168,407	168,407
494,616.57000		10/17/2019		494,616.57	36,308,766	1.000000000 ^S 77.372848751	494,616.57	38,269,893	0	1,961,127	1,961,127
796,526.00000		10/17/2019		796,526.00	58,471,304	1.000000000 ^S 77.372848751	796,526.00	61,629,486	0	3,158,182	3,158,182
93,901.30000		10/25/2019		93,901.30	6,952,942	1.000000000 ^S 77.372848751	93,901.30	7,265,411	0	312,469	312,469
1,189,000.00000		10/25/2019		1,189,000.00	88,039,755	1.000000000 ^S 77.372848751	1,189,000.00	91,996,317	0	3,956,562	3,956,562
80,888.08000		10/28/2019		80,888.08	5,997,956	1.000000000 ^S 77.372848751	80,888.08	6,258,541	0	260,585	260,585
174.01000		10/31/2019		174.01	12,960	1.000000000 ^S 77.372848751	174.01	13,464	0	504	504

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
54,378.37000		11/05/2019		54,378.37	4,072,485	1.000000000 ^S 77.372848751	54,378.37	4,207,409	0	134,924	134,924
40,069.97000		11/06/2019		40,069.97	3,015,842	1.000000000 ^S 77.372848751	40,069.97	3,100,328	0	84,486	84,486
44,114.45000		11/18/2019		44,114.45	3,268,289	1.000000000 ^S 77.372848751	44,114.45	3,413,261	0	144,972	144,972
1,583.93000		11/20/2019		1,583.93	117,312	1.000000000 ^S 77.372848751	1,583.93	122,553	0	5,241	5,241
57.48000		11/29/2019		57.48	4,258	1.000000000 ^S 77.372848751	57.48	4,447	0	189	189
58,114.35000		11/29/2019		58,114.35	4,306,495	1.000000000 ^S 77.372848751	58,114.35	4,496,473	0	189,978	189,978
98,741.57000		12/02/2019		98,741.57	7,314,041	1.000000000 ^S 77.372848751	98,741.57	7,639,917	0	325,876	325,876
48,402.75000		12/03/2019		48,402.75	3,598,527	1.000000000 ^S 77.372848751	48,402.75	3,745,059	0	146,532	146,532
32,537.11000		12/09/2019		32,537.11	2,414,911	1.000000000 ^S 77.372848751	32,537.11	2,517,489	0	102,578	102,578
172,797.71000		12/10/2019		172,797.71	12,818,591	1.000000000 ^S 77.372848751	172,797.71	13,369,851	0	551,260	551,260
1,198.23000		12/13/2019		1,198.23	90,365	1.000000000 ^S 77.372848751	1,198.23	92,710	0	2,345	2,345
83.64000		12/31/2019		83.64	6,390	1.000000000 ^S 77.372848751	83.64	6,471	0	81	81
29,041.67000		01/06/2020		29,041.67	2,182,412	1.000000000 ^S 77.372848751	29,041.67	2,247,037	0	64,625	64,625
1,470,000.00000		01/17/2020		1,470,000.00	111,680,575	1.000000000 ^S 77.372848751	1,470,000.00	113,738,088	0	2,057,513	2,057,513
29,041.67000		01/22/2020		29,041.67	2,189,532	1.000000000 ^S 77.372848751	29,041.67	2,247,037	0	57,505	57,505
141,977.62000		01/28/2020		141,977.62	10,448,495	1.000000000 ^S 77.372848751	141,977.62	10,985,213	0	536,718	536,718

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
181.73000		01/31/2020		181.73	13,186	1.000000000 ^S 77.372848751	181.73	14,061	0	875	875
98,842.82000		02/06/2020		98,842.82	7,316,767	1.000000000 ^S 77.372848751	98,842.82	7,647,751	0	330,984	330,984
7,549.76000		02/07/2020		7,549.76	559,446	1.000000000 ^S 77.372848751	7,549.76	584,146	0	24,700	24,700
95.44000		02/28/2020		95.44	6,637	1.000000000 ^S 77.372848751	95.44	7,384	0	747	747
57,889.69000		03/02/2020		57,889.69	4,025,994	1.000000000 ^S 77.372848751	57,889.69	4,479,090	0	453,096	453,096
272,839.00000		03/10/2020		272,839.00	18,623,739	1.000000000 ^S 77.372848751	272,839.00	21,110,331	0	2,486,592	2,486,592
659,818.00000		03/10/2020		659,818.00	45,038,569	1.000000000 ^S 77.372848751	659,818.00	51,051,998	0	6,013,429	6,013,429
700,000.00000		03/10/2020		700,000.00	47,781,355	1.000000000 ^S 77.372848751	700,000.00	54,160,994	0	6,379,639	6,379,639
18.70000		03/31/2020		18.70	1,236	1.000000000 ^S 77.372848751	18.70	1,447	0	211	211
71,462.33000		04/01/2020		71,462.33	4,721,792	1.000000000 ^S 77.372848751	71,462.33	5,529,244	0	807,452	807,452
9,680.58000		04/21/2020		9,680.58	665,714	1.000000000 ^S 77.372848751	9,680.58	749,014	0	83,300	83,300
63,772.17000		04/23/2020		63,772.17	4,339,960	1.000000000 ^S 77.372848751	63,772.17	4,934,234	0	594,274	594,274
251,782.00000		05/19/2020		251,782.00	17,578,822	1.000000000 ^S 77.372848751	251,782.00	19,481,091	0	1,902,269	1,902,269
255,125.00000		05/19/2020		255,125.00	17,812,223	1.000000000 ^S 77.372848751	255,125.00	19,739,748	0	1,927,525	1,927,525
273,093.00000		05/19/2020		273,093.00	19,066,706	1.000000000 ^S 77.372848751	273,093.00	21,129,983	0	2,063,277	2,063,277
895,616.57000		05/19/2020		895,616.57	62,529,825	1.000000000 ^S 77.372848751	895,616.57	69,296,405	0	6,766,580	6,766,580

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

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

(注 2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	単価／ 為替レート	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	未実現損益 通貨 （円）	合計 （円）
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
71,152.03000		05/29/2020		71,152.03	5,099,670	1.000000000 ^S 77.372848751	71,152.03	5,505,235	0	405,565	405,565
977.46000		06/02/2020		977.46	71,336	1.000000000 ^S 77.372848751	977.46	75,629	0	4,293	4,293
825,000.00000		06/19/2020		825,000.00	60,452,907	1.000000000 ^S 77.372848751	825,000.00	63,832,600	0	3,379,693	3,379,693
14,449.44000		06/24/2020		14,449.44	1,068,462	1.000000000 ^S 77.372848751	14,449.44	1,117,994	0	49,532	49,532
7,942.71000		06/29/2020		7,942.71	583,600	1.000000000 ^S 77.372848751	7,942.71	614,550	0	30,950	30,950
500,000.00000		07/10/2020		500,000.00	37,343,226	1.000000000 ^S 77.372848751	500,000.00	38,686,424	0	1,343,198	1,343,198
187,138.00000		07/28/2020		187,138.00	14,063,868	1.000000000 ^S 77.372848751	187,138.00	14,479,400	0	415,532	415,532
368,862.00000		07/28/2020		368,862.00	27,720,860	1.000000000 ^S 77.372848751	368,862.00	28,539,904	0	819,044	819,044
1,664,616.57000		07/28/2020		1,664,616.57	125,099,912	1.000000000 ^S 77.372848751	1,664,616.57	128,796,126	0	3,696,214	3,696,214
8,497.85000		07/30/2020		8,497.85	639,909	1.000000000 ^S 77.372848751	8,497.85	657,503	0	17,594	17,594
417,000.00000		08/12/2020		417,000.00	31,803,007	1.000000000 ^S 77.372848751	417,000.00	32,264,478	0	461,471	461,471
71,170.60000		08/17/2020		71,170.60	5,434,220	1.000000000 ^S 77.372848751	71,170.60	5,506,672	0	72,452	72,452
900,000.00000		08/24/2020		900,000.00	68,215,418	1.000000000 ^S 77.372848751	900,000.00	69,635,564	0	1,420,146	1,420,146
978.97000		08/25/2020		978.97	74,331	1.000000000 ^S 77.372848751	978.97	75,746	0	1,415	1,415
32,913.88000		08/27/2020		32,913.88	2,523,983	1.000000000 ^S 77.372848751	32,913.88	2,546,641	0	22,658	22,658
-200,038.08000		12/09/2014		-200,038.08	-20,104,285	1.000000000 ^S 77.372848751	-200,038.08	-15,477,516	0	4,626,769	4,626,769

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-128,649.45000		12/10/2014		-128,649.45	-12,782,326	1.000000000 ^S 77.372848751	-128,649.45	-9,953,974	0	2,828,352	2,828,352
-701,988.29000		12/11/2014		-701,988.29	-69,264,315	1.000000000 ^S 77.372848751	-701,988.29	-54,314,834	0	14,949,481	14,949,481
-69,226.87000		12/11/2014		-69,226.87	-6,830,529	1.000000000 ^S 77.372848751	-69,226.87	-5,356,280	0	1,474,249	1,474,249
-233,220.13000		12/12/2014		-233,220.13	-22,988,872	1.000000000 ^S 77.372848751	-233,220.13	-18,044,906	0	4,943,966	4,943,966
-1,012,066.41000		12/15/2014		-1,012,066.41	-98,967,724	1.000000000 ^S 77.372848751	-1,012,066.41	-78,306,461	0	20,661,263	20,661,263
-882,994.13000		12/15/2014		-882,994.13	-86,346,033	1.000000000 ^S 77.372848751	-882,994.13	-68,319,771	0	18,026,262	18,026,262
-667,933.59000		12/15/2014		-667,933.59	-65,315,741	1.000000000 ^S 77.372848751	-667,933.59	-51,679,925	0	13,635,816	13,635,816
-230,255.10000		12/16/2014		-230,255.10	-22,377,237	1.000000000 ^S 77.372848751	-230,255.10	-17,815,493	0	4,561,744	4,561,744
-67,739.36000		12/17/2014		-67,739.36	-6,523,402	1.000000000 ^S 77.372848751	-67,739.36	-5,241,187	0	1,282,215	1,282,215
-244,669.86000		12/19/2014		-244,669.86	-23,723,117	1.000000000 ^S 77.372848751	-244,669.86	-18,930,804	0	4,792,313	4,792,313
-148,648.91000		12/22/2014		-148,648.91	-14,467,922	1.000000000 ^S 77.372848751	-148,648.91	-11,501,390	0	2,966,532	2,966,532
-151,043.46000		12/24/2014		-151,043.46	-14,765,543	1.000000000 ^S 77.372848751	-151,043.46	-11,686,663	0	3,078,880	3,078,880
-105,843.81000		01/05/2015		-105,843.81	-10,336,129	1.000000000 ^S 77.372848751	-105,843.81	-8,189,437	0	2,146,692	2,146,692
-204,027.32000		01/07/2015		-204,027.32	-19,651,794	1.000000000 ^S 77.372848751	-204,027.32	-15,786,175	0	3,865,619	3,865,619
-92,171.03000		01/08/2015		-92,171.03	-8,853,375	1.000000000 ^S 77.372848751	-92,171.03	-7,131,535	0	1,721,840	1,721,840
-686,560.80000		01/09/2015		-686,560.80	-66,622,818	1.000000000 ^S 77.372848751	-686,560.80	-53,121,165	0	13,501,653	13,501,653

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
-296,399.69000		01/13/2015		-296,399.69	-28,690,461	1.000000000 ^S 77.372848751	-296,399.69	-22,933,288	0	5,757,173	5,757,173
-20,527.98000		01/14/2015		-20,527.98	-1,983,598	1.000000000 ^S 77.372848751	-20,527.98	-1,588,308	0	395,290	395,290
-39,405.57000		01/15/2015		-39,405.57	-3,758,292	1.000000000 ^S 77.372848751	-39,405.57	-3,048,921	0	709,371	709,371
-39,335.92000		01/21/2015		-39,335.92	-3,807,263	1.000000000 ^S 77.372848751	-39,335.92	-3,043,532	0	763,731	763,731
-144,341.08000		01/22/2015		-144,341.08	-13,851,088	1.000000000 ^S 77.372848751	-144,341.08	-11,168,081	0	2,683,007	2,683,007
-140,447.93000		01/22/2015		-140,447.93	-13,477,498	1.000000000 ^S 77.372848751	-140,447.93	-10,866,856	0	2,610,642	2,610,642
-131,846.04000		01/22/2015		-131,846.04	-12,652,054	1.000000000 ^S 77.372848751	-131,846.04	-10,201,304	0	2,450,750	2,450,750
-11,116.87000		01/22/2015		-11,116.87	-1,066,784	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,116.87	-860,144	0	206,640	206,640
-9,303.87000		01/28/2015		-9,303.87	-869,334	1.000000000 ^S 77.372848751	-9,303.87	-719,867	0	149,467	149,467
-258,206.95000		02/05/2015		-258,206.95	-23,515,972	1.000000000 ^S 77.372848751	-258,206.95	-19,978,207	0	3,537,765	3,537,765
-128,192.28000		02/09/2015		-128,192.28	-11,912,251	1.000000000 ^S 77.372848751	-128,192.28	-9,918,602	0	1,993,649	1,993,649
-76,498.09000		02/10/2015		-76,498.09	-7,094,696	1.000000000 ^S 77.372848751	-76,498.09	-5,918,875	0	1,175,821	1,175,821
-643,025.87000		02/12/2015		-643,025.87	-59,704,371	1.000000000 ^S 77.372848751	-643,025.87	-49,752,743	0	9,951,628	9,951,628
-195,720.57000		02/18/2015		-195,720.57	-18,170,317	1.000000000 ^S 77.372848751	-195,720.57	-15,143,458	0	3,026,859	3,026,859
-12,078.57000		02/20/2015		-12,078.57	-1,119,958	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,078.57	-934,553	0	185,405	185,405
-203,751.45000		02/23/2015		-203,751.45	-18,949,081	1.000000000 ^S 77.372848751	-203,751.45	-15,764,830	0	3,184,251	3,184,251

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-16,686.40000		02/25/2015		-16,686.40	-1,554,713	1.000000000 ^S 77.372848751	-16,686.40	-1,291,074	0	263,639	263,639
-164,421.91000		03/02/2015		-164,421.91	-15,385,592	1.000000000 ^S 77.372848751	-164,421.91	-12,721,792	0	2,663,800	2,663,800
-12,405.71000		03/03/2015		-12,405.71	-1,159,873	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,405.71	-959,865	0	200,008	200,008
-125,474.92000		03/06/2015		-125,474.92	-11,724,150	1.000000000 ^S 77.372848751	-125,474.92	-9,708,352	0	2,015,798	2,015,798
-152,618.80000		03/09/2015		-152,618.80	-14,295,699	1.000000000 ^S 77.372848751	-152,618.80	-11,808,551	0	2,487,148	2,487,148
-708,611.63000		03/11/2015		-708,611.63	-65,607,231	1.000000000 ^S 77.372848751	-708,611.63	-54,827,300	0	10,779,931	10,779,931
-27,978.64000		03/11/2015		-27,978.64	-2,590,419	1.000000000 ^S 77.372848751	-27,978.64	-2,164,787	0	425,632	425,632
-174,287.44000		03/13/2015		-174,287.44	-16,285,835	1.000000000 ^S 77.372848751	-174,287.44	-13,485,116	0	2,800,719	2,800,719
-7,763.28000		03/17/2015		-7,763.28	-720,984	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,763.28	-600,667	0	120,317	120,317
-302,844.98000		03/23/2015		-302,844.98	-28,263,848	1.000000000 ^S 77.372848751	-302,844.98	-23,431,979	0	4,831,869	4,831,869
-97,995.40000		03/25/2015		-97,995.40	-9,248,315	1.000000000 ^S 77.372848751	-97,995.40	-7,582,183	0	1,666,132	1,666,132
-172,798.05000		03/26/2015		-172,798.05	-16,206,911	1.000000000 ^S 77.372848751	-172,798.05	-13,369,877	0	2,837,034	2,837,034
-975,466.76000		03/27/2015		-975,466.76	-90,954,622	1.000000000 ^S 77.372848751	-975,466.76	-75,474,642	0	15,479,980	15,479,980
-256,508.24000		03/30/2015		-256,508.24	-23,694,394	1.000000000 ^S 77.372848751	-256,508.24	-19,846,773	0	3,847,621	3,847,621
-189,563.24000		03/31/2015		-189,563.24	-17,377,298	1.000000000 ^S 77.372848751	-189,563.24	-14,667,048	0	2,710,250	2,710,250
-206,250.64000		04/02/2015		-206,250.64	-18,798,942	1.000000000 ^S 77.372848751	-206,250.64	-15,958,200	0	2,840,742	2,840,742

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通 貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-90,318.63000		04/07/2015		-90,318.63	-8,194,681	1.000000000 ^S 77.372848751	-90,318.63	-6,988,210	0	1,206,471	1,206,471
-74,243.21000		04/08/2015		-74,243.21	-6,835,651	1.000000000 ^S 77.372848751	-74,243.21	-5,744,409	0	1,091,242	1,091,242
-78,171.43000		04/09/2015		-78,171.43	-7,218,890	1.000000000 ^S 77.372848751	-78,171.43	-6,048,346	0	1,170,544	1,170,544
-705,086.17000		04/13/2015		-705,086.17	-65,108,703	1.000000000 ^S 77.372848751	-705,086.17	-54,554,526	0	10,554,177	10,554,177
-37,651.50000		04/13/2015		-37,651.50	-3,476,795	1.000000000 ^S 77.372848751	-37,651.50	-2,913,204	0	563,591	563,591
-246,307.80000		04/14/2015		-246,307.80	-22,433,763	1.000000000 ^S 77.372848751	-246,307.80	-19,057,536	0	3,376,227	3,376,227
-57,294.63000		04/15/2015		-57,294.63	-5,220,124	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,294.63	-4,433,049	0	787,075	787,075
-39,422.26000		04/20/2015		-39,422.26	-3,646,622	1.000000000 ^S 77.372848751	-39,422.26	-3,050,213	0	596,409	596,409
-167,462.13000		04/21/2015		-167,462.13	-15,429,360	1.000000000 ^S 77.372848751	-167,462.13	-12,957,022	0	2,472,338	2,472,338
-11,204.33000		04/21/2015		-11,204.33	-1,032,327	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,204.33	-866,911	0	165,416	165,416
-58,785.17000		04/23/2015		-58,785.17	-5,468,165	1.000000000 ^S 77.372848751	-58,785.17	-4,548,376	0	919,789	919,789
-203,446.05000		04/24/2015		-203,446.05	-18,910,269	1.000000000 ^S 77.372848751	-203,446.05	-15,741,200	0	3,169,069	3,169,069
-19,719.18000		04/27/2015		-19,719.18	-1,835,889	1.000000000 ^S 77.372848751	-19,719.18	-1,525,729	0	310,160	310,160
-746,896.35000		04/28/2015		-746,896.35	-69,998,726	1.000000000 ^S 77.372848751	-746,896.35	-57,789,498	0	12,209,228	12,209,228
-47,545.85000		04/30/2015		-47,545.85	-4,556,043	1.000000000 ^S 77.372848751	-47,545.85	-3,678,758	0	877,285	877,285
-35,878.86000		05/11/2015		-35,878.86	-3,395,944	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,878.86	-2,776,050	0	619,894	619,894

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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通 貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-59,220.06000		05/12/2015		-59,220.06	-5,621,675	1.000000000S 77.372848751	-59,220.06	-4,582,025	0	1,039,650	1,039,650
-684,441.51000		05/13/2015		-684,441.51	-65,461,528	1.000000000S 77.372848751	-684,441.51	52,957,189	0	12,504,339	12,504,339
-157,020.19000		05/13/2015		-157,020.19	-15,017,765	1.000000000S 77.372848751	-157,020.19	12,149,099	0	2,868,666	2,868,666
-45,251.01000		05/15/2015		-45,251.01	-4,364,516	1.000000000S 77.372848751	-45,251.01	-3,501,200	0	863,316	863,316
-518,763.75000		05/20/2015		-518,763.75	-49,524,085	1.000000000S 77.372848751	-518,763.75	40,138,229	0	9,385,856	9,385,856
-6,306.57000		05/22/2015		-6,306.57	-601,860	1.000000000S 77.372848751	-6,306.57	-487,957	0	113,903	113,903
-52,113.71000		05/26/2015		-52,113.71	-4,952,607	1.000000000S 77.372848751	-52,113.71	-4,032,186	0	920,421	920,421
-393,354.22000		05/29/2015		-393,354.22	-37,332,985	1.000000000S 77.372848751	-393,354.22	30,434,937	0	6,898,048	6,898,048
-245,742.67000		06/01/2015		-245,742.67	-23,342,732	1.000000000S 77.372848751	-245,742.67	19,013,810	0	4,328,922	4,328,922
-5,170.70000		06/02/2015		-5,170.70	-490,237	1.000000000S 77.372848751	-5,170.70	-400,072	0	90,165	90,165
-78,821.02000		06/03/2015		-78,821.02	-7,578,180	1.000000000S 77.372848751	-78,821.02	-6,098,607	0	1,479,573	1,479,573
-113,860.14000		06/10/2015		-113,860.14	-10,869,006	1.000000000S 77.372848751	-113,860.14	-8,809,683	0	2,059,323	2,059,323
-666,844.90000		06/11/2015		-666,844.90	-63,423,573	1.000000000S 77.372848751	-666,844.90	51,595,690	0	11,827,883	11,827,883
-110,710.67000		06/11/2015		-110,710.67	-10,529,684	1.000000000S 77.372848751	-110,710.67	-8,566,000	0	1,963,684	1,963,684
-54,834.71000		06/12/2015		-54,834.71	-5,234,697	1.000000000S 77.372848751	-54,834.71	-4,242,718	0	991,979	991,979
-83,284.46000		06/15/2015		-83,284.46	-7,946,384	1.000000000S 77.372848751	-83,284.46	-6,443,956	0	1,502,428	1,502,428

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-479,833.36000		06/16/2015		-479,833.36	-46,020,105	1.000000000 ^S	-479,833.36	-37,126,074	0	8,894,031	8,894,031
						77.372848751					
-17,695.85000		06/16/2015		-17,695.85	-1,697,183	1.000000000 ^S	-17,695.85	-1,369,178	0	328,005	328,005
						77.372848751					
-470,587.90000		06/18/2015		-470,587.90	-44,826,446	1.000000000 ^S	-470,587.90	-36,410,726	0	8,415,720	8,415,720
						77.372848751					
-156,011.32000		06/19/2015		-156,011.32	-15,014,828	1.000000000 ^S	-156,011.32	-12,071,040	0	2,943,788	2,943,788
						77.372848751					
-49,769.29000		06/22/2015		-49,769.29	-4,738,361	1.000000000 ^S	-49,769.29	-3,850,792	0	887,569	887,569
						77.372848751					
-106,347.76000		06/24/2015		-106,347.76	-10,178,922	1.000000000 ^S	-106,347.76	-8,228,429	0	1,950,493	1,950,493
						77.372848751					
-13,612.05000		06/25/2015		-13,612.05	-1,301,380	1.000000000 ^S	-13,612.05	-1,053,203	0	248,177	248,177
						77.372848751					
-255,184.50000		06/29/2015		-255,184.50	-24,175,877	1.000000000 ^S	-255,184.50	-19,744,352	0	4,431,525	4,431,525
						77.372848751					
-321,067.80000		06/30/2015		-321,067.80	-30,136,472	1.000000000 ^S	-321,067.80	-24,841,930	0	5,294,542	5,294,542
						77.372848751					
-64,733.44000		07/01/2015		-64,733.44	-6,088,164	1.000000000 ^S	-64,733.44	-5,008,611	0	1,079,553	1,079,553
						77.372848751					
-28,970.18000		07/06/2015		-28,970.18	-2,672,746	1.000000000 ^S	-28,970.18	-2,241,505	0	431,241	431,241
						77.372848751					
-19,343.07000		07/08/2015		-19,343.07	-1,755,373	1.000000000 ^S	-19,343.07	-1,496,628	0	258,745	258,745
						77.372848751					
-676,268.27000		07/10/2015		-676,268.27	-60,941,337	1.000000000 ^S	-676,268.27	-52,324,803	0	8,616,534	8,616,534
						77.372848751					
-68,449.88000		07/10/2015		-68,449.88	-6,168,302	1.000000000 ^S	-68,449.88	-5,296,162	0	872,140	872,140
						77.372848751					
-275,119.99000		07/13/2015		-275,119.99	-25,043,111	1.000000000 ^S	-275,119.99	-21,286,817	0	3,756,294	3,756,294
						77.372848751					
-93,052.47000		07/21/2015		-93,052.47	-8,525,992	1.000000000 ^S	-93,052.47	-7,199,735	0	1,326,257	1,326,257
						77.372848751					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	未実現損益 市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-73,784.97000		07/21/2015		-73,784.97	-6,760,595	1.000000000S 77.372848751	-73,784.97	-5,708,953	0	1,051,642	1,051,642
-110,427.24000		07/22/2015		-110,427.24	-10,172,242	1.000000000S 77.372848751	-110,427.24	-8,544,070	0	1,628,172	1,628,172
-164,563.52000		07/23/2015		-164,563.52	-15,061,940	1.000000000S 77.372848751	-164,563.52	-12,732,748	0	2,329,192	2,329,192
-87,873.33000		07/27/2015		-87,873.33	-7,910,912	1.000000000S 77.372848751	-87,873.33	-6,799,010	0	1,111,902	1,111,902
-13,601.15000		07/28/2015		-13,601.15	-1,221,936	1.000000000S 77.372848751	-13,601.15	-1,052,360	0	169,576	169,576
-59,933.50000		08/05/2015		-59,933.50	-5,510,135	1.000000000S 77.372848751	-59,933.50	-4,637,226	0	872,909	872,909
-143,187.55000		08/06/2015		-143,187.55	-13,144,987	1.000000000S 77.372848751	-143,187.55	-11,078,829	0	2,066,158	2,066,158
-158,035.75000		08/10/2015		-158,035.75	-14,529,172	1.000000000S 77.372848751	-158,035.75	-12,227,676	0	2,301,496	2,301,496
-669,741.07000		08/11/2015		-669,741.07	-61,661,426	1.000000000S 77.372848751	-669,741.07	-51,819,775	0	9,841,651	9,841,651
-284,337.22000		08/11/2015		-284,337.22	-26,178,234	1.000000000S 77.372848751	-284,337.22	-21,999,981	0	4,178,253	4,178,253
-		08/12/2015		-	-	1.000000000S 77.372848751	-	-	0	108,238,657	108,238,657
7,892,527.01000		08/12/2015		7,892,527.01	718,905,956	1.000000000S 77.372848751	7,892,527.01	610,667,299	0	108,238,657	108,238,657
-156,845.94000		08/13/2015		-156,845.94	-14,320,359	1.000000000S 77.372848751	-156,845.94	-12,135,617	0	2,184,742	2,184,742
-53,128.21000		08/14/2015		-53,128.21	-4,863,119	1.000000000S 77.372848751	-53,128.21	-4,110,681	0	752,438	752,438
-162,199.09000		08/17/2015		-162,199.09	-14,865,372	1.000000000S 77.372848751	-162,199.09	-12,549,806	0	2,315,566	2,315,566
-21,061.93000		08/19/2015		-21,061.93	-1,921,161	1.000000000S 77.372848751	-21,061.93	-1,629,622	0	291,539	291,539
-265,076.96000		08/20/2015		-265,076.96	-24,126,074	1.000000000S 77.372848751	-265,076.96	-20,509,760	0	3,616,314	3,616,314

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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-19,404.32000		08/24/2015		-19,404.32	-213	1.000000000 ^S 77.372848751	-19,404.32	-1,501,368	0	-1,501,155	-1,501,155
-196,668.41000		08/25/2015		-196,668.41	-16,800,889	1.000000000 ^S 77.372848751	-196,668.41	-15,216,795	0	1,584,094	1,584,094
-462,149.98000		08/26/2015		-462,149.98	-39,759,612	1.000000000 ^S 77.372848751	-462,149.98	-35,757,861	0	4,001,751	4,001,751
-32,107.10000		08/27/2015		-32,107.10	-2,718,823	1.000000000 ^S 77.372848751	-32,107.10	-2,484,218	0	234,605	234,605
-86,093.85000		09/01/2015		-86,093.85	-7,396,676	1.000000000 ^S 77.372848751	-86,093.85	-6,661,326	0	735,350	735,350
-93,737.05000		09/02/2015		-93,737.05	-7,905,601	1.000000000 ^S 77.372848751	-93,737.05	-7,252,703	0	652,898	652,898
-4,157.48000		09/03/2015		-4,157.48	-349,983	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,157.48	-321,676	0	28,307	28,307
-102,367.87000		09/04/2015		-102,367.87	-8,650,619	1.000000000 ^S 77.372848751	-102,367.87	-7,920,494	0	730,125	730,125
-642,283.89000		09/09/2015		-642,283.89	-53,850,984	1.000000000 ^S 77.372848751	-642,283.89	-49,695,334	0	4,155,650	4,155,650
-476,290.57000		09/10/2015		-476,290.57	-40,505,866	1.000000000 ^S 77.372848751	-476,290.57	-36,851,958	0	3,653,908	3,653,908
-107,114.37000		09/11/2015		-107,114.37	-9,136,362	1.000000000 ^S 77.372848751	-107,114.37	-8,287,744	0	848,618	848,618
-575,423.39000		09/14/2015		-575,423.39	-48,988,118	1.000000000 ^S 77.372848751	-575,423.39	-44,522,147	0	4,465,971	4,465,971
-92,596.64000		09/14/2015		-92,596.64	-7,883,126	1.000000000 ^S 77.372848751	-92,596.64	-7,164,466	0	718,660	718,660
-636,341.83000		09/15/2015		-636,341.83	-54,620,063	1.000000000 ^S 77.372848751	-636,341.83	-49,235,580	0	5,384,483	5,384,483
-57,680.52000		09/16/2015		-57,680.52	-4,915,496	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,680.52	-4,462,906	0	452,590	452,590
-148,138.07000		09/17/2015		-148,138.07	-12,842,800	1.000000000 ^S 77.372848751	-148,138.07	-11,461,864	0	1,380,936	1,380,936

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

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

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

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 2020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)	未実現損益 市場 (円)	通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-888,355.94000		09/18/2015		-888,355.94	-76,774,291	1.000000000 ^S 77.372848751	-888,355.94	-68,734,630	0	8,039,661	8,039,661
-252,646.81000		09/24/2015		-252,646.81	-21,364,671	1.000000000 ^S 77.372848751	-252,646.81	-19,548,003	0	1,816,668	1,816,668
-49,056.91000		09/25/2015		-49,056.91	-4,093,695	1.000000000 ^S 77.372848751	-49,056.91	-3,795,673	0	298,022	298,022
-72,142.91000		09/28/2015		-72,142.91	-6,115,979	1.000000000 ^S 77.372848751	-72,142.91	-5,581,902	0	534,077	534,077
-70,823.93000		09/30/2015		-70,823.93	-5,954,410	1.000000000 ^S 77.372848751	-70,823.93	-5,479,849	0	474,561	474,561
-198,025.63000		10/01/2015		-198,025.63	-16,654,940	1.000000000 ^S 77.372848751	-198,025.63	-15,321,807	0	1,333,133	1,333,133
-122,307.91000		10/06/2015		-122,307.91	-10,416,695	1.000000000 ^S 77.372848751	-122,307.91	-9,463,311	0	953,384	953,384
-39,456.54000		10/06/2015		-39,456.54	-3,360,426	1.000000000 ^S 77.372848751	-39,456.54	-3,052,865	0	307,561	307,561
-17,998.66000		10/07/2015		-17,998.66	-1,543,637	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,998.66	-1,392,608	0	151,029	151,029
-94,044.65000		10/08/2015		-94,044.65	-8,145,767	1.000000000 ^S 77.372848751	-94,044.65	-7,276,502	0	869,265	869,265
-413,942.78000		10/09/2015		-413,942.78	-35,732,854	1.000000000 ^S 77.372848751	-413,942.78	-32,027,932	0	3,704,922	3,704,922
-18,029.52000		10/09/2015		-18,029.52	-1,556,365	1.000000000 ^S 77.372848751	-18,029.52	-1,394,995	0	161,370	161,370
-201,846.72000		10/15/2015		-201,846.72	-17,479,324	1.000000000 ^S 77.372848751	-201,846.72	-15,617,456	0	1,861,868	1,861,868
-106,109.09000		10/15/2015		-106,109.09	-9,188,731	1.000000000 ^S 77.372848751	-106,109.09	-8,209,963	0	978,768	978,768
-13,046.14000		10/16/2015		-13,046.14	-1,131,560	1.000000000 ^S 77.372848751	-13,046.14	-1,009,417	0	122,143	122,143
-938,332.24000		10/22/2015		-938,332.24	-81,210,340	1.000000000 ^S 77.372848751	-938,332.24	-72,601,438	0	8,608,902	8,608,902

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通 貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-52,217.18000		10/26/2015		-52,217.18	-4,570,998	1.000000000S 77.372848751	-52,217.18	-4,040,192	0	530,806	530,806
-156,124.38000		10/27/2015		-156,124.38	-13,705,268	1.000000000S 77.372848751	-156,124.38	12,079,788	0	1,625,480	1,625,480
-221,516.12000		10/30/2015		-221,516.12	-18,997,458	1.000000000S 77.372848751	-221,516.12	17,139,333	0	1,858,125	1,858,125
-22,603.85000		11/05/2015		-22,603.85	-1,966,401	1.000000000S 77.372848751	-22,603.85	-1,748,924	0	217,477	217,477
-28,494.89000		11/06/2015		-28,494.89	-2,474,770	1.000000000S 77.372848751	-28,494.89	-2,204,731	0	270,039	270,039
-33,113.93000		11/10/2015		-33,113.93	-2,878,332	1.000000000S 77.372848751	-33,113.93	-2,562,119	0	316,213	316,213
-908,189.06000		11/12/2015		-908,189.06	-78,762,965	1.000000000S 77.372848751	-908,189.06	70,269,175	0	8,493,790	8,493,790
-377,515.60000		11/12/2015		-377,515.60	-32,740,152	1.000000000S 77.372848751	-377,515.60	29,209,457	0	3,530,695	3,530,695
-6,155.13000		11/13/2015		-6,155.13	-537,849	1.000000000S 77.372848751	-6,155.13	-476,240	0	61,609	61,609
-156,394.49000		11/17/2015		-156,394.49	-13,637,532	1.000000000S 77.372848751	-156,394.49	12,100,687	0	1,536,845	1,536,845
-16,749.47000		11/18/2015		-16,749.47	-1,472,174	1.000000000S 77.372848751	-16,749.47	-1,295,954	0	176,220	176,220
-535,263.52000		11/19/2015		-535,263.52	-46,835,996	1.000000000S 77.372848751	-535,263.52	41,414,863	0	5,421,133	5,421,133
-171,111.94000		11/20/2015		-171,111.94	-15,132,801	1.000000000S 77.372848751	-171,111.94	13,239,418	0	1,893,383	1,893,383
-74,491.46000		11/24/2015		-74,491.46	-6,589,055	1.000000000S 77.372848751	-74,491.46	-5,763,616	0	825,439	825,439
-907,253.22000		11/25/2015		-907,253.22	-80,284,748	1.000000000S 77.372848751	-907,253.22	70,196,766	0	10,087,982	10,087,982
-124,050.79000		11/27/2015		-124,050.79	-10,988,000	1.000000000S 77.372848751	-124,050.79	-9,598,163	0	1,389,837	1,389,837

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-125,483.80000		12/01/2015		-125,483.80	-11,209,303	1.000000000 ^S 77.372848751	-125,483.80	-9,709,039	0	1,500,264	1,500,264
-29,511.79000		12/03/2015		-29,511.79	-2,666,440	1.000000000 ^S 77.372848751	-29,511.79	-2,283,411	0	383,029	383,029
-33,063.02000		12/04/2015		-33,063.02	-2,969,898	1.000000000 ^S 77.372848751	-33,063.02	-2,558,180	0	411,718	411,718
-33,111.98000		12/08/2015		-33,111.98	-2,969,410	1.000000000 ^S 77.372848751	-33,111.98	-2,561,968	0	407,442	407,442
-329,209.04000		12/09/2015		-329,209.04	-29,234,099	1.000000000 ^S 77.372848751	-329,209.04	-25,471,841	0	3,762,258	3,762,258
-29,648.06000		12/10/2015		-29,648.06	-2,614,894	1.000000000 ^S 77.372848751	-29,648.06	-2,293,955	0	320,939	320,939
-327,000.00000		12/11/2015		-327,000.00	-28,998,504	1.000000000 ^S 77.372848751	-327,000.00	-25,300,922	0	3,697,582	3,697,582
-92,475.65000		12/11/2015		-92,475.65	-8,200,781	1.000000000 ^S 77.372848751	-92,475.65	-7,155,104	0	1,045,677	1,045,677
-57,766.60000		12/11/2015		-57,766.60	-5,122,768	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,766.60	-4,469,566	0	653,202	653,202
-34,992.57000		12/14/2015		-34,992.57	-3,051,138	1.000000000 ^S 77.372848751	-34,992.57	-2,707,475	0	343,663	343,663
-288,079.45000		12/15/2015		-288,079.45	-25,176,774	1.000000000 ^S 77.372848751	-288,079.45	-22,289,528	0	2,887,246	2,887,246
-109,269.69000		12/16/2015		-109,269.69	-9,536,047	1.000000000 ^S 77.372848751	-109,269.69	-8,454,507	0	1,081,540	1,081,540
-26,796.21000		12/18/2015		-26,796.21	-2,338,039	1.000000000 ^S 77.372848751	-26,796.21	-2,073,299	0	264,740	264,740
-35,901.50000		12/30/2015		-35,901.50	-3,154,307	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,901.50	-2,777,801	0	376,506	376,506
-191,729.95000		01/04/2016		-191,729.95	-16,780,325	1.000000000 ^S 77.372848751	-191,729.95	-14,834,692	0	1,945,633	1,945,633
-223,008.99000		01/05/2016		-223,008.99	-19,064,056	1.000000000 ^S 77.372848751	-223,008.99	-17,254,841	0	1,809,215	1,809,215

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-17,213.36000		01/07/2016		-17,213.36	-1,442,564	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,213.36	-1,331,847	0	110,717	110,717
-379,405.26000		01/12/2016		-379,405.26	-31,131,953	1.000000000 ^S 77.372848751	-379,405.26	-29,355,666	0	1,776,287	1,776,287
-189,599.29000		01/15/2016		-189,599.29	-15,584,866	1.000000000 ^S 77.372848751	-189,599.29	-14,669,837	0	915,029	915,029
-8,880.25000		01/19/2016		-8,880.25	-716,821	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,880.25	-687,090	0	29,731	29,731
-90,489.83000		01/21/2016		-90,489.83	-7,198,238	1.000000000 ^S 77.372848751	-90,489.83	-7,001,456	0	196,782	196,782
-57,779.34000		01/21/2016		-57,779.34	-4,596,201	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,779.34	-4,470,552	0	125,649	125,649
-7,629.83000		01/21/2016		-7,629.83	-606,934	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,629.83	-590,342	0	16,592	16,592
-121,619.56000		01/22/2016		-121,619.56	-9,910,282	1.000000000 ^S 77.372848751	-121,619.56	-9,410,052	0	500,230	500,230
-214,100.94000		02/01/2016		-214,100.94	-18,334,604	1.000000000 ^S 77.372848751	-214,100.94	-16,565,600	0	1,769,004	1,769,004
-21,646.66000		02/04/2016		-21,646.66	-1,815,370	1.000000000 ^S 77.372848751	-21,646.66	-1,674,864	0	140,506	140,506
-14,653.90000		02/05/2016		-14,653.90	-1,240,675	1.000000000 ^S 77.372848751	-14,653.90	-1,133,814	0	106,861	106,861
-30,116.40000		02/10/2016		-30,116.40	-2,445,030	1.000000000 ^S 77.372848751	-30,116.40	-2,330,192	0	114,838	114,838
-381,805.81000		02/12/2016		-381,805.81	-30,235,477	1.000000000 ^S 77.372848751	-381,805.81	-29,541,403	0	694,074	694,074
-152,354.76000		02/12/2016		-152,354.76	-12,065,083	1.000000000 ^S 77.372848751	-152,354.76	-11,788,122	0	276,961	276,961
-16,916.50000		02/17/2016		-16,916.50	-1,364,954	1.000000000 ^S 77.372848751	-16,916.50	-1,308,878	0	56,076	56,076
-114,575.44000		02/22/2016		-114,575.44	-9,163,101	1.000000000 ^S 77.372848751	-114,575.44	-8,865,028	0	298,073	298,073

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-37,349.25000		02/23/2016		-37,349.25	-3,051,565	1.000000000 ^S 77.372848751	-37,349.25	-2,889,818	0	161,747	161,747
-123,804.34000		03/02/2016		-123,804.34	-10,057,811	1.000000000 ^S 77.372848751	-123,804.34	-9,579,094	0	478,717	478,717
-27,289.30000		03/03/2016		-27,289.30	-2,257,397	1.000000000 ^S 77.372848751	-27,289.30	-2,111,451	0	145,946	145,946
-10,054.65000		03/07/2016		-10,054.65	-847,732	1.000000000 ^S 77.372848751	-10,054.65	-777,957	0	69,775	69,775
-211,885.31000		03/09/2016		-211,885.31	-17,733,243	1.000000000 ^S 77.372848751	-211,885.31	-16,394,170	0	1,339,073	1,339,073
-377,078.03000		03/11/2016		-377,078.03	-31,843,855	1.000000000 ^S 77.372848751	-377,078.03	-29,175,601	0	2,668,254	2,668,254
-74,706.21000		03/14/2016		-74,706.21	-6,403,880	1.000000000 ^S 77.372848751	-74,706.21	-5,780,232	0	623,648	623,648
-73,687.89000		03/15/2016		-73,687.89	-6,289,651	1.000000000 ^S 77.372848751	-73,687.89	-5,701,442	0	588,209	588,209
-45,075.31000		03/16/2016		-45,075.31	-3,796,491	1.000000000 ^S 77.372848751	-45,075.31	-3,487,605	0	308,886	308,886
-29,125.30000		03/18/2016		-29,125.30	-2,475,492	1.000000000 ^S 77.372848751	-29,125.30	-2,253,507	0	221,985	221,985
-97,821.68000		03/22/2016		-97,821.68	-8,292,500	1.000000000 ^S 77.372848751	-97,821.68	-7,568,742	0	723,758	723,758
-112,039.68000		03/23/2016		-112,039.68	-9,552,811	1.000000000 ^S 77.372848751	-112,039.68	-8,668,829	0	883,982	883,982
-159,202.44000		03/24/2016		-159,202.44	-13,507,411	1.000000000 ^S 77.372848751	-159,202.44	-12,317,946	0	1,189,465	1,189,465
-32,177.14000		03/31/2016		-32,177.14	-2,784,601	1.000000000 ^S 77.372848751	-32,177.14	-2,489,637	0	294,964	294,964
-64,762.22000		04/05/2016		-64,762.22	-5,485,619	1.000000000 ^S 77.372848751	-64,762.22	-5,010,837	0	474,782	474,782
-26,208.62000		04/06/2016		-26,208.62	-2,182,406	1.000000000 ^S 77.372848751	-26,208.62	-2,027,836	0	154,570	154,570

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-373,765.27000		04/11/2016		-373,765.27	-30,674,974	1.000000000 ^S	-373,765.27	-28,919,284	0	1,755,690	1,755,690
						77.372848751					
-204,881.37000		04/11/2016		-204,881.37	-16,814,646	1.000000000 ^S	-204,881.37	-15,852,255	0	962,391	962,391
						77.372848751					
-43,019.52000		04/12/2016		-43,019.52	-3,527,545	1.000000000 ^S	-43,019.52	-3,328,543	0	199,002	199,002
						77.372848751					
-33,801.18000		04/13/2016		-33,801.18	-2,800,107	1.000000000 ^S	-33,801.18	-2,615,294	0	184,813	184,813
						77.372848751					
-141,797.35000		04/14/2016		-141,797.35	-11,838,108	1.000000000 ^S	-141,797.35	-10,971,265	0	866,843	866,843
						77.372848751					
-3,319.09000		04/18/2016		-3,319.09	-278,038	1.000000000 ^S	-3,319.09	-256,807	0	21,231	21,231
						77.372848751					
-83,104.57000		04/19/2016		-83,104.57	-6,999,836	1.000000000 ^S	-83,104.57	-6,430,037	0	569,799	569,799
						77.372848751					
-7,007.13000		04/19/2016		-7,007.13	-590,205	1.000000000 ^S	-7,007.13	-542,162	0	48,043	48,043
						77.372848751					
-32,699.55000		04/20/2016		-32,699.55	-2,792,082	1.000000000 ^S	-32,699.55	-2,530,057	0	262,025	262,025
						77.372848751					
2,677,613.47000		04/21/2016		2,677,613.47	228,369,211	1.000000000 ^S	2,677,613.47	207,174,582	0	21,194,629	21,194,629
						77.372848751					
-92,321.29000		04/21/2016		-92,321.29	-7,873,930	1.000000000 ^S	-92,321.29	-7,143,161	0	730,769	730,769
						77.372848751					
-51,467.98000		04/26/2016		-51,467.98	-4,411,808	1.000000000 ^S	-51,467.98	-3,982,224	0	429,584	429,584
						77.372848751					
-15,428.24000		05/09/2016		-15,428.24	-1,209,910	1.000000000 ^S	-15,428.24	-1,193,727	0	16,183	16,183
						77.372848751					
-102,314.26000		05/11/2016		-102,314.26	-8,222,605	1.000000000 ^S	-102,314.26	-7,916,346	0	306,259	306,259
						77.372848751					
-352,627.83000		05/12/2016		-352,627.83	-28,284,357	1.000000000 ^S	-352,627.83	-27,283,820	0	1,000,537	1,000,537
						77.372848751					
-32,453.42000		05/17/2016		-32,453.42	-2,578,702	1.000000000 ^S	-32,453.42	-2,511,014	0	67,688	67,688
						77.372848751					

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損 益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-184,519.95000		05/18/2016		-184,519.95	-14,755,931	1.000000000 ^S 77.372848751	-184,519.95	-14,276,834	0	479,097	479,097
-346,026.04000		05/23/2016		-346,026.04	-27,596,972	1.000000000 ^S 77.372848751	-346,026.04	-26,773,020	0	823,952	823,952
-349,425.52000		06/10/2016		-349,425.52	-27,668,680	1.000000000 ^S 77.372848751	-349,425.52	-27,036,048	0	632,632	632,632
-205,061.01000		06/14/2016		-205,061.01	-16,138,898	1.000000000 ^S 77.372848751	-205,061.01	-15,866,155	0	272,743	272,743
-27,132.00000		06/17/2016		-27,132.00	-2,060,548	1.000000000 ^S 77.372848751	-27,132.00	-2,099,280	0	-38,732	-38,732
-3,725.24000		07/07/2016		-3,725.24	-281,556	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,725.24	-288,232	0	-6,676	-6,676
-359,882.81000		07/11/2016		-359,882.81	-27,321,043	1.000000000 ^S 77.372848751	-359,882.81	-27,845,158	0	-524,115	-524,115
-11,042.19000		07/11/2016		-11,042.19	-838,284	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,042.19	-854,366	0	-16,082	-16,082
-123,264.71000		07/12/2016		-123,264.71	-9,538,466	1.000000000 ^S 77.372848751	-123,264.71	-9,537,342	0	1,124	1,124
-253,623.43000		07/14/2016		-253,623.43	-20,172,228	1.000000000 ^S 77.372848751	-253,623.43	-19,623,567	0	548,661	548,661
-78,638.63000		07/14/2016		-78,638.63	-6,254,613	1.000000000 ^S 77.372848751	-78,638.63	-6,084,495	0	170,118	170,118
-6,630.58000		07/14/2016		-6,630.58	-527,371	1.000000000 ^S 77.372848751	-6,630.58	-513,027	0	14,344	14,344
-105,691.38000		07/20/2016		-105,691.38	-8,420,947	1.000000000 ^S 77.372848751	-105,691.38	-8,177,643	0	243,304	243,304
-26,928.63000		07/22/2016		-26,928.63	-2,148,021	1.000000000 ^S 77.372848751	-26,928.63	-2,083,545	0	64,476	64,476
-11,865.10000		07/29/2016		-11,865.10	-934,463	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,865.10	-918,037	0	16,426	16,426
-64,818.19000		08/02/2016		-64,818.19	-5,014,401	1.000000000 ^S 77.372848751	-64,818.19	-5,015,168	0	-767	-767

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損 益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-19,853.51000		08/02/2016		-19,853.51	-1,535,888	1.000000000 ^S 77.372848751	-19,853.51	-1,536,123	0	-235	-235
-181,375.34000		08/03/2016		-181,375.34	-13,938,155	1.000000000 ^S 77.372848751	-181,375.34	-14,033,527	0	-95,372	-95,372
-25,260.07000		08/04/2016		-25,260.07	-1,938,997	1.000000000 ^S 77.372848751	-25,260.07	-1,954,444	0	-15,447	-15,447
-356,084.08000		08/12/2016		-356,084.08	-27,843,105	1.000000000 ^S 77.372848751	-356,084.08	-27,551,240	0	291,865	291,865
-42,406.06000		08/12/2016		-42,406.06	-3,315,836	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,406.06	-3,281,078	0	34,758	34,758
-33,369.43000		08/16/2016		-33,369.43	-2,591,016	1.000000000 ^S 77.372848751	-33,369.43	-2,581,888	0	9,128	9,128
-146,047.78000		08/17/2016		-146,047.78	-11,265,304	1.000000000 ^S 77.372848751	-146,047.78	-11,300,133	0	-34,829	-34,829
-12,365.22000		08/18/2016		-12,365.22	-946,746	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,365.22	-956,732	0	-9,986	-9,986
-25,656.87000		08/19/2016		-25,656.87	-1,972,799	1.000000000 ^S 77.372848751	-25,656.87	-1,985,145	0	-12,346	-12,346
-62,280.99000		08/22/2016		-62,280.99	-4,755,276	1.000000000 ^S 77.372848751	-62,280.99	-4,818,858	0	-63,582	-63,582
-115,979.16000		08/23/2016		-115,979.16	-8,883,458	1.000000000 ^S 77.372848751	-115,979.16	-8,973,638	0	-90,180	-90,180
-45,244.15000		08/24/2016		-45,244.15	-3,466,822	1.000000000 ^S 77.372848751	-45,244.15	-3,500,669	0	-33,847	-33,847
-118,911.22000		08/25/2016		-118,911.22	-9,101,467	1.000000000 ^S 77.372848751	-118,911.22	-9,200,500	0	-99,033	-99,033
-18,695.42000		09/02/2016		-18,695.42	-1,456,164	1.000000000 ^S 77.372848751	-18,695.42	-1,446,518	0	9,646	9,646
-647,737.56000		09/08/2016		-647,737.56	-50,558,123	1.000000000 ^S 77.372848751	-647,737.56	-50,117,300	0	440,823	440,823
-349,412.93000		09/12/2016		-349,412.93	-27,165,953	1.000000000 ^S 77.372848751	-349,412.93	-27,035,074	0	130,879	130,879

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-17,748.89000		09/15/2016		-17,748.89	-1,360,703	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,748.89	-1,373,282	0	-12,579	-12,579
-179,125.75000		09/21/2016		-179,125.75	-13,765,066	1.000000000 ^S 77.372848751	-179,125.75	-13,859,470	0	-94,404	-94,404
-355,570.37000		10/12/2016		-355,570.37	-27,813,188	1.000000000 ^S 77.372848751	-355,570.37	-27,511,492	0	301,696	301,696
-87,209.56000		10/14/2016		-87,209.56	-6,810,737	1.000000000 ^S 77.372848751	-87,209.56	-6,747,652	0	63,085	63,085
-49,550.92000		10/20/2016		-49,550.92	-3,937,169	1.000000000 ^S 77.372848751	-49,550.92	-3,833,896	0	103,273	103,273
-108,096.46000		10/26/2016		-108,096.46	-8,631,787	1.000000000 ^S 77.372848751	-108,096.46	-8,363,731	0	268,056	268,056
-6,022.62000		11/09/2016		-6,022.62	-486,973	1.000000000 ^S 77.372848751	-6,022.62	-465,987	0	20,986	20,986
-358,077.71000		11/14/2016		-358,077.71	-28,775,830	1.000000000 ^S 77.372848751	-358,077.71	-27,705,492	0	1,070,338	1,070,338
-105,736.37000		11/15/2016		-105,736.37	-8,633,411	1.000000000 ^S 77.372848751	-105,736.37	-8,181,124	0	452,287	452,287
-8,950.00000		11/16/2016		-8,950.00	-735,749	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,950.00	-692,487	0	43,262	43,262
-43,039.27000		11/18/2016		-43,039.27	-3,517,706	1.000000000 ^S 77.372848751	-43,039.27	-3,330,071	0	187,635	187,635
-29,290.91000		11/25/2016		-29,290.91	-2,456,555	1.000000000 ^S 77.372848751	-29,290.91	-2,266,321	0	190,234	190,234
-51,254.81000		11/30/2016		-51,254.81	-4,320,135	1.000000000 ^S 77.372848751	-51,254.81	-3,965,731	0	354,404	354,404
-156,086.08000		12/01/2016		-156,086.08	-13,140,616	1.000000000 ^S 77.372848751	-156,086.08	-12,076,825	0	1,063,791	1,063,791
-99,004.27000		12/02/2016		-99,004.27	-8,385,070	1.000000000 ^S 77.372848751	-99,004.27	-7,660,242	0	724,828	724,828
-241,950.12000		12/06/2016		-241,950.12	-20,677,187	1.000000000 ^S 77.372848751	-241,950.12	-18,720,370	0	1,956,817	1,956,817

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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-52,956.42000		12/07/2016		-52,956.42	-4,499,736	1.000000000 ^S 77.372848751	-52,956.42	-4,097,389	0	402,347	402,347
-352,726.96000		12/09/2016		-352,726.96	-29,973,125	1.000000000 ^S 77.372848751	-352,726.96	-27,291,490	0	2,681,635	2,681,635
-9,409.35000		12/12/2016		-9,409.35	-807,660	1.000000000 ^S 77.372848751	-9,409.35	-728,028	0	79,632	79,632
-242,673.60000		12/14/2016		-242,673.60	-20,968,061	1.000000000 ^S 77.372848751	-242,673.60	-18,776,348	0	2,191,713	2,191,713
-8,765.00000		12/16/2016		-8,765.00	-764,049	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,765.00	-678,173	0	85,876	85,876
-63,041.53000		12/19/2016		-63,041.53	-5,432,127	1.000000000 ^S 77.372848751	-63,041.53	-4,877,703	0	554,424	554,424
-113,105.55000		12/22/2016		-113,105.55	-9,651,835	1.000000000 ^S 77.372848751	-113,105.55	-8,751,299	0	900,536	900,536
-202,488.26000		12/28/2016		-202,488.26	-17,117,239	1.000000000 ^S 77.372848751	-202,488.26	-15,667,094	0	1,450,145	1,450,145
-17,327.64000		12/29/2016		-17,327.64	-1,462,733	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,327.64	-1,340,689	0	122,044	122,044
-1,900.70000		12/30/2016		-1,900.70	-159,632	1.000000000 ^S 77.372848751	-1,900.70	-147,063	0	12,569	12,569
-17,618.00000		01/04/2017		-17,618.00	-1,501,301	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,618.00	-1,363,155	0	138,146	138,146
-550,762.83000		01/05/2017		-550,762.83	-47,018,808	1.000000000 ^S 77.372848751	-550,762.83	-42,614,089	0	4,404,719	4,404,719
-46,205.35000		01/06/2017		-46,205.35	-3,920,910	1.000000000 ^S 77.372848751	-46,205.35	-3,575,040	0	345,870	345,870
-75,551.78000		01/11/2017		-75,551.78	-6,438,078	1.000000000 ^S 77.372848751	-75,551.78	-5,845,656	0	592,422	592,422
-349,599.06000		01/12/2017		-349,599.06	-30,063,342	1.000000000 ^S 77.372848751	-349,599.06	-27,049,475	0	3,013,867	3,013,867
-11,816.04000		01/12/2017		-11,816.04	-1,016,106	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,816.04	-914,241	0	101,865	101,865

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	合計 (円)	未実現損益
クラスに割当てられていない資産												
外貨建現金勘定												
非グループ化の有価証券												
-78,835.06000		01/18/2017		-78,835.06	-6,719,133	1.000000000 ^S 77.372848751	-78,835.06	-6,099,693	0	619,440	619,440	
-11,222.99000		01/18/2017		-11,222.99	-956,538	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,222.99	-868,355	0	88,183	88,183	
-6,647.14000		01/18/2017		-6,647.14	-566,537	1.000000000 ^S 77.372848751	-6,647.14	-514,308	0	52,229	52,229	
-57,843.82000		01/20/2017		-57,843.82	-5,033,172	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,843.82	-4,475,541	0	557,631	557,631	
-59,564.39000		01/23/2017		-59,564.39	-5,172,781	1.000000000 ^S 77.372848751	-59,564.39	-4,608,667	0	564,114	564,114	
-120,856.84000		01/24/2017		-120,856.84	-10,353,246	1.000000000 ^S 77.372848751	-120,856.84	-9,351,038	0	1,002,208	1,002,208	
-105,955.38000		01/24/2017		-105,955.38	-9,076,707	1.000000000 ^S 77.372848751	-105,955.38	-8,198,070	0	878,637	878,637	
-186,290.44000		01/27/2017		-186,290.44	-16,102,463	1.000000000 ^S 77.372848751	-186,290.44	-14,413,822	0	1,688,641	1,688,641	
-72,198.29000		01/27/2017		-72,198.29	-6,240,633	1.000000000 ^S 77.372848751	-72,198.29	-5,586,187	0	654,446	654,446	
-66,189.39000		02/01/2017		-66,189.39	-5,656,632	1.000000000 ^S 77.372848751	-66,189.39	-5,121,262	0	535,370	535,370	
-17,013.34000		02/02/2017		-17,013.34	-1,460,104	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,013.34	-1,316,371	0	143,733	143,733	
-10,224.17000		02/07/2017		-10,224.17	-877,520	1.000000000 ^S 77.372848751	-10,224.17	-791,073	0	86,447	86,447	
-177,969.53000		02/09/2017		-177,969.53	-15,213,556	1.000000000 ^S 77.372848751	-177,969.53	-13,770,010	0	1,443,546	1,443,546	
-344,229.20000		02/10/2017		-344,229.20	-29,662,809	1.000000000 ^S 77.372848751	-344,229.20	-26,633,994	0	3,028,815	3,028,815	
-152,291.16000		02/13/2017		-152,291.16	-13,270,154	1.000000000 ^S 77.372848751	-152,291.16	-11,783,201	0	1,486,953	1,486,953	
-967,326.20000		02/15/2017		-967,326.20	-84,398,304	1.000000000 ^S 77.372848751	-967,326.20	-74,844,784	0	9,553,520	9,553,520	

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-71,449.49000		02/16/2017		-71,449.49	-6,292,028	1.000000000 ^S 77.372848751	-71,449.49	-5,528,251	0	763,777	763,777
-34,639.01000		02/23/2017		-34,639.01	-3,017,462	1.000000000 ^S 77.372848751	-34,639.01	-2,680,119	0	337,343	337,343
-52,248.31000		03/01/2017		-52,248.31	-4,494,545	1.000000000 ^S 77.372848751	-52,248.31	-4,042,601	0	451,944	451,944
-44,953.93000		03/03/2017		-44,953.93	-3,898,960	1.000000000 ^S 77.372848751	-44,953.93	-3,478,214	0	420,746	420,746
-185,905.53000		03/08/2017		-185,905.53	-16,102,616	1.000000000 ^S 77.372848751	-185,905.53	-14,384,040	0	1,718,576	1,718,576
-11,158.43000		03/09/2017		-11,158.43	-965,561	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,158.43	-863,360	0	102,201	102,201
-334,340.29000		03/10/2017		-334,340.29	-28,791,636	1.000000000 ^S 77.372848751	-334,340.29	-25,868,861	0	2,922,775	2,922,775
-189,359.17000		03/14/2017		-189,359.17	-16,457,305	1.000000000 ^S 77.372848751	-189,359.17	-14,651,258	0	1,806,047	1,806,047
-201,782.17000		03/15/2017		-201,782.17	-17,521,607	1.000000000 ^S 77.372848751	-201,782.17	-15,612,461	0	1,909,146	1,909,146
-93,724.51000		03/16/2017		-93,724.51	-8,160,137	1.000000000 ^S 77.372848751	-93,724.51	-7,251,732	0	908,405	908,405
-951,148.84000		03/17/2017		-951,148.84	-82,485,587	1.000000000 ^S 77.372848751	-951,148.84	-73,593,095	0	8,892,492	8,892,492
-49,845.77000		03/21/2017		-49,845.77	-4,339,671	1.000000000 ^S 77.372848751	-49,845.77	-3,856,709	0	482,962	482,962
-97,972.14000		03/22/2017		-97,972.14	-8,458,699	1.000000000 ^S 77.372848751	-97,972.14	-7,580,384	0	878,315	878,315
-129,338.35000		03/24/2017		-129,338.35	-10,986,556	1.000000000 ^S 77.372848751	-129,338.35	-10,007,277	0	979,279	979,279
-35,149.28000		03/29/2017		-35,149.28	-2,959,437	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,149.28	-2,719,600	0	239,837	239,837
-121,963.21000		04/03/2017		-121,963.21	-10,367,407	1.000000000 ^S 77.372848751	-121,963.21	-9,436,641	0	930,766	930,766

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

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

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

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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニ ット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-17,011.29000		04/04/2017		-17,011.29	-1,434,849	1.000000000 ^S	-17,011.29	-1,316,212	0	118,637	118,637
						77.372848751					
-99,836.86000		04/05/2017		-99,836.86	-8,339,503	1.000000000 ^S	-99,836.86	-7,724,662	0	614,841	614,841
						77.372848751					
-321,826.20000		04/11/2017		-321,826.20	-26,821,039	1.000000000 ^S	-321,826.20	-24,900,610	0	1,920,429	1,920,429
						77.372848751					
-2,535.89000		04/13/2017		-2,535.89	-208,025	1.000000000 ^S	-2,535.89	-196,209	0	11,816	11,816
						77.372848751					
-17,906.57000		04/24/2017		-17,906.57	-1,469,466	1.000000000 ^S	-17,906.57	-1,385,482	0	83,984	83,984
						77.372848751					
-97,737.47000		04/26/2017		-97,737.47	-8,168,487	1.000000000 ^S	-97,737.47	-7,562,226	0	606,261	606,261
						77.372848751					
-72,720.60000		04/26/2017		-72,720.60	-6,077,682	1.000000000 ^S	-72,720.60	-5,626,600	0	451,082	451,082
						77.372848751					
-6,131.59000		04/26/2017		-6,131.59	-512,453	1.000000000 ^S	-6,131.59	-474,419	0	38,034	38,034
						77.372848751					
-				-	-	1.000000000 ^S	-	-	0		
5,770,905.72000		05/02/2017		5,770,905.72	481,079,087	1.000000000 ^S	5,770,905.72	446,511,415	0	34,567,672	34,567,672
						77.372848751					
-757,937.72000		05/08/2017		-757,937.72	-63,229,524	1.000000000 ^S	-757,937.72	-58,643,801	0	4,585,723	4,585,723
						77.372848751					
-93,372.59000		05/11/2017		-93,372.59	-7,870,999	1.000000000 ^S	-93,372.59	-7,224,503	0	646,496	646,496
						77.372848751					
-277,865.98000		05/12/2017		-277,865.98	-23,283,752	1.000000000 ^S	-277,865.98	-21,499,282	0	1,784,470	1,784,470
						77.372848751					
-83,218.51000		05/12/2017		-83,218.51	-6,973,287	1.000000000 ^S	-83,218.51	-6,438,853	0	534,434	534,434
						77.372848751					
-87,633.54000		05/15/2017		-87,633.54	-7,339,187	1.000000000 ^S	-87,633.54	-6,780,457	0	558,730	558,730
						77.372848751					
-161,718.79000		05/16/2017		-161,718.79	-13,634,189	1.000000000 ^S	-161,718.79	-12,512,643	0	1,121,546	1,121,546
						77.372848751					
-51,805.98000		05/17/2017		-51,805.98	-4,351,820	1.000000000 ^S	-51,805.98	-4,008,376	0	343,444	343,444
						77.372848751					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-215,576.55000		05/19/2017		-215,576.55	-17,787,680	1.000000000 ^S 77.372848751	-215,576.55	-16,679,772	0	1,107,908	1,107,908
-339,293.20000		05/22/2017		-339,293.20	-28,164,073	1.000000000 ^S 77.372848751	-339,293.20	-26,252,081	0	1,911,992	1,911,992
-105,085.63000		05/24/2017		-105,085.63	-8,748,278	1.000000000 ^S 77.372848751	-105,085.63	-8,130,775	0	617,503	617,503
-35,824.15000		05/26/2017		-35,824.15	-2,994,583	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,824.15	-2,771,817	0	222,766	222,766
-85,534.03000		06/01/2017		-85,534.03	-7,041,589	1.000000000 ^S 77.372848751	-85,534.03	-6,618,012	0	423,577	423,577
-184,424.56000		06/06/2017		-184,424.56	-15,242,969	1.000000000 ^S 77.372848751	-184,424.56	-14,269,454	0	973,515	973,515
-268,856.14000		06/09/2017		-268,856.14	-22,316,945	1.000000000 ^S 77.372848751	-268,856.14	-20,802,165	0	1,514,780	1,514,780
-48,274.55000		06/16/2017		-48,274.55	-4,048,407	1.000000000 ^S 77.372848751	-48,274.55	-3,735,139	0	313,268	313,268
-28,558.93000		06/19/2017		-28,558.93	-2,409,398	1.000000000 ^S 77.372848751	-28,558.93	-2,209,686	0	199,712	199,712
-32,535.99000		06/22/2017		-32,535.99	-2,741,102	1.000000000 ^S 77.372848751	-32,535.99	-2,517,402	0	223,700	223,700
-36,028.00000		06/27/2017		-36,028.00	-3,046,343	1.000000000 ^S 77.372848751	-36,028.00	-2,787,589	0	258,754	258,754
-85,677.03000		06/28/2017		-85,677.03	-7,298,656	1.000000000 ^S 77.372848751	-85,677.03	-6,629,076	0	669,580	669,580
-50,207.38000		06/29/2017		-50,207.38	-4,284,996	1.000000000 ^S 77.372848751	-50,207.38	-3,884,688	0	400,308	400,308
-17,179.10000		06/30/2017		-17,179.10	-1,485,268	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,179.10	-1,329,196	0	156,072	156,072
-24,916.13000		07/06/2017		-24,916.13	-2,139,501	1.000000000 ^S 77.372848751	-24,916.13	-1,927,832	0	211,669	211,669
-70,337.04000		07/07/2017		-70,337.04	-6,033,979	1.000000000 ^S 77.372848751	-70,337.04	-5,442,177	0	591,802	591,802

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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)	通貨 (円)	未実現損益 合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-268,122.83000		07/11/2017		-268,122.83	-23,253,058	1.000000000 ^S 77.372848751	-268,122.83	-20,745,427	0	2,507,631	2,507,631
-94,299.32000		07/12/2017		-94,299.32	-8,216,368	1.000000000 ^S 77.372848751	-94,299.32	-7,296,207	0	920,161	920,161
-48,129.04000		07/13/2017		-48,129.04	-4,176,056	1.000000000 ^S 77.372848751	-48,129.04	-3,723,881	0	452,175	452,175
-94,307.37000		07/14/2017		-94,307.37	-8,260,227	1.000000000 ^S 77.372848751	-94,307.37	-7,296,830	0	963,397	963,397
-224,064.11000		07/18/2017		-224,064.11	-19,759,163	1.000000000 ^S 77.372848751	-224,064.11	-17,336,478	0	2,422,685	2,422,685
-62,985.03000		07/18/2017		-62,985.03	-5,554,354	1.000000000 ^S 77.372848751	-62,985.03	-4,873,331	0	681,023	681,023
-5,310.71000		07/18/2017		-5,310.71	-468,327	1.000000000 ^S 77.372848751	-5,310.71	-410,905	0	57,422	57,422
-84,652.73000		07/19/2017		-84,652.73	-7,503,258	1.000000000 ^S 77.372848751	-84,652.73	-6,549,823	0	953,435	953,435
-57,508.35000		07/24/2017		-57,508.35	-5,058,492	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,508.35	-4,449,585	0	608,907	608,907
-34,173.40000		07/27/2017		-34,173.40	-3,033,016	1.000000000 ^S 77.372848751	-34,173.40	-2,644,093	0	388,923	388,923
-42,955.96000		07/28/2017		-42,955.96	-3,821,788	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,955.96	-3,323,625	0	498,163	498,163
-34,563.35000		08/01/2017		-34,563.35	-3,048,960	1.000000000 ^S 77.372848751	-34,563.35	-2,674,265	0	374,695	374,695
-11,898.68000		08/02/2017		-11,898.68	-1,046,921	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,898.68	-920,635	0	126,286	126,286
-251,943.26000		08/08/2017		-251,943.26	-22,077,618	1.000000000 ^S 77.372848751	-251,943.26	-19,493,568	0	2,584,050	2,584,050
-129,223.68000		08/08/2017		-129,223.68	-11,323,784	1.000000000 ^S 77.372848751	-129,223.68	-9,998,404	0	1,325,380	1,325,380
-26,983.86000		08/09/2017		-26,983.86	-2,360,030	1.000000000 ^S 77.372848751	-26,983.86	-2,087,818	0	272,212	272,212

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-5,436.08000		08/10/2017		-5,436.08	-470,606	1.000000000S 77.372848751	-5,436.08	-420,605	0	50,001	50,001
-261,862.81000		08/14/2017		-261,862.81	-22,503,263	1.000000000S 77.372848751	-261,862.81	-20,261,072	0	2,242,191	2,242,191
-38,687.10000		08/14/2017		-38,687.10	-3,324,588	1.000000000S 77.372848751	-38,687.10	-2,993,331	0	331,257	331,257
-234,673.89000		08/16/2017		-234,673.89	-20,287,202	1.000000000S 77.372848751	-234,673.89	-18,157,387	0	2,129,815	2,129,815
-151,106.11000		08/17/2017		-151,106.11	-13,198,995	1.000000000S 77.372848751	-151,106.11	-11,691,510	0	1,507,485	1,507,485
-23,853.89000		08/18/2017		-23,853.89	-2,076,341	1.000000000S 77.372848751	-23,853.89	-1,845,643	0	230,698	230,698
-128,055.35000		08/22/2017		-128,055.35	-11,058,464	1.000000000S 77.372848751	-128,055.35	-9,908,007	0	1,150,457	1,150,457
-20,640.91000		08/23/2017		-20,640.91	-1,790,067	1.000000000S 77.372848751	-20,640.91	-1,597,046	0	193,021	193,021
-47,297.81000		08/29/2017		-47,297.81	-4,106,488	1.000000000S 77.372848751	-47,297.81	-3,659,566	0	446,922	446,922
-1,347,714.81000		08/30/2017		-1,347,714.81	-116,950,732	1.000000000S 77.372848751	-1,347,714.81	-104,276,534	0	12,674,198	12,674,198
-1,203,000.00000		08/30/2017		-1,203,000.00	-104,392,806	1.000000000S 77.372848751	-1,203,000.00	-93,079,537	0	11,313,269	11,313,269
-30,083.55000		08/30/2017		-30,083.55	-2,610,562	1.000000000S 77.372848751	-30,083.55	-2,327,650	0	282,912	282,912
-83,968.93000		09/05/2017		-83,968.93	-7,314,593	1.000000000S 77.372848751	-83,968.93	-6,496,915	0	817,678	817,678
-61,112.18000		09/08/2017		-61,112.18	-5,325,375	1.000000000S 77.372848751	-61,112.18	-4,728,423	0	596,952	596,952
-245,747.74000		09/11/2017		-245,747.74	-21,382,314	1.000000000S 77.372848751	-245,747.74	-19,014,203	0	2,368,111	2,368,111
-18,460.20000		09/11/2017		-18,460.20	-1,606,207	1.000000000S 77.372848751	-18,460.20	-1,428,318	0	177,889	177,889

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
-110,577.39000		09/12/2017		-110,577.39	-9,667,378	1.000000000 ^S 77.372848751	-110,577.39	-8,555,688	0	1,111,690	1,111,690
-140,374.85000		09/14/2017		-140,374.85	-12,413,249	1.000000000 ^S 77.372848751	-140,374.85	-10,861,202	0	1,552,047	1,552,047
-93,807.37000		09/15/2017		-93,807.37	-8,281,886	1.000000000 ^S 77.372848751	-93,807.37	-7,258,143	0	1,023,743	1,023,743
-94,643.60000		09/20/2017		-94,643.60	-8,441,750	1.000000000 ^S 77.372848751	-94,643.60	-7,322,845	0	1,118,905	1,118,905
-37,527.78000		09/26/2017		-37,527.78	-3,332,691	1.000000000 ^S 77.372848751	-37,527.78	-2,903,631	0	429,060	429,060
-20,531.50000		09/28/2017		-20,531.50	-1,818,416	1.000000000 ^S 77.372848751	-20,531.50	-1,588,581	0	229,835	229,835
-233,742.95000		09/29/2017		-233,742.95	-20,642,355	1.000000000 ^S 77.372848751	-233,742.95	-18,085,358	0	2,556,997	2,556,997
-149,591.47000		10/05/2017		-149,591.47	-13,246,493	1.000000000 ^S 77.372848751	-149,591.47	-11,574,318	0	1,672,175	1,672,175
-25,802.59000		10/06/2017		-25,802.59	-2,268,258	1.000000000 ^S 77.372848751	-25,802.59	-1,996,420	0	271,838	271,838
-250,526.60000		10/12/2017		-250,526.60	-21,872,667	1.000000000 ^S 77.372848751	-250,526.60	-19,383,957	0	2,488,710	2,488,710
-150,522.57000		10/12/2017		-150,522.57	-13,141,639	1.000000000 ^S 77.372848751	-150,522.57	-11,646,360	0	1,495,279	1,495,279
-58,012.04000		10/16/2017		-58,012.04	-5,122,230	1.000000000 ^S 77.372848751	-58,012.04	-4,488,557	0	633,673	633,673
-4,891.40000		10/16/2017		-4,891.40	-431,891	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,891.40	-378,462	0	53,429	53,429
-8,629.54000		10/19/2017		-8,629.54	-763,983	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,629.54	-667,692	0	96,291	96,291
-79,173.19000		10/20/2017		-79,173.19	-7,021,242	1.000000000 ^S 77.372848751	-79,173.19	-6,125,855	0	895,387	895,387
-73,221.02000		10/24/2017		-73,221.02	-6,498,544	1.000000000 ^S 77.372848751	-73,221.02	-5,665,319	0	833,225	833,225

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 2020年8月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-53,753.51000		10/24/2017		-53,753.51	-4,770,755	1.000000000 ^S 77.372848751	-53,753.51	-4,159,062	0	611,693	611,693
-1,778,714.81000		10/25/2017		-1,778,714.81	-157,587,713	1.000000000 ^S 77.372848751	-1,778,714.81	-137,624,232	0	19,963,481	19,963,481
-1,390,000.00000		10/25/2017		-1,390,000.00	-123,148,983	1.000000000 ^S 77.372848751	-1,390,000.00	-107,548,260	0	15,600,723	15,600,723
-59,387.12000		10/25/2017		-59,387.12	-5,261,485	1.000000000 ^S 77.372848751	-59,387.12	-4,594,951	0	666,534	666,534
-7,958.77000		10/31/2017		-7,958.77	-691,905	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,958.77	-615,793	0	76,112	76,112
-30,242.86000		11/02/2017		-30,242.86	-2,647,087	1.000000000 ^S 77.372848751	-30,242.86	-2,339,976	0	307,111	307,111
-98,737.84000		11/08/2017		-98,737.84	-8,600,813	1.000000000 ^S 77.372848751	-98,737.84	-7,639,628	0	961,185	961,185
-9,009.98000		11/09/2017		-9,009.98	-785,309	1.000000000 ^S 77.372848751	-9,009.98	-697,128	0	88,181	88,181
-247,808.62000		11/10/2017		-247,808.62	-21,573,723	1.000000000 ^S 77.372848751	-247,808.62	-19,173,659	0	2,400,064	2,400,064
-141,305.97000		11/14/2017		-141,305.97	-12,248,394	1.000000000 ^S 77.372848751	-141,305.97	-10,933,245	0	1,315,149	1,315,149
-64,748.95000		11/20/2017		-64,748.95	-5,487,267	1.000000000 ^S 77.372848751	-64,748.95	-5,009,811	0	477,456	477,456
-32,436.77000		11/22/2017		-32,436.77	-2,764,939	1.000000000 ^S 77.372848751	-32,436.77	-2,509,725	0	255,214	255,214
-203,554.78000		11/24/2017		-203,554.78	-17,261,865	1.000000000 ^S 77.372848751	-203,554.78	-15,749,613	0	1,512,252	1,512,252
-42,562.46000		11/28/2017		-42,562.46	-3,600,917	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,562.46	-3,293,179	0	307,738	307,738
-99,582.58000		12/01/2017		-99,582.58	-8,459,807	1.000000000 ^S 77.372848751	-99,582.58	-7,704,988	0	754,819	754,819
-47,244.20000		12/07/2017		-47,244.20	-4,017,059	1.000000000 ^S 77.372848751	-47,244.20	-3,655,418	0	361,641	361,641

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-13,390.76000		12/08/2017		-13,390.76	-1,135,904	1.000000000 ^S 77.372848751	-13,390.76	-1,036,081	0	99,823	99,823
-246,793.05000		12/11/2017		-246,793.05	-21,044,157	1.000000000 ^S 77.372848751	-246,793.05	-19,095,081	0	1,949,076	1,949,076
-30,330.71000		12/11/2017		-30,330.71	-2,586,314	1.000000000 ^S 77.372848751	-30,330.71	-2,346,773	0	239,541	239,541
-85,954.84000		12/12/2017		-85,954.84	-7,349,616	1.000000000 ^S 77.372848751	-85,954.84	-6,650,571	0	699,045	699,045
-55,703.20000		12/13/2017		-55,703.20	-4,782,497	1.000000000 ^S 77.372848751	-55,703.20	-4,309,915	0	472,582	472,582
-126,098.54000		12/19/2017		-126,098.54	-10,875,723	1.000000000 ^S 77.372848751	-126,098.54	-9,756,603	0	1,119,120	1,119,120
-39,931.85000		12/20/2017		-39,931.85	-3,451,152	1.000000000 ^S 77.372848751	-39,931.85	-3,089,641	0	361,511	361,511
-28,911.07000		01/05/2018		-28,911.07	-2,563,200	1.000000000 ^S 77.372848751	-28,911.07	-2,236,932	0	326,268	326,268
-245,282.90000		01/12/2018		-245,282.90	-21,514,923	1.000000000 ^S 77.372848751	-245,282.90	-18,978,237	0	2,536,686	2,536,686
-12,441.34000		01/12/2018		-12,441.34	-1,091,289	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,441.34	-962,622	0	128,667	128,667
-35,513.33000		01/16/2018		-35,513.33	-3,129,459	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,513.33	-2,747,768	0	381,691	381,691
-56,303.33000		01/22/2018		-56,303.33	-4,983,918	1.000000000 ^S 77.372848751	-56,303.33	-4,356,349	0	627,569	627,569
-73,732.89000		01/24/2018		-73,732.89	-6,506,404	1.000000000 ^S 77.372848751	-73,732.89	-5,704,924	0	801,480	801,480
-54,860.23000		01/24/2018		-54,860.23	-4,841,026	1.000000000 ^S 77.372848751	-54,860.23	-4,244,692	0	596,334	596,334
-4,625.65000		01/24/2018		-4,625.65	-408,181	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,625.65	-357,900	0	50,281	50,281
-104,867.61000		01/29/2018		-104,867.61	-9,216,108	1.000000000 ^S 77.372848751	-104,867.61	-8,113,906	0	1,102,202	1,102,202

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-315,218.62000		01/30/2018		-315,218.62	-27,821,128	1.000000000 ^S 77.372848751	-315,218.62	-24,389,363	0	3,431,765	3,431,765
-92,606.37000		01/31/2018		-92,606.37	-8,151,384	1.000000000 ^S 77.372848751	-92,606.37	-7,165,219	0	986,165	986,165
-42,223.81000		02/08/2018		-42,223.81	-3,622,522	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,223.81	-3,266,976	0	355,546	355,546
-240,819.94000		02/09/2018		-240,819.94	-20,510,385	1.000000000 ^S 77.372848751	-240,819.94	-18,632,925	0	1,877,460	1,877,460
-114,626.90000		02/09/2018		-114,626.90	-9,762,655	1.000000000 ^S 77.372848751	-114,626.90	-8,869,010	0	893,645	893,645
-54,329.53000		02/15/2018		-54,329.53	-4,574,151	1.000000000 ^S 77.372848751	-54,329.53	-4,203,631	0	370,520	370,520
-8,354.61000		02/23/2018		-8,354.61	-701,268	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,354.61	-646,420	0	54,848	54,848
-241,131.03000		03/09/2018		-241,131.03	-19,903,757	1.000000000 ^S 77.372848751	-241,131.03	-18,656,995	0	1,246,762	1,246,762
-11,810.63000		03/15/2018		-11,810.63	-987,676	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,810.63	-913,822	0	73,854	73,854
-71,875.05000		03/23/2018		-71,875.05	-5,825,270	1.000000000 ^S 77.372848751	-71,875.05	-5,561,177	0	264,093	264,093
-42,568.15000		03/26/2018		-42,568.15	-3,447,582	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,568.15	-3,293,619	0	153,963	153,963
-50,297.76000		03/27/2018		-50,297.76	-4,076,366	1.000000000 ^S 77.372848751	-50,297.76	-3,891,681	0	184,685	184,685
-1,535.28000		04/09/2018		-1,535.28	-126,334	1.000000000 ^S 77.372848751	-1,535.28	-118,789	0	7,545	7,545
-88,985.26000		04/10/2018		-88,985.26	-7,326,140	1.000000000 ^S 77.372848751	-88,985.26	-6,885,043	0	441,097	441,097
-240,542.88000		04/11/2018		-240,542.88	-19,991,243	1.000000000 ^S 77.372848751	-240,542.88	-18,611,488	0	1,379,755	1,379,755
-106,173.13000		04/12/2018		-106,173.13	-8,804,183	1.000000000 ^S 77.372848751	-106,173.13	-8,214,918	0	589,265	589,265

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-160,886.21000		04/16/2018		-160,886.21	-13,449,333	1.000000000 ^S 77.372848751	-160,886.21	-12,448,224	0	1,001,109	1,001,109
-51,033.60000		04/17/2018		-51,033.60	-4,256,750	1.000000000 ^S 77.372848751	-51,033.60	-3,948,615	0	308,135	308,135
-4,303.00000		04/17/2018		-4,303.00	-358,916	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,303.00	-332,935	0	25,981	25,981
-103,980.92000		04/18/2018		-103,980.92	-8,658,256	1.000000000 ^S 77.372848751	-103,980.92	-8,045,300	0	612,956	612,956
-134,354.93000		04/20/2018		-134,354.93	-11,212,243	1.000000000 ^S 77.372848751	-134,354.93	-10,395,424	0	816,819	816,819
-68,589.85000		04/23/2018		-68,589.85	-5,669,514	1.000000000 ^S 77.372848751	-68,589.85	-5,306,992	0	362,522	362,522
-40,543.60000		05/02/2018		-40,543.60	-3,348,880	1.000000000 ^S 77.372848751	-40,543.60	-3,136,974	0	211,906	211,906
-237,079.40000		05/15/2018		-237,079.40	-19,620,584	1.000000000 ^S 77.372848751	-237,079.40	-18,343,509	0	1,277,075	1,277,075
-104,464.09000		05/16/2018		-104,464.09	-8,615,124	1.000000000 ^S 77.372848751	-104,464.09	-8,082,684	0	532,440	532,440
-42,940.74000		05/17/2018		-42,940.74	-3,555,049	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,940.74	-3,322,447	0	232,602	232,602
-259,940.71000		05/25/2018		-259,940.71	-21,430,186	1.000000000 ^S 77.372848751	-259,940.71	-20,112,353	0	1,317,833	1,317,833
-40,016.55000		05/29/2018		-40,016.55	-3,302,356	1.000000000 ^S 77.372848751	-40,016.55	-3,096,194	0	206,162	206,162
-7,569.94000		06/04/2018		-7,569.94	-627,097	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,569.94	-585,708	0	41,389	41,389
-234,723.65000		06/08/2018		-234,723.65	-19,730,048	1.000000000 ^S 77.372848751	-234,723.65	-18,161,237	0	1,568,811	1,568,811
-354,424.37000		06/13/2018		-354,424.37	-29,758,065	1.000000000 ^S 77.372848751	-354,424.37	-27,422,823	0	2,335,242	2,335,242
-26,321.04000		06/21/2018		-26,321.04	-2,136,994	1.000000000 ^S 77.372848751	-26,321.04	-2,036,534	0	100,460	100,460

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>非グループ化の有価証券</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-62,568.05000		06/27/2018		-62,568.05	-5,082,558	1.000000000 ^S 77.372848751	-62,568.05	-4,841,068	0	241,490	241,490
-33,424.92000		06/28/2018		-33,424.92	-2,725,829	1.000000000 ^S 77.372848751	-33,424.92	-2,586,181	0	139,648	139,648
-59,587.09000		06/29/2018		-59,587.09	-4,831,738	1.000000000 ^S 77.372848751	-59,587.09	-4,610,423	0	221,315	221,315
-230,807.11000		07/11/2018		-230,807.11	-19,164,246	1.000000000 ^S 77.372848751	-230,807.11	-17,858,204	0	1,306,042	1,306,042
-12,445.25000		07/11/2018		-12,445.25	-1,033,347	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,445.25	-962,924	0	70,423	70,423
-48,245.27000		07/13/2018		-48,245.27	-4,015,011	1.000000000 ^S 77.372848751	-48,245.27	-3,732,874	0	282,137	282,137
-31,820.25000		07/13/2018		-31,820.25	-2,648,107	1.000000000 ^S 77.372848751	-31,820.25	-2,462,023	0	186,084	186,084
-4,067.90000		07/13/2018		-4,067.90	-338,534	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,067.90	-314,745	0	23,789	23,789
-64,842.30000		07/19/2018		-64,842.30	-5,396,805	1.000000000 ^S 77.372848751	-64,842.30	-5,017,033	0	379,772	379,772
-779,961.50000		07/23/2018		-779,961.50	-64,630,841	1.000000000 ^S 77.372848751	-779,961.50	-60,347,843	0	4,282,998	4,282,998
-71,225.84000		07/24/2018		-71,225.84	-5,858,481	1.000000000 ^S 77.372848751	-71,225.84	-5,510,946	0	347,535	347,535
-38,008.43000		08/02/2018		-38,008.43	-3,151,351	1.000000000 ^S 77.372848751	-38,008.43	-2,940,821	0	210,530	210,530
-46,911.01000		08/07/2018		-46,911.01	-3,862,706	1.000000000 ^S 77.372848751	-46,911.01	-3,629,638	0	233,068	233,068
-230,631.58000		08/10/2018		-230,631.58	-18,925,734	1.000000000 ^S 77.372848751	-230,631.58	-17,844,622	0	1,081,112	1,081,112
-32,792.89000		08/17/2018		-32,792.89	-2,641,480	1.000000000 ^S 77.372848751	-32,792.89	-2,537,279	0	104,201	104,201
-27,692.84000		08/20/2018		-27,692.84	-2,226,969	1.000000000 ^S 77.372848751	-27,692.84	-2,142,674	0	84,295	84,295

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2020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>非グループ化の有価証券</u>											
<u>外貨建現金勘定</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-9,664.19000		08/22/2018		-9,664.19	-784,528	1.000000000 ^S 77.372848751	-9,664.19	-747,746	0	36,782	36,782
-18,900.99000		08/30/2018		-18,900.99	-1,539,099	1.000000000 ^S 77.372848751	-18,900.99	-1,462,423	0	76,676	76,676
-54,937.84000		08/31/2018		-54,937.84	-4,456,768	1.000000000 ^S 77.372848751	-54,937.84	-4,250,697	0	206,071	206,071
-232,403.15000		09/11/2018		-232,403.15	-18,379,859	1.000000000 ^S 77.372848751	-232,403.15	-17,981,694	0	398,165	398,165
-31,758.92000		09/19/2018		-31,758.92	-2,571,503	1.000000000 ^S 77.372848751	-31,758.92	-2,457,278	0	114,225	114,225
-12,327.35000		09/25/2018		-12,327.35	-1,007,913	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,327.35	-953,802	0	54,111	54,111
-16,004.18000		09/27/2018		-16,004.18	-1,313,144	1.000000000 ^S 77.372848751	-16,004.18	-1,238,289	0	74,855	74,855
-48,724.25000		10/02/2018		-48,724.25	-4,008,359	1.000000000 ^S 77.372848751	-48,724.25	-3,769,934	0	238,425	238,425
-23,470.68000		10/04/2018		-23,470.68	-1,915,543	1.000000000 ^S 77.372848751	-23,470.68	-1,815,993	0	99,550	99,550
-231,419.36000		10/12/2018		-231,419.36	-18,468,092	1.000000000 ^S 77.372848751	-231,419.36	-17,905,575	0	562,517	562,517
-53,598.82000		10/12/2018		-53,598.82	-4,277,377	1.000000000 ^S 77.372848751	-53,598.82	-4,147,093	0	130,284	130,284
-46,892.60000		10/12/2018		-46,892.60	-3,742,197	1.000000000 ^S 77.372848751	-46,892.60	-3,628,214	0	113,983	113,983
-3,953.84000		10/12/2018		-3,953.84	-315,531	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,953.84	-305,920	0	9,611	9,611
-63,024.29000		10/16/2018		-63,024.29	-5,032,717	1.000000000 ^S 77.372848751	-63,024.29	-4,876,369	0	156,348	156,348
-20,113.75000		10/17/2018		-20,113.75	-1,610,303	1.000000000 ^S 77.372848751	-20,113.75	-1,556,258	0	54,045	54,045
-664,259.35000		10/18/2018		-664,259.35	-53,018,344	1.000000000 ^S 77.372848751	-664,259.35	-51,395,638	0	1,622,706	1,622,706

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-18,070.52000		10/24/2018		-18,070.52	-1,429,780	1.000000000 ^S 77.372848751	-18,070.52	-1,398,168	0	31,612	31,612
-30,359.39000		10/26/2018		-30,359.39	-2,418,580	1.000000000 ^S 77.372848751	-30,359.39	-2,348,992	0	69,588	69,588
-104,308.20000		10/31/2018		-104,308.20	-8,365,512	1.000000000 ^S 77.372848751	-104,308.20	-8,070,623	0	294,889	294,889
-50,401.50000		11/08/2018		-50,401.50	-4,159,745	1.000000000 ^S 77.372848751	-50,401.50	-3,899,708	0	260,037	260,037
-224,392.25000		11/09/2018		-224,392.25	-18,614,349	1.000000000 ^S 77.372848751	-224,392.25	-17,361,868	0	1,252,481	1,252,481
-9,986.37000		11/09/2018		-9,986.37	-828,414	1.000000000 ^S 77.372848751	-9,986.37	-772,674	0	55,740	55,740
-10,134.32000		11/19/2018		-10,134.32	-836,189	1.000000000 ^S 77.372848751	-10,134.32	-784,121	0	52,068	52,068
-1,139,616.57000		11/20/2018		-1,139,616.57	-93,691,893	1.000000000 ^S 77.372848751	-1,139,616.57	-88,175,381	0	5,516,512	5,516,512
-42,170.11000		11/20/2018		-42,170.11	-3,466,953	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,170.11	-3,262,822	0	204,131	204,131
-38,005.37000		11/21/2018		-38,005.37	-3,108,318	1.000000000 ^S 77.372848751	-38,005.37	-2,940,584	0	167,734	167,734
-8,931.98000		12/03/2018		-8,931.98	-740,639	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,931.98	-691,093	0	49,546	49,546
-73,433.24000		12/05/2018		-73,433.24	-6,104,102	1.000000000 ^S 77.372848751	-73,433.24	-5,681,739	0	422,363	422,363
-190,442.27000		12/11/2018		-190,442.27	-15,458,291	1.000000000 ^S 77.372848751	-190,442.27	-14,735,061	0	723,230	723,230
-12,136.99000		12/11/2018		-12,136.99	-985,165	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,136.99	-939,073	0	46,092	46,092
-76,869.70000		12/13/2018		-76,869.70	-6,289,951	1.000000000 ^S 77.372848751	-76,869.70	-5,947,628	0	342,323	342,323
-459,000.00000		12/19/2018		-459,000.00	-37,076,503	1.000000000 ^S 77.372848751	-459,000.00	-35,514,138	0	1,562,365	1,562,365

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-31,261.26000		12/21/2018		-31,261.26	-2,482,585	1.000000000 ^S 77.372848751	-31,261.26	-2,418,773	0	63,812	63,812
-34,959.38000		12/27/2018		-34,959.38	-2,721,231	1.000000000 ^S 77.372848751	-34,959.38	-2,704,907	0	16,324	16,324
-13,486.62000		01/08/2019		-13,486.62	-1,043,413	1.000000000 ^S 77.372848751	-13,486.62	-1,043,498	0	-85	-85
-228,095.44000		01/11/2019		-228,095.44	-17,745,273	1.000000000 ^S 77.372848751	-228,095.44	-17,648,394	0	96,879	96,879
-31,995.00000		01/16/2019		-31,995.00	-2,501,010	1.000000000 ^S 77.372848751	-31,995.00	-2,475,544	0	25,466	25,466
-44,669.19000		01/17/2019		-44,669.19	-3,490,929	1.000000000 ^S 77.372848751	-44,669.19	-3,456,182	0	34,747	34,747
-60,036.00000		01/22/2019		-60,036.00	-4,709,139	1.000000000 ^S 77.372848751	-60,036.00	-4,645,156	0	63,983	63,983
-25,634.10000		01/22/2019		-25,634.10	-2,010,703	1.000000000 ^S 77.372848751	-25,634.10	-1,983,383	0	27,320	27,320
-254,230.16000		01/31/2019		-254,230.16	-20,035,819	1.000000000 ^S 77.372848751	-254,230.16	-19,670,512	0	365,307	365,307
-226,610.05000		02/12/2019		-226,610.05	-17,678,793	1.000000000 ^S 77.372848751	-226,610.05	-17,533,465	0	145,328	145,328
-46,516.42000		02/12/2019		-46,516.42	-3,628,939	1.000000000 ^S 77.372848751	-46,516.42	-3,599,108	0	29,831	29,831
-221,553.53000		02/20/2019		-221,553.53	-17,494,299	1.000000000 ^S 77.372848751	-221,553.53	-17,142,228	0	352,071	352,071
-38,774.55000		03/01/2019		-38,774.55	-3,070,891	1.000000000 ^S 77.372848751	-38,774.55	-3,000,097	0	70,794	70,794
-63,764.01000		03/04/2019		-63,764.01	-5,062,062	1.000000000 ^S 77.372848751	-63,764.01	-4,933,603	0	128,459	128,459
-231,531.52000		03/11/2019		-231,531.52	-18,113,517	1.000000000 ^S 77.372848751	-231,531.52	-17,914,253	0	199,264	199,264
-15,693.27000		03/14/2019		-15,693.27	-1,237,080	1.000000000 ^S 77.372848751	-15,693.27	-1,214,233	0	22,847	22,847

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-11,606.00000		03/15/2019		-11,606.00	-915,480	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,606.00	-897,989	0	17,491	17,491
-600,999.98000		03/26/2019		-600,999.98	-47,070,099	1.000000000 ^S 77.372848751	-600,999.98	-46,501,081	0	569,018	569,018
-515,784.59000		03/29/2019		-515,784.59	-40,357,721	1.000000000 ^S 77.372848751	-515,784.59	-39,907,723	0	449,998	449,998
-73,349.53000		04/08/2019		-73,349.53	-5,822,604	1.000000000 ^S 77.372848751	-73,349.53	-5,675,262	0	147,342	147,342
-225,346.84000		04/11/2019		-225,346.84	-17,858,735	1.000000000 ^S 77.372848751	-225,346.84	-17,435,727	0	423,008	423,008
-35,132.62000		04/17/2019		-35,132.62	-2,821,296	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,132.62	-2,718,311	0	102,985	102,985
-58,870.03000		04/18/2019		-58,870.03	-4,734,422	1.000000000 ^S 77.372848751	-58,870.03	-4,554,942	0	179,480	179,480
-43,801.67000		04/18/2019		-43,801.67	-3,522,600	1.000000000 ^S 77.372848751	-43,801.67	-3,389,060	0	133,540	133,540
-3,693.23000		04/18/2019		-3,693.23	-297,015	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,693.23	-285,756	0	11,259	11,259
-225,082.95000		05/14/2019		-225,082.95	-17,085,005	1.000000000 ^S 77.372848751	-225,082.95	-17,415,309	0	-330,304	-330,304
-94,910.58000		05/17/2019		-94,910.58	-7,205,523	1.000000000 ^S 77.372848751	-94,910.58	-7,343,502	0	-137,979	-137,979
-87,834.76000		05/23/2019		-87,834.76	-6,662,312	1.000000000 ^S 77.372848751	-87,834.76	-6,796,026	0	-133,714	-133,714
-55,793.55000		05/31/2019		-55,793.55	-4,229,298	1.000000000 ^S 77.372848751	-55,793.55	-4,316,906	0	-87,608	-87,608
-226,601.48000		06/12/2019		-226,601.48	-17,112,794	1.000000000 ^S 77.372848751	-226,601.48	-17,532,802	0	-420,008	-420,008
-15,197.25000		06/25/2019		-15,197.25	-1,134,949	1.000000000 ^S 77.372848751	-15,197.25	-1,175,855	0	-40,906	-40,906
-11,644.71000		07/08/2019		-11,644.71	-880,468	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,644.71	-900,984	0	-20,516	-20,516

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-121,556.01000		07/11/2019		-121,556.01	-9,176,397	1.000000000 ^S 77.372848751	-121,556.01	-9,405,135	0	-228,738	-228,738
-44,689.00000		07/18/2019		-44,689.00	-3,384,444	1.000000000 ^S 77.372848751	-44,689.00	-3,457,715	0	-73,271	-73,271
-3,768.04000		07/18/2019		-3,768.04	-285,366	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,768.04	-291,544	0	-6,178	-6,178
-29,373.95000		07/19/2019		-29,373.95	-2,230,106	1.000000000 ^S 77.372848751	-29,373.95	-2,272,746	0	-42,640	-42,640
-441,467.63000		07/22/2019		-441,467.63	-33,520,533	1.000000000 ^S 77.372848751	-441,467.63	-34,157,608	0	-637,075	-637,075
-175,549.92000		07/30/2019		-175,549.92	-13,177,136	1.000000000 ^S 77.372848751	-175,549.92	-13,582,797	0	-405,661	-405,661
-60,062.61000		07/31/2019		-60,062.61	-4,485,957	1.000000000 ^S 77.372848751	-60,062.61	-4,647,215	0	-161,258	-161,258
-232,223.94000		08/09/2019		-232,223.94	-16,768,953	1.000000000 ^S 77.372848751	-232,223.94	-17,967,828	0	-1,198,875	-1,198,875
-205,109.53000		09/11/2019		-205,109.53	-15,096,651	1.000000000 ^S 77.372848751	-205,109.53	-15,869,909	0	-773,258	-773,258
-17,578.68000		09/17/2019		-17,578.68	-1,302,835	1.000000000 ^S 77.372848751	-17,578.68	-1,360,113	0	-57,278	-57,278
-10,884.12000		09/19/2019		-10,884.12	-805,883	1.000000000 ^S 77.372848751	-10,884.12	-842,135	0	-36,252	-36,252
-778,958.02000		09/24/2019		-778,958.02	-56,646,058	1.000000000 ^S 77.372848751	-778,958.02	-60,270,201	0	-3,624,143	-3,624,143
-7,509.72000		10/03/2019		-7,509.72	-539,891	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,509.72	-581,048	0	-41,157	-41,157
-205,806.16000		10/11/2019		-205,806.16	-15,010,764	1.000000000 ^S 77.372848751	-205,806.16	-15,923,809	0	-913,045	-913,045
-32,085.08000		10/11/2019		-32,085.08	-2,340,171	1.000000000 ^S 77.372848751	-32,085.08	-2,482,514	0	-142,343	-142,343
-47,442.98000		10/15/2019		-47,442.98	-3,480,370	1.000000000 ^S 77.372848751	-47,442.98	-3,670,799	0	-190,429	-190,429

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-4,000.25000		10/15/2019		-4,000.25	-293,454	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,000.25	-309,511	0	-16,057	-16,057
-63,764.01000		10/17/2019		-63,764.01	-4,680,782	1.000000000 ^S 77.372848751	-63,764.01	-4,933,603	0	-252,821	-252,821
-88,188.28000		10/24/2019		-88,188.28	-6,556,354	1.000000000 ^S 77.372848751	-88,188.28	-6,823,378	0	-267,024	-267,024
-997,183.01000		10/29/2019		-997,183.01	-74,336,492	1.000000000 ^S 77.372848751	-997,183.01	-77,154,890	0	-2,818,398	-2,818,398
-18,077.89000		10/30/2019		-18,077.89	-1,350,202	1.000000000 ^S 77.372848751	-18,077.89	-1,398,738	0	-48,536	-48,536
-200,251.64000		11/12/2019		-200,251.64	-14,964,007	1.000000000 ^S 77.372848751	-200,251.64	-15,494,040	0	-530,033	-530,033
-49,082.82000		11/13/2019		-49,082.82	-3,665,794	1.000000000 ^S 77.372848751	-49,082.82	-3,797,678	0	-131,884	-131,884
-20,180.00000		11/25/2019		-20,180.00	-1,487,718	1.000000000 ^S 77.372848751	-20,180.00	-1,561,384	0	-73,666	-73,666
-202,741.20000		12/11/2019		-202,741.20	-15,005,931	1.000000000 ^S 77.372848751	-202,741.20	-15,686,664	0	-680,733	-680,733
-574,851.64000		12/16/2019		-574,851.64	-43,181,511	1.000000000 ^S 77.372848751	-574,851.64	-44,477,909	0	-1,296,398	-1,296,398
-4,780.63000		12/17/2019		-4,780.63	-361,393	1.000000000 ^S 77.372848751	-4,780.63	-369,891	0	-8,498	-8,498
-494,616.57000		12/19/2019		-494,616.57	-37,192,781	1.000000000 ^S 77.372848751	-494,616.57	-38,269,893	0	-1,077,112	-1,077,112
-13,059.23000		12/20/2019		-13,059.23	-981,935	1.000000000 ^S 77.372848751	-13,059.23	-1,010,430	0	-28,495	-28,495
-3,061.85000		12/24/2019		-3,061.85	-231,660	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,061.85	-236,904	0	-5,244	-5,244
-26,661.23000		12/27/2019		-26,661.23	-2,028,365	1.000000000 ^S 77.372848751	-26,661.23	-2,062,855	0	-34,490	-34,490
-143,370.03000		01/07/2020		-143,370.03	-10,767,119	1.000000000 ^S 77.372848751	-143,370.03	-11,092,948	0	-325,829	-325,829

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-14,950.87000		01/08/2020		-14,950.87	-1,115,419	1.000000000S 77.372848751	-14,950.87	-1,156,791	0	-41,372	-41,372
-197,898.31000		01/10/2020		-197,898.31	-14,857,545	1.000000000S 77.372848751	-197,898.31	-15,311,956	0	-454,411	-454,411
-62,954.74000		01/29/2020		-62,954.74	-4,639,562	1.000000000S 77.372848751	-62,954.74	-4,870,988	0	-231,426	-231,426
-58,342.15000		02/04/2020		-58,342.15	-4,246,537	1.000000000S 77.372848751	-58,342.15	-4,514,098	0	-267,561	-267,561
-199,630.11000		02/12/2020		-199,630.11	-14,748,546	1.000000000S 77.372848751	-199,630.11	-15,445,950	0	-697,404	-697,404
-16,163.64000		02/28/2020		-16,163.64	-1,169,196	1.000000000S 77.372848751	-16,163.64	-1,250,627	0	-81,431	-81,431
-1,683,616.57000		03/10/2020		-1,683,616.57	-114,922,117	1.000000000S 77.372848751	-1,683,616.57	-130,266,210	0	-15,344,093	-15,344,093
-341,601.08000		03/11/2020		-341,601.08	-22,956,980	1.000000000S 77.372848751	-341,601.08	-26,430,649	0	-3,473,669	-3,473,669
-199,895.77000		03/11/2020		-199,895.77	-13,433,808	1.000000000S 77.372848751	-199,895.77	-15,466,505	0	-2,032,697	-2,032,697
-9,798.00000		03/24/2020		-9,798.00	-627,957	1.000000000S 77.372848751	-9,798.00	-758,099	0	-130,142	-130,142
-198,161.35000		04/14/2020		-198,161.35	-13,606,730	1.000000000S 77.372848751	-198,161.35	-15,332,308	0	-1,725,578	-1,725,578
-59,967.25000		04/28/2020		-59,967.25	-4,154,860	1.000000000S 77.372848751	-59,967.25	-4,639,837	0	-484,977	-484,977
-44,618.04000		04/28/2020		-44,618.04	-3,091,383	1.000000000S 77.372848751	-44,618.04	-3,452,225	0	-360,842	-360,842
-3,762.06000		04/28/2020		-3,762.06	-260,656	1.000000000S 77.372848751	-3,762.06	-291,081	0	-30,425	-30,425
-198,664.80000		05/14/2020		-198,664.80	-13,775,595	1.000000000S 77.372848751	-198,664.80	-15,371,262	0	-1,595,667	-1,595,667
-44,195.22000		05/19/2020		-44,195.22	-3,085,605	1.000000000S 77.372848751	-44,195.22	-3,419,510	0	-333,905	-333,905

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2020年8月末日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-198,852.82000		06/11/2020		-198,852.82	-14,907,920	1.000000000 ^S 77.372848751	-198,852.82	-15,385,809	0	-477,889	-477,889
-162.06000		06/11/2020		-162.06	-12,150	1.000000000 ^S 77.372848751	-162.06	-12,539	0	-389	-389
-8,754.11000		06/12/2020		-8,754.11	-644,312	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,754.11	-677,330	0	-33,018	-33,018
-7,750.00000		06/15/2020		-7,750.00	-568,998	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,750.00	-599,640	0	-30,642	-30,642
-15,511.80000		06/16/2020		-15,511.80	-1,142,240	1.000000000 ^S 77.372848751	-15,511.80	-1,200,192	0	-57,952	-57,952
-23,202.00000		06/17/2020		-23,202.00	-1,704,897	1.000000000 ^S 77.372848751	-23,202.00	-1,795,205	0	-90,308	-90,308
-35,546.52000		06/18/2020		-35,546.52	-2,635,936	1.000000000 ^S 77.372848751	-35,546.52	-2,750,336	0	-114,400	-114,400
-605,404.68000		06/19/2020		-605,404.68	-44,361,785	1.000000000 ^S 77.372848751	-605,404.68	-46,841,885	0	-2,480,100	-2,480,100
-152,267.88000		06/22/2020		-152,267.88	-11,176,599	1.000000000 ^S 77.372848751	-152,267.88	-11,781,400	0	-604,801	-604,801
-11,662.50000		06/25/2020		-11,662.50	-859,904	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,662.50	-902,361	0	-42,457	-42,457
-7,777.00000		06/26/2020		-7,777.00	-571,793	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,777.00	-601,729	0	-29,936	-29,936
-19,286.41000		06/30/2020		-19,286.41	-1,423,771	1.000000000 ^S 77.372848751	-19,286.41	-1,492,244	0	-68,473	-68,473
-11,667.00000		07/01/2020		-11,667.00	-866,611	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,667.00	-902,709	0	-36,098	-36,098
-3,891.50000		07/02/2020		-3,891.50	-289,661	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,891.50	-301,096	0	-11,435	-11,435
-7,784.00000		07/06/2020		-7,784.00	-580,762	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,784.00	-602,270	0	-21,508	-21,508
-11,591.56000		07/07/2020		-11,591.56	-870,380	1.000000000 ^S 77.372848751	-11,591.56	-896,872	0	-26,492	-26,492

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-7,784.00000		07/08/2020		-7,784.00	-583,408	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,784.00	-602,270	0	-18,862	-18,862
-7,812.00000		07/09/2020		-7,812.00	-585,149	1.000000000 ^S 77.372848751	-7,812.00	-604,437	0	-19,288	-19,288
-192,699.63000		07/10/2020		-192,699.63	-14,392,052	1.000000000 ^S 77.372848751	-192,699.63	-14,909,719	0	-517,667	-517,667
-5,968.29000		07/10/2020		-5,968.29	-445,750	1.000000000 ^S 77.372848751	-5,968.29	-461,784	0	-16,034	-16,034
-67,490.38000		07/13/2020		-67,490.38	-5,013,915	1.000000000 ^S 77.372848751	-67,490.38	-5,221,923	0	-208,008	-208,008
-42,642.14000		07/15/2020		-42,642.14	-3,186,186	1.000000000 ^S 77.372848751	-42,642.14	-3,299,344	0	-113,158	-113,158
-3,595.46000		07/15/2020		-3,595.46	-268,650	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,595.46	-278,191	0	-9,541	-9,541
-24,622.52000		07/16/2020		-24,622.52	-1,847,388	1.000000000 ^S 77.372848751	-24,622.52	-1,905,115	0	-57,727	-57,727
-3,893.00000		07/17/2020		-3,893.00	-291,913	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,893.00	-301,213	0	-9,300	-9,300
-3,896.50000		07/20/2020		-3,896.50	-291,596	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,896.50	-301,483	0	-9,887	-9,887
-2,922.04000		07/21/2020		-2,922.04	-219,589	1.000000000 ^S 77.372848751	-2,922.04	-226,087	0	-6,498	-6,498
-57,311.61000		07/22/2020		-57,311.61	-4,354,693	1.000000000 ^S 77.372848751	-57,311.61	-4,434,363	0	-79,670	-79,670
-34,354.75000		07/22/2020		-34,354.75	-2,610,368	1.000000000 ^S 77.372848751	-34,354.75	-2,658,125	0	-47,757	-47,757
-3,910.00000		07/27/2020		-3,910.00	-293,843	1.000000000 ^S 77.372848751	-3,910.00	-302,528	0	-8,685	-8,685
-5,740.95000		07/28/2020		-5,740.95	-431,446	1.000000000 ^S 77.372848751	-5,740.95	-444,194	0	-12,748	-12,748
-10,962.84000		08/06/2020		-10,962.84	-835,391	1.000000000 ^S 77.372848751	-10,962.84	-848,226	0	-12,835	-12,835

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
-177,143.44000		08/12/2020		-177,143.44	-13,510,058	1.000000000 ^S 77.372848751	-177,143.44	-13,706,093	0	-196,035	-196,035
-12,122.71000		08/12/2020		-12,122.71	-924,553	1.000000000 ^S 77.372848751	-12,122.71	-937,969	0	-13,416	-13,416
-52,384.44000		08/13/2020		-52,384.44	-4,016,526	1.000000000 ^S 77.372848751	-52,384.44	-4,053,133	0	-36,607	-36,607
-10,958.81000		08/18/2020		-10,958.81	-837,510	1.000000000 ^S 77.372848751	-10,958.81	-847,914	0	-10,404	-10,404
-275,950.40000		08/20/2020		-275,950.40	-21,100,323	1.000000000 ^S 77.372848751	-275,950.40	-21,351,069	0	-250,746	-250,746
-62,870.83000		08/21/2020		-62,870.83	-4,770,834	1.000000000 ^S 77.372848751	-62,870.83	-4,864,495	0	-93,661	-93,661
-116,678.12000		08/24/2020		-116,678.12	-8,843,608	1.000000000 ^S 77.372848751	-116,678.12	-9,027,719	0	-184,111	-184,111
-8,315.43000		08/26/2020		-8,315.43	-635,712	1.000000000 ^S 77.372848751	-8,315.43	-643,389	0	-7,677	-7,677
1,020,084.92000	合計 -----			1,020,085	-253,808,922		1,020,085	78,926,883	0	332,735,805	332,735,805
0.00000											
38,120.90	BRITISH POUND GBP	08/20/2020		38,120.90	5,309,821	1.000000000 ^S 140.382095492	38,120.90	5,351,492	0	41,671	41,671
289,327.13		08/20/2020		289,327.13	40,300,075	1.000000000 ^S 140.382095492	289,327.13	40,616,349	0	316,274	316,274
327,448.03000	合計 -----			327,448	45,609,896		327,448	45,967,841	0	357,945	357,945
0.00000											
50.00	CANADIAN DOLLAR CAD	08/13/2014		50.00	4,670	1.000000000 ^S 0.012443854	50.00	4,018	0	-652	-652

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
5,301.37000	EURO	08/20/2020		5,301.37	666,535	1.000000000 ^S	5,301.37	664,219	0	-2,316	-2,316
	EUR					125.291889006					
415,463.66000		08/20/2020		415,463.66	52,235,740	1.000000000 ^S	415,463.66	52,054,227	0	-181,513	-181,513
						125.291889006					
420,765.03000	合計 -----			420,765	52,902,275		420,765	52,718,446	0	-183,829	-183,829
0.00000											
10,124.38000	UNITED STATES DOLLAR	08/14/2020		10,124.38	1,082,144	1.000000000 ^S	10,124.38	1,066,148	0	-15,996	-15,996
	USD					0.009496225					
34,344.15000		08/14/2020		34,344.15	3,670,874	1.000000000 ^S	34,344.15	3,616,611	0	-54,263	-54,263
						0.009496225					
1,779,051.00000		08/14/2020		1,779,051.00	190,153,861	1.000000000 ^S	1,779,051.00	187,342,970	0	-2,810,891	-2,810,891
						0.009496225					
2,723,958.86000		08/14/2020		2,723,958.86	291,150,334	1.000000000 ^S	2,723,958.86	286,846,495	0	-4,303,839	-4,303,839
						0.009496225					
48,875.00000		08/15/2020		48,875.00	5,202,988	1.000000000 ^S	48,875.00	5,146,782	0	-56,206	-56,206
						0.009496225					
83,250.00000		08/15/2020		83,250.00	8,862,378	1.000000000 ^S	83,250.00	8,766,641	0	-95,737	-95,737
						0.009496225					
163,383.75000		08/15/2020		163,383.75	17,393,016	1.000000000 ^S	163,383.75	17,205,126	0	-187,890	-187,890
						0.009496225					
11,437.30000		08/17/2020		11,437.30	1,217,558	1.000000000 ^S	11,437.30	1,204,405	0	-13,153	-13,153
						0.009496225					
127,925.00000		08/19/2020		127,925.00	13,489,692	1.000000000 ^S	127,925.00	13,471,142	0	-18,550	-18,550
						0.009496225					
5,665.00000		08/20/2020		5,665.00	598,507	1.000000000 ^S	5,665.00	596,553	0	-1,954	-1,954
						0.009496225					
95,660.83000		08/20/2020		95,660.83	10,106,567	1.000000000 ^S	95,660.83	10,073,564	0	-33,003	-33,003
						0.009496225					
933,680.00000		08/20/2020		933,680.00	98,643,295	1.000000000 ^S	933,680.00	98,321,175	0	-322,120	-322,120
						0.009496225					

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	単価／ 為替レート	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	未実現損益 通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,077,608.66000		08/20/2020		1,077,608.66	113,849,359	1.000000000 ^S 0.009496225	1,077,608.66	113,477,583	0	-371,776	-371,776
2,514,897.51000		08/20/2020		2,514,897.51	265,698,931	1.000000000 ^S 0.009496225	2,514,897.51	264,831,289	0	-867,642	-867,642
4,642,365.00000		08/20/2020		4,642,365.00	490,465,880	1.000000000 ^S 0.009496225	4,642,365.00	488,864,259	0	-1,601,621	-1,601,621
5,386,467.00000		08/20/2020		5,386,467.00	569,080,259	1.000000000 ^S 0.009496225	5,386,467.00	567,221,922	0	-1,858,337	-1,858,337
63,480.00000	USD	08/25/2020		63,480.00	6,719,993	1.000000000 ^S 0.009496225	63,480.00	6,684,762	0	-35,231	-35,231
89,553.85000		08/26/2020		89,553.85	9,541,963	1.000000000 ^S 0.009496225	89,553.85	9,430,468	0	-111,495	-111,495
29,700.00000		08/27/2020		29,700.00	3,152,506	1.000000000 ^S 0.009496225	29,700.00	3,127,559	0	-24,947	-24,947
-7,490,249.49000		05/19/2020		-7,490,249.49	-804,602,635	1.000000000 ^S 0.009496225	-7,490,249.49	-788,760,743	0	15,841,892	15,841,892
-287,782.50000		05/19/2020		-287,782.50	-30,913,597	1.000000000 ^S 0.009496225	-287,782.50	-30,304,937	0	608,660	608,660
-268,200.02000		05/19/2020		-268,200.02	-28,810,047	1.000000000 ^S 0.009496225	-268,200.02	-28,242,804	0	567,243	567,243
-264,384.35000		05/19/2020		-264,384.35	-28,400,168	1.000000000 ^S 0.009496225	-264,384.35	-27,840,995	0	559,173	559,173
-247,424.85000		05/19/2020		-247,424.85	-26,578,379	1.000000000 ^S 0.009496225	-247,424.85	-26,055,075	0	523,304	523,304
-207,436.14000		05/19/2020		-207,436.14	-22,282,791	1.000000000 ^S 0.009496225	-207,436.14	-21,844,063	0	438,728	438,728
-16,257.37000		05/19/2020		-16,257.37	-1,746,367	1.000000000 ^S 0.009496225	-16,257.37	-1,711,982	0	34,385	34,385
-26,424.00000		05/20/2020		-26,424.00	-2,852,075	1.000000000 ^S 0.009496225	-26,424.00	-2,782,579	0	69,496	69,496

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-17,612.00000		05/26/2020		-17,612.00	-1,896,812	1.000000000 ^S 0.009496225	-17,612.00	-1,854,632	0	42,180	42,180
-5,682.75000		05/27/2020		-5,682.75	-611,435	1.000000000 ^S 0.009496225	-5,682.75	-598,422	0	13,013	13,013
-8,869.00000		05/28/2020		-8,869.00	-956,389	1.000000000 ^S 0.009496225	-8,869.00	-933,950	0	22,439	22,439
-16,388.16000		06/02/2020		-16,388.16	-1,762,628	1.000000000 ^S 0.009496225	-16,388.16	-1,725,755	0	36,873	36,873
-503,806.82000		06/10/2020		-503,806.82	-54,267,552	1.000000000 ^S 0.009496225	-503,806.82	-53,053,379	0	1,214,173	1,214,173
-24,568.92000		06/10/2020		-24,568.92	-2,646,441	1.000000000 ^S 0.009496225	-24,568.92	-2,587,230	0	59,211	59,211
-823,343.80000		06/11/2020		-823,343.80	-88,299,506	1.000000000 ^S 0.009496225	-823,343.80	-86,702,221	0	1,597,285	1,597,285
-224,646.78000		06/11/2020		-224,646.78	-24,092,244	1.000000000 ^S 0.009496225	-224,646.78	-23,656,430	0	435,814	435,814
-18,116.00000		06/15/2020		-18,116.00	-1,944,390	1.000000000 ^S 0.009496225	-18,116.00	-1,907,705	0	36,685	36,685
-3,220,263.87000		06/16/2020		-3,220,263.87	-345,872,423	1.000000000 ^S 0.009496225	-3,220,263.87	-339,109,896	0	6,762,527	6,762,527
-32,886.48000		06/18/2020		-32,886.48	-3,526,911	1.000000000 ^S 0.009496225	-32,886.48	-3,463,111	0	63,800	63,800
-99,825.60000		06/24/2020		-99,825.60	-10,604,972	1.000000000 ^S 0.009496225	-99,825.60	-10,512,135	0	92,837	92,837
-9,087.00000		06/25/2020		-9,087.00	-971,446	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,087.00	-956,907	0	14,539	14,539
-9,094.00000		06/29/2020		-9,094.00	-976,104	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,094.00	-957,644	0	18,460	18,460
-816.67000		06/30/2020		-816.67	-87,968	1.000000000 ^S 0.009496225	-816.67	-85,999	0	1,969	1,969

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
-10,631.00000		07/01/2020		-10,631.00	-1,145,118	1.000000000 ^S 0.009496225	-10,631.00	-1,119,497	0	25,621	25,621
-9,095.00000		07/06/2020		-9,095.00	-977,985	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,095.00	-957,749	0	20,236	20,236
-26,657.95000		07/08/2020		-26,657.95	-2,867,196	1.000000000 ^S 0.009496225	-26,657.95	-2,807,215	0	59,981	59,981
-12,257.81000		07/09/2020		-12,257.81	-1,317,960	1.000000000 ^S 0.009496225	-12,257.81	-1,290,809	0	27,151	27,151
-295,451.90000		07/10/2020		-295,451.90	-31,697,555	1.000000000 ^S 0.009496225	-295,451.90	-31,112,563	0	584,992	584,992
-127,048.24000		07/10/2020		-127,048.24	-13,630,370	1.000000000 ^S 0.009496225	-127,048.24	-13,378,815	0	251,555	251,555
-9,098.00000		07/13/2020		-9,098.00	-971,257	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,098.00	-958,065	0	13,192	13,192
-179,272.43000		07/15/2020		-179,272.43	-19,227,864	1.000000000 ^S 0.009496225	-179,272.43	-18,878,284	0	349,580	349,580
-15,115.72000		07/15/2020		-15,115.72	-1,621,236	1.000000000 ^S 0.009496225	-15,115.72	-1,591,761	0	29,475	29,475
-9,101.00000		07/15/2020		-9,101.00	-976,128	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,101.00	-958,381	0	17,747	17,747
-9,096.00000		07/16/2020		-9,096.00	-971,817	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,096.00	-957,854	0	13,963	13,963
-6,867.20000		07/20/2020		-6,867.20	-735,786	1.000000000 ^S 0.009496225	-6,867.20	-723,151	0	12,635	12,635
-240,944.57000		07/22/2020		-240,944.57	-25,758,180	1.000000000 ^S 0.009496225	-240,944.57	-25,372,669	0	385,511	385,511
-9,235.00000		08/03/2020		-9,235.00	-976,417	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,235.00	-972,492	0	3,925	3,925
-86,976.54000		08/06/2020		-86,976.54	-9,181,678	1.000000000 ^S 0.009496225	-86,976.54	-9,159,065	0	22,613	22,613

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
クラスに割当てられていない資産											
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
-9,252.00000		08/07/2020		-9,252.00	-976,317	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,252.00	-974,282	0	2,035	2,035
-9,273.00000		08/11/2020		-9,273.00	-980,852	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,273.00	-976,493	0	4,359	4,359
-825,438.66000		08/12/2020		-825,438.66	-87,880,329	1.000000000 ^S 0.009496225	-825,438.66	-86,922,820	0	957,509	957,509
-663,957.82000		08/12/2020		-663,957.82	-70,688,271	1.000000000 ^S 0.009496225	-663,957.82	-69,918,080	0	770,191	770,191
-172,136.00000		08/12/2020		-172,136.00	-18,326,460	1.000000000 ^S 0.009496225	-172,136.00	-18,126,782	0	199,678	199,678
-9,213.00000		08/12/2020		-9,213.00	-980,862	1.000000000 ^S 0.009496225	-9,213.00	-970,175	0	10,687	10,687
-18,687.95000		08/14/2020		-18,687.95	-1,997,461	1.000000000 ^S 0.009496225	-18,687.95	-1,967,935	0	29,526	29,526
-106,877.14000		08/17/2020		-106,877.14	-11,377,605	1.000000000 ^S 0.009496225	-106,877.14	-11,254,698	0	122,907	122,907
-73,824.00000		08/18/2020		-73,824.00	-7,830,512	1.000000000 ^S 0.009496225	-73,824.00	-7,774,037	0	56,475	56,475
-100,969.24000		08/19/2020		-100,969.24	-10,647,207	1.000000000 ^S 0.009496225	-100,969.24	-10,632,566	0	14,641	14,641
-64,512.00000		08/20/2020		-64,512.00	-6,815,693	1.000000000 ^S 0.009496225	-64,512.00	-6,793,436	0	22,257	22,257
-59,607.46000		08/21/2020		-59,607.46	-6,315,112	1.000000000 ^S 0.009496225	-59,607.46	-6,276,964	0	38,148	38,148
-61,675.49000		08/24/2020		-61,675.49	-6,534,827	1.000000000 ^S 0.009496225	-61,675.49	-6,494,738	0	40,089	40,089
-64,603.00000		08/25/2020		-64,603.00	-6,838,873	1.000000000 ^S 0.009496225	-64,603.00	-6,803,019	0	35,854	35,854
-62,807.65000		08/27/2020		-62,807.65	-6,666,718	1.000000000 ^S 0.009496225	-62,807.65	-6,613,960	0	52,758	52,758

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

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

(注２) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020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>											
-74,780.17000		08/28/2020		-74,780.17	-7,959,975	1.000000000 ^S 0.009496225	-74,780.17	-7,874,726	0	85,249	85,249
2,573,797.78000	合計 -----			2,573,798	250,503,204		2,573,798	271,033,779	0	20,530,575	20,530,575
0.00000											
4,342,145.76000	非グループ化の有価証券小計			4,342,146	95,211,123		4,342,146	448,650,967	0	353,439,844	353,439,844
4,342,145.76000	外貨建現金勘定合計			4,342,146	95,211,123		4,342,146	448,650,967	0	353,439,844	353,439,844
<u>先物(ポジション)</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
306,899.00000	AUD FORWARD 13 OCT	08/05/2020		306,899.00	23,246,180	1.000000000 ^F 77.336757186	306,899.00	23,734,573	0	488,393	488,393
	FAU13OCT										
1,183,101.00000		08/05/2020		1,183,101.00	89,614,430	1.000000000 ^F 77.336757186	1,183,101.00	91,497,195	0	1,882,765	1,882,765
-1,664,616.57000		07/14/2020		-1,664,616.57	-123,910,493	1.000000000 ^F 77.336757186	-1,664,616.57	-128,736,047	0	-4,825,554	-4,825,554
-417,000.00000		08/10/2020		-417,000.00	-31,616,411	1.000000000 ^F 77.336757186	-417,000.00	-32,249,428	0	-633,017	-633,017
-900,000.00000		08/20/2020		-900,000.00	-67,982,509	1.000000000 ^F 77.336757186	-900,000.00	-69,603,081	0	-1,620,572	-1,620,572
	FAU13OCT										
-1,491,616.57000	合計 -----			-1,491,617	-110,648,803		-1,491,617	-115,356,788	0	-4,707,985	-4,707,985
0.00000											
3,072,000.00000	EUR FORWARD 03 SEP	08/28/2020		3,072,000.00	385,531,993	1.000000000 ^F 125.299591323	3,072,000.00	384,920,345	0	-611,648	-611,648
	FEU03SEP										
3,900,000.00000	EUR FORWARD 13 OCT	08/18/2020		3,900,000.00	490,926,248	1.000000000 ^F 125.345232106	3,900,000.00	488,846,405	0	-2,079,843	-2,079,843
	FEU13OCT										
-23,729,363.20000		07/14/2020		-23,729,363.20	-2,892,192,949	1.000000000 ^F 125.345232106	-23,729,363.20	-2,974,362,538	0	-82,169,589	-82,169,589
-23,729,363.20000		07/14/2020		-23,729,363.20	-2,892,180,223	1.000000000 ^F 125.345232106	-23,729,363.20	-2,974,362,538	0	-82,182,315	-82,182,315
-23,729,363.20000		07/14/2020		-23,729,363.20	-2,891,109,288	1.000000000 ^F 125.345232106	-23,729,363.20	-2,974,362,538	0	-83,253,250	-83,253,250

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年 8 月末日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注 1)	取得原価 (基準通貨) (注 2) (円)	単価 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注 1)	価額 (基準通貨) (注 2) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-23,729,363.18000		07/14/2020		-23,729,363.18	-2,890,432,186	1.000000000F 125.345232106	-23,729,363.18	-2,974,362,536	0	-83,930,350	-83,930,350
-795,000.00000		07/16/2020		-795,000.00	-97,142,687	1.000000000F 125.345232106	-795,000.00	-99,649,460	0	-2,506,773	-2,506,773
-817,248.51000		07/27/2020		-817,248.51	-101,620,853	1.000000000F 125.345232106	-817,248.51	-102,438,204	0	-817,351	-817,351
-791,000.00000		07/29/2020		-791,000.00	-97,531,321	1.000000000F 125.345232106	-791,000.00	-99,148,079	0	-1,616,758	-1,616,758
-3,072,000.00000		08/28/2020		-3,072,000.00	-389,934,055	1.000000000F 125.345232106	-3,072,000.00	-385,060,553	0	4,873,502	4,873,502
-96,492,701.29000 0.00000	合計 -----			-96,492,701	-11,761,217,314		-96,492,701	-12,094,900,041	0	-333,682,727	-333,682,727
818,000.00	GBP FORWARD 13 OCT FGB13OCT	08/18/2020		818,000.00	113,653,771	1.000000000F 140.335356595	818,000.00	114,794,322	0	1,140,551	1,140,551
1,909,000.00		08/18/2020		1,909,000.00	265,238,445	1.000000000F 140.335356595	1,909,000.00	267,900,196	0	2,661,751	2,661,751
-22,790,842.59		07/14/2020		-22,790,842.59	-3,063,469,679	1.000000000F 140.335356595	-22,790,842.59	-3,198,361,022	0	-134,891,343	-134,891,343
-818,000.00		08/05/2020		-818,000.00	-113,938,934	1.000000000F 140.335356595	-818,000.00	-114,794,322	0	-855,388	-855,388
-20,881,842.59000 0.00000	合計 -----			-20,881,843	-2,798,516,397		-20,881,843	-2,930,460,826	0	-131,944,429	-131,944,429
-3,660,069.89000	USD FORWARD 03 SEP FUS03SEP	08/28/2020		-3,660,069.89	-385,531,995	1.000000000F 0.009496770	-3,660,069.89	-385,401,551	0	130,444	130,444
-1,424,801.81000		08/28/2020		-1,424,801.81	-150,000,001	1.000000000F 0.009496770	-1,424,801.81	-150,030,148	0	-30,147	-30,147
-5,084,871.70000 0.00000	合計 -----			-5,084,872	-535,531,996		-5,084,872	-535,431,699	0	100,297	100,297
977,743.46000	USD FORWARD 13 OCT FUS13OCT	07/14/2020		977,743.46	104,735,959	1.000000000F 0.009501847	977,743.46	102,900,358	0	-1,835,601	-1,835,601

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

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

（注 2）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （円）	単価／ 為替レート	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （円）	市場 （円）	未実現損益 通貨 （円）	合計 （円）
クラスに割当てられていない資産											
先物（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
1,155,073.78000		07/14/2020		1,155,073.78	123,910,492	1.000000000F 0.009501847	1,155,073.78	121,563,079	0	-2,347,413	-2,347,413
26,944,146.12000		07/14/2020		26,944,146.12	2,890,432,159	1.000000000F 0.009501847	26,944,146.12	2,835,674,593	0	-54,757,566	-54,757,566
26,950,458.15000		07/14/2020		26,950,458.15	2,891,109,282	1.000000000F 0.009501847	26,950,458.15	2,836,338,888	0	-54,770,394	-54,770,394
26,960,441.09000		07/14/2020		26,960,441.09	2,892,180,202	1.000000000F 0.009501847	26,960,441.09	2,837,389,519	0	-54,790,683	-54,790,683
26,960,559.74000		07/14/2020		26,960,559.74	2,892,192,930	1.000000000F 0.009501847	26,960,559.74	2,837,402,006	0	-54,790,924	-54,790,924
28,557,174.19000		07/14/2020		28,557,174.19	3,063,469,679	1.000000000F 0.009501847	28,557,174.19	3,005,434,016	0	-58,035,663	-58,035,663
909,235.14000		07/16/2020		909,235.14	97,142,686	1.000000000F 0.009501847	909,235.14	95,690,358	0	-1,452,328	-1,452,328
960,000.00000		07/27/2020		960,000.00	101,620,853	1.000000000F 0.009501847	960,000.00	101,032,989	0	-587,864	-587,864
1,048,034.27000		07/30/2020		1,048,034.27	110,060,003	1.000000000F 0.009501847	1,048,034.27	110,297,953	0	237,950	237,950
1,075,453.64000		08/05/2020		1,075,453.64	113,938,933	1.000000000F 0.009501847	1,075,453.64	113,183,641	0	-755,292	-755,292
298,592.02000		08/10/2020		298,592.02	31,616,410	1.000000000F 0.009501847	298,592.02	31,424,629	0	-191,781	-191,781
1,112,890.48000		08/11/2020		1,112,890.48	118,000,003	1.000000000F 0.009501847	1,112,890.48	117,123,595	0	-876,408	-876,408
643,469.40000		08/20/2020		643,469.40	67,982,509	1.000000000F 0.009501847	643,469.40	67,720,455	0	-262,054	-262,054
1,425,527.59000		08/28/2020		1,425,527.59	150,000,001	1.000000000F 0.009501847	1,425,527.59	150,026,368	0	26,367	26,367
3,663,243.26000		08/28/2020		3,663,243.26	389,934,053	1.000000000F 0.009501847	3,663,243.26	385,529,599	0	-4,404,454	-4,404,454

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2020年8月末日現在

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (円)	単価／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (円)	市場 (円)	未実現損益 通貨 (円)	合計 (円)
<u>クラスに割当てられていない資産</u>											
<u>先物（ポジション）</u>											
<u>非グループ化の有価証券</u>											
-858,598.24000		08/05/2020		-858,598.24	-90,604,001	1.000000000F 0.009501847	-858,598.24	-90,361,194	0	242,807	242,807
-854,934.57000		08/05/2020		-854,934.57	-89,614,430	1.000000000F 0.009501847	-854,934.57	-89,975,619	0	-361,189	-361,189
-221,739.74000		08/05/2020		-221,739.74	-23,246,180	1.000000000F 0.009501847	-221,739.74	-23,336,488	0	-90,308	-90,308
-4,647,800.04000		08/18/2020		-4,647,800.04	-490,926,250	1.000000000F 0.009501847	-4,647,800.04	-489,147,009	0	1,779,241	1,779,241
-2,515,678.86000		08/18/2020		-2,515,678.86	-265,238,448	1.000000000F 0.009501847	-2,515,678.86	-264,756,827	0	481,621	481,621
-1,077,955.41000		08/18/2020		-1,077,955.41	-113,653,771	1.000000000F 0.009501847	-1,077,955.41	-113,446,934	0	206,837	206,837
139,465,335.47000 0.00000	合計 -----			139,465,335	14,965,043,074		139,465,335	14,677,707,975	0	-287,335,099	-287,335,099
18,586,303.32000	非グループ化の有価証券小計			18,586,303	144,660,557		18,586,303	-613,521,034	0	-758,181,591	-758,181,591
18,586,303.32000	先物（ポジション）合計			18,586,303	144,660,557		18,586,303	-613,521,034	0	-758,181,591	-758,181,591
<u>証拠金勘定</u>											
<u>証拠金勘定</u>											
120,000.00	USD MARGIN	08/12/2020		120,000.00	12,775,800	1.000000000S 0.009496225	120,000.00	12,636,600	0	-139,200	-139,200
210,000.00	USDMAR	08/12/2020		210,000.00	22,357,650	1.000000000S 0.009496225	210,000.00	22,114,051	0	-243,599	-243,599
290,000.00		08/21/2020		290,000.00	30,724,049	1.000000000S 0.009496225	290,000.00	30,538,451	0	-185,598	-185,598
620,000.00000 0.00000	USDMAR 合計 -----			620,000	65,857,499		620,000	65,289,102	0	-568,397	-568,397
620,000.00000	証拠金勘定小計			620,000	65,857,499		620,000	65,289,102	0	-568,397	-568,397
620,000.00000	証拠金勘定合計			620,000	65,857,499		620,000	65,289,102	0	-568,397	-568,397
379,236,937.08000	クラスに割当てられていない資産合計			387,996,113	36,188,855,552		409,605,993	37,677,520,548	2,388,912,253	-900,247,260	1,488,664,993
992,299,579.47000	ポートフォリオ合計			1,001,058,755	26,181,479,180		1,022,668,636	27,737,127,931	2,388,912,253	-833,263,505	1,555,648,748

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

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

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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（2020年9月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約198億円）
発行済株式総数 5,051,655株

（２）事業の内容及び営業の状況

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

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

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

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

管理会社は、2020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	32	4,918,614,219.52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、2020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＝105.80円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2020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	4,337,018,208	458,856,526
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	2,855,171,572	302,077,152
040	その他の要求払預金	1,481,846,636	156,779,374
050	売買目的で保有される金融資産	27,207,999	2,878,606
060	デリバティブ	27,207,999	2,878,606
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	2,784	295
142	持分証券	2,784	295
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	3,021,982,786	319,725,779
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	3,021,982,786	319,725,779
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	5,168,539	546,831
280	有形固定資産	5,168,539	546,831
290	投資不動産		
300	無形資産	3,009,484	318,403
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,009,484	318,403
330	税金資産	751	79
340	現行税金資産	751	79
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	25,770,032	2,726,469
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	7,420,160,584	785,052,990

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)

2020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	45,589,584	4,823,378
020	デリバティブ	45,589,584	4,823,378
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	6,884,536,105	728,383,920
120	預金	6,880,136,553	727,918,447
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	4,399,552	465,473
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	14,432,457	1,526,954
250	現行税金負債	14,159,986	1,498,127
260	繰延税金負債	272,471	28,827
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	16,811,084	1,778,613
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	6,961,369,230	736,512,865

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)

2020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	19,797,081
020	払込資本	187,117,966	19,797,081
030	未払込請求資本		
040	株式発行差金		
050	資本を除く発行済みエクイティ商品	0	0
060	複合金融商品のエクイティ部分		
070	その他の発行済みエクイティ商品		
080	その他のエクイティ		
090	その他の累積包括利益	0	0
095	損益に再分類されることがない項目	0	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-)損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
124	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
320	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動		
330	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性		
340	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動(ヘッジ項目)		
350	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動(ヘッジ手段)		
360	負債の信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動		
128	損益に再分類されることがある項目	0	0
130	外国事業純投資のヘッジ(有効部分)		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ準備金(有効部分)		
155	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動		
165	ヘッジ手段(指定されていない要素)		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
180	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	1,810	191
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	247,675,774	26,204,097
220	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の準備金または累積損失		
230	その他	247,675,774	26,204,097
240	(-)自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	23,995,804	2,538,756

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	458,791,354	48,540,125
310	資本および負債合計	7,420,160,584	785,052,990

(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

2020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	34,935,989	3,696,228
020	売買目的で保有される金融資産	15,216,383	1,609,893
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	14,121,622	1,494,068
070	デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	646,408	68,390
085	負債に係る利息収益	4,951,576	523,877
090	(支払利息)	14,741,325	1,559,632
100	(売買目的で保有される金融負債)	89,472	9,466
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)	3,914,625	414,167
130	(デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	1,338	142
145	(資産に係る支払利息)	10,735,889	1,135,857
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	0	0
170	売買目的で保有される金融資産		
175	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
191	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	70,505,130	7,459,443
210	(支払手数料)	35,524,547	3,758,497
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	4,699,042	497,159
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	1,263,523	133,681
350	(その他の事業費用)	1,095,269	115,879
355	事業収益合計、純額	60,042,543	6,352,501

米ドル

千円

360	（管理費用）	24,876,507	2,631,934
370	（従業員費用）	10,360,793	1,096,172
380	（その他の管理費用）	14,515,714	1,535,763
385	（破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金）	1,594,626	168,711
390	（減価償却）	1,352,769	143,123
400	（有形固定資産）	719,564	76,130
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	633,205	66,993
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
435	（破綻処理基金および預金保証制度に支払うコミットメント）		
440	（コミットメントおよび保証）		
450	（その他の引当金）		
460	（損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	378,022	39,995
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）	0	0
491	（償却後原価における金融資産）	378,022	39,995
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	31,840,619	3,368,737
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	7,844,815	829,981
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	23,995,804	2,538,756
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	23,995,804	2,538,756
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	23,995,804	2,538,756

[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

(8) 申込取扱場所

< 訂正前 >

三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社
東京都千代田区丸の内二丁目５番２号

(中略)

(注) 上記日本における販売会社または販売取扱会社（以下に定義する。）の日本における本支店において、申込みの取扱いを行う。

< 訂正後 >

三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社
東京都千代田区丸の内二丁目５番２号 (*)

(中略)

(注) 上記日本における販売会社または販売取扱会社（以下に定義する。）の日本における本支店において、申込みの取扱いを行う。

(*) 2020年12月21日を変更予定日として、以下に変更される。
東京都千代田区大手町一丁目９番２号

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（2020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（2020年9月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約198億円）

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、2020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＝105.80円）による。

（ ）会社の沿革

（後略）

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

（Ａ）日本

2020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

2020年10月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

５ 運用状況

（２）投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄

（2020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	Citigroup Inc	米国	社債	4.600	2026/3/9	8,450,000	113.37	957,935,011	123.60	1,044,443,391	2.77
2	BNP Paribas SA	フランス	社債	4.375	2025/9/28	7,650,000	114.43	875,368,671	118.86	909,247,072	2.41
3	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	120.83	894,118,980	2.37
4	Wells Fargo & Co	米国	社債	5.950	2086/12/1	6,410,000	79.66	510,608,458	129.42	829,588,635	2.20
5	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	119.49	825,684,703	2.19
6	Credit Agricole SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	6,400,000	121.42	777,075,880	119.68	765,931,731	2.03
7	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	146.15	752,654,032	2.00
8	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	6,240,000	110.91	692,056,012	118.36	738,543,447	1.96
9	Morgan Stanley	米国	社債	3.950	2027/4/23	6,010,000	110.46	663,862,835	121.33	729,171,627	1.94
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	147.89	695,095,628	1.85
11	Standard Chartered PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	113.99	678,254,633	1.80
12	Digital Realty Trust LP	米国	社債	4.450	2028/7/15	5,100,000	110.10	561,519,214	130.11	663,557,484	1.76
13	Landesbank Baden - Wuerttemberg	ドイツ	社債	3.625	2025/6/16	4,980,000	139.33	693,886,457	129.61	645,460,769	1.71
14	Bank of America Corp	米国	社債	3.950	2025/4/21	5,320,000	115.63	615,146,786	119.66	636,617,608	1.69
15	Aon Corp	米国	社債	2.800	2030/5/15	5,050,000	107.20	541,347,187	115.75	584,514,808	1.55
16	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	3.202	2029/9/17	5,000,000	107.28	536,424,972	116.43	582,125,895	1.55
17	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	108.85	571,449,081	1.52
18	China Construction Bank Corp	中国	社債	2.450 (2025年6月 以降変動金利)	2030/6/24	5,250,000	107.26	563,136,140	107.66	565,218,155	1.50
19	Santander UK PLC	英国	社債	5.000	2023/11/7	4,800,000	100.22	481,041,369	117.55	564,249,780	1.50
20	Truist Bank	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	107.71	538,540,345	1.43

	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	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	179.55	529,659,111	1.41
22	Bank of Montreal	カナダ	社債	3.803 (2027年12月以降変動金利)	2032/12/15	4,350,000	112.73	490,397,233	115.52	502,498,012	1.33
23	HSBC Bank USA NA	米国	社債	7.000	2039/1/15	3,000,000	137.73	413,185,215	161.60	484,806,071	1.29
24	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungs-gesellschaft AG	オランダ	社債	3.375 (2027年9月以降変動金利)	2047/9/29	3,700,000	121.97	451,293,194	129.02	477,371,346	1.27
25	Prudential Financial Inc	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	4,150,000	93.99	390,045,442	114.79	476,372,547	1.26
26	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	118.24	472,969,336	1.26
27	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	121.20	472,675,750	1.26
28	HSBC Holdings PLC	英国	社債	6.800	2038/6/1	3,050,000	141.19	430,633,498	152.35	464,653,740	1.23
29	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	3,700,000	130.66	483,456,916	123.00	455,116,118	1.21
30	NN Group NV	オランダ	社債	4.500 (2026年1月以降変動金利)	永久債	3,300,000	139.93	461,773,159	132.60	437,575,637	1.16

投資不動産物件

該当事項なし。(2020年6月末日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項なし。(2020年6月末日現在)

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

（2020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	Wells Fargo & Co	米国	社債	5.950	2036/12/15	6,410,000	79.66	510,608,458	137.48	881,228,194	2.37
2	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	117.73	813,501,970	2.19
3	Goldman Sachs Capital I	米国	社債	6.345	2034/2/15	5,150,000	139.56	718,749,937	145.35	748,556,051	2.02
4	Credit Agricole SA	フランス	社債	4.375	2025/3/17	6,400,000	121.42	777,075,880	116.88	748,057,475	2.01
5	BPCE SA	フランス	社債	4.500	2025/3/15	6,240,000	110.91	692,056,012	117.11	730,758,641	1.97
6	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	155.30	729,923,145	1.97
7	Morgan Stanley	米国	社債	3.950	2027/4/23	6,010,000	110.46	663,862,835	119.29	716,939,619	1.93
8	Standard Chartered PLC	英国	社債	4.300	2027/2/19	5,950,000	99.87	594,216,645	112.29	668,103,794	1.80
9	BNP Paribas SA	フランス	社債	4.375	2025/9/28	5,650,000	114.43	646,514,116	117.81	665,653,343	1.79
10	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	110.92	582,349,679	1.57
11	Aon Corp	米国	社債	2.800	2030/5/15	5,050,000	107.20	541,347,187	114.29	577,180,745	1.55
12	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	日本	社債	3.202	2029/9/17	5,000,000	107.28	536,424,972	114.75	573,766,623	1.55
13	Banco Santander Mexico	メキシコ	社債	5.375	2025/4/17	4,850,000	120.31	583,481,444	117.57	570,198,761	1.54
14	China Construction Bank Corp	中国	社債	2.450 (2025年6月以降変動金利)	2030/6/24	5,250,000	107.26	563,136,140	106.23	557,705,770	1.50
15	Truist Bank	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	109.50	547,500,221	1.47
16	Bank of America Corp	米国	社債	7.750	2038/5/14	2,950,000	168.19	496,152,228	174.51	514,819,141	1.39
17	Bank of Montreal	カナダ	社債	3.803 (2027年12月以降変動金利)	2032/12/15	4,350,000	112.73	490,397,233	116.91	508,578,438	1.37
18	Athene Global Funding	米国	社債	2.450	2027/8/20	4,700,000	105.31	494,950,896	108.18	508,465,192	1.37
19	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	126.78	507,111,637	1.37
20	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG	オランダ	社債	3.375 (2027年9月以降変動金利)	2047/9/29	3,700,000	121.97	451,293,194	135.76	502,324,509	1.35

	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	De Volksbank NV	オランダ	社債	1.750 (2025年10月以降変動金利)	2030/10/22	3,800,000	126.19	479,510,696	127.18	483,265,551	1.30
22	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	3,700,000	130.66	483,456,916	126.17	466,834,691	1.26
23	Prudential Financial Inc	米国	社債	5.625 (2023年6月以降変動金利)	2043/6/15	4,150,000	93.99	390,045,442	112.45	466,687,750	1.26
24	HSBC Bank USA NA	米国	社債	7.000	2039/1/15	3,000,000	137.73	413,185,215	154.47	463,397,235	1.25
25	Citigroup Inc	米国	社債	4.600	2026/3/9	3,800,000	113.37	430,787,342	121.01	459,850,781	1.24
26	HSBC Holdings PLC	英国	社債	6.800	2038/6/1	3,050,000	141.19	430,633,498	148.47	452,837,198	1.22
27	NN Group NV	オランダ	社債	4.500 (2026年1月以降変動金利)	永久債	3,300,000	139.93	461,773,159	137.16	452,617,448	1.22
28	Bank of Ireland Group	アイルランド	社債	2.375 (2024年10月以降変動金利)	2029/10/14	3,600,000	123.13	443,282,716	122.35	440,473,894	1.19
29	Australia & New Zealand Banking Group	オーストラリア	社債	1.125 (2024年11月以降変動金利)	2029/11/21	3,500,000	120.16	420,573,761	123.87	433,548,601	1.17
30	CNA Financial Corp	米国	社債	2.050	2030/8/15	4,100,000	106.38	436,147,216	105.16	431,145,696	1.16

投資不動産物件

該当事項なし。(2020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。(2020年9月末日現在)