

【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3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、アロン通り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 下瀬 伸彦
同 大西 信治
- 【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【電話番号】 03(6212)8316
- 【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 東京海上ストラテジック・トラスト - 東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
(Tokio Marine Strategic Trust - Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund)
- 【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】 米ドル建 米ドルヘッジクラス：
20億アメリカ合衆国ドル(約2,211億6,000万円)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1,662億4,000万円)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、2021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=110.58円および1豪ドル=83.12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、2021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1 5 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3 1 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1 1 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

(2021年9月末日現在)

| 資産の種類 | 地域名 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|----------------------|----------------|---------|
| 社債 | 英国 | 6,491,805,290 | 17.04 |
| | 米国 | 6,350,275,674 | 16.67 |
| | フランス | 4,502,918,121 | 11.82 |
| | オランダ | 2,414,627,420 | 6.34 |
| | 日本 | 2,337,394,324 | 6.14 |
| | オーストラリア | 1,788,724,291 | 4.70 |
| | ドイツ | 1,503,941,697 | 3.95 |
| | オーストリア | 1,500,099,749 | 3.94 |
| | ベルギー | 1,210,599,552 | 3.18 |
| | イタリア | 1,112,056,782 | 2.92 |
| | デンマーク | 992,702,018 | 2.61 |
| | アイルランド | 901,574,563 | 2.37 |
| | スペイン | 900,654,601 | 2.36 |
| | ケイマン諸島 | 767,974,108 | 2.02 |
| | スイス | 634,719,142 | 1.67 |
| | メキシコ | 606,183,625 | 1.59 |
| | 中国 | 594,461,580 | 1.56 |
| | スウェーデン | 375,932,303 | 0.99 |
| | 香港 | 370,773,550 | 0.97 |
| | フィンランド | 331,203,629 | 0.87 |
| | 英領ヴァージン諸島 | 326,989,740 | 0.86 |
| | ノルウェー | 235,597,319 | 0.62 |
| | ルクセンブルグ | 212,764,609 | 0.56 |
| | シンガポール | 206,482,478 | 0.54 |
| 韓国 | 194,125,717 | 0.51 | |
| チェコ共和国 | 181,643,865 | 0.48 | |
| ペルー | 165,250,388 | 0.43 | |
| 国際機関 | 55,085,994 | 0.14 | |
| | 小計 | 37,266,562,129 | 97.82 |
| | 現金・その他の資産 (負債控除後) | 828,615,268 | 2.18 |
| | 合計(純資産総額) | 38,095,177,397 | 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、2021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=111.92円および1豪ドル=80.46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

2021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 |
| 2020年10月末日 | 132,001,445.24 | 14,773,602 | 0.009105 | 1.0190 |
| 11月末日 | 144,350,025.63 | 16,155,655 | 0.009257 | 1.0360 |
| 12月末日 | 146,917,355.78 | 16,442,990 | 0.009278 | 1.0384 |
| 2021年1月末日 | 155,178,233.75 | 17,367,548 | 0.009202 | 1.0299 |
| 2月末日 | 153,438,292.84 | 17,172,814 | 0.009052 | 1.0131 |
| 3月末日 | 152,997,792.17 | 17,123,513 | 0.008960 | 1.0028 |
| 4月末日 | 153,791,656.31 | 17,212,362 | 0.008956 | 1.0024 |
| 5月末日 | 155,682,608.30 | 17,423,998 | 0.008917 | 0.9980 |
| 6月末日 | 157,835,829.89 | 17,664,986 | 0.008937 | 1.0002 |
| 7月末日 | 160,341,519.26 | 17,945,423 | 0.008960 | 1.0028 |
| 8月末日 | 164,020,511.25 | 18,357,176 | 0.008912 | 0.9974 |
| 9月末日 | 155,030,397.50 | 17,351,002 | 0.008791 | 0.9839 |

<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 |
| 2020年10月末日 | 28,733,384.50 | 2,311,888 | 0.007789 | 0.6267 |
| 11月末日 | 29,504,115.27 | 2,373,901 | 0.007909 | 0.6364 |
| 12月末日 | 29,844,474.00 | 2,401,286 | 0.007917 | 0.6370 |
| 2021年1月末日 | 30,016,646.93 | 2,415,139 | 0.007854 | 0.6319 |
| 2月末日 | 29,452,946.93 | 2,369,784 | 0.007726 | 0.6216 |
| 3月末日 | 28,834,336.69 | 2,320,011 | 0.007642 | 0.6149 |
| 4月末日 | 28,858,117.95 | 2,321,924 | 0.007643 | 0.6150 |
| 5月末日 | 29,222,515.87 | 2,351,244 | 0.007608 | 0.6121 |
| 6月末日 | 30,976,883.64 | 2,492,400 | 0.007623 | 0.6133 |
| 7月末日 | 30,621,030.63 | 2,463,768 | 0.007649 | 0.6154 |
| 8月末日 | 30,182,404.12 | 2,428,476 | 0.007610 | 0.6123 |
| 9月末日 | 29,590,592.76 | 2,380,859 | 0.007505 | 0.6039 |

<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~2021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

2021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 |
| 2020年10月1日～2021年9月末日 | 0.000694 | 0.077672 |

<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 |
| 2020年10月1日～2021年9月末日 | 0.000582 | 0.046828 |

<参考情報>

分配の推移(2021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 |
| 第9会計年度(2020年3月1日～2021年2月28日) | 0.000720 |
| 2021年5月 | 0.000058 |
| 2021年6月 | 0.000055 |
| 2021年7月 | 0.000055 |
| 2021年8月 | 0.000055 |
| 2021年9月 | 0.000055 |
| 直近1年間累計 | 0.000694 |
| 設定来累計 | 0.005029 |

| 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 |
| 第9会計年度(2020年3月1日～2021年2月28日) | 0.000622 |
| 2021年5月 | 0.000048 |
| 2021年6月 | 0.000045 |
| 2021年7月 | 0.000045 |
| 2021年8月 | 0.000045 |
| 2021年9月 | 0.000045 |
| 直近1年間累計 | 0.000582 |
| 設定来累計 | 0.006638 |

収益率の推移

2021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) |
|----------------------|--------|
| 2020年10月1日～2021年9月末日 | 3.74% |

(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) |
|----------------------|--------|
| 2020年10月1日～2021年9月末日 | 3.41% |

(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、2021年については2021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。2021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

2021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2021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 |
|--------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|
| 2020年10月1日～ 2021年9月末日 | 5,145,054,535 (5,145,054,535) | 1,739,609,056 (1,739,609,056) | 17,635,684,655 (17,635,684,655) |

<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 |
|--------------------------|------------------------------|------------------------------|----------------------------------|
| 2020年10月1日～ 2021年9月末日 | 867,922,093 (867,922,093) | 517,311,324 (517,311,324) | 3,942,648,722 (3,942,648,722) |

(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

2021年8月31日現在

| | 円 |
|--------------------|-----------------------|
| 資産 | |
| 現金 | 845,589,338 |
| 銀行預金 - 基準通貨 | 225,695,405 |
| 銀行預金 - 外国通貨 | 619,893,933 |
| ブローカーが保有する現金 | (5,505,000) |
| ブローカーが保有する現金 - 米ドル | (5,505,000) |
| 有価証券(取得原価) | 34,276,458,958 |
| 債券(取得原価) | 34,276,458,958 |
| 未実現評価損益 | 3,512,785,438 |
| 未実現時価評価損益 | 2,246,648,772 |
| 未実現通貨運用損益 | 1,266,220,798 |
| 未決済取引にかかる未実現為替差損益 | (428,921) |
| 未実現通貨繰延損益 | 344,789 |
| 未収収益 | 369,410,155 |
| 期日経過の未収利息 | (2) |
| 現金に係る未収利息 | 45,430 |
| 債券に係る未収利息 | 369,364,727 |
| 資本証券 | 494,217,628 |
| 受益証券販売未収金 | 494,217,628 |
| その他の資産 | (11,440,679) |
| その他の資産 | (11,440,679) |
| 資産合計: | 39,481,515,838 |

2021年8月31日現在

円

負債

| | | |
|-----------------|--------------|------------|
| 資本証券 | | 3,045,876 |
| 受益証券買戻未払金 | | 3,045,876 |
| 未払費用 | | 77,742,100 |
| 未払監査費用 | | 1,909,003 |
| 未払報告費用 | | 103,313 |
| 未払投資顧問報酬 | | 43,544,556 |
| 未払投資顧問報酬 - 豪ドル | (36,318,075) | |
| 未払受託報酬 | | 658,863 |
| 未払管理報酬 | | 8,227,416 |
| 未払代行協会員報酬 | | 1,683,792 |
| 未払代行協会員報酬 - 豪ドル | (1,987,849) | |
| 未払販売報酬 | | 19,969,675 |
| 未払販売報酬 - 豪ドル | (23,570,973) | |
| 未払副管理報酬 | | 1,645,482 |
| 負債合計： | | 80,787,976 |

資本

| | | |
|-------------------|--------------------|--------------------|
| ファンド受益証券 | | 53,918,069,638 |
| 発行済ファンド受益証券(額面価額) | | 71,702,814,120,005 |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | 41,099,476,943,730 | |
| ブラジル・リアル | 5,017,740,095 | |
| 米ドル | 3,268,654,410 | |
| 豪ドル | 1,681,892,025 | |
| ユーロ | 13,913,294 | |
| 日本円 | 9,156,510,799 | |
| 資源国通貨バスケット | 178,008,165 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 30,565,593,322,161 | |
| メキシコ・ペソ | 1,071,852,384 | |
| トルコ・リラ | 16,587,999,561 | |
| ロシア・ルーブル | 767,283,381 | |

2021年8月31日現在

円

| | | |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 受益証券額面超過額 | | (71,648,896,050,367) |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | (41,086,188,364,009) | |
| ブラジル・リアル | 6,612,170,905 | |
| 米ドル | (43,629,410) | |
| 豪ドル | (676,844,025) | |
| ユーロ | (2,261,294) | |
| 日本円 | 3,970,545,201 | |
| 資源国通貨バスケット | 3,042,835 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | (30,561,227,750,744) | |
| メキシコ・ペソ | (133,763,884) | |
| トルコ・リラ | (11,431,051,061) | |
| ロシア・ルーブル | 221,855,119 | |
| 分配金支払額 | | (61,163,518,201) |
| 配当金支払額 | | (61,163,518,201) |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | (9,544,192,307) | |
| ブラジル・リアル | (16,557,156,098) | |
| 米ドル | (3,207,649,122) | |
| 豪ドル | (4,532,576,375) | |
| ユーロ | (20,328,879) | |
| 日本円 | (19,118,119,350) | |
| 資源国通貨バスケット | (312,772,467) | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | (3,559,664,201) | |
| メキシコ・ペソ | (572,448,170) | |
| トルコ・リラ | (2,655,715,626) | |
| ロシア・ルーブル | (1,082,895,606) | |

2021年8月31日現在

円

| | | |
|-----------------|----------------|-----------------------|
| 利益剰余金 | | 44,921,056,948 |
| 利益剰余金 | | 44,921,056,948 |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | 38,691,103,228 | |
| ブラジル・リアル | 32,760,437,681 | |
| 米ドル | 13,221,845,731 | |
| 豪ドル | 17,604,664,452 | |
| ユーロ | 71,937,869 | |
| 日本円 | 45,274,829,781 | |
| 資源国通貨バスケット | 721,228,788 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 6,640,975,557 | |
| メキシコ・ペソ | 622,191,379 | |
| トルコ・リラ | (454,233,602) | |
| ロシア・ルーブル | 2,696,731,817 | |
| 中間純利益 | | 1,725,119,477 |
| 資本合計: | | 39,400,727,862 |
| 負債および資本合計 | | 39,481,515,838 |
| 純資産額合計 | | 39,400,727,862 |
| 発行済受益証券総数 | | 22,374,407,363.41140口 |
| 受益証券1口当たり純資産額合計 | | 1.760973 |

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

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

| | | |
|-------------|---------------|-----------------|
| 収益 | | |
| 実現損益 | | 271,931,821 |
| 為替取引に係る実現利益 | | 3,784,068,164 |
| ブラジル・レアル | 345,830,993 | |
| 豪ドル | 239,866,832 | |
| ユーロ | 2,818,822 | |
| 日本円 | 534,188,661 | |
| 資源国通貨バスケット | 23,935,459 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 374,593,667 | |
| メキシコ・ペソ | 113,302,312 | |
| トルコ・リラ | 538,690,141 | |
| ロシア・ルーブル | 67,993,620 | |
| 為替取引に係る実現損失 | | (3,954,909,483) |
| ブラジル・レアル | (319,492,455) | |
| 豪ドル | (299,979,471) | |
| ユーロ | (3,229,466) | |
| 日本円 | (978,316,527) | |
| 資源国通貨バスケット | (21,852,728) | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | (480,414,364) | |
| メキシコ・ペソ | (106,553,605) | |
| トルコ・リラ | (577,593,944) | |
| ロシア・ルーブル | (59,134,757) | |
| 市場に係る実現利益 | | 369,915,837 |
| 市場に係る実現損失 | | (30,130,948) |

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

| | | |
|-------------|-------------|---------------|
| 通貨に係る実現利益 | | 374,727,447 |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | 6,860,543 | |
| 日本円 | 1 | |
| 資源国通貨バスケット | 5 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 1,851,828 | |
| メキシコ・ペソ | 1 | |
| トルコ・リラ | 4 | |
| 通貨に係る実現損失 | | (271,739,196) |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | (7,963,450) | |
| ブラジル・レアル | (1) | |
| 豪ドル | (1) | |
| 日本円 | (1) | |
| 資源国通貨バスケット | (3) | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | (2,826,386) | |
| メキシコ・ペソ | (2) | |
| トルコ・リラ | (2) | |
| ロシア・ルーブル | (1) | |
| 受取利息 | | 605,681,552 |
| 現金に係る受取利息 | | 25,848 |
| 債券に係る受取利息 | | 605,655,704 |
| 未実現評価損益 | | 1,080,831,139 |
| 未実現時価評価損益 | | 209,602,563 |

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

| | | |
|-------------------|--------------|----------------------|
| 未実現通貨運用損益 | | 885,892,276 |
| ブラジル・リアル | 91,815,638 | |
| 豪ドル | (25,891,279) | |
| ユーロ | (127,897) | |
| 日本円 | 163,437,260 | |
| 資源国通貨バスケット | 1,597,465 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | (41,631,109) | |
| メキシコ・ペソ | 29,415,791 | |
| トルコ・リラ | (23,646,326) | |
| ロシア・ルーブル | 2,962,020 | |
| 未決済取引にかかる未実現為替差損益 | | (441,149) |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | (507,299) | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 66,150 | |
| 未実現通貨繰延損益 | | (14,222,551) |
| 収益合計： | | <u>1,958,444,512</u> |

2021年3月1日から2021年8月31日までの期間

円

| | | |
|-------------|------------|---------------|
| 費用 | | |
| 費用 - 報酬 | | 228,887,185 |
| 監査費用 | | 1,068,923 |
| 報告費用 | | 86,671 |
| 弁護士費用 | | 173,945 |
| 投資顧問報酬 | | 130,055,471 |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | 69,144,871 | |
| ブラジル・リアル | 3,187,288 | |
| 米ドル | 12,784,311 | |
| 豪ドル | 3,889,093 | |
| ユーロ | 45,298 | |
| 日本円 | 21,453,278 | |
| 資源国通貨バスケット | 252,623 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 9,998,252 | |
| メキシコ・ペソ | 1,532,603 | |
| トルコ・リラ | 6,045,874 | |
| ロシア・ルーブル | 770,026 | |
| 受託報酬 | | 1,973,773 |
| 現金支出費用 | | 576,291 |
| 未払管理報酬 | | 24,492,064 |
| 代行協会員報酬 | | 5,000,432 |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | 4,337,836 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 627,250 | |
| 販売報酬 | | 59,570,223 |
| 米ドル建 米ドルヘッジ | 51,446,567 | |
| 豪ドル建 豪ドルヘッジ | 7,439,117 | |
| 副保管報酬 | | 990,982 |
| 副管理報酬 | | 4,898,410 |
| 源泉徴収税費用 | | 4,093,651 |
| 源泉徴収税 | | 4,093,651 |
| 支払利息 | | 344,199 |
| 当座借越利息 | | 5,310 |
| 支払利息 | | 338,889 |
| 費用合計： | | 233,325,035 |
| 投資純利益 | | 1,725,119,477 |

[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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 30,320,894.09000 | AUD FORWARD 13 SEP FAU13SEP | 8/3/2021 | AUD | 30,320,894.09 | 2,436,687,421 | 1.000000000F 80.288215424 | 30,320,894.09 | 2,434,410,477 | 0 | -2,276,944 | -2,276,944 |
| -22,420,300.00000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/3/2021 | AUD | -22,420,300.00 | -2,436,687,431 | 1.000000000F 0.009103586 | -22,420,300.00 | -2,462,798,726 | 0 | -26,111,295 | -26,111,295 |
| 7,900,594.09000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 7,900,594 | -10 | | 7,900,594 | -28,388,249 | 0 | -28,388,239 | -28,388,239 |
| 7,900,594.09000 | 先物(ポジション)合計 | | | 7,900,594 | -10 | | 7,900,594 | -28,388,249 | 0 | -28,388,239 | -28,388,239 |
| 7,900,594.09000 | 豪ドルクラス受益証券合計 | | | 7,900,594 | -10 | | 7,900,594 | -28,388,249 | 0 | -28,388,239 | -28,388,239 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 17,452,538.02000 | AUD FORWARD 13 SEP FAU13SEP | 8/3/2021 | | 17,452,538.02 | 1,402,543,729 | 1.000000000F | 17,452,538.02 | 1,401,233,132 | 0 | -1,310,597 | -1,310,597 |
| | | | AUH | | | 80.288215424 | | | | | |
| -12,905,000.00000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/3/2021 | | -12,905,000.00 | -1,402,543,735 | 1.000000000F | -12,905,000.00 | -1,417,573,251 | 0 | -15,029,516 | -15,029,516 |
| | | | AUH | | | 0.009103586 | | | | | |
| 4,547,538.02000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 4,547,538 | -6 | | 4,547,538 | -16,340,119 | 0 | -16,340,113 | -16,340,113 |
| 4,547,538.02000 | 先物(ポジション)合計 | | | 4,547,538 | -6 | | 4,547,538 | -16,340,119 | 0 | -16,340,113 | -16,340,113 |
| 4,547,538.02000 | 豪ドル建豪ドルヘッジクラス受益証券合計 | | | 4,547,538 | -6 | | 4,547,538 | -16,340,119 | 0 | -16,340,113 | -16,340,113 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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) |
|--------------------------|--------------------------------|----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| 資源国通貨バスケットクラス受益証券 | | | | | | | | | | | |
| 先物(ポジション) | | | | | | | | | | | |
| 非グループ化の有価証券 | | | | | | | | | | | |
| 387,188.04000 | AUD FORWARD 13 SEP FAU13SEP | 8/3/2021 | | 387,188.04 | 31,115,713 | 1.000000000F 80.288215424 | 387,188.04 | 31,086,637 | 0 | -29,076 | -29,076 |
| 1,512,036.19000 | BRL FORWARD 13 SEP FBR13SEP | 8/3/2021 | BKH | 1,512,036.19 | 31,339,992 | 1.000000000F 0.046694445 | 1,512,036.19 | 32,381,500 | 0 | 1,041,508 | 1,041,508 |
| -286,300.00000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/3/2021 | BKH | -286,300.00 | -31,339,993 | 1.000000000F 0.009103586 | -286,300.00 | -31,449,145 | 0 | -109,152 | -109,152 |
| -286,300.00000 | | 8/3/2021 | BKH | -286,300.00 | -31,115,713 | 1.000000000F 0.009103586 | -286,300.00 | -31,449,145 | 0 | -333,432 | -333,432 |
| -286,300.00000 | | 8/3/2021 | BKH | -286,300.00 | -31,321,502 | 1.000000000F 0.009103586 | -286,300.00 | -31,449,145 | 0 | -127,643 | -127,643 |
| -858,900.00000 | 合計 ----- | | | -858,900 | -93,777,208 | | -858,900 | -94,347,435 | 0 | -570,227 | -570,227 |
| 0.00000 | | | | | | | | | | | |
| 4,125,268.07000 | ZAR FORWARD 13 SEP FZA13SEP | 8/3/2021 | BKH | 4,125,268.07 | 31,321,501 | 1.000000000F 0.131928208 | 4,125,268.07 | 31,269,037 | 0 | -52,464 | -52,464 |
| 5,165,592.30000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 5,165,592 | -2 | | 5,165,592 | 389,739 | 0 | 389,741 | 389,741 |
| 5,165,592.30000 | 先物(ポジション)合計 | | | 5,165,592 | -2 | | 5,165,592 | 389,739 | 0 | 389,741 | 389,741 |
| 5,165,592.30000 | 資源国通貨バスケットクラス受益証券合計 | | | 5,165,592 | -2 | | 5,165,592 | 389,739 | 0 | 389,741 | 389,741 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|------------------------|--------------------------------|----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| ブラジル・レアルクラス受益証券 | | | | | | | | | | | |
| 先物(ポジション) | | | | | | | | | | | |
| 非グループ化の有価証券 | | | | | | | | | | | |
| 59,538,735.55000 | BRL FORWARD 13 SEP FBR13SEP | 8/3/2021 | | 59,538,735.55 | 1,234,060,089 | 1.000000000F 0.046694445 | 59,538,735.55 | 1,275,071,061 | 0 | 41,010,972 | 41,010,972 |
| -11,273,500.00000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/3/2021 | BRH | -11,273,500.00 | -1,234,060,103 | 1.000000000F 0.009103586 | -11,273,500.00 | -1,238,358,159 | 0 | -4,298,056 | -4,298,056 |
| 48,265,235.55000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 48,265,236 | -14 | | 48,265,236 | 36,712,902 | 0 | 36,712,916 | 36,712,916 |
| 48,265,235.55000 | 先物(ポジション)合計 | | | 48,265,236 | -14 | | 48,265,236 | 36,712,902 | 0 | 36,712,916 | 36,712,916 |
| 48,265,235.55000 | ブラジル・レアルクラス受益証券合計 | | | 48,265,236 | -14 | | 48,265,236 | 36,712,902 | 0 | 36,712,916 | 36,712,916 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|--------------------|--------------------------------|----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>ユーロクラス受益証券</u> | | | | | | | | | | | |
| <u>先物(ポジション)</u> | | | | | | | | | | | |
| <u>非グループ化の有価証券</u> | | | | | | | | | | | |
| 128,344.76000 | EUR FORWARD 13 SEP FEU13SEP | 8/3/2021 | | 128,344.76 | 16,582,576 | 1.000000000F 129.704142258 | 128,344.76 | 16,646,847 | 0 | 64,271 | 64,271 |
| -152,600.00000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/3/2021 | EUH | -152,600.00 | -16,582,576 | 1.000000000F 0.009103586 | -152,600.00 | -16,762,625 | 0 | -180,049 | -180,049 |
| -24,255.24000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | -24,255 | 0 | | -24,255 | -115,778 | 0 | -115,778 | -115,778 |
| -24,255.24000 | 先物(ポジション)合計 | | | -24,255 | 0 | | -24,255 | -115,778 | 0 | -115,778 | -115,778 |
| -24,255.24000 | ユーロクラス受益証券合計 | | | -24,255 | 0 | | -24,255 | -115,778 | 0 | -115,778 | -115,778 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -73,849,400.00000 | USD FORWARD 13 SEP | 8/3/2021 | | -73,849,400.00 | -8,062,744,625 | 1.000000000 ^F | -73,849,400.00 | -8,112,121,970 | 0 | -49,377,345 | -49,377,345 |
| | FUS13SEP | | JPH | | | 0.009103586 | | | | | |
| -73,849,400.00000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | -73,849,400 | -8,062,744,625 | | -73,849,400 | -8,112,121,970 | 0 | -49,377,345 | -49,377,345 |
| -73,849,400.00000 | 先物(ポジション)合計 | | | -73,849,400 | -8,062,744,625 | | -73,849,400 | -8,112,121,970 | 0 | -49,377,345 | -49,377,345 |
| -73,849,400.00000 | 日本円クラス受益証券合計 | | | -73,849,400 | -8,062,744,625 | | -73,849,400 | -8,112,121,970 | 0 | -49,377,345 | -49,377,345 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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) |
|-------------------|--------------------------------|----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| メキシコ・ペソクラス受益証券 | | | | | | | | | | | |
| 先物(ポジション) | | | | | | | | | | | |
| 非グループ化の有価証券 | | | | | | | | | | | |
| 105,555,575.10 | MXN FORWARD 13 SEP FMX13SEP | 8/3/2021 | | 105,555,575.10 | 577,644,270 | 1.000000000F 0.182765691 | 105,555,575.10 | 577,545,898 | 0 | -98,372 | -98,372 |
| -5,292,200.00000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/3/2021 | MXH | -5,292,200.00 | -577,644,272 | 1.000000000F 0.009103586 | -5,292,200.00 | -581,331,357 | 0 | -3,687,085 | -3,687,085 |
| 100,263,375.10000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 100,263,375 | -2 | | 100,263,375 | -3,785,459 | 0 | -3,785,457 | -3,785,457 |
| 100,263,375.10000 | 先物(ポジション)合計 | | | 100,263,375 | -2 | | 100,263,375 | -3,785,459 | 0 | -3,785,457 | -3,785,457 |
| 100,263,375.10000 | メキシコ・ペソクラス受益証券合計 | | | 100,263,375 | -2 | | 100,263,375 | -3,785,459 | 0 | -3,785,457 | -3,785,457 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 202,898,082.06 | RUB FORWARD 13 SEP FRU13SEP | 8/3/2021 | | 202,898,082.06 | 302,216,005 | 1.000000000F 0.668291636 | 202,898,082.06 | 303,607,095 | 0 | 1,391,090 | 1,391,090 |
| -7,042,000.00 | | 8/6/2021 | RUH | -7,042,000.00 | -10,507,640 | 1.000000000F 0.668291636 | -7,042,000.00 | -10,537,316 | 0 | -29,676 | -29,676 |
| -7,468,000.00 | | 8/18/2021 | RUH | -7,468,000.00 | -11,084,187 | 1.000000000F 0.668291636 | -7,468,000.00 | -11,174,762 | 0 | -90,575 | -90,575 |
| 188,388,082.060000 | 合計 ----- | | | 188,388,082 | 280,624,178 | | 188,388,082 | 281,895,017 | 0 | 1,270,839 | 1,270,839 |
| 95,272.880000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/6/2021 | | 95,272.88 | 10,507,640 | 1.000000000F 0.009103586 | 95,272.88 | 10,465,423 | 0 | -42,217 | -42,217 |
| 100,861.670000 | | 8/18/2021 | RUH | 100,861.67 | 11,084,187 | 1.000000000F 0.009103586 | 100,861.67 | 11,079,334 | 0 | -4,853 | -4,853 |
| -2,756,700.000000 | | 8/3/2021 | RUH | -2,756,700.00 | -302,216,007 | 1.000000000F 0.009103586 | -2,756,700.00 | -302,814,737 | 0 | -598,730 | -598,730 |
| -2,560,565.450000 | 合計 ----- | | | -2,560,565 | -280,624,180 | | -2,560,565 | -281,269,980 | 0 | -645,800 | -645,800 |
| 185,827,516.610000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 185,827,517 | -2 | | 185,827,517 | 625,037 | 0 | 625,039 | 625,039 |
| 185,827,516.610000 | 先物(ポジション)合計 | | | 185,827,517 | -2 | | 185,827,517 | 625,037 | 0 | 625,039 | 625,039 |
| 185,827,516.610000 | ロシア・ルーブルクラス受益証券合計 | | | 185,827,517 | -2 | | 185,827,517 | 625,037 | 0 | 625,039 | 625,039 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 180,908,230.10 | TRY FORWARD 13 SEP FTR13SEP | 8/3/2021 | | 180,908,230.10 | 2,338,321,663 | 1.000000000F 0.076195704 | 180,908,230.10 | 2,374,257,610 | 0 | 35,935,947 | 35,935,947 |
| 6,042,863.96 | | 8/17/2021 | TRH | 6,042,863.96 | 78,499,499 | 1.000000000F 0.076195704 | 6,042,863.96 | 79,307,148 | 0 | 807,649 | 807,649 |
| -7,936,000.00 | | 8/6/2021 | TRH | -7,936,000.00 | -99,534,994 | 1.000000000F 0.076195704 | -7,936,000.00 | -104,152,854 | 0 | -4,617,860 | -4,617,860 |
| 179,015,094.060000 | 合計 ----- | | | 179,015,094 | 2,317,286,168 | | 179,015,094 | 2,349,411,904 | 0 | 32,125,736 | 32,125,736 |
| 902,484.790000 | USD FORWARD 13 SEP FUS13SEP | 8/6/2021 | | 902,484.79 | 99,534,994 | 1.000000000F 0.009103586 | 902,484.79 | 99,135,087 | 0 | -399,907 | -399,907 |
| -21,310,900.000000 | | 8/3/2021 | TRH | -21,310,900.00 | -2,338,321,678 | 1.000000000F 0.009103586 | -21,310,900.00 | -2,340,934,660 | 0 | -2,612,982 | -2,612,982 |
| -706,900.000000 | | 8/17/2021 | TRH | -706,900.00 | -78,499,499 | 1.000000000F 0.009103586 | -706,900.00 | -77,650,719 | 0 | 848,780 | 848,780 |
| -21,115,315.210000 | 合計 ----- | | | -21,115,315 | -2,317,286,183 | | -21,115,315 | -2,319,450,292 | 0 | -2,164,109 | -2,164,109 |
| 157,899,778.850000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 157,899,779 | -15 | | 157,899,779 | 29,961,612 | 0 | 29,961,627 | 29,961,627 |
| 157,899,778.850000 | 先物(ポジション)合計 | | | 157,899,779 | -15 | | 157,899,779 | 29,961,612 | 0 | 29,961,627 | 29,961,627 |
| 157,899,778.850000 | トルコ・リラクラス受益証券合計 | | | 157,899,779 | -15 | | 157,899,779 | 29,961,612 | 0 | 29,961,627 | 29,961,627 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 225,695,405.00000 | JPY CASH | 8/28/2021 | | 225,695,405 | 225,695,405 | 1.000000000 | 225,695,405 | 225,695,405 | 0 | 0 | 0 |
| | CASHJPY | | | | | 1.000000000 | | | | | |
| 225,695,405.00000 | 基準通貨現金小計 | | | 225,695,405 | 225,695,405 | | 225,695,405 | 225,695,405 | 0 | 0 | 0 |
| 225,695,405.00000 | 現金合計 | | | 225,695,405 | 225,695,405 | | 225,695,405 | 225,695,405 | 0 | 0 | 0 |
| 社債 | | | | | | | | | | | |
| 固定利率から変動利率に転換される社債 | | | | | | | | | | | |
| 1,700,000.00000 | AGEAS | 4/4/2019 | | 1,731,875.00 | 215,180,494 | 114.750999451 ^C 129.684236999 | 1,950,766.99 | 252,983,729 | 28,386,841 | 9,416,394 | 37,803,235 |
| | FRN 07022049 BBEL017Z BE0002644251 | | | | | | | | | | |
| 1,400,000.00000 | AGEAS | 11/13/2020 | | 1,392,370.00 | 172,214,561 | 107.485000610 ^C 129.684236999 | 1,504,790.01 | 195,147,544 | 14,579,103 | 8,353,880 | 22,932,983 |
| | FRN PERP/CALL BBEL018A BE6317598850 | | | | | | | | | | |
| 1,800,000.00000 | AIA GROUP | 3/31/2021 | | 1,806,300.00 | 199,243,925 | 101.841003418 ^C 0.009102494 | 1,833,138.06 | 201,388,549 | 2,948,429 | -803,805 | 2,144,624 |
| | FRN PERP/CALL BHKG003W XS2328261263 | | | | | | | | | | |
| 1,550,000.00000 | AIB GROUP PLC | 9/23/2020 | | 1,549,256.00 | 190,410,454 | 107.529998779 ^C 129.684236999 | 1,666,714.98 | 216,146,661 | 15,232,578 | 10,503,628 | 25,736,206 |
| | FRN 05302031 BIRL02BX XS2230399441 | | | | | | | | | | |
| 1,600,000.00000 | AMER INTL GROUP | 10/30/2020 | | 1,763,200.00 | 184,324,937 | 115.325996399 ^C 0.009102494 | 1,845,215.94 | 202,715,425 | 9,010,272 | 9,380,217 | 18,390,489 |
| | FRN 04012048 BUSA9EMH US026874DM66 | | | | | | | | | | |
| 1,800,000.00000 | ARGENTUM NETH | 8/12/2020 | | 1,807,920.00 | 192,480,207 | 102.721000671 ^C 0.009102494 | 1,848,978.01 | 203,128,726 | 4,510,633 | 6,137,886 | 10,648,519 |
| | FRN PERP/CALL BNLDTEUZ XS1640851983 | | | | | | | | | | |
| 2,250,000.00000 | ASR NEDERLAND NV | 4/25/2019 | | 2,298,401.00 | 283,695,075 | 112.738998413 ^C 129.684236999 | 2,536,627.46 | 328,960,597 | 30,894,217 | 14,371,305 | 45,265,522 |
| | FRN 05022049 BNLD121A XS1989708836 | | | | | | | | | | |
| 2,550,000.00000 | ASSICURAZIONI | 10/9/2020 | | 3,031,645.00 | 378,289,811 | 122.700996399 ^C 129.684236999 | 3,128,875.41 | 405,765,820 | 12,609,251 | 14,866,758 | 27,476,009 |
| | FRN 06082048 BITA038R XS1428773763 | | | | | | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 4,500,000.00000 | AUST & NZ BANK FRN 05052031 BAUS08CS XS2294372169 | 1/29/2021 | | 4,500,450.00 | 569,080,991 | 100.517997742 ^C 129.684236999 | 4,523,309.90 | 586,601,993 | 2,964,568 | 14,556,433 | 17,521,001 |
| 2,000,000.00 | AVIVA PLC FRN 06032055 BGBR22PZ XS2181348405 | 6/5/2020 | | 2,042,380.00 | 285,230,621 | 112.727996826 ^C 151.194825005 | 2,254,559.94 | 340,877,795 | 32,080,508 | 23,566,666 | 55,647,174 |
| 4,700,000.00 | AXA SA FRN PERP/CALL BFRA10DI XS1134541561 | 5/24/2013 | | 5,063,974.18 | 854,967,509 | 116.744003296 ^C 151.194825005 | 5,486,968.15 | 829,601,190 | 63,954,500 | -89,320,819 | -25,366,319 |
| 1,500,000.00000 | BANCO DE CREDITO FRN 07012030 BPER002V US05971V2C81 | 7/13/2021 | | 1,494,000.00 | 164,810,617 | 99.773002625 ^C 0.009102494 | 1,496,595.04 | 164,415,933 | 285,091 | -679,775 | -394,684 |
| 3,600,000.00000 | BANK OF IRELAND FRN 10142029 BIRL02BJ XS2065555562 | 11/18/2019 | | 3,685,123.15 | 443,282,716 | 104.402999878 ^C 129.684236999 | 3,758,508.00 | 487,419,242 | 9,516,858 | 34,619,668 | 44,136,526 |
| 3,600,000.00000 | BARCLAYS PLC FRN 03102042 BGBR22QR US06738EBS37 | 3/3/2021 | | 3,600,000.00 | 385,056,019 | 108.662002563 ^C 0.009102494 | 3,911,832.09 | 429,753,878 | 34,257,874 | 10,439,985 | 44,697,859 |
| 4,000,000.00000 | BAWAG GROUP AG FRN 03262029 BAUTO16H XS1968814332 | 3/19/2019 | | 3,995,520.00 | 504,988,434 | 104.547996521 ^C 129.684236999 | 4,181,919.86 | 542,329,086 | 24,173,124 | 13,167,529 | 37,340,653 |
| 1,000,000.00 | BNP PARIBAS FRN 05242031 BFRA10TI FRO014003N10 | 5/17/2021 | | 997,690.00 | 153,807,644 | 101.203002930 ^C 151.194825005 | 1,012,030.03 | 153,013,703 | 2,168,138 | -2,962,079 | -793,941 |
| 2,300,000.00000 | BNP PARIBAS FRN 08312033 BFRA10TP FRO0140057U9 | 8/23/2021 | | 2,297,355.00 | 295,992,695 | 99.241996765 ^C 129.684236999 | 2,282,565.93 | 296,012,820 | -1,917,910 | 1,938,035 | 20,125 |
| 1,800,000.00000 | CAIXABANK FRN 06182031 BESPO289 XS2310118976 | 3/9/2021 | | 1,792,314.00 | 231,711,424 | 101.273002625 ^C 129.684236999 | 1,822,914.05 | 236,403,217 | 3,968,344 | 723,450 | 4,691,794 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|--------------------|--|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|---|----------------------|-----------------------------|------------|--------------------|------------|
| クラスに割当てられていない資産 | | | | | | | | | | | |
| 社債 | | | | | | | | | | | |
| 固定利率から変動利率に転換される社債 | | | | | | | | | | | |
| 5,250,000.00000 | CHINA CONST BANK FRN 06242030 BCHN000Y XS2140531950 | 6/26/2020 | | 5,246,528.80 | 563,136,140 | 102.358001709 ^C 0.009102494 | 5,373,795.09 | 590,365,134 | 13,981,475 | 13,247,519 | 27,228,994 |
| 810,000.00 | CLOSE BROS GRP FRN 09112031 BGBR22R5 XS2351480566 | 6/3/2021 | | 808,721.10 | 125,739,124 | 100.958000183 ^C 151.194825005 | 817,759.80 | 123,641,050 | 1,366,605 | -3,464,679 | -2,098,074 |
| 2,300,000.00000 | CNP ASSURANCES FRN 07272050 BFRA10R8 FRO013463775 | 11/20/2019 | | 2,285,210.00 | 274,710,913 | 105.873001099 ^C 129.684236999 | 2,435,079.03 | 315,791,365 | 19,435,650 | 21,644,802 | 41,080,452 |
| 3,400,000.00000 | COM BK AUSTRALIA FRN 09122034 BAUS08BI USQ2704MAA64 | 9/5/2019 | | 3,400,000.00 | 363,970,009 | 107.346000671 ^C 0.009102494 | 3,649,764.02 | 400,963,079 | 27,439,076 | 9,553,994 | 36,993,070 |
| 1,200,000.00000 | COOPERATIVE RAB FRN PERP/CALL BNLDTEUU XS2202900424 | 7/7/2020 | | 1,200,000.00 | 145,657,442 | 112.383003235 ^C 129.684236999 | 1,348,596.04 | 174,891,648 | 19,270,564 | 9,963,642 | 29,234,206 |
| 2,000,000.00000 | CRDT AGR ASSR FRN 01292048 BFRA10L9 FRO013312154 | 1/22/2018 | | 2,007,829.00 | 272,543,704 | 108.530998230 ^C 129.684236999 | 2,170,619.96 | 281,495,194 | 21,111,422 | -12,159,932 | 8,951,490 |
| 1,400,000.00000 | CRED AGRICOLE SA FRN PERP/CALL BFRA10SS FRO013533999 | 10/7/2020 | | 1,400,000.00 | 174,581,833 | 110.676002502 ^C 129.684236999 | 1,549,464.04 | 200,941,061 | 19,383,129 | 6,976,099 | 26,359,228 |
| 1,200,000.00 | CRED AGRICOLE SA FRN 12092031 BFRA10TJ FRO014003W84 | 6/2/2021 | | 1,202,088.00 | 186,641,192 | 100.577003479 ^C 151.194825005 | 1,206,924.04 | 182,480,669 | 731,184 | -4,891,707 | -4,160,523 |
| 2,800,000.00 | CREDIT SUISSE FRN 06092028 BCHE012Q CH0550413337 | 6/3/2020 | | 2,795,455.00 | 382,293,772 | 103.078002930 ^C 151.194825005 | 2,886,184.08 | 436,376,097 | 13,717,768 | 40,364,558 | 54,082,326 |
| 2,650,000.00 | CYBG PLC FRN 06222025 BGBR22JQ XS1637124741 | 11/30/2020 | | 2,740,935.50 | 381,572,058 | 104.995002747 ^C 151.194825005 | 2,782,367.57 | 420,679,578 | 6,264,315 | 32,843,205 | 39,107,520 |

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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 6,910,000.00000 | DAI-ICHI MUTUAL FRN PERP/CALL BJPN303K US23380YAC12 | 10/23/2014 | | 7,095,133.09 | 796,992,374 | 110.658996582 ^C 0.009102494 | 7,646,536.66 | 840,048,526 | 60,577,197 | -17,521,046 | 43,056,151 |
| 2,250,000.00000 | DANSKE BANK A/S FRN 06212029 BDNK024B XS1967697738 | 6/30/2020 | | 2,309,239.50 | 279,812,950 | 105.550003052 ^C 129.684236999 | 2,374,875.07 | 307,983,861 | 8,511,899 | 19,659,013 | 28,170,912 |
| 3,000,000.00000 | DANSKE BANK A/S FRN 05152031 BDNK024G XS2299135819 | 2/8/2021 | | 3,000,285.00 | 380,237,162 | 100.890998840 ^C 129.684236999 | 3,026,729.97 | 392,519,166 | 3,429,495 | 8,852,509 | 12,282,004 |
| 1,800,000.00000 | DBS GROUP HLDGS FRN PERP/CALL BSGP00AU XS2122408854 | 2/20/2020 | | 1,800,000.00 | 201,762,010 | 102.973999023 ^C 0.009102494 | 1,853,531.98 | 203,629,025 | 5,881,024 | -4,014,008 | 1,867,016 |
| 3,300,000.00000 | DEUTSCHE BANK AG FRN 09032026 BDEU43ED DE000DL19VPO | 8/27/2020 | | 3,286,404.00 | 412,439,286 | 104.030998230 ^C 129.684236999 | 3,433,022.94 | 445,208,961 | 19,014,166 | 13,755,509 | 32,769,675 |
| 1,300,000.00000 | DEUTSCHE BANK AG FRN 02172032 BDEU43ES DE000DL19VU0 | 2/8/2021 | | 1,297,946.00 | 164,493,469 | 102.561996460 ^C 129.684236999 | 1,333,305.95 | 172,908,765 | 4,585,629 | 3,829,668 | 8,415,297 |
| 5,250,000.00000 | DISCOVER BANK FRN 08092028 BUSA9CU3 US25466AAN19 | 2/28/2019 | | 5,244,015.00 | 583,763,733 | 106.230003357 ^C 0.009102494 | 5,577,075.18 | 612,697,484 | 36,589,991 | -7,656,240 | 28,933,751 |
| 2,000,000.00000 | DNB BANK ASA FRN PERP/CALL BNOR024J XS2075280995 | 11/5/2019 | | 2,001,800.00 | 218,496,472 | 105.990997314 ^C 0.009102494 | 2,119,819.95 | 232,883,421 | 12,965,671 | 1,421,278 | 14,386,949 |
| 950,000.00000 | ELM BV FOR HELVE FRN 09292047 BNLD12E4 XS1587893451 | 3/30/2017 | | 973,098.09 | 115,872,577 | 113.476997375 ^C 129.684236999 | 1,078,031.48 | 139,803,689 | 13,608,206 | 10,322,906 | 23,931,112 |
| 1,600,000.00000 | ERSTE GROUP FRN PERP/CALL BAUTO17A AT0000A2L583 | 11/16/2020 | | 1,600,000.00 | 198,086,195 | 107.767997742 ^C 129.684236999 | 1,724,287.96 | 223,612,969 | 16,118,190 | 9,408,584 | 25,526,774 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 1,700,000.00000 | HANNOVER RUECKV FRN 10092039 BDEU43DF XS2063350925 | 10/1/2019 | | 1,682,354.00 | 198,098,357 | 101.916000366 ^C 129.684236999 | 1,732,572.01 | 224,687,279 | 6,512,484 | 20,076,438 | 26,588,922 |
| 1,200,000.00000 | ING GROEP NV FRN 05262031 BNLDTEUN XS2176621170 | 5/19/2020 | | 1,198,056.00 | 141,564,503 | 106.709999084 ^C 129.684236999 | 1,280,519.99 | 166,063,258 | 10,694,279 | 13,804,475 | 24,498,754 |
| 500,000.00000 | ING GROEP NV FRN 06092032 BNLDTEVQ XS2350756446 | 6/2/2021 | | 497,620.00 | 66,582,328 | 100.884002686 ^C 129.684236999 | 504,420.01 | 65,415,325 | 881,855 | -2,048,858 | -1,167,003 |
| 3,400,000.00000 | JPMORGAN CHASE FRN 05132031 BUSA9EB5 US46647PP09 | 5/6/2020 | | 3,400,000.00 | 360,570,015 | 105.830001831 ^C 0.009102494 | 3,598,220.06 | 395,300,460 | 21,776,456 | 12,953,988 | 34,730,444 |
| 2,250,000.00000 | JYSKE BANK A/S FRN 01282031 BDNK024F XS2109391214 | 11/5/2020 | | 2,224,035.00 | 272,639,083 | 101.914001465 ^C 129.684236999 | 2,293,065.03 | 297,374,389 | 8,952,107 | 15,783,199 | 24,735,306 |
| 900,000.00000 | KBC GROUP NV FRN 09182029 BBEL017K BE0002290592 | 9/11/2017 | | 897,642.00 | 117,137,187 | 104.265998840 ^C 129.684236999 | 938,393.99 | 121,694,909 | 5,284,891 | -727,169 | 4,557,722 |
| 3,000,000.00000 | KBC GROUP NV FRN 12032029 BBEL0181 BE0002664457 | 8/27/2019 | | 2,985,303.00 | 351,000,708 | 100.556999207 ^C 129.684236999 | 3,016,709.98 | 391,219,732 | 4,072,990 | 36,146,034 | 40,219,024 |
| 3,000,000.00000 | LA BANQUE POSTAL FRN 08022032 BFRA10T6 FRO014001R34 | 1/29/2021 | | 2,983,050.00 | 379,425,930 | 99.577003479 ^C 129.684236999 | 2,987,310.10 | 387,407,032 | 552,468 | 7,428,633 | 7,981,101 |
| 1,106,000.00000 | LIBERTY MUTUAL FRN 12152051 BUSA9F2F US53079EBM57 | 8/11/2021 | | 1,106,000.00 | 122,179,825 | 102.385002136 ^C 0.009102494 | 1,132,378.12 | 124,403,062 | 2,897,901 | -674,664 | 2,223,237 |
| 1,300,000.00 | LLOYDS BK GR PLC FRN PERP/CALL BGBR22QP XS2080995405 | 12/18/2020 | | 1,365,000.00 | 190,305,323 | 106.161003113 ^C 151.194825005 | 1,380,093.04 | 208,662,926 | 2,281,990 | 16,075,613 | 18,357,603 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 750,000.00 | LLOYDS BK GR PLC FRN 12152031 BGBR22R6 XS2351166421 | 6/8/2021 | | 750,777.00 | 116,253,092 | 101.207000732 ^C 151.194825005 | 759,052.51 | 114,764,811 | 1,251,214 | -2,739,495 | -1,488,281 |
| 1,250,000.00 | M&G PLC FRN 10202051 BGBR22PY XS1888920276 | 6/4/2020 | | 1,373,600.00 | 188,771,192 | 120.378997803 ^C 151.194825005 | 1,504,737.47 | 227,508,519 | 19,827,307 | 18,910,020 | 38,737,327 |
| 600,000.00000 | MAPFRE FRN 03312047 BESPO267 ES0224244089 | 3/22/2017 | | 600,000.00 | 71,996,318 | 116.944999695 ^C 129.684236999 | 701,670.00 | 90,995,538 | 13,184,996 | 5,814,224 | 18,999,220 |
| 3,100,000.00000 | MITSUMI SUMITOMO FRN PERP/CALL BJPN3074 USJ4517MAA74 | 2/27/2019 | | 3,100,000.00 | 343,774,504 | 114.736000061 ^C 0.009102494 | 3,556,816.00 | 390,751,810 | 50,185,806 | -3,208,501 | 46,977,305 |
| 3,500,000.00000 | MORGAN STANLEY FRN 04222042 BUSA9EV4 US61772BAC72 | 4/19/2021 | | 3,500,000.00 | 378,104,998 | 107.036003113 ^C 0.009102494 | 3,746,260.11 | 411,564,139 | 27,054,136 | 6,405,006 | 33,459,142 |
| 2,000,000.00000 | MUNICH RE FRN 05262049 BDEU43C0 XS1843448314 | 11/15/2018 | | 2,117,407.20 | 267,453,226 | 117.199996948 ^C 129.684236999 | 2,343,999.94 | 303,979,844 | 29,385,506 | 7,141,111 | 36,526,617 |
| 700,000.00000 | MUNICH RE FRN 05262041 BDEU43EI XS2221845683 | 9/15/2020 | | 691,929.00 | 86,490,485 | 102.822998047 ^C 129.684236999 | 719,760.99 | 93,341,654 | 3,609,370 | 3,241,799 | 6,851,169 |
| 1,200,000.00000 | MUTUELLE ASSUR FRN 06212052 BFRA10TK FRO014003XZ7 | 6/15/2021 | | 1,200,123.00 | 160,037,988 | 102.302001953 ^C 129.684236999 | 1,227,624.02 | 159,203,485 | 3,566,449 | -4,400,952 | -834,503 |
| 2,400,000.00000 | NATIONWIDE BLDG FRN 07182030 BGBR2209 US63861VAE74 | 7/12/2019 | | 2,400,912.00 | 259,334,521 | 112.912002563 ^C 0.009102494 | 2,709,888.06 | 297,708,305 | 33,944,110 | 4,429,674 | 38,373,784 |
| 500,000.00 | NATWEST GROUP FRN 11282031 BGBR22R3 XS2346516250 | 5/25/2021 | | 500,000.00 | 76,971,853 | 101.178001404 ^C 151.194825005 | 505,890.01 | 76,487,951 | 890,539 | -1,374,440 | -483,901 |

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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 3,000,000.00000 | NIPPON LIFE INS FRN 01212051 BJPN308K USJ54675BA04 | 1/13/2021 | | 3,000,000.00 | 311,805,000 | 99.415000916 ^C 0.009102494 | 2,982,450.03 | 327,651,963 | -1,928,040 | 17,775,003 | 15,846,963 |
| 3,300,000.00000 | NN GROUP NV FRN PERP/CALL BNLD127Z XS1028950290 | 11/10/2014 | | 3,460,611.63 | 461,773,159 | 114.823997498 ^C 129.684236999 | 3,789,191.92 | 491,398,463 | 42,611,684 | -12,986,380 | 29,625,304 |
| 2,900,000.00000 | NORDEA BANK AB FRN 08182031 BSWE038F XS2343459074 | 5/10/2021 | | 2,893,736.00 | 382,614,869 | 100.722999573 ^C 129.684236999 | 2,920,966.99 | 378,803,375 | 3,531,430 | -7,342,924 | -3,811,494 |
| 1,750,000.00000 | PEAK RE BVI HLDN FRN PERP/CALL BVGB004A XS2239623437 | 10/20/2020 | | 1,750,000.00 | 184,730,007 | 105.780998230 ^C 0.009102494 | 1,851,167.47 | 203,369,260 | 11,114,258 | 7,524,995 | 18,639,253 |
| 1,850,000.00000 | PRINCIPAL FINL FRN 05152055 BUSA9BM4 US74251VAL62 | 1/12/2021 | | 1,813,000.00 | 188,914,600 | 99.767997742 ^C 0.009102494 | 1,845,707.96 | 202,769,478 | 3,593,296 | 10,261,582 | 13,854,878 |
| 1,200,000.00 | PRUDENTIAL PLC FRN 07202055 BGBR22DZ XS1243995302 | 10/28/2019 | | 1,340,712.00 | 187,906,361 | 120.358001709 ^C 151.194825005 | 1,444,296.02 | 218,370,084 | 15,661,368 | 14,802,355 | 30,463,723 |
| 1,800,000.00000 | RAIFFEISEN BK IN FRN 06182032 BAUT0172 XS2189786226 | 6/9/2020 | | 1,789,776.00 | 218,898,549 | 110.018997192 ^C 129.684236999 | 1,980,341.95 | 256,819,135 | 24,713,400 | 13,207,186 | 37,920,586 |
| 800,000.00000 | RAIFFEISEN BK IN FRN 06172033 BAUT017H XS2353473692 | 6/9/2021 | | 796,560.00 | 106,383,042 | 101.184997559 ^C 129.684236999 | 809,479.98 | 104,976,794 | 1,675,518 | -3,081,766 | -1,406,248 |
| 1,400,000.00000 | RAIFFEISENBK AS FRN 06092028 BCZE0006 XS2348241048 | 6/2/2021 | | 1,396,108.00 | 186,801,417 | 100.973999023 ^C 129.684236999 | 1,413,635.99 | 183,326,304 | 2,273,104 | -5,748,216 | -3,475,112 |
| 1,200,000.00 | RL FINANCE N04 FRN 10072049 BGBR220S XS2061962465 | 9/30/2019 | | 1,175,712.00 | 156,582,293 | 115.035003662 ^C 151.194825005 | 1,380,420.04 | 208,712,367 | 30,950,797 | 21,179,277 | 52,130,074 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 2,500,000.00000 | ROYAL BK SCOTLND FRN 05182029 BGBR22MB US780097BG51 | 5/15/2018 | | 2,500,000.00 | 275,799,985 | 117.797996521 ^C 0.009102494 | 2,944,949.91 | 323,532,200 | 48,882,198 | -1,149,982 | 47,732,216 |
| 1,550,000.00000 | SAMPO OYJ FRN 09032052 BFIN015V XS2226645278 | 8/28/2020 | | 1,548,891.00 | 194,383,740 | 108.069999695 ^C 129.684236999 | 1,675,085.00 | 217,232,120 | 16,365,372 | 6,483,008 | 22,848,380 |
| 1,750,000.00000 | SHINHAN FINL GRP FRN PERP/CALL BKOR011Y USY7749XAY77 | 5/4/2021 | | 1,750,000.00 | 191,100,003 | 99.276000977 ^C 0.009102494 | 1,737,330.02 | 190,863,077 | -1,391,924 | 1,154,999 | -236,925 |
| 2,200,000.00000 | SOCIETE GENERALE FRN 06302031 BFRA10TA FRO014002QE8 | 3/25/2021 | | 2,186,690.00 | 281,015,732 | 101.108001709 ^C 129.684236999 | 2,224,376.04 | 288,466,509 | 4,887,285 | 2,563,492 | 7,450,777 |
| 800,000.00000 | SUMITOMO LIFE FRN 04152081 BJPN308Q US86564CAC47 | 4/8/2021 | | 800,000.00 | 87,415,997 | 104.732002258 ^C 0.009102494 | 837,856.02 | 92,046,863 | 4,158,862 | 472,004 | 4,630,866 |
| 1,800,000.00000 | SWISS RE FIN FRN PERP/CALL BLUX02DE XS2049422343 | 8/28/2019 | | 1,806,282.00 | 191,312,364 | 106.181999207 ^C 0.009102494 | 1,911,275.99 | 209,972,782 | 11,534,639 | 7,125,778 | 18,660,417 |
| 1,750,000.00000 | SYNOVUS BANK GA FRN 10292030 BUSA9EM7 US87164DSE12 | 10/22/2020 | | 1,750,000.00 | 183,408,741 | 107.268997192 ^C 0.009102494 | 1,877,207.45 | 206,230,012 | 13,975,011 | 8,846,261 | 22,821,272 |
| 1,700,000.00000 | UBS GROUP FRN PERP/CALL BCHE012R CHO558521263 | 7/23/2020 | | 1,720,400.00 | 184,074,201 | 109.585998535 ^C 0.009102494 | 1,862,961.98 | 204,665,004 | 15,661,859 | 4,928,945 | 20,590,804 |
| 4,550,000.00000 | UNICREDIT SPA FRN 09232029 BITA0386 XS2055089457 | 11/25/2020 | | 4,520,650.50 | 562,443,768 | 101.311996460 ^C 129.684236999 | 4,609,695.84 | 597,804,888 | 11,547,777 | 23,813,343 | 35,361,120 |
| 1,100,000.00 | VIRGIN MONEY FRN 08192031 BGBR22R1 XS2343851510 | 5/12/2021 | | 1,100,242.00 | 169,641,846 | 101.747001648 ^C 151.194825005 | 1,119,217.02 | 169,219,821 | 2,868,925 | -3,290,949 | -422,024 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 3,800,000.00000 | VOLKSBANK NV FRN 10222030 BNLDTEUY XS2202902636 | 7/15/2020 | | 3,890,234.00 | 479,510,696 | 105.379997253 ^C 129.684236999 | 4,004,439.90 | 519,312,732 | 14,810,704 | 24,991,332 | 39,802,036 |
| 1,100,000.00000 | VOLKSBANK WIEN A FRN 10062027 BAUT017B AT000B121967 | 11/30/2020 | | 1,097,800.00 | 136,932,717 | 102.421997070 ^C 129.684236999 | 1,126,641.97 | 146,107,704 | 3,740,349 | 5,434,638 | 9,174,987 |
| 1,850,000.00000 | WESTPAC BANKING FRN 05132031 BAUS08CY XS2342206591 | 5/6/2021 | | 1,850,000.00 | 243,337,069 | 100.802001953 ^C 129.684236999 | 1,864,837.04 | 241,839,968 | 1,924,130 | -3,421,231 | -1,497,101 |
| 1,200,000.00000 | XLIT LTD FRN 06292047 BCYM05AV XS1633784183 | 6/22/2017 | | 1,188,648.00 | 147,662,895 | 113.169998169 ^C 129.684236999 | 1,358,039.98 | 176,116,378 | 21,967,469 | 6,486,014 | 28,453,483 |
| 1,800,000.00000 | ZURICH FINANCE FRN 04192051 BIRLO2BY XS2283177561 | 1/12/2021 | | 1,800,000.00 | 187,560,000 | 101.225997925 ^C 0.009102494 | 1,822,067.96 | 200,172,388 | 2,424,386 | 10,188,002 | 12,612,388 |
| 178,026,000.00000 | 固定利率から変動利率に転換される社債小計 | | | 180,044,323 | 21,978,271,036 | | 189,467,103 | 23,679,900,747 | 1,167,965,786 | 533,663,931 | 1,701,629,717 |
| 変動利率 | | | | | | | | | | | |
| 2,000,000.00000 | AEGON NV FRN PERP/CALL BNLDTEU9 NL0000116168 | 2/3/2020 | | 1,715,000.00 | 186,437,645 | 94.067001343 ^C 0.009102494 | 1,881,340.03 | 206,684,017 | 18,274,116 | 1,972,257 | 20,246,373 |
| 1,740,000.00000 | HARTFORD FINL FRN 02122047 BUSA9COP US416515BC76 | 12/4/2017 | | 1,666,050.00 | 187,797,158 | 96.550003052 ^C 0.009102494 | 1,679,970.05 | 184,561,512 | 1,529,257 | -4,764,903 | -3,235,646 |
| 2,300,000.00000 | HSBC BANK PLC FRN PERP/CALL GGBR22PB XS0015190423 | 12/20/2019 | | 1,805,500.00 | 197,620,996 | 95.528999329 ^C 0.009102494 | 2,197,166.98 | 241,380,767 | 43,028,535 | 731,236 | 43,759,771 |
| 4,150,000.00000 | PRUDENTIAL FIN FRN 06152043 BUSA95MG US744320AM42 | 12/14/2012 | | 4,245,496.10 | 390,045,442 | 106.972999573 ^C 0.009102494 | 4,439,379.48 | 487,710,234 | 21,300,029 | 76,364,764 | 97,664,793 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|------------------|---|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------|--------------------|-------------|
| クラスに割当てられていない資産 | | | | | | | | | | | |
| 社債 | | | | | | | | | | | |
| 変動利率 | | | | | | | | | | | |
| 1,290,000.00000 | SOMPO JAPAN INS FRN 03282073 BJPN302D USJ7620TAB73 | 3/22/2013 | | 1,302,286.41 | 125,730,568 | 106.623001099C 0.009102494 | 1,375,436.71 | 151,105,479 | 8,036,292 | 17,338,618 | 25,374,910 |
| 11,480,000.00000 | 変動利率小計 | | | 10,734,333 | 1,087,631,809 | | 11,573,293 | 1,271,442,009 | 92,168,229 | 91,641,972 | 183,810,201 |
| ミディアム・ターム・ノート | | | | | | | | | | | |
| 800,000.00000 | ASSICURAZIONI 2.124 % 10012030 BITA0387 XS2056491587 | 9/23/2019 | | 800,950.00 | 94,550,296 | 107.441001892C 129.684236999 | 859,528.02 | 111,467,235 | 7,596,645 | 9,320,294 | 16,916,939 |
| 2,600,000.00000 | BANQ FED CRD MUT 2.375 % 03242026 BFRA10NI XS1385945131 | 8/13/2019 | | 2,887,300.00 | 341,110,482 | 109.573997498C 129.684236999 | 2,848,923.93 | 369,460,527 | -4,976,771 | 33,326,815 | 28,350,044 |
| 6,240,000.00000 | BPCE 4.5 % 03152025 BFRA10DA US05578UAD63 | 10/14/2014 | | 6,235,382.91 | 692,056,012 | 110.476997375C 0.009102494 | 6,893,764.64 | 757,348,990 | 72,329,817 | -7,036,839 | 65,292,978 |
| 800,000.00 | HSBC HLDGS PLC 6 % 03292040 BGBR22NX XS0498768315 | 5/28/2019 | | 1,017,096.00 | 141,259,280 | 144.216003418C 151.194825005 | 1,153,728.03 | 174,437,707 | 20,658,055 | 12,520,372 | 33,178,427 |
| 1,300,000.00000 | HUARONG FIN 2019 3.625 % 09302030 BVB0049 XS2235973869 | 9/24/2020 | | 1,295,567.00 | 136,649,924 | 91.516998291C 0.009102494 | 1,189,720.98 | 130,702,748 | -11,628,244 | 5,681,068 | -5,947,176 |
| 1,980,000.00000 | LB BADEN-WUERTT 3.625 % 06162025 BDEU4391 XS1246732249 | 6/9/2015 | | 1,972,495.80 | 275,882,567 | 111.700996399C 129.684236999 | 2,211,679.73 | 286,819,998 | 31,018,385 | -20,080,954 | 10,937,431 |
| 3,600,000.00000 | NATL AUSTRALIABK 2.332 % 08212030 BAUS08C5 USG6S94TAC79 | 8/17/2020 | | 3,600,000.00 | 381,852,016 | 98.264999390C 0.009102494 | 3,537,539.98 | 388,634,146 | -6,861,858 | 13,643,988 | 6,782,130 |
| 2,870,000.00000 | PHOENIX GRP 4.375 % 01242029 BGBR22P5 XS1881005117 | 11/29/2019 | | 3,120,805.50 | 380,970,967 | 119.066001892C 129.684236999 | 3,417,194.25 | 443,156,230 | 38,436,949 | 23,748,313 | 62,185,262 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| メディアム・ターム・ノート | | | | | | | | | | | |
| 3,000,000.00000 | SANTANDER ISSUAN 3.125 % 01192027 BESPO263 XS1548444816 | 1/4/2017 | | 2,967,900.00 | 364,610,750 | 114.053001404 ^C 129.684236999 | 3,421,590.04 | 443,726,294 | 58,836,447 | 20,279,097 | 79,115,544 |
| 1,800,000.00000 | VOLKSBANK WIEN A 0.875 % 03232026 BAUT017E AT000B122080 | 3/12/2021 | | 1,790,208.00 | 232,917,327 | 101.911003113 ^C 129.684236999 | 1,834,398.06 | 237,892,512 | 5,730,754 | -755,568 | 4,975,186 |
| 24,990,000.00000 | メディアム・ターム・ノート小計 | | | 25,687,705 | 3,041,859,621 | | 27,368,068 | 3,343,646,387 | 211,140,179 | 90,646,586 | 301,786,765 |
| 私券債 | | | | | | | | | | | |
| 1,372,000.00000 | AVIATION CAPITAL 3.5 % 11012027 BUSA9BXQ US05369AAA97 | 1/22/2021 | | 1,469,658.96 | 152,550,606 | 106.193960000 ^C 0.009102494 | 1,456,981.13 | 160,063,949 | -1,392,786 | 8,906,129 | 7,513,343 |
| 1,828,000.00000 | AVIATION CAPITAL 4.875 % 10012025 BUSA9EQL US05367AAH68 | 1/20/2021 | | 2,046,720.20 | 211,978,802 | 111.232002258 ^C 0.009102494 | 2,033,321.00 | 223,380,647 | -1,472,036 | 12,873,881 | 11,401,845 |
| 700,000.00000 | AVOLON HDGS 4.25 % 04152026 BCYM05C0 US05401AAL52 | 11/16/2020 | | 699,825.00 | 73,198,199 | 108.617000000 ^C 0.009102494 | 760,319.00 | 83,528,646 | 6,645,871 | 3,684,576 | 10,330,447 |
| 3,250,000.00000 | AVOLON HDGS 2.125 % 02212026 BCYM05C2 US05401AAM36 | 1/20/2021 | | 3,203,427.50 | 332,732,013 | 99.771003723 ^C 0.009102494 | 3,242,557.62 | 356,227,384 | 4,298,835 | 19,196,535 | 23,495,370 |
| 570,000.00000 | AVOLON HDGS 5.5 % 01152026 BCYM05C3 US05401AAK79 | 2/4/2021 | | 643,661.10 | 67,854,754 | 113.488998413 ^C 0.009102494 | 646,887.29 | 71,067,038 | 354,429 | 2,857,855 | 3,212,284 |
| 655,000.00000 | AVOLON HDGS 4.375 % 05012026 BCYM05C4 US05401AAG67 | 2/4/2021 | | 707,275.55 | 74,560,989 | 108.996002197 ^C 0.009102494 | 713,923.81 | 78,431,671 | 730,378 | 3,140,304 | 3,870,682 |
| 1,850,000.00000 | BNP PARIBAS 4.375 % 09282025 BFRA10G5 US05581KAA97 | 10/1/2015 | | 1,794,960.54 | 211,690,463 | 110.723999023 ^C 0.009102494 | 2,048,393.98 | 225,036,565 | 27,842,198 | -14,496,096 | 13,346,102 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 1,300,000.00000 | GLOBAL ATLANTI 3.125 % 06152031 BUSA9EX7 US37959GAB32 | 6/14/2021 | | 1,303,641.00 | 143,461,410 | 101.669998169 ^C 0.009102494 | 1,321,709.98 | 145,203,059 | 1,985,058 | -243,408 | 1,741,650 |
| 5,950,000.00000 | STANDARD CHART 4.3 % 02192027 BGBR22H3 US853254BF64 | 8/16/2016 | | 5,915,252.00 | 594,216,645 | 110.049003601 ^C 0.009102494 | 6,547,915.71 | 719,354,027 | 69,504,436 | 55,632,946 | 125,137,382 |
| 17,475,000.00000 | 私募債小計 | | | 17,784,422 | 1,862,243,881 | | 18,772,010 | 2,062,292,986 | 108,496,383 | 91,552,722 | 200,049,105 |
| 公募債 | | | | | | | | | | | |
| 3,150,000.00000 | AMERICAN HOMES 4 4.25 % 02152028 BUSA9C4K US02666TAA51 | 6/6/2019 | | 3,314,357.00 | 355,353,340 | 114.583999634 ^C 0.009102494 | 3,609,395.99 | 396,528,247 | 32,412,984 | 8,761,923 | 41,174,907 |
| 1,850,000.00000 | AXA EQUITABLE HO 5 % 04202048 BUSA9CRL US054561AM77 | 7/5/2019 | | 1,905,925.50 | 206,726,207 | 129.994003296 ^C 0.009102494 | 2,404,889.06 | 264,201,115 | 54,816,137 | 2,658,770 | 57,474,907 |
| 400,000.00000 | BOARD 2.75 % 01222033 BSUP121Y XS2288824969 | 1/14/2021 | | 396,264.00 | 49,925,955 | 106.614000000 ^C 129.684236999 | 426,456.00 | 55,304,621 | 3,915,426 | 1,463,239 | 5,378,665 |
| 2,100,000.00000 | CAPITAL ONE FINL 1.65 % 06122029 BUSA9DOT XS2010331440 | 6/5/2019 | | 2,092,713.00 | 254,547,631 | 107.122001648 ^C 129.684236999 | 2,249,562.03 | 291,732,736 | 20,340,847 | 16,844,258 | 37,185,105 |
| 2,600,000.00000 | CHUBB INA HLDGS 2.5 % 03152038 BUSA9C6V XS1785813251 | 3/1/2018 | | 2,599,974.00 | 339,008,298 | 123.597999573 ^C 129.684236999 | 3,213,547.99 | 416,746,519 | 79,570,875 | -1,832,654 | 77,738,221 |
| 1,030,000.00000 | CITIGROUP INC 8.125 % 07152039 BUSA9426 US172967EW71 | 5/5/2016 | | 1,581,977.00 | 169,137,062 | 172.466003418 ^C 0.009102494 | 1,776,399.84 | 195,155,288 | 21,359,293 | 4,658,933 | 26,018,226 |
| 1,000,000.00000 | DIGITAL DUTCH 1 % 01152032 BNLDTEV3 XS2232115423 | 9/14/2020 | | 990,170.00 129.684236999 | 124,200,604 | 100.597999573 ^C | 1,005,980.00 | 130,459,748 | 2,050,307 | 4,208,837 | 6,259,144 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 1,550,000.00000 | FIRST HORIZON 5.75 % 05012030 BUSA9EHA US337158AJ88 | 8/27/2020 | | 1,755,995.00 | 186,916,888 | 124.221000671 ^C 0.009102494 | 1,925,425.51 | 211,527,249 | 18,613,636 | 5,996,724 | 24,610,360 |
| 5,150,000.00000 | GOLDMAN SACHS GP 6.345% 02152034 BUSA2420 US38143VAA70 | 10/20/2017 | | 6,447,248.16 | 718,749,937 | 141.619995117 ^C 0.009102494 | 7,293,429.75 | 801,256,200 | 92,961,510 | -10,455,248 | 82,506,262 |
| 2,800,000.00 | HASTINGS GRP FIN 3 % 05242025 BJEY0016 XS1815424202 | 9/27/2019 | | 2,774,604.00 | 368,529,829 | 106.252998352 ^C 151.194825005 | 2,975,083.95 | 449,817,298 | 30,311,532 | 50,975,937 | 81,287,469 |
| 3,000,000.00000 | HSBC BANK USA NA 7 % 01152039 BUSA9CQP US4042Q1AD94 | 1/11/2019 | | 3,811,320.00 | 413,185,215 | 157.149002075 ^C 0.009102494 | 4,714,470.06 | 517,931,686 | 99,220,067 | 5,526,404 | 104,746,471 |
| 3,050,000.00000 | HSBC HLDGS PLC 6.8% 06012038 BGBR2073 US404280AJ87 | 5/29/2019 | | 3,937,580.50 | 430,633,498 | 144.856994629 ^C 0.009102494 | 4,418,138.34 | 485,376,682 | 52,794,084 | 1,949,100 | 54,743,184 |
| 1,400,000.00000 | LA MONDIALE 0.75 % 04202026 BFRA10ST FRO014000774 | 10/13/2020 | | 1,396,188.00 | 173,043,965 | 101.900001526 ^C 129.684236999 | 1,426,600.02 | 185,007,535 | 3,943,960 | 8,019,610 | 11,963,570 |
| 3,550,000.00000 | LSEGA FIN PLC 3.2 % 04062041 BGBR22QT USG5690PAE19 | 3/25/2021 | | 3,532,321.00 | 385,499,865 | 106.064700000 ^C 0.009102494 | 3,765,296.85 | 413,655,516 | 25,594,727 | 2,560,924 | 28,155,651 |
| 2,950,000.00000 | MERRILL LYNCH 7.75 % 05142038 BUSA8579 US59023VAA89 | 10/20/2017 | | 4,374,083.00 | 496,152,228 | 158.623001099 ^C 0.009102494 | 4,679,378.53 | 514,076,530 | 33,539,767 | -15,615,465 | 17,924,302 |
| 2,000,000.00000 | METLIFE INC 6.4% 12152036 BUSA5773 US59156RAP38 | 6/13/2017 | | 2,305,000.00 | 253,434,756 | 128.468994141 ^C 0.009102494 | 2,569,379.88 | 282,272,077 | 29,044,774 | -207,454 | 28,837,320 |
| 900,000.00000 | NASDAQ INC 3.25 % 04282050 BUSA9EAK US63111XAB73 | 4/23/2020 | | 882,882.00 | 95,011,345 | 102.761001587 ^C 0.009102494 | 924,849.01 | 101,603,914 | 4,610,496 | 1,982,072 | 6,592,568 |

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 400,000.00 | RL FINANCE NO3 6.125 % 11132028 BGBR22RA XS1319738537 | 7/15/2021 | | 499,000.00 | 76,129,201 | 124.476997375 ^C 151.194825005 | 497,907.99 | 75,281,111 | -165,106 | -682,983 | -848,089 |
| 4,850,000.00000 | SANTANDER MEXICO 5.375 % 04172025 BMEX00CF USP1507SAH06 | 8/11/2020 | | 5,480,500.00 | 583,481,444 | 113.351997375 ^C 0.009102494 | 5,497,571.87 | 603,963,251 | 1,875,516 | 18,606,292 | 20,481,808 |
| 1,500,000.00000 | SANTANDER UK GRP 5.625 % 09152045 BGBR220V XS1291352711 | 10/18/2019 | | 1,794,255.00 | 194,703,578 | 132.559000000 ^C 0.009102494 | 1,988,385.00 | 218,443,978 | 21,327,122 | 2,413,278 | 23,740,400 |
| 1,150,000.00000 | STANDARD CHART 5.3 % 01092043 BGBR2207 XS0875267394 | 7/1/2019 | | 1,284,964.00 | 139,193,730 | 124.865997314 ^C 0.009102494 | 1,435,958.97 | 157,754,454 | 16,588,307 | 1,972,416 | 18,560,723 |
| 2,730,000.00000 | SUMITOMO MITSUI 3.202 % 09172029 BJPN3070 US86562MBS89 | 9/10/2019 | | 2,730,000.00 | 292,888,035 | 107.386001587 ^C 0.009102494 | 2,931,637.84 | 322,069,736 | 22,151,934 | 7,029,768 | 29,181,702 |
| 49,110,000.00000 | 公募債小計 | | | 55,887,321 | 6,306,452,611 | | 61,729,744 | 7,090,165,491 | 666,878,195 | 116,834,681 | 783,712,876 |
| 281,081,000.00000 | 社債合計 | | | 290,138,103 | 34,276,458,958 | | 308,910,217 | 37,447,447,620 | 2,246,648,772 | 924,339,892 | 3,170,988,664 |
| 外貨建現金勘定 | | | | | | | | | | | |
| 非グループ化の有価証券 | | | | | | | | | | | |
| 831,096.41000 | AUSTRALIAN DOLLAR AUD | 9/14/2015 | | 831,096.41 | 70,754,595 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | 831,096.41 | 66,729,712 | 0 | -4,024,883 | -4,024,883 |
| 1,200,000.00000 | | 9/17/2015 | | 1,200,000.00 | 104,033,759 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | 1,200,000.00 | 96,349,417 | 0 | -7,684,342 | -7,684,342 |
| 4,580.00000 | | 9/29/2015 | | 4,580.00 | 384,148 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | 4,580.00 | 367,734 | 0 | -16,414 | -16,414 |
| 1,050.33000 | | 9/30/2015 | | 1,050.33 | 88,338 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | 1,050.33 | 84,332 | 0 | -4,006 | -4,006 |
| 41,308.36000 | | 10/2/2015 | | 41,308.36 | 3,484,596 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | 41,308.36 | 3,316,697 | 0 | -167,899 | -167,899 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 1,200,000.00000 | | 10/7/2015 | | 1,200,000.00 | 102,916,819 | 1.000000000 ^S | 1,200,000.00 | 96,349,417 | 0 | -6,567,402 | -6,567,402 |
| 479,833.36000 | | 10/14/2015 | | 479,833.36 | 41,980,363 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 479,833.36 | 38,526,387 | 0 | -3,453,976 | -3,453,976 |
| 34,504.30000 | | 10/19/2015 | | 34,504.30 | 2,988,523 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 34,504.30 | 2,770,391 | 0 | -218,132 | -218,132 |
| 1,500,000.00000 | | 10/21/2015 | | 1,500,000.00 | 130,659,384 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,500,000.00 | 120,436,771 | 0 | -10,222,613 | -10,222,613 |
| 146,966.97000 | | 10/23/2015 | | 146,966.97 | 12,774,602 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 146,966.97 | 11,800,152 | 0 | -974,450 | -974,450 |
| 33,373.73000 | | 10/28/2015 | | 33,373.73 | 2,903,788 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 33,373.73 | 2,679,616 | 0 | -224,172 | -224,172 |
| 1,210.89000 | | 10/30/2015 | | 1,210.89 | 104,252 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,210.89 | 97,224 | 0 | -7,028 | -7,028 |
| 191,801.71000 | | 11/2/2015 | | 191,801.71 | 16,513,279 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 191,801.71 | 15,399,986 | 0 | -1,113,293 | -1,113,293 |
| 1,450.44000 | | 11/9/2015 | | 1,450.44 | 125,722 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,450.44 | 116,458 | 0 | -9,264 | -9,264 |
| 1,100,000.00000 | | 11/10/2015 | | 1,100,000.00 | 95,614,298 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,100,000.00 | 88,320,299 | 0 | -7,293,999 | -7,293,999 |
| 1,370,000.00000 | | 11/20/2015 | | 1,370,000.00 | 121,160,088 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,370,000.00 | 109,998,918 | 0 | -11,161,170 | -11,161,170 |
| 1,241.63000 | | 11/30/2015 | | 1,241.63 | 110,913 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,241.63 | 99,692 | 0 | -11,221 | -11,221 |
| 55,217.71000 | | 11/30/2015 | | 55,217.71 | 4,875,314 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 55,217.71 | 4,433,495 | 0 | -441,819 | -441,819 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| 67,803.25000 | | 12/2/2015 | | 67,803.25 | 6,086,449 | 1.000000000 ^S | 67,803.25 | 5,444,003 | 0 | -642,446 | -642,446 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,200,000.00000 | | 12/8/2015 | | 1,200,000.00 | 107,613,376 | 1.000000000 ^S | 1,200,000.00 | 96,349,417 | 0 | -11,263,959 | -11,263,959 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 479,833.36000 | | 12/14/2015 | | 479,833.36 | 41,838,537 | 1.000000000 ^S | 479,833.36 | 38,526,387 | 0 | -3,312,150 | -3,312,150 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,300,000.00000 | | 12/14/2015 | | 1,300,000.00 | 113,352,056 | 1.000000000 ^S | 1,300,000.00 | 104,378,535 | 0 | -8,973,521 | -8,973,521 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 920,000.00000 | | 12/18/2015 | | 920,000.00 | 80,272,386 | 1.000000000 ^S | 920,000.00 | 73,867,887 | 0 | -6,404,499 | -6,404,499 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 7,027.13000 | | 12/21/2015 | | 7,027.13 | 613,059 | 1.000000000 ^S | 7,027.13 | 564,217 | 0 | -48,842 | -48,842 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 69,609.63000 | | 12/22/2015 | | 69,609.63 | 6,058,273 | 1.000000000 ^S | 69,609.63 | 5,589,039 | 0 | -469,234 | -469,234 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 30,652.58000 | | 12/24/2015 | | 30,652.58 | 2,680,171 | 1.000000000 ^S | 30,652.58 | 2,461,132 | 0 | -219,039 | -219,039 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 31,897.52000 | | 12/29/2015 | | 31,897.52 | 2,787,126 | 1.000000000 ^S | 31,897.52 | 2,561,090 | 0 | -226,036 | -226,036 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 930.50000 | | 12/31/2015 | | 930.50 | 81,438 | 1.000000000 ^S | 930.50 | 74,711 | 0 | -6,727 | -6,727 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 64,476.82000 | | 1/6/2016 | | 64,476.82 | 5,481,018 | 1.000000000 ^S | 64,476.82 | 5,176,920 | 0 | -304,098 | -304,098 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 29,058.54000 | | 1/14/2016 | | 29,058.54 | 2,404,861 | 1.000000000 ^S | 29,058.54 | 2,333,144 | 0 | -71,717 | -71,717 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 306,365.43000 | | 1/20/2016 | | 306,365.43 | 24,967,386 | 1.000000000 ^S | 306,365.43 | 24,598,442 | 0 | -368,944 | -368,944 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 453,323.95000 | | 1/25/2016 | | 453,323.95 | 37,747,169 | 1.000000000 ^S | 453,323.95 | 36,397,915 | 0 | -1,349,254 | -1,349,254 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 54,860.74000 | | 1/28/2016 | | 54,860.74 | 4,588,058 | 1.000000000 ^S | 54,860.74 | 4,404,834 | 0 | -183,224 | -183,224 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 778.74000 | | 1/29/2016 | | 778.74 | 66,688 | 1.000000000 ^S | 778.74 | 62,526 | 0 | -4,162 | -4,162 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 9,624.24000 | | 2/2/2016 | | 9,624.24 | 825,300 | 1.000000000 ^S | 9,624.24 | 772,742 | 0 | -52,558 | -52,558 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 45,449.01000 | | 2/3/2016 | | 45,449.01 | 3,852,337 | 1.000000000 ^S | 45,449.01 | 3,649,155 | 0 | -203,182 | -203,182 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 900,000.00000 | | 2/19/2016 | | 900,000.00 | 73,080,576 | 1.000000000 ^S | 900,000.00 | 72,262,063 | 0 | -818,513 | -818,513 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 549.31000 | | 2/29/2016 | | 549.31 | 44,286 | 1.000000000 ^S | 549.31 | 44,105 | 0 | -181 | -181 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 549.31000 | | 2/29/2016 | | 549.31 | 7 | 1.000000000 ^S | 549.31 | 44,105 | 0 | 44,098 | 44,098 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 300,000.00000 | | 3/11/2016 | | 300,000.00 | 25,334,694 | 1.000000000 ^S | 300,000.00 | 24,087,354 | 0 | -1,247,340 | -1,247,340 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 870,000.00000 | | 3/18/2016 | | 870,000.00 | 73,945,274 | 1.000000000 ^S | 870,000.00 | 69,853,327 | 0 | -4,091,947 | -4,091,947 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 670.89000 | | 3/31/2016 | | 670.89 | 58,005 | 1.000000000 ^S | 670.89 | 53,867 | 0 | -4,138 | -4,138 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 670.89000 | | 3/31/2016 | | 670.89 | 8 | 1.000000000 ^S | 670.89 | 53,867 | 0 | 53,859 | 53,859 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 49,152.02000 | | 4/1/2016 | | 49,152.02 | 4,249,676 | 1.000000000 ^S | 49,152.02 | 3,946,474 | 0 | -303,202 | -303,202 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 0.11000 | | 4/4/2016 | | 0.11 | 9 | 1.000000000 ^S | 0.11 | 9 | 0 | 0 | 0 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 118,557.70000 | | 4/4/2016 | | 118,557.70 | 10,179,618 | 1.000000000 ^S | 118,557.70 | 9,519,138 | 0 | -660,480 | -660,480 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 54,704.79000 | | 4/7/2016 | | 54,704.79 | 4,550,661 | 1.000000000 ^S | 54,704.79 | 4,392,312 | 0 | -158,349 | -158,349 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,000,000.00000 | | 4/13/2016 | | 1,000,000.00 | 82,840,523 | 1.000000000 ^S | 1,000,000.00 | 80,291,181 | 0 | -2,549,342 | -2,549,342 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 279,833.36000 | | 4/18/2016 | | 279,833.36 | 23,441,485 | 1.000000000 ^S | 279,833.36 | 22,468,151 | 0 | -973,334 | -973,334 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 2,500,000.00000 | | 4/21/2016 | | 2,500,000.00 | 213,220,853 | 1.000000000 ^S | 2,500,000.00 | 200,727,952 | 0 | -12,492,901 | -12,492,901 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 9,845.91000 | | 4/22/2016 | | 9,845.91 | 837,399 | 1.000000000 ^S | 9,845.91 | 790,540 | 0 | -46,859 | -46,859 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 71,738.60000 | | 4/28/2016 | | 71,738.60 | 6,049,028 | 1.000000000 ^S | 71,738.60 | 5,759,977 | 0 | -289,051 | -289,051 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 651.99000 | | 4/29/2016 | | 651.99 | 8 | 1.000000000 ^S | 651.99 | 52,349 | 0 | 52,341 | 52,341 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 651.99000 | | 4/29/2016 | | 651.99 | 53,237 | 1.000000000 ^S | 651.99 | 52,349 | 0 | -888 | -888 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 3,199.32000 | | 5/6/2016 | | 3,199.32 | 256,662 | 1.000000000 ^S | 3,199.32 | 256,877 | 0 | 215 | 215 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 37,851.41000 | | 5/10/2016 | | 37,851.41 | 3,002,766 | 1.000000000 ^S | 37,851.41 | 3,039,134 | 0 | 36,368 | 36,368 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 52,780.08000 | | 5/13/2016 | | 52,780.08 | 4,214,171 | 1.000000000 ^S | 52,780.08 | 4,237,775 | 0 | 23,604 | 23,604 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,000,000.00000 | | 5/18/2016 | | 1,000,000.00 | 79,969,300 | 1.000000000 ^S | 1,000,000.00 | 80,291,181 | 0 | 321,881 | 321,881 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 28,390.46000 | | 5/26/2016 | | 28,390.46 | 2,250,076 | 1.000000000 ^S | 28,390.46 | 2,279,504 | 0 | 29,428 | 29,428 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 487.18000 | | 5/31/2016 | | 487.18 | 39,143 | 1.000000000 ^S | 487.18 | 39,116 | 0 | -27 | -27 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 77,920.52000 | | 6/16/2016 | | 77,920.52 | 6,116,756 | 1.000000000 ^S | 77,920.52 | 6,256,331 | 0 | 139,575 | 139,575 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 435,877.61000 | | 6/24/2016 | | 435,877.61 | 34,923,776 | 1.000000000 ^S | 435,877.61 | 34,997,128 | 0 | 73,352 | 73,352 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 193,723.40000 | | 6/27/2016 | | 193,723.40 | 14,830,685 | 1.000000000 ^S | 193,723.40 | 15,554,281 | 0 | 723,596 | 723,596 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 51,500.28000 | | 6/28/2016 | | 51,500.28 | 3,847,670 | 1.000000000 ^S | 51,500.28 | 4,135,018 | 0 | 287,348 | 287,348 |
| 370.39000 | | 6/30/2016 | | 370.39 | 28,294 | 1.000000000 ^S | 370.39 | 29,739 | 0 | 1,445 | 1,445 |
| 41,200.23000 | | 6/30/2016 | | 41,200.23 | 3,144,683 | 1.000000000 ^S | 41,200.23 | 3,308,015 | 0 | 163,332 | 163,332 |
| 28,419.86000 | | 7/6/2016 | | 28,419.86 | 2,155,687 | 1.000000000 ^S | 28,419.86 | 2,281,864 | 0 | 126,177 | 126,177 |
| 975,728.88000 | | 7/8/2016 | | 975,728.88 | 73,727,142 | 1.000000000 ^S | 975,728.88 | 78,342,424 | 0 | 4,615,282 | 4,615,282 |
| 10,303.13000 | | 7/19/2016 | | 10,303.13 | 827,218 | 1.000000000 ^S | 10,303.13 | 827,250 | 0 | 32 | 32 |
| 85,548.05000 | | 7/26/2016 | | 85,548.05 | 6,769,315 | 1.000000000 ^S | 85,548.05 | 6,868,754 | 0 | 99,439 | 99,439 |
| 49,430.39000 | | 7/27/2016 | | 49,430.39 | 3,887,241 | 1.000000000 ^S | 49,430.39 | 3,968,824 | 0 | 81,583 | 81,583 |
| 966.37000 | | 7/29/2016 | | 966.37 | 75,274 | 1.000000000 ^S | 966.37 | 77,591 | 0 | 2,317 | 2,317 |
| 279,833.36000 | | 8/18/2016 | | 279,833.36 | 21,425,498 | 1.000000000 ^S | 279,833.36 | 22,468,151 | 0 | 1,042,653 | 1,042,653 |
| 900,000.00000 | | 8/23/2016 | | 900,000.00 | 68,935,762 | 1.000000000 ^S | 900,000.00 | 72,262,063 | 0 | 3,326,301 | 3,326,301 |
| 312.44000 | | 8/31/2016 | | 312.44 | 24,288 | 1.000000000 ^S | 312.44 | 25,086 | 0 | 798 | 798 |
| 2,905.89000 | | 8/31/2016 | | 2,905.89 | 224,400 | 1.000000000 ^S | 2,905.89 | 233,317 | 0 | 8,917 | 8,917 |
| 244,354.19000 | | 9/6/2016 | | 244,354.19 | 19,161,904 | 1.000000000 ^S | 244,354.19 | 19,619,486 | 0 | 457,582 | 457,582 |
| 1,000,000.00000 | | 9/8/2016 | | 1,000,000.00 | 78,053,406 | 1.000000000 ^S | 1,000,000.00 | 80,291,181 | 0 | 2,237,775 | 2,237,775 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 397,132.94000 | | 9/14/2016 | | 397,132.94 | 30,405,336 | 1.000000000 ^S | 397,132.94 | 31,886,273 | 0 | 1,480,937 | 1,480,937 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 74,453.68000 | | 9/20/2016 | | 74,453.68 | 5,728,229 | 1.000000000 ^S | 74,453.68 | 5,977,974 | 0 | 249,745 | 249,745 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 109,580.94000 | | 9/26/2016 | | 109,580.94 | 8,438,525 | 1.000000000 ^S | 109,580.94 | 8,798,383 | 0 | 359,858 | 359,858 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 57,901.38000 | | 9/27/2016 | | 57,901.38 | 4,441,152 | 1.000000000 ^S | 57,901.38 | 4,648,970 | 0 | 207,818 | 207,818 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 38,744.71000 | | 9/28/2016 | | 38,744.71 | 2,976,084 | 1.000000000 ^S | 38,744.71 | 3,110,859 | 0 | 134,775 | 134,775 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 205,508.38000 | | 9/29/2016 | | 205,508.38 | 15,834,834 | 1.000000000 ^S | 205,508.38 | 16,500,511 | 0 | 665,677 | 665,677 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 556.44000 | | 9/30/2016 | | 556.44 | 43,120 | 1.000000000 ^S | 556.44 | 44,677 | 0 | 1,557 | 1,557 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 96,868.26000 | | 9/30/2016 | | 96,868.26 | 7,548,319 | 1.000000000 ^S | 96,868.26 | 7,777,667 | 0 | 229,348 | 229,348 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 10,705.70000 | | 10/4/2016 | | 10,705.70 | 833,355 | 1.000000000 ^S | 10,705.70 | 859,573 | 0 | 26,218 | 26,218 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 145,292.56000 | | 10/4/2016 | | 145,292.56 | 11,309,888 | 1.000000000 ^S | 145,292.56 | 11,665,711 | 0 | 355,823 | 355,823 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 279,833.36000 | | 10/18/2016 | | 279,833.36 | 22,177,198 | 1.000000000 ^S | 279,833.36 | 22,468,151 | 0 | 290,953 | 290,953 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 83,301.08000 | | 10/27/2016 | | 83,301.08 | 6,668,666 | 1.000000000 ^S | 83,301.08 | 6,688,342 | 0 | 19,676 | 19,676 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 833.18000 | | 10/31/2016 | | 833.18 | 66,625 | 1.000000000 ^S | 833.18 | 66,897 | 0 | 272 | 272 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 74,583.53000 | | 10/31/2016 | | 74,583.53 | 5,960,068 | 1.000000000 ^S | 74,583.53 | 5,988,400 | 0 | 28,332 | 28,332 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 142,255.95000 | | 11/2/2016 | | 142,255.95 | 11,375,416 | 1.000000000 ^S | 142,255.95 | 11,421,898 | 0 | 46,482 | 46,482 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 134,756.68000 | | 11/4/2016 | | 134,756.68 | 10,678,599 | 1.000000000 ^S | 134,756.68 | 10,819,773 | 0 | 141,174 | 141,174 |
| 849.50000 | | 11/30/2016 | | 849.50 | 71,518 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 849.50 | 68,207 | 0 | -3,311 | -3,311 |
| 885,465.77000 | | 12/13/2016 | | 885,465.77 | 76,650,084 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 885,465.77 | 71,095,092 | 0 | -5,554,992 | -5,554,992 |
| 279,833.36000 | | 12/15/2016 | | 279,833.36 | 24,213,667 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 279,833.36 | 22,468,151 | 0 | -1,745,516 | -1,745,516 |
| 829.17000 | | 12/21/2016 | | 829.17 | 70,900 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 829.17 | 66,575 | 0 | -4,325 | -4,325 |
| 464.62000 | | 12/30/2016 | | 464.62 | 39,240 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 464.62 | 37,305 | 0 | -1,935 | -1,935 |
| 1,226,556.69000 | | 1/5/2017 | | 1,226,556.69 | 104,711,557 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,226,556.69 | 98,481,685 | 0 | -6,229,872 | -6,229,872 |
| 282,384.02000 | | 1/27/2017 | | 282,384.02 | 24,408,543 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 282,384.02 | 22,672,946 | 0 | -1,735,597 | -1,735,597 |
| 1,199,688.72000 | | 1/27/2017 | | 1,199,688.72 | 103,697,984 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,199,688.72 | 96,324,424 | 0 | -7,373,560 | -7,373,560 |
| 587.10000 | | 1/31/2017 | | 587.10 | 50,174 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 587.10 | 47,139 | 0 | -3,035 | -3,035 |
| 277,517.50000 | | 2/15/2017 | | 277,517.50 | 24,213,142 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 277,517.50 | 22,282,208 | 0 | -1,930,934 | -1,930,934 |
| 786,360.14000 | | 2/15/2017 | | 786,360.14 | 68,609,185 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 786,360.14 | 63,137,784 | 0 | -5,471,401 | -5,471,401 |
| 63,860.76000 | | 2/27/2017 | | 63,860.76 | 5,510,685 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 63,860.76 | 5,127,456 | 0 | -383,229 | -383,229 |
| 598.25000 | | 2/28/2017 | | 598.25 | 51,463 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 598.25 | 48,034 | 0 | -3,429 | -3,429 |
| 702,000.00000 | | 3/10/2017 | | 702,000.00 | 60,452,566 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 702,000.00 | 56,364,409 | 0 | -4,088,157 | -4,088,157 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| 1,412,000.00000 | | 3/16/2017 | | 1,412,000.00 | 122,935,970 | 1.000000000 ^S | 1,412,000.00 | 113,371,148 | 0 | -9,564,822 | -9,564,822 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 62,745.10000 | | 3/27/2017 | | 62,745.10 | 5,307,406 | 1.000000000 ^S | 62,745.10 | 5,037,878 | 0 | -269,528 | -269,528 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 470.71000 | | 3/31/2017 | | 470.71 | 40,012 | 1.000000000 ^S | 470.71 | 37,794 | 0 | -2,218 | -2,218 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 89,505.17000 | | 3/31/2017 | | 89,505.17 | 7,644,438 | 1.000000000 ^S | 89,505.17 | 7,186,476 | 0 | -457,962 | -457,962 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 766,000.00000 | | 4/7/2017 | | 766,000.00 | 64,145,110 | 1.000000000 ^S | 766,000.00 | 61,503,045 | 0 | -2,642,065 | -2,642,065 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 279,833.36000 | | 4/18/2017 | | 279,833.36 | 23,068,187 | 1.000000000 ^S | 279,833.36 | 22,468,151 | 0 | -600,036 | -600,036 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,068,505.95000 | | 4/18/2017 | | 1,068,505.95 | 88,082,762 | 1.000000000 ^S | 1,068,505.95 | 85,791,605 | 0 | -2,291,157 | -2,291,157 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,125,804.00000 | | 4/18/2017 | | 1,125,804.00 | 92,806,152 | 1.000000000 ^S | 1,125,804.00 | 90,392,133 | 0 | -2,414,019 | -2,414,019 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 106,547.89000 | | 4/27/2017 | | 106,547.89 | 8,885,757 | 1.000000000 ^S | 106,547.89 | 8,554,856 | 0 | -330,901 | -330,901 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 978.41000 | | 4/28/2017 | | 978.41 | 81,563 | 1.000000000 ^S | 978.41 | 78,558 | 0 | -3,005 | -3,005 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 5,940,000.00000 | | 4/28/2017 | | 5,940,000.00 | 492,026,980 | 1.000000000 ^S | 5,940,000.00 | 476,929,615 | 0 | -15,097,365 | -15,097,365 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,390,000.00000 | | 5/5/2017 | | 1,390,000.00 | 115,907,314 | 1.000000000 ^S | 1,390,000.00 | 111,604,742 | 0 | -4,302,572 | -4,302,572 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,344,823.25000 | | 5/26/2017 | | 1,344,823.25 | 112,415,381 | 1.000000000 ^S | 1,344,823.25 | 107,977,447 | 0 | -4,437,934 | -4,437,934 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 895.60000 | | 5/31/2017 | | 895.60 | 73,730 | 1.000000000 ^S | 895.60 | 71,909 | 0 | -1,821 | -1,821 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|------------------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|------------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> | | | | | | | | | | | |
| <u>外貨建現金勘定</u> | | | | | | | | | | | |
| <u>非グループ化の有価証券</u> | | | | | | | | | | | |
| 4,843.12000 | | 6/2/2017 | | 4,843.12 | 397,848 | 1.000000000 ^S | 4,843.12 | 388,860 | 0 | -8,988 | -8,988 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 7,078.68000 | | 6/13/2017 | | 7,078.68 | 586,390 | 1.000000000 ^S | 7,078.68 | 568,356 | 0 | -18,034 | -18,034 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 275,955.42000 | | 6/14/2017 | | 275,955.42 | 22,875,822 | 1.000000000 ^S | 275,955.42 | 22,156,787 | 0 | -719,035 | -719,035 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 320,000.00000 | | 6/14/2017 | | 320,000.00 | 3,860 | 1.000000000 ^S | 320,000.00 | 25,693,178 | 0 | 25,689,318 | 25,689,318 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 270,000.00000 | | 6/16/2017 | | 270,000.00 | 22,642,776 | 1.000000000 ^S | 270,000.00 | 21,678,619 | 0 | -964,157 | -964,157 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 701,045.96000 | | 6/28/2017 | | 701,045.96 | 59,720,715 | 1.000000000 ^S | 701,045.96 | 56,287,808 | 0 | -3,432,907 | -3,432,907 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,125,804.00000 | | 6/28/2017 | | 1,125,804.00 | 95,905,011 | 1.000000000 ^S | 1,125,804.00 | 90,392,133 | 0 | -5,512,878 | -5,512,878 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,347,714.81000 | | 6/28/2017 | | 1,347,714.81 | 114,809,152 | 1.000000000 ^S | 1,347,714.81 | 108,209,614 | 0 | -6,599,538 | -6,599,538 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,390,000.00000 | | 6/28/2017 | | 1,390,000.00 | 118,411,344 | 1.000000000 ^S | 1,390,000.00 | 111,604,742 | 0 | -6,806,602 | -6,806,602 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 754.51000 | | 6/30/2017 | | 754.51 | 65,028 | 1.000000000 ^S | 754.51 | 60,580 | 0 | -4,448 | -4,448 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,264,000.00000 | | 7/18/2017 | | 1,264,000.00 | 111,466,230 | 1.000000000 ^S | 1,264,000.00 | 101,488,053 | 0 | -9,978,177 | -9,978,177 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 118,871.82000 | | 7/25/2017 | | 118,871.82 | 10,477,503 | 1.000000000 ^S | 118,871.82 | 9,544,359 | 0 | -933,144 | -933,144 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 604.28000 | | 7/31/2017 | | 604.28 | 53,306 | 1.000000000 ^S | 604.28 | 48,518 | 0 | -4,788 | -4,788 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,203,000.00000 | | 8/17/2017 | | 1,203,000.00 | 105,081,064 | 1.000000000 ^S | 1,203,000.00 | 96,590,291 | 0 | -8,490,773 | -8,490,773 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 772,000.00000 | | 8/30/2017 | | 772,000.00 | 66,991,892 | 1.000000000 ^S | 772,000.00 | 61,984,792 | 0 | -5,007,100 | -5,007,100 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 607.32000 | | 8/31/2017 | | 607.32 | 53,015 | 1.000000000 ^S | 607.32 | 48,762 | 0 | -4,253 | -4,253 |
| 2,039.21000 | | 9/1/2017 | | 2,039.21 | 178,011 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 2,039.21 | 163,731 | 0 | -14,280 | -14,280 |
| 1,760,000.00000 | | 9/18/2017 | | 1,760,000.00 | 156,419,764 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,760,000.00 | 141,312,479 | 0 | -15,107,285 | -15,107,285 |
| 11,349.96000 | | 9/27/2017 | | 11,349.96 | 1,003,371 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 11,349.96 | 911,302 | 0 | -92,069 | -92,069 |
| 823.11000 | | 9/29/2017 | | 823.11 | 72,700 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 823.11 | 66,088 | 0 | -6,612 | -6,612 |
| 27,121.31000 | | 10/3/2017 | | 27,121.31 | 2,392,132 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 27,121.31 | 2,177,602 | 0 | -214,530 | -214,530 |
| 88,632.36000 | | 10/26/2017 | | 88,632.36 | 7,758,635 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 88,632.36 | 7,116,397 | 0 | -642,238 | -642,238 |
| 736.84000 | | 10/31/2017 | | 736.84 | 64,198 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 736.84 | 59,162 | 0 | -5,036 | -5,036 |
| 8,233.29000 | | 11/16/2017 | | 8,233.29 | 705,946 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 8,233.29 | 661,061 | 0 | -44,885 | -44,885 |
| 484,308.44000 | | 11/21/2017 | | 484,308.44 | 41,128,430 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 484,308.44 | 38,885,697 | 0 | -2,242,733 | -2,242,733 |
| 230.45000 | | 11/30/2017 | | 230.45 | 19,577 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 230.45 | 18,503 | 0 | -1,074 | -1,074 |
| 1,695,000.00000 | | 12/11/2017 | | 1,695,000.00 | 144,533,433 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,695,000.00 | 136,093,552 | 0 | -8,439,881 | -8,439,881 |
| 27,121.31000 | | 12/28/2017 | | 27,121.31 | 2,386,064 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 27,121.31 | 2,177,602 | 0 | -208,462 | -208,462 |
| 523.56000 | | 12/29/2017 | | 523.56 | 46,130 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 523.56 | 42,037 | 0 | -4,093 | -4,093 |
| 96,866.03000 | | 12/29/2017 | | 96,866.03 | 8,518,656 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 96,866.03 | 7,777,488 | 0 | -741,168 | -741,168 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 19,401.29000 | | 1/9/2018 | | 19,401.29 | 1,717,947 | 1.000000000 ^S | 19,401.29 | 1,557,752 | 0 | -160,195 | -160,195 |
| 3,712.80000 | | 1/17/2018 | | 3,712.80 | 327,014 | 1.000000000 ^S | 3,712.80 | 298,105 | 0 | -28,909 | -28,909 |
| 759,513.00000 | | 1/17/2018 | | 759,513.00 | 66,896,074 | 1.000000000 ^S | 759,513.00 | 60,982,196 | 0 | -5,913,878 | -5,913,878 |
| 1,439,655.07000 | | 1/17/2018 | | 1,439,655.07 | 126,801,347 | 1.000000000 ^S | 1,439,655.07 | 115,591,606 | 0 | -11,209,741 | -11,209,741 |
| 1,571,080.15000 | | 1/17/2018 | | 1,571,080.15 | 138,376,951 | 1.000000000 ^S | 1,571,080.15 | 126,143,881 | 0 | -12,233,070 | -12,233,070 |
| 937.46000 | | 1/31/2018 | | 937.46 | 82,860 | 1.000000000 ^S | 937.46 | 75,270 | 0 | -7,590 | -7,590 |
| 767,000.00000 | | 2/9/2018 | | 767,000.00 | 65,324,597 | 1.000000000 ^S | 767,000.00 | 61,583,336 | 0 | -3,741,261 | -3,741,261 |
| 222,233.52000 | | 2/13/2018 | | 222,233.52 | 18,878,141 | 1.000000000 ^S | 222,233.52 | 17,843,392 | 0 | -1,034,749 | -1,034,749 |
| 572.52000 | | 2/28/2018 | | 572.52 | 47,605 | 1.000000000 ^S | 572.52 | 45,968 | 0 | -1,637 | -1,637 |
| 184,792.64000 | | 3/16/2018 | | 184,792.64 | 15,316,445 | 1.000000000 ^S | 184,792.64 | 14,837,219 | 0 | -479,226 | -479,226 |
| 116,717.00000 | | 3/22/2018 | | 116,717.00 | 9,564,337 | 1.000000000 ^S | 116,717.00 | 9,371,346 | 0 | -192,991 | -192,991 |
| 730,655.07000 | | 3/22/2018 | | 730,655.07 | 59,873,294 | 1.000000000 ^S | 730,655.07 | 58,665,158 | 0 | -1,208,136 | -1,208,136 |
| 1,359,283.00000 | | 3/22/2018 | | 1,359,283.00 | 111,386,007 | 1.000000000 ^S | 1,359,283.00 | 109,138,437 | 0 | -2,247,570 | -2,247,570 |
| 548.62000 | | 3/29/2018 | | 548.62 | 44,754 | 1.000000000 ^S | 548.62 | 44,049 | 0 | -705 | -705 |
| 575,000.00000 | | 4/18/2018 | | 575,000.00 | 47,878,949 | 1.000000000 ^S | 575,000.00 | 46,167,429 | 0 | -1,711,520 | -1,711,520 |

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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 0.04000 | | 4/30/2018 | | 0.04 | 3 | 1.000000000 ^S | 0.04 | 3 | 0 | 0 | 0 |
| 404.67000 | | 4/30/2018 | | 404.67 | 33,426 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 404.67 | 32,491 | 0 | -935 | -935 |
| 57,148.43000 | | 5/8/2018 | | 57,148.43 | 4,695,613 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 57,148.43 | 4,588,515 | 0 | -107,098 | -107,098 |
| 700,000.00000 | | 5/15/2018 | | 700,000.00 | 57,931,683 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 700,000.00 | 56,203,827 | 0 | -1,727,856 | -1,727,856 |
| 1,305,655.07000 | | 5/16/2018 | | 1,305,655.07 | 107,677,003 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,305,655.07 | 104,832,588 | 0 | -2,844,415 | -2,844,415 |
| 28,442.03000 | | 5/24/2018 | | 28,442.03 | 2,361,408 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 28,442.03 | 2,283,644 | 0 | -77,764 | -77,764 |
| 337.42000 | | 5/31/2018 | | 337.42 | 27,738 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 337.42 | 27,092 | 0 | -646 | -646 |
| 41,255.59000 | | 6/5/2018 | | 41,255.59 | 3,458,418 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 41,255.59 | 3,312,460 | 0 | -145,958 | -145,958 |
| 58,915.23000 | | 6/6/2018 | | 58,915.23 | 4,919,294 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 58,915.23 | 4,730,373 | 0 | -188,921 | -188,921 |
| 777,655.00000 | | 6/13/2018 | | 777,655.00 | 65,293,219 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 777,655.00 | 62,438,838 | 0 | -2,854,381 | -2,854,381 |
| 537.23000 | | 6/29/2018 | | 537.23 | 43,966 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 537.23 | 43,135 | 0 | -831 | -831 |
| 690,000.00000 | | 7/24/2018 | | 690,000.00 | 56,754,011 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 690,000.00 | 55,400,915 | 0 | -1,353,096 | -1,353,096 |
| 31,207.59000 | | 7/30/2018 | | 31,207.59 | 2,564,892 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 31,207.59 | 2,505,694 | 0 | -59,198 | -59,198 |
| 377.22000 | | 7/31/2018 | | 377.22 | 31,391 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 377.22 | 30,287 | 0 | -1,104 | -1,104 |
| 144,861.46000 | | 7/31/2018 | | 144,861.46 | 11,909,905 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 144,861.46 | 11,631,098 | 0 | -278,807 | -278,807 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 118,572.90000 | | 8/21/2018 | | 118,572.90 | 9,567,568 | 1.000000000 ^S | 118,572.90 | 9,520,358 | 0 | -47,210 | -47,210 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 110,597.95000 | | 8/28/2018 | | 110,597.95 | 9,022,493 | 1.000000000 ^S | 110,597.95 | 8,880,040 | 0 | -142,453 | -142,453 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 110,062.03000 | | 8/29/2018 | | 110,062.03 | 8,986,444 | 1.000000000 ^S | 110,062.03 | 8,837,010 | 0 | -149,434 | -149,434 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 541.98000 | | 8/31/2018 | | 541.98 | 43,462 | 1.000000000 ^S | 541.98 | 43,516 | 0 | 54 | 54 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 35,715.85000 | | 9/5/2018 | | 35,715.85 | 2,856,195 | 1.000000000 ^S | 35,715.85 | 2,867,668 | 0 | 11,473 | 11,473 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 10,030.29000 | | 9/6/2018 | | 10,030.29 | 804,746 | 1.000000000 ^S | 10,030.29 | 805,344 | 0 | 598 | 598 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 587.18000 | | 9/28/2018 | | 587.18 | 48,257 | 1.000000000 ^S | 587.18 | 47,145 | 0 | -1,112 | -1,112 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 446,987.00000 | | 10/10/2018 | | 446,987.00 | 35,791,150 | 1.000000000 ^S | 446,987.00 | 35,889,114 | 0 | 97,964 | 97,964 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 653,013.00000 | | 10/10/2018 | | 653,013.00 | 52,288,067 | 1.000000000 ^S | 653,013.00 | 52,431,185 | 0 | 143,118 | 143,118 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 606.11000 | | 10/31/2018 | | 606.11 | 48,480 | 1.000000000 ^S | 606.11 | 48,665 | 0 | 185 | 185 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 9,875.75000 | | 11/5/2018 | | 9,875.75 | 804,182 | 1.000000000 ^S | 9,875.75 | 792,936 | 0 | -11,246 | -11,246 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 459,000.00000 | | 11/8/2018 | | 459,000.00 | 37,882,262 | 1.000000000 ^S | 459,000.00 | 36,853,652 | 0 | -1,028,610 | -1,028,610 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 340,876.48000 | | 11/14/2018 | | 340,876.48 | 27,993,030 | 1.000000000 ^S | 340,876.48 | 27,369,375 | 0 | -623,655 | -623,655 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 258,427.01000 | | 11/15/2018 | | 258,427.01 | 21,246,604 | 1.000000000 ^S | 258,427.01 | 20,749,410 | 0 | -497,194 | -497,194 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 653,013.00000 | | 11/20/2018 | | 653,013.00 | 53,686,499 | 1.000000000 ^S | 653,013.00 | 52,431,185 | 0 | -1,255,314 | -1,255,314 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 1,657.84000 | | 11/29/2018 | | 1,657.84 | 136,528 | 1.000000000 ^S | 1,657.84 | 133,110 | 0 | -3,418 | -3,418 |
| 554.37000 | | 11/30/2018 | | 554.37 | 45,968 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 554.37 | 44,511 | 0 | -1,457 | -1,457 |
| 94,945.23000 | | 11/30/2018 | | 94,945.23 | 7,866,272 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 94,945.23 | 7,623,265 | 0 | -243,007 | -243,007 |
| 56,052.05000 | | 12/6/2018 | | 56,052.05 | 4,609,486 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 56,052.05 | 4,500,485 | 0 | -109,001 | -109,001 |
| 48,583.36000 | | 12/7/2018 | | 48,583.36 | 3,938,270 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 48,583.36 | 3,900,815 | 0 | -37,455 | -37,455 |
| 722,616.57000 | | 12/19/2018 | | 722,616.57 | 58,370,578 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 722,616.57 | 58,019,738 | 0 | -350,840 | -350,840 |
| 748.57000 | | 12/31/2018 | | 748.57 | 57,819 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 748.57 | 60,104 | 0 | 2,285 | 2,285 |
| 0.09000 | | 1/17/2019 | | 0.09 | 7 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 0.09 | 7 | 0 | 0 | 0 |
| 44,669.10000 | | 1/17/2019 | | 44,669.10 | 3,490,922 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 44,669.10 | 3,586,535 | 0 | 95,613 | 95,613 |
| 8,335.47000 | | 1/23/2019 | | 8,335.47 | 651,153 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 8,335.47 | 669,265 | 0 | 18,112 | 18,112 |
| 48,430.88000 | | 1/29/2019 | | 48,430.88 | 3,793,245 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 48,430.88 | 3,888,573 | 0 | 95,328 | 95,328 |
| 722,616.57000 | | 1/29/2019 | | 722,616.57 | 56,597,394 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 722,616.57 | 58,019,738 | 0 | 1,422,344 | 1,422,344 |
| 44,745.30000 | | 1/30/2019 | | 44,745.30 | 3,497,538 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 44,745.30 | 3,592,653 | 0 | 95,115 | 95,115 |
| 481.63000 | | 1/31/2019 | | 481.63 | 38,219 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 481.63 | 38,671 | 0 | 452 | 452 |
| 12,725.41000 | | 2/1/2019 | | 12,725.41 | 1,009,804 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 12,725.41 | 1,021,738 | 0 | 11,934 | 11,934 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 587,000.00000 | | 2/12/2019 | | 587,000.00 | 45,794,312 | 1.000000000 ^S | 587,000.00 | 47,130,923 | 0 | 1,336,611 | 1,336,611 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 276,145.36000 | | 2/22/2019 | | 276,145.36 | 21,664,268 | 1.000000000 ^S | 276,145.36 | 22,172,037 | 0 | 507,769 | 507,769 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 7,748.98000 | | 2/26/2019 | | 7,748.98 | 616,211 | 1.000000000 ^S | 7,748.98 | 622,175 | 0 | 5,964 | 5,964 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 474,707.41000 | | 2/27/2019 | | 474,707.41 | 37,717,403 | 1.000000000 ^S | 474,707.41 | 38,114,819 | 0 | 397,416 | 397,416 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 344.55000 | | 2/28/2019 | | 344.55 | 27,288 | 1.000000000 ^S | 344.55 | 27,664 | 0 | 376 | 376 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 130,705.64000 | | 2/28/2019 | | 130,705.64 | 10,352,769 | 1.000000000 ^S | 130,705.64 | 10,494,510 | 0 | 141,741 | 141,741 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 122,045.83000 | | 3/5/2019 | | 122,045.83 | 9,671,860 | 1.000000000 ^S | 122,045.83 | 9,799,204 | 0 | 127,344 | 127,344 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 6,205.83000 | | 3/8/2019 | | 6,205.83 | 486,732 | 1.000000000 ^S | 6,205.83 | 498,273 | 0 | 11,541 | 11,541 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 50,174.39000 | | 3/12/2019 | | 50,174.39 | 3,937,071 | 1.000000000 ^S | 50,174.39 | 4,028,561 | 0 | 91,490 | 91,490 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,309,616.57000 | | 3/14/2019 | | 1,309,616.57 | 103,235,373 | 1.000000000 ^S | 1,309,616.57 | 105,150,661 | 0 | 1,915,288 | 1,915,288 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 817.38000 | | 3/29/2019 | | 817.38 | 64,267 | 1.000000000 ^S | 817.38 | 65,628 | 0 | 1,361 | 1,361 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 980,000.00000 | | 3/29/2019 | | 980,000.00 | 76,680,395 | 1.000000000 ^S | 980,000.00 | 78,685,357 | 0 | 2,004,962 | 2,004,962 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 348,561.68000 | | 4/3/2019 | | 348,561.68 | 27,414,241 | 1.000000000 ^S | 348,561.68 | 27,986,429 | 0 | 572,188 | 572,188 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 757.42000 | | 4/30/2019 | | 757.42 | 59,375 | 1.000000000 ^S | 757.42 | 60,814 | 0 | 1,439 | 1,439 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 225,051.00000 | | 5/22/2019 | | 225,051.00 | 17,131,923 | 1.000000000 ^S | 225,051.00 | 18,069,611 | 0 | 937,688 | 937,688 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|--|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| クラスに割当てられていない資産 | | | | | | | | | | | |
| 外貨建現金勘定 | | | | | | | | | | | |
| 非グループ化の有価証券 | | | | | | | | | | | |
| 270,321.00000 | | 5/22/2019 | | 270,321.00 | 20,578,085 | 1.000000000 ^S | 270,321.00 | 21,704,392 | 0 | 1,126,307 | 1,126,307 |
| 824,616.57000 | | 5/22/2019 | | 824,616.57 | 62,773,628 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 824,616.57 | 66,209,438 | 0 | 3,435,810 | 3,435,810 |
| 969,628.00000 | | 5/22/2019 | | 969,628.00 | 73,812,569 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 969,628.00 | 77,852,577 | 0 | 4,040,008 | 4,040,008 |
| 23,246.84000 | | 5/24/2019 | | 23,246.84 | 1,756,916 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 23,246.84 | 1,866,516 | 0 | 109,600 | 109,600 |
| 9,866.90000 | | 5/28/2019 | | 9,866.90 | 747,461 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 9,866.90 | 792,225 | 0 | 44,764 | 44,764 |
| 406.98000 | | 5/31/2019 | | 406.98 | 30,616 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 406.98 | 32,677 | 0 | 2,061 | 2,061 |
| 407,039.23000 | | 6/5/2019 | | 407,039.23 | 30,767,128 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 407,039.23 | 32,681,660 | 0 | 1,914,532 | 1,914,532 |
| 108,816.91000 | | 6/17/2019 | | 108,816.91 | 8,116,170 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 108,816.91 | 8,737,038 | 0 | 620,868 | 620,868 |
| 264,480.03000 | | 6/19/2019 | | 264,480.03 | 19,708,851 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 264,480.03 | 21,235,414 | 0 | 1,526,563 | 1,526,563 |
| 279,974.49000 | | 6/21/2019 | | 279,974.49 | 20,833,547 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 279,974.49 | 22,479,482 | 0 | 1,645,935 | 1,645,935 |
| 28,800.40000 | | 6/24/2019 | | 28,800.40 | 2,145,362 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 28,800.40 | 2,312,418 | 0 | 167,056 | 167,056 |
| 21,821.41000 | | 6/26/2019 | | 21,821.41 | 1,626,618 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 21,821.41 | 1,752,067 | 0 | 125,449 | 125,449 |
| 55,817.33000 | | 6/27/2019 | | 55,817.33 | 4,195,210 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 55,817.33 | 4,481,639 | 0 | 286,429 | 286,429 |
| 350.04000 | | 6/28/2019 | | 350.04 | 26,465 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 350.04 | 28,105 | 0 | 1,640 | 1,640 |
| 27,908.70000 | | 7/2/2019 | | 27,908.70 | 2,106,119 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 27,908.70 | 2,240,822 | 0 | 134,703 | 134,703 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 59,549.79000 | | 7/3/2019 | | 59,549.79 | 4,503,747 | 1.000000000 ^S | 59,549.79 | 4,781,323 | 0 | 277,576 | 277,576 |
| 131,731.93000 | | 7/5/2019 | | 131,731.93 | 9,968,860 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 131,731.93 | 10,576,912 | 0 | 608,052 | 608,052 |
| 1,131.71000 | | 7/26/2019 | | 1,131.71 | 85,538 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,131.71 | 90,866 | 0 | 5,328 | 5,328 |
| 114,258.08000 | | 7/29/2019 | | 114,258.08 | 8,579,187 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 114,258.08 | 9,173,916 | 0 | 594,729 | 594,729 |
| 4.01000 | | 7/31/2019 | | 4.01 | 300 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 4.01 | 322 | 0 | 22 | 22 |
| 417.64000 | | 7/31/2019 | | 417.64 | 31,254 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 417.64 | 33,533 | 0 | 2,279 | 2,279 |
| 134,803.62000 | | 8/6/2019 | | 134,803.62 | 9,687,573 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 134,803.62 | 10,823,542 | 0 | 1,135,969 | 1,135,969 |
| 86,380.36000 | | 8/7/2019 | | 86,380.36 | 6,225,477 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 86,380.36 | 6,935,581 | 0 | 710,104 | 710,104 |
| 143,214.88000 | | 8/13/2019 | | 143,214.88 | 10,194,166 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 143,214.88 | 11,498,892 | 0 | 1,304,726 | 1,304,726 |
| 39,099.81000 | | 8/22/2019 | | 39,099.81 | 2,826,023 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 39,099.81 | 3,139,370 | 0 | 313,347 | 313,347 |
| 971.71000 | | 8/23/2019 | | 971.71 | 69,976 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 971.71 | 78,020 | 0 | 8,044 | 8,044 |
| 121,648.02000 | | 8/27/2019 | | 121,648.02 | 8,734,737 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 121,648.02 | 9,767,263 | 0 | 1,032,526 | 1,032,526 |
| 61,537.04000 | | 8/29/2019 | | 61,537.04 | 4,393,490 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 61,537.04 | 4,940,882 | 0 | 547,392 | 547,392 |
| 153.50000 | | 8/30/2019 | | 153.50 | 10,978 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 153.50 | 12,325 | 0 | 1,347 | 1,347 |
| 15,452.99000 | | 8/30/2019 | | 15,452.99 | 1,107,096 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 15,452.99 | 1,240,739 | 0 | 133,643 | 133,643 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| 55,856.26000 | | 9/3/2019 | | 55,856.26 | 3,992,855 | 1.000000000 ^S | 55,856.26 | 4,484,765 | 0 | 491,910 | 491,910 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 48,430.88000 | | 9/4/2019 | | 48,430.88 | 3,464,290 | 1.000000000 ^S | 48,430.88 | 3,888,573 | 0 | 424,283 | 424,283 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 54,952.37000 | | 9/5/2019 | | 54,952.37 | 3,962,710 | 1.000000000 ^S | 54,952.37 | 4,412,191 | 0 | 449,481 | 449,481 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 64,772.08000 | | 9/10/2019 | | 64,772.08 | 4,770,186 | 1.000000000 ^S | 64,772.08 | 5,200,627 | 0 | 430,441 | 430,441 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 153,971.37000 | | 9/12/2019 | | 153,971.37 | 11,376,349 | 1.000000000 ^S | 153,971.37 | 12,362,543 | 0 | 986,194 | 986,194 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 41,554.36000 | | 9/20/2019 | | 41,554.36 | 3,053,248 | 1.000000000 ^S | 41,554.36 | 3,336,449 | 0 | 283,201 | 283,201 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 971.71000 | | 9/27/2019 | | 971.71 | 70,724 | 1.000000000 ^S | 971.71 | 78,020 | 0 | 7,296 | 7,296 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 154.70000 | | 9/30/2019 | | 154.70 | 11,276 | 1.000000000 ^S | 154.70 | 12,421 | 0 | 1,145 | 1,145 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 441,818.69000 | | 9/30/2019 | | 441,818.69 | 32,367,102 | 1.000000000 ^S | 441,818.69 | 35,474,144 | 0 | 3,107,042 | 3,107,042 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 252,253.40000 | | 10/1/2019 | | 252,253.40 | 18,387,049 | 1.000000000 ^S | 252,253.40 | 20,253,723 | 0 | 1,866,674 | 1,866,674 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 23,141.04000 | | 10/2/2019 | | 23,141.04 | 1,670,366 | 1.000000000 ^S | 23,141.04 | 1,858,021 | 0 | 187,655 | 187,655 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 14,691.66000 | | 10/8/2019 | | 14,691.66 | 1,060,324 | 1.000000000 ^S | 14,691.66 | 1,179,611 | 0 | 119,287 | 119,287 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 42,474.00000 | | 10/17/2019 | | 42,474.00 | 3,117,927 | 1.000000000 ^S | 42,474.00 | 3,410,288 | 0 | 292,361 | 292,361 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 494,616.57000 | | 10/17/2019 | | 494,616.57 | 36,308,766 | 1.000000000 ^S | 494,616.57 | 39,713,349 | 0 | 3,404,583 | 3,404,583 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 796,526.00000 | | 10/17/2019 | | 796,526.00 | 58,471,304 | 1.000000000 ^S | 796,526.00 | 63,954,013 | 0 | 5,482,709 | 5,482,709 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 93,901.30000 | | 10/25/2019 | | 93,901.30 | 6,952,942 | 1.000000000 ^S | 93,901.30 | 7,539,446 | 0 | 586,504 | 586,504 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,189,000.00000 | | 10/25/2019 | | 1,189,000.00 | 88,039,755 | 1.000000000 ^S | 1,189,000.00 | 95,466,214 | 0 | 7,426,459 | 7,426,459 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 80,888.08000 | | 10/28/2019 | | 80,888.08 | 5,997,956 | 1.000000000 ^S | 80,888.08 | 6,494,599 | 0 | 496,643 | 496,643 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 174.01000 | | 10/31/2019 | | 174.01 | 12,960 | 1.000000000 ^S | 174.01 | 13,971 | 0 | 1,011 | 1,011 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 54,378.37000 | | 11/5/2019 | | 54,378.37 | 4,072,485 | 1.000000000 ^S | 54,378.37 | 4,366,104 | 0 | 293,619 | 293,619 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 40,069.97000 | | 11/6/2019 | | 40,069.97 | 3,015,842 | 1.000000000 ^S | 40,069.97 | 3,217,265 | 0 | 201,423 | 201,423 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 44,114.45000 | | 11/18/2019 | | 44,114.45 | 3,268,289 | 1.000000000 ^S | 44,114.45 | 3,542,001 | 0 | 273,712 | 273,712 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,583.93000 | | 11/20/2019 | | 1,583.93 | 117,312 | 1.000000000 ^S | 1,583.93 | 127,176 | 0 | 9,864 | 9,864 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 57.48000 | | 11/29/2019 | | 57.48 | 4,258 | 1.000000000 ^S | 57.48 | 4,615 | 0 | 357 | 357 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 58,114.35000 | | 11/29/2019 | | 58,114.35 | 4,306,495 | 1.000000000 ^S | 58,114.35 | 4,666,070 | 0 | 359,575 | 359,575 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 98,741.57000 | | 12/2/2019 | | 98,741.57 | 7,314,041 | 1.000000000 ^S | 98,741.57 | 7,928,077 | 0 | 614,036 | 614,036 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 48,402.75000 | | 12/3/2019 | | 48,402.75 | 3,598,527 | 1.000000000 ^S | 48,402.75 | 3,886,314 | 0 | 287,787 | 287,787 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 32,537.11000 | | 12/9/2019 | | 32,537.11 | 2,414,911 | 1.000000000 ^S | 32,537.11 | 2,612,443 | 0 | 197,532 | 197,532 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 172,797.71000 | | 12/10/2019 | | 172,797.71 | 12,818,591 | 1.000000000 ^S | 172,797.71 | 13,874,132 | 0 | 1,055,541 | 1,055,541 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,198.23000 | | 12/13/2019 | | 1,198.23 | 90,365 | 1.000000000 ^S | 1,198.23 | 96,207 | 0 | 5,842 | 5,842 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 83.64000 | | 12/31/2019 | | 83.64 | 6,390 | 1.000000000 ^S | 83.64 | 6,716 | 0 | 326 | 326 |
| 29,041.67000 | | 1/6/2020 | | 29,041.67 | 2,182,412 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 29,041.67 | 2,331,790 | 0 | 149,378 | 149,378 |
| 1,470,000.00000 | | 1/17/2020 | | 1,470,000.00 | 111,680,575 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 1,470,000.00 | 118,028,036 | 0 | 6,347,461 | 6,347,461 |
| 29,041.67000 | | 1/22/2020 | | 29,041.67 | 2,189,532 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 29,041.67 | 2,331,790 | 0 | 142,258 | 142,258 |
| 141,977.62000 | | 1/28/2020 | | 141,977.62 | 10,448,495 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 141,977.62 | 11,399,551 | 0 | 951,056 | 951,056 |
| 181.73000 | | 1/31/2020 | | 181.73 | 13,186 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 181.73 | 14,591 | 0 | 1,405 | 1,405 |
| 98,842.82000 | | 2/6/2020 | | 98,842.82 | 7,316,767 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 98,842.82 | 7,936,207 | 0 | 619,440 | 619,440 |
| 7,549.76000 | | 2/7/2020 | | 7,549.76 | 559,446 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 7,549.76 | 606,179 | 0 | 46,733 | 46,733 |
| 95.44000 | | 2/28/2020 | | 95.44 | 6,637 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 95.44 | 7,663 | 0 | 1,026 | 1,026 |
| 57,889.69000 | | 3/2/2020 | | 57,889.69 | 4,025,994 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 57,889.69 | 4,648,032 | 0 | 622,038 | 622,038 |
| 272,839.00000 | | 3/10/2020 | | 272,839.00 | 18,623,739 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 272,839.00 | 21,906,566 | 0 | 3,282,827 | 3,282,827 |
| 659,818.00000 | | 3/10/2020 | | 659,818.00 | 45,038,569 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 659,818.00 | 52,977,566 | 0 | 7,938,997 | 7,938,997 |
| 700,000.00000 | | 3/10/2020 | | 700,000.00 | 47,781,355 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 700,000.00 | 56,203,827 | 0 | 8,422,472 | 8,422,472 |
| 18.70000 | | 3/31/2020 | | 18.70 | 1,236 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 18.70 | 1,501 | 0 | 265 | 265 |
| 71,462.33000 | | 4/1/2020 | | 71,462.33 | 4,721,792 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 71,462.33 | 5,737,795 | 0 | 1,016,003 | 1,016,003 |

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 9,680.58000 | | 4/21/2020 | | 9,680.58 | 665,714 | 1.000000000 ^S | 9,680.58 | 777,265 | 0 | 111,551 | 111,551 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 63,772.17000 | | 4/23/2020 | | 63,772.17 | 4,339,960 | 1.000000000 ^S | 63,772.17 | 5,120,343 | 0 | 780,383 | 780,383 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 251,782.00000 | | 5/19/2020 | | 251,782.00 | 17,578,822 | 1.000000000 ^S | 251,782.00 | 20,215,874 | 0 | 2,637,052 | 2,637,052 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 255,125.00000 | | 5/19/2020 | | 255,125.00 | 17,812,223 | 1.000000000 ^S | 255,125.00 | 20,484,288 | 0 | 2,672,065 | 2,672,065 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 273,093.00000 | | 5/19/2020 | | 273,093.00 | 19,066,706 | 1.000000000 ^S | 273,093.00 | 21,926,959 | 0 | 2,860,253 | 2,860,253 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 895,616.57000 | | 5/19/2020 | | 895,616.57 | 62,529,825 | 1.000000000 ^S | 895,616.57 | 71,910,112 | 0 | 9,380,287 | 9,380,287 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 71,152.03000 | | 5/29/2020 | | 71,152.03 | 5,099,670 | 1.000000000 ^S | 71,152.03 | 5,712,881 | 0 | 613,211 | 613,211 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 977.46000 | | 6/2/2020 | | 977.46 | 71,336 | 1.000000000 ^S | 977.46 | 78,481 | 0 | 7,145 | 7,145 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 825,000.00000 | | 6/19/2020 | | 825,000.00 | 60,452,907 | 1.000000000 ^S | 825,000.00 | 66,240,224 | 0 | 5,787,317 | 5,787,317 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 14,449.44000 | | 6/24/2020 | | 14,449.44 | 1,068,462 | 1.000000000 ^S | 14,449.44 | 1,160,163 | 0 | 91,701 | 91,701 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 7,942.71000 | | 6/29/2020 | | 7,942.71 | 583,600 | 1.000000000 ^S | 7,942.71 | 637,730 | 0 | 54,130 | 54,130 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 500,000.00000 | | 7/10/2020 | | 500,000.00 | 37,343,226 | 1.000000000 ^S | 500,000.00 | 40,145,590 | 0 | 2,802,364 | 2,802,364 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 187,138.00000 | | 7/28/2020 | | 187,138.00 | 14,063,868 | 1.000000000 ^S | 187,138.00 | 15,025,531 | 0 | 961,663 | 961,663 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 368,862.00000 | | 7/28/2020 | | 368,862.00 | 27,720,860 | 1.000000000 ^S | 368,862.00 | 29,616,366 | 0 | 1,895,506 | 1,895,506 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,664,616.57000 | | 7/28/2020 | | 1,664,616.57 | 125,099,912 | 1.000000000 ^S | 1,664,616.57 | 133,654,030 | 0 | 8,554,118 | 8,554,118 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|------------------------|----|------------|-------------------|------------------------|-------------------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| <u>クラスに割当てられていない資産</u> | | | | | | | | | | | |
| <u>外貨建現金勘定</u> | | | | | | | | | | | |
| <u>非グループ化の有価証券</u> | | | | | | | | | | | |
| 8,497.85000 | | 7/30/2020 | | 8,497.85 | 639,909 | 1.000000000 ^S | 8,497.85 | 682,302 | 0 | 42,393 | 42,393 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 417,000.00000 | | 8/12/2020 | | 417,000.00 | 31,803,007 | 1.000000000 ^S | 417,000.00 | 33,481,422 | 0 | 1,678,415 | 1,678,415 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 71,170.60000 | | 8/17/2020 | | 71,170.60 | 5,434,220 | 1.000000000 ^S | 71,170.60 | 5,714,372 | 0 | 280,152 | 280,152 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 900,000.00000 | | 8/24/2020 | | 900,000.00 | 68,215,418 | 1.000000000 ^S | 900,000.00 | 72,262,063 | 0 | 4,046,645 | 4,046,645 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 978.97000 | | 8/25/2020 | | 978.97 | 74,331 | 1.000000000 ^S | 978.97 | 78,603 | 0 | 4,272 | 4,272 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 32,913.88000 | | 8/27/2020 | | 32,913.88 | 2,523,983 | 1.000000000 ^S | 32,913.88 | 2,642,694 | 0 | 118,711 | 118,711 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 42,672.92000 | | 9/1/2020 | | 42,672.92 | 3,346,648 | 1.000000000 ^S | 42,672.92 | 3,426,259 | 0 | 79,611 | 79,611 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 23,304.76000 | | 9/3/2020 | | 23,304.76 | 1,811,440 | 1.000000000 ^S | 23,304.76 | 1,871,167 | 0 | 59,727 | 59,727 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 126,727.84000 | | 9/4/2020 | | 126,727.84 | 9,821,882 | 1.000000000 ^S | 126,727.84 | 10,175,128 | 0 | 353,246 | 353,246 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 290,679.76000 | | 9/16/2020 | | 290,679.76 | 22,390,123 | 1.000000000 ^S | 290,679.76 | 23,339,021 | 0 | 948,898 | 948,898 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 155,318.66000 | | 9/23/2020 | | 155,318.66 | 11,702,094 | 1.000000000 ^S | 155,318.66 | 12,470,719 | 0 | 768,625 | 768,625 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 51,470.92000 | | 10/6/2020 | | 51,470.92 | 3,909,939 | 1.000000000 ^S | 51,470.92 | 4,132,661 | 0 | 222,722 | 222,722 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 3,562.84000 | | 10/8/2020 | | 3,562.84 | 269,638 | 1.000000000 ^S | 3,562.84 | 286,065 | 0 | 16,427 | 16,427 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 12,584.74000 | | 10/13/2020 | | 12,584.74 | 955,554 | 1.000000000 ^S | 12,584.74 | 1,010,444 | 0 | 54,890 | 54,890 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 22,253.78000 | | 10/14/2020 | | 22,253.78 | 1,683,325 | 1.000000000 ^S | 22,253.78 | 1,786,782 | 0 | 103,457 | 103,457 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 862,815.16000 | | 10/21/2020 | | 862,815.16 | 64,251,517 | 1.000000000 ^S | 862,815.16 | 69,276,448 | 0 | 5,024,931 | 5,024,931 |
| 58,541.51000 | | 10/26/2020 | | 58,541.51 | 4,358,946 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 58,541.51 | 4,700,367 | 0 | 341,421 | 341,421 |
| 178,062.61000 | | 11/13/2020 | | 178,062.61 | 13,596,134 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 178,062.61 | 14,296,857 | 0 | 700,723 | 700,723 |
| 74,506.18000 | | 11/17/2020 | | 74,506.18 | 5,705,626 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 74,506.18 | 5,982,189 | 0 | 276,563 | 276,563 |
| 172,617.12000 | | 11/25/2020 | | 172,617.12 | 13,265,673 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 172,617.12 | 13,859,632 | 0 | 593,959 | 593,959 |
| 43,562.48000 | | 11/30/2020 | | 43,562.48 | 3,351,823 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 43,562.48 | 3,497,683 | 0 | 145,860 | 145,860 |
| 84,957.41000 | | 12/2/2020 | | 84,957.41 | 6,529,312 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 84,957.41 | 6,821,331 | 0 | 292,019 | 292,019 |
| 35,306.23000 | | 12/7/2020 | | 35,306.23 | 2,734,402 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 35,306.23 | 2,834,779 | 0 | 100,377 | 100,377 |
| 279,767.70000 | | 12/16/2020 | | 279,767.70 | 21,880,912 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 279,767.70 | 22,462,879 | 0 | 581,967 | 581,967 |
| 220,000.00000 | | 12/17/2020 | | 220,000.00 | 17,226,863 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 220,000.00 | 17,664,060 | 0 | 437,197 | 437,197 |
| 278,065.00000 | | 12/17/2020 | | 278,065.00 | 21,773,580 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 278,065.00 | 22,326,167 | 0 | 552,587 | 552,587 |
| 293,903.00000 | | 12/17/2020 | | 293,903.00 | 23,013,758 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 293,903.00 | 23,597,819 | 0 | 584,061 | 584,061 |
| 345,000.00000 | | 12/17/2020 | | 345,000.00 | 27,014,853 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 345,000.00 | 27,700,457 | 0 | 685,604 | 685,604 |
| 412,032.00000 | | 12/17/2020 | | 412,032.00 | 32,263,721 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 412,032.00 | 33,082,536 | 0 | 818,815 | 818,815 |
| 606,097.00000 | | 12/17/2020 | | 606,097.00 | 47,459,772 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 606,097.00 | 48,664,244 | 0 | 1,204,472 | 1,204,472 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 766,101.00000 | | 12/17/2020 | | 766,101.00 | 59,988,713 | 1.000000000 ^S | 766,101.00 | 61,511,154 | 0 | 1,522,441 | 1,522,441 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,079,652.57000 | | 12/17/2020 | | 1,079,652.57 | 84,541,030 | 1.000000000 ^S | 1,079,652.57 | 86,686,580 | 0 | 2,145,550 | 2,145,550 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 2,721.84000 | | 12/18/2020 | | 2,721.84 | 213,629 | 1.000000000 ^S | 2,721.84 | 218,540 | 0 | 4,911 | 4,911 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 49,932.28000 | | 12/24/2020 | | 49,932.28 | 3,922,933 | 1.000000000 ^S | 49,932.28 | 4,009,122 | 0 | 86,189 | 86,189 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 977.46000 | | 1/4/2021 | | 977.46 | 77,873 | 1.000000000 ^S | 977.46 | 78,481 | 0 | 608 | 608 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 256,589.45000 | | 1/6/2021 | | 256,589.45 | 20,385,106 | 1.000000000 ^S | 256,589.45 | 20,601,870 | 0 | 216,764 | 216,764 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 99,206.26000 | | 1/14/2021 | | 99,206.26 | 7,979,169 | 1.000000000 ^S | 99,206.26 | 7,965,388 | 0 | -13,781 | -13,781 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 977.46000 | | 1/25/2021 | | 977.46 | 78,338 | 1.000000000 ^S | 977.46 | 78,481 | 0 | 143 | 143 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 3,138.00000 | | 1/27/2021 | | 3,138.00 | 251,946 | 1.000000000 ^S | 3,138.00 | 251,954 | 0 | 8 | 8 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 36,989.75000 | | 1/28/2021 | | 36,989.75 | 2,959,739 | 1.000000000 ^S | 36,989.75 | 2,969,951 | 0 | 10,212 | 10,212 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 198,691.97000 | | 2/1/2021 | | 198,691.97 | 15,960,377 | 1.000000000 ^S | 198,691.97 | 15,953,213 | 0 | -7,164 | -7,164 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 125,166.54000 | | 2/2/2021 | | 125,166.54 | 10,007,952 | 1.000000000 ^S | 125,166.54 | 10,049,769 | 0 | 41,817 | 41,817 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 105,617.87000 | | 2/17/2021 | | 105,617.87 | 8,679,976 | 1.000000000 ^S | 105,617.87 | 8,480,184 | 0 | -199,792 | -199,792 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 220,000.00000 | | 2/25/2021 | | 220,000.00 | 18,454,619 | 1.000000000 ^S | 220,000.00 | 17,664,060 | 0 | -790,559 | -790,559 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 606,097.00000 | | 2/25/2021 | | 606,097.00 | 50,842,222 | 1.000000000 ^S | 606,097.00 | 48,664,244 | 0 | -2,177,978 | -2,177,978 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 1,079,652.57000 | | 2/25/2021 | | 1,079,652.57 | 90,566,256 | 1.000000000 ^S | 1,079,652.57 | 86,686,580 | 0 | -3,879,676 | -3,879,676 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 1,178,133.00000 | | 2/25/2021 | | 1,178,133.00 | 98,827,250 | 1.000000000 ^S | 1,178,133.00 | 94,593,690 | 0 | -4,233,560 | -4,233,560 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 27,274.36000 | | 3/16/2021 | | 27,274.36 | 2,300,840 | 1.000000000 ^S | 27,274.36 | 2,189,891 | 0 | -110,949 | -110,949 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 230,000.00000 | | 3/17/2021 | | 230,000.00 | 19,429,054 | 1.000000000 ^S | 230,000.00 | 18,466,972 | 0 | -962,082 | -962,082 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 68,625.67000 | | 3/24/2021 | | 68,625.67 | 5,726,146 | 1.000000000 ^S | 68,625.67 | 5,510,036 | 0 | -216,110 | -216,110 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 21,173.53000 | | 3/31/2021 | | 21,173.53 | 1,774,898 | 1.000000000 ^S | 21,173.53 | 1,700,048 | 0 | -74,850 | -74,850 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 16,773.41000 | | 4/1/2021 | | 16,773.41 | 1,411,689 | 1.000000000 ^S | 16,773.41 | 1,346,757 | 0 | -64,932 | -64,932 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 16,508.40000 | | 4/9/2021 | | 16,508.40 | 1,377,708 | 1.000000000 ^S | 16,508.40 | 1,325,479 | 0 | -52,229 | -52,229 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 178,000.00000 | | 4/12/2021 | | 178,000.00 | 14,880,930 | 1.000000000 ^S | 178,000.00 | 14,291,830 | 0 | -589,100 | -589,100 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 34,272.09000 | | 4/19/2021 | | 34,272.09 | 2,885,186 | 1.000000000 ^S | 34,272.09 | 2,751,747 | 0 | -133,439 | -133,439 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 227,000.00000 | | 4/22/2021 | | 227,000.00 | 19,030,155 | 1.000000000 ^S | 227,000.00 | 18,226,098 | 0 | -804,057 | -804,057 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 2,719.28000 | | 4/23/2021 | | 2,719.28 | 227,002 | 1.000000000 ^S | 2,719.28 | 218,334 | 0 | -8,668 | -8,668 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 48,402.75000 | | 4/26/2021 | | 48,402.75 | 4,042,204 | 1.000000000 ^S | 48,402.75 | 3,886,314 | 0 | -155,890 | -155,890 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 42,832.87000 | | 5/10/2021 | | 42,832.87 | 3,646,416 | 1.000000000 ^S | 42,832.87 | 3,439,102 | 0 | -207,314 | -207,314 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 29,602.39000 | | 5/18/2021 | | 29,602.39 | 2,509,916 | 1.000000000 ^S | 29,602.39 | 2,376,811 | 0 | -133,105 | -133,105 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 338,819.02000 | | 5/19/2021 | | 338,819.02 | 28,754,662 | 1.000000000 ^S | 338,819.02 | 27,204,179 | 0 | -1,550,483 | -1,550,483 |
| 158,194.73000 | | 5/20/2021 | | 158,194.73 | 13,306,116 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 158,194.73 | 12,701,642 | 0 | -604,474 | -604,474 |
| 122,000.37000 | | 5/21/2021 | | 122,000.37 | 10,317,694 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 122,000.37 | 9,795,554 | 0 | -522,140 | -522,140 |
| 103,675.01000 | | 6/4/2021 | | 103,675.01 | 8,763,261 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 103,675.01 | 8,324,189 | 0 | -439,072 | -439,072 |
| 111,326.28000 | | 6/16/2021 | | 111,326.28 | 9,413,337 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 111,326.28 | 8,938,518 | 0 | -474,819 | -474,819 |
| 704,554.28000 | | 6/17/2021 | | 704,554.28 | 59,707,879 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 704,554.28 | 56,569,495 | 0 | -3,138,384 | -3,138,384 |
| 20,358.08000 | | 6/18/2021 | | 20,358.08 | 1,698,573 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 20,358.08 | 1,634,574 | 0 | -63,999 | -63,999 |
| 374,599.57000 | | 6/21/2021 | | 374,599.57 | 30,903,754 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 374,599.57 | 30,077,042 | 0 | -826,712 | -826,712 |
| 155,060.62000 | | 6/22/2021 | | 155,060.62 | 12,858,750 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 155,060.62 | 12,450,000 | 0 | -408,750 | -408,750 |
| 27,585.42000 | | 6/24/2021 | | 27,585.42 | 2,296,246 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 27,585.42 | 2,214,866 | 0 | -81,380 | -81,380 |
| 15,408.23000 | | 6/29/2021 | | 15,408.23 | 1,290,589 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 15,408.23 | 1,237,145 | 0 | -53,444 | -53,444 |
| 38,622.97000 | | 6/30/2021 | | 38,622.97 | 3,207,212 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 38,622.97 | 3,101,084 | 0 | -106,128 | -106,128 |
| 290,416.31000 | | 7/1/2021 | | 290,416.31 | 24,199,155 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 290,416.31 | 23,317,869 | 0 | -881,286 | -881,286 |
| 73,842.66000 | | 7/2/2021 | | 73,842.66 | 6,159,599 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 73,842.66 | 5,928,914 | 0 | -230,685 | -230,685 |
| 64,540.65000 | | 7/8/2021 | | 64,540.65 | 5,339,767 | 80.291180997 1.000000000 ^S | 64,540.65 | 5,182,045 | 0 | -157,722 | -157,722 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31日現在

| 口数/金額 | 種類 | 取引日 | サブ ユニット クラス | 取得原価 (表示通貨) (注1) | 取得原価 (基準通貨) (注2) (円) | 単価/ 為替レート | 価額 (表示通貨) (注1) | 価額 (基準通貨) (注2) (円) | 市場 (円) | 未実現損益 通貨 (円) | 合計 (円) |
|-----------------|----|-----------|-------------------|------------------------|-------------------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------|-----------|
| クラスに割当てられていない資産 | | | | | | | | | | | |
| 外貨建現金勘定 | | | | | | | | | | | |
| 非グループ化の有価証券 | | | | | | | | | | | |
| 29,905.52000 | | 7/14/2021 | | 29,905.52 | 2,463,219 | 1.000000000 ^S | 29,905.52 | 2,401,150 | 0 | -62,069 | -62,069 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 36,014.76000 | | 7/27/2021 | | 36,014.76 | 2,935,161 | 1.000000000 ^S | 36,014.76 | 2,891,668 | 0 | -43,493 | -43,493 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 49,274.00000 | | 7/29/2021 | | 49,274.00 | 3,980,733 | 1.000000000 ^S | 49,274.00 | 3,956,268 | 0 | -24,465 | -24,465 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 128,112.34000 | | 7/30/2021 | | 128,112.34 | 10,393,021 | 1.000000000 ^S | 128,112.34 | 10,286,291 | 0 | -106,730 | -106,730 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 141,000.00000 | | 8/5/2021 | | 141,000.00 | 11,399,302 | 1.000000000 ^S | 141,000.00 | 11,321,057 | 0 | -78,245 | -78,245 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 5,217.67000 | | 8/6/2021 | | 5,217.67 | 424,333 | 1.000000000 ^S | 5,217.67 | 418,933 | 0 | -5,400 | -5,400 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 11,729.09000 | | 8/19/2021 | | 11,729.09 | 932,826 | 1.000000000 ^S | 11,729.09 | 941,742 | 0 | 8,916 | 8,916 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 456,000.00000 | | 8/19/2021 | | 456,000.00 | 36,266,141 | 1.000000000 ^S | 456,000.00 | 36,612,779 | 0 | 346,638 | 346,638 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| 5,913.02000 | | 8/27/2021 | | 5,913.02 | 471,517 | 1.000000000 ^S | 5,913.02 | 474,763 | 0 | 3,246 | 3,246 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -150,655.79000 | | 2/12/2015 | | -150,655.79 | -13,988,254 | 1.000000000 ^S | -150,655.79 | -12,096,331 | 0 | 1,891,923 | 1,891,923 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -195,720.57000 | | 2/18/2015 | | -195,720.57 | -18,170,317 | 1.000000000 ^S | -195,720.57 | -15,714,636 | 0 | 2,455,681 | 2,455,681 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -12,078.57000 | | 2/20/2015 | | -12,078.57 | -1,119,958 | 1.000000000 ^S | -12,078.57 | -969,803 | 0 | 150,155 | 150,155 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -203,751.45000 | | 2/23/2015 | | -203,751.45 | -18,949,081 | 1.000000000 ^S | -203,751.45 | -16,359,445 | 0 | 2,589,636 | 2,589,636 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -16,686.40000 | | 2/25/2015 | | -16,686.40 | -1,554,713 | 1.000000000 ^S | -16,686.40 | -1,339,771 | 0 | 214,942 | 214,942 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -164,421.91000 | | 3/2/2015 | | -164,421.91 | -15,385,592 | 1.000000000 ^S | -164,421.91 | -13,201,629 | 0 | 2,183,963 | 2,183,963 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -12,405.71000 | | 3/3/2015 | | -12,405.71 | -1,159,873 | 1.000000000 ^S | -12,405.71 | -996,069 | 0 | 163,804 | 163,804 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -125,474.92000 | | 3/6/2015 | | -125,474.92 | -11,724,150 | 1.000000000 ^S | -125,474.92 | -10,074,530 | 0 | 1,649,620 | 1,649,620 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -152,618.80000 | | 3/9/2015 | | -152,618.80 | -14,295,699 | 1.000000000 ^S | -152,618.80 | -12,253,944 | 0 | 2,041,755 | 2,041,755 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -708,611.63000 | | 3/11/2015 | | -708,611.63 | -65,607,231 | 1.000000000 ^S | -708,611.63 | -56,895,265 | 0 | 8,711,966 | 8,711,966 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -27,978.64000 | | 3/11/2015 | | -27,978.64 | -2,590,419 | 1.000000000 ^S | -27,978.64 | -2,246,438 | 0 | 343,981 | 343,981 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -174,287.44000 | | 3/13/2015 | | -174,287.44 | -16,285,835 | 1.000000000 ^S | -174,287.44 | -13,993,744 | 0 | 2,292,091 | 2,292,091 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,763.28000 | | 3/17/2015 | | -7,763.28 | -720,984 | 1.000000000 ^S | -7,763.28 | -623,323 | 0 | 97,661 | 97,661 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -302,844.98000 | | 3/23/2015 | | -302,844.98 | -28,263,848 | 1.000000000 ^S | -302,844.98 | -24,315,781 | 0 | 3,948,067 | 3,948,067 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -97,995.40000 | | 3/25/2015 | | -97,995.40 | -9,248,315 | 1.000000000 ^S | -97,995.40 | -7,868,166 | 0 | 1,380,149 | 1,380,149 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -172,798.05000 | | 3/26/2015 | | -172,798.05 | -16,206,911 | 1.000000000 ^S | -172,798.05 | -13,874,160 | 0 | 2,332,751 | 2,332,751 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -975,466.76000 | | 3/27/2015 | | -975,466.76 | -90,954,622 | 1.000000000 ^S | -975,466.76 | -78,321,378 | 0 | 12,633,244 | 12,633,244 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -256,508.24000 | | 3/30/2015 | | -256,508.24 | -23,694,394 | 1.000000000 ^S | -256,508.24 | -20,595,350 | 0 | 3,099,044 | 3,099,044 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -189,563.24000 | | 3/31/2015 | | -189,563.24 | -17,377,298 | 1.000000000 ^S | -189,563.24 | -15,220,256 | 0 | 2,157,042 | 2,157,042 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -206,250.64000 | | 4/2/2015 | | -206,250.64 | -18,798,942 | 1.000000000 ^S | -206,250.64 | -16,560,107 | 0 | 2,238,835 | 2,238,835 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -90,318.63000 | | 4/7/2015 | | -90,318.63 | -8,194,681 | 1.000000000 ^S | -90,318.63 | -7,251,789 | 0 | 942,892 | 942,892 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -74,243.21000 | | 4/8/2015 | | -74,243.21 | -6,835,651 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -74,243.21 | -5,961,075 | 0 | 874,576 | 874,576 |
| -78,171.43000 | | 4/9/2015 | | -78,171.43 | -7,218,890 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -78,171.43 | -6,276,476 | 0 | 942,414 | 942,414 |
| -705,086.17000 | | 4/13/2015 | | -705,086.17 | -65,108,703 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -705,086.17 | -56,612,201 | 0 | 8,496,502 | 8,496,502 |
| -37,651.50000 | | 4/13/2015 | | -37,651.50 | -3,476,795 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -37,651.50 | -3,023,083 | 0 | 453,712 | 453,712 |
| -246,307.80000 | | 4/14/2015 | | -246,307.80 | -22,433,763 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -246,307.80 | -19,776,344 | 0 | 2,657,419 | 2,657,419 |
| -57,294.63000 | | 4/15/2015 | | -57,294.63 | -5,220,124 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -57,294.63 | -4,600,254 | 0 | 619,870 | 619,870 |
| -39,422.26000 | | 4/20/2015 | | -39,422.26 | -3,646,622 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -39,422.26 | -3,165,260 | 0 | 481,362 | 481,362 |
| -167,462.13000 | | 4/21/2015 | | -167,462.13 | -15,429,360 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -167,462.13 | -13,445,732 | 0 | 1,983,628 | 1,983,628 |
| -11,204.33000 | | 4/21/2015 | | -11,204.33 | -1,032,327 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -11,204.33 | -899,609 | 0 | 132,718 | 132,718 |
| -58,785.17000 | | 4/23/2015 | | -58,785.17 | -5,468,165 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -58,785.17 | -4,719,931 | 0 | 748,234 | 748,234 |
| -203,446.05000 | | 4/24/2015 | | -203,446.05 | -18,910,269 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -203,446.05 | -16,334,924 | 0 | 2,575,345 | 2,575,345 |
| -19,719.18000 | | 4/27/2015 | | -19,719.18 | -1,835,889 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -19,719.18 | -1,583,276 | 0 | 252,613 | 252,613 |
| -746,896.35000 | | 4/28/2015 | | -746,896.35 | -69,998,726 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -746,896.35 | -59,969,190 | 0 | 10,029,536 | 10,029,536 |
| -47,545.85000 | | 4/30/2015 | | -47,545.85 | -4,556,043 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -47,545.85 | -3,817,512 | 0 | 738,531 | 738,531 |
| -35,878.86000 | | 5/11/2015 | | -35,878.86 | -3,395,944 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -35,878.86 | -2,880,756 | 0 | 515,188 | 515,188 |

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

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

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

[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 2021年8月31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 | | 5/12/2015 | | -59,220.06 | -5,621,675 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -59,220.06 | -4,754,849 | 0 | 866,826 | 866,826 |
| -684,441.51000 | | 5/13/2015 | | -684,441.51 | -65,461,528 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -684,441.51 | -54,954,617 | 0 | 10,506,911 | 10,506,911 |
| -157,020.19000 | | 5/13/2015 | | -157,020.19 | -15,017,765 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -157,020.19 | -12,607,336 | 0 | 2,410,429 | 2,410,429 |
| -45,251.01000 | | 5/15/2015 | | -45,251.01 | -4,364,516 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -45,251.01 | -3,633,257 | 0 | 731,259 | 731,259 |
| -518,763.75000 | | 5/20/2015 | | -518,763.75 | -49,524,085 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -518,763.75 | -41,652,154 | 0 | 7,871,931 | 7,871,931 |
| -6,306.57000 | | 5/22/2015 | | -6,306.57 | -601,860 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -6,306.57 | -506,362 | 0 | 95,498 | 95,498 |
| -52,113.71000 | | 5/26/2015 | | -52,113.71 | -4,952,607 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -52,113.71 | -4,184,271 | 0 | 768,336 | 768,336 |
| -393,354.22000 | | 5/29/2015 | | -393,354.22 | -37,332,985 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -393,354.22 | -31,582,875 | 0 | 5,750,110 | 5,750,110 |
| -245,742.67000 | | 6/1/2015 | | -245,742.67 | -23,342,732 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -245,742.67 | -19,730,969 | 0 | 3,611,763 | 3,611,763 |
| -5,170.70000 | | 6/2/2015 | | -5,170.70 | -490,237 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -5,170.70 | -415,162 | 0 | 75,075 | 75,075 |
| -78,821.02000 | | 6/3/2015 | | -78,821.02 | -7,578,180 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -78,821.02 | -6,328,633 | 0 | 1,249,547 | 1,249,547 |
| -113,860.14000 | | 6/10/2015 | | -113,860.14 | -10,869,006 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -113,860.14 | -9,141,965 | 0 | 1,727,041 | 1,727,041 |
| -666,844.90000 | | 6/11/2015 | | -666,844.90 | -63,423,573 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -666,844.90 | -53,541,765 | 0 | 9,881,808 | 9,881,808 |
| -110,710.67000 | | 6/11/2015 | | -110,710.67 | -10,529,684 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -110,710.67 | -8,889,090 | 0 | 1,640,594 | 1,640,594 |
| -54,834.71000 | | 6/12/2015 | | -54,834.71 | -5,234,697 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -54,834.71 | -4,402,744 | 0 | 831,953 | 831,953 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -83,284.46000 | | 6/15/2015 | | -83,284.46 | -7,946,384 | 1.000000000 ^S | -83,284.46 | -6,687,008 | 0 | 1,259,376 | 1,259,376 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -479,833.36000 | | 6/16/2015 | | -479,833.36 | -46,020,105 | 1.000000000 ^S | -479,833.36 | -38,526,387 | 0 | 7,493,718 | 7,493,718 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,695.85000 | | 6/16/2015 | | -17,695.85 | -1,697,183 | 1.000000000 ^S | -17,695.85 | -1,420,821 | 0 | 276,362 | 276,362 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -470,587.90000 | | 6/18/2015 | | -470,587.90 | -44,826,446 | 1.000000000 ^S | -470,587.90 | -37,784,058 | 0 | 7,042,388 | 7,042,388 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -156,011.32000 | | 6/19/2015 | | -156,011.32 | -15,014,828 | 1.000000000 ^S | -156,011.32 | -12,526,333 | 0 | 2,488,495 | 2,488,495 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -49,769.29000 | | 6/22/2015 | | -49,769.29 | -4,738,361 | 1.000000000 ^S | -49,769.29 | -3,996,035 | 0 | 742,326 | 742,326 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -106,347.76000 | | 6/24/2015 | | -106,347.76 | -10,178,922 | 1.000000000 ^S | -106,347.76 | -8,538,787 | 0 | 1,640,135 | 1,640,135 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -13,612.05000 | | 6/25/2015 | | -13,612.05 | -1,301,380 | 1.000000000 ^S | -13,612.05 | -1,092,928 | 0 | 208,452 | 208,452 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -255,184.50000 | | 6/29/2015 | | -255,184.50 | -24,175,877 | 1.000000000 ^S | -255,184.50 | -20,489,065 | 0 | 3,686,812 | 3,686,812 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -321,067.80000 | | 6/30/2015 | | -321,067.80 | -30,136,472 | 1.000000000 ^S | -321,067.80 | -25,778,913 | 0 | 4,357,559 | 4,357,559 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -64,733.44000 | | 7/1/2015 | | -64,733.44 | -6,088,164 | 1.000000000 ^S | -64,733.44 | -5,197,524 | 0 | 890,640 | 890,640 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -28,970.18000 | | 7/6/2015 | | -28,970.18 | -2,672,746 | 1.000000000 ^S | -28,970.18 | -2,326,050 | 0 | 346,696 | 346,696 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -19,343.07000 | | 7/8/2015 | | -19,343.07 | -1,755,373 | 1.000000000 ^S | -19,343.07 | -1,553,078 | 0 | 202,295 | 202,295 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -676,268.27000 | | 7/10/2015 | | -676,268.27 | -60,941,337 | 1.000000000 ^S | -676,268.27 | -54,298,378 | 0 | 6,642,959 | 6,642,959 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -68,449.88000 | | 7/10/2015 | | -68,449.88 | -6,168,302 | 1.000000000 ^S | -68,449.88 | -5,495,922 | 0 | 672,380 | 672,380 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -275,119.99000 | | 7/13/2015 | | -275,119.99 | -25,043,111 | 1.000000000 ^S | -275,119.99 | -22,089,709 | 0 | 2,953,402 | 2,953,402 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -93,052.47000 | | 7/21/2015 | | -93,052.47 | -8,525,992 | 1.000000000 ^S | -93,052.47 | -7,471,293 | 0 | 1,054,699 | 1,054,699 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -73,784.97000 | | 7/21/2015 | | -73,784.97 | -6,760,595 | 1.000000000 ^S | -73,784.97 | -5,924,282 | 0 | 836,313 | 836,313 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -110,427.24000 | | 7/22/2015 | | -110,427.24 | -10,172,242 | 1.000000000 ^S | -110,427.24 | -8,866,334 | 0 | 1,305,908 | 1,305,908 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -164,563.52000 | | 7/23/2015 | | -164,563.52 | -15,061,940 | 1.000000000 ^S | -164,563.52 | -13,212,999 | 0 | 1,848,941 | 1,848,941 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -87,873.33000 | | 7/27/2015 | | -87,873.33 | -7,910,912 | 1.000000000 ^S | -87,873.33 | -7,055,453 | 0 | 855,459 | 855,459 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -13,601.15000 | | 7/28/2015 | | -13,601.15 | -1,221,936 | 1.000000000 ^S | -13,601.15 | -1,092,052 | 0 | 129,884 | 129,884 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -59,933.50000 | | 8/5/2015 | | -59,933.50 | -5,510,135 | 1.000000000 ^S | -59,933.50 | -4,812,131 | 0 | 698,004 | 698,004 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -143,187.55000 | | 8/6/2015 | | -143,187.55 | -13,144,987 | 1.000000000 ^S | -143,187.55 | -11,496,697 | 0 | 1,648,290 | 1,648,290 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -158,035.75000 | | 8/10/2015 | | -158,035.75 | -14,529,172 | 1.000000000 ^S | -158,035.75 | -12,688,877 | 0 | 1,840,295 | 1,840,295 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -669,741.07000 | | 8/11/2015 | | -669,741.07 | -61,661,426 | 1.000000000 ^S | -669,741.07 | -53,774,301 | 0 | 7,887,125 | 7,887,125 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -284,337.22000 | | 8/11/2015 | | -284,337.22 | -26,178,234 | 1.000000000 ^S | -284,337.22 | -22,829,771 | 0 | 3,348,463 | 3,348,463 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,892,527.01000 | | 8/12/2015 | | -7,892,527.01 | -718,905,956 | 1.000000000 ^S | -7,892,527.01 | -633,700,315 | 0 | 85,205,641 | 85,205,641 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -156,845.94000 | | 8/13/2015 | | -156,845.94 | -14,320,359 | 1.000000000 ^S | -156,845.94 | -12,593,346 | 0 | 1,727,013 | 1,727,013 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -53,128.21000 | | 8/14/2015 | | -53,128.21 | -4,863,119 | 1.000000000 ^S | -53,128.21 | -4,265,727 | 0 | 597,392 | 597,392 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -162,199.09000 | | 8/17/2015 | | -162,199.09 | -14,865,372 | 1.000000000 ^S | -162,199.09 | -13,023,156 | 0 | 1,842,216 | 1,842,216 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -21,061.93000 | | 8/19/2015 | | -21,061.93 | -1,921,161 | 1.000000000 ^S | -21,061.93 | -1,691,087 | 0 | 230,074 | 230,074 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -265,076.96000 | | 8/20/2015 | | -265,076.96 | -24,126,074 | 1.000000000 ^S | -265,076.96 | -21,283,342 | 0 | 2,842,732 | 2,842,732 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -19,404.32000 | | 8/24/2015 | | -19,404.32 | -213 | 1.000000000 ^S | -19,404.32 | -1,557,996 | 0 | -1,557,783 | -1,557,783 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -196,668.41000 | | 8/25/2015 | | -196,668.41 | -16,800,889 | 1.000000000 ^S | -196,668.41 | -15,790,739 | 0 | 1,010,150 | 1,010,150 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -462,149.98000 | | 8/26/2015 | | -462,149.98 | -39,759,612 | 1.000000000 ^S | -462,149.98 | -37,106,568 | 0 | 2,653,044 | 2,653,044 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -32,107.10000 | | 8/27/2015 | | -32,107.10 | -2,718,823 | 1.000000000 ^S | -32,107.10 | -2,577,917 | 0 | 140,906 | 140,906 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -86,093.85000 | | 9/1/2015 | | -86,093.85 | -7,396,676 | 1.000000000 ^S | -86,093.85 | -6,912,577 | 0 | 484,099 | 484,099 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -93,737.05000 | | 9/2/2015 | | -93,737.05 | -7,905,601 | 1.000000000 ^S | -93,737.05 | -7,526,258 | 0 | 379,343 | 379,343 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -4,157.48000 | | 9/3/2015 | | -4,157.48 | -349,983 | 1.000000000 ^S | -4,157.48 | -333,809 | 0 | 16,174 | 16,174 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -102,367.87000 | | 9/4/2015 | | -102,367.87 | -8,650,619 | 1.000000000 ^S | -102,367.87 | -8,219,237 | 0 | 431,382 | 431,382 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -642,283.89000 | | 9/9/2015 | | -642,283.89 | -53,850,984 | 1.000000000 ^S | -642,283.89 | -51,569,732 | 0 | 2,281,252 | 2,281,252 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -476,290.57000 | | 9/10/2015 | | -476,290.57 | -40,505,866 | 1.000000000 ^S | -476,290.57 | -38,241,932 | 0 | 2,263,934 | 2,263,934 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -107,114.37000 | | 9/11/2015 | | -107,114.37 | -9,136,362 | 1.000000000 ^S | -107,114.37 | -8,600,339 | 0 | 536,023 | 536,023 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -575,423.39000 | | 9/14/2015 | | -575,423.39 | -48,988,118 | 1.000000000 ^S | -575,423.39 | -46,201,424 | 0 | 2,786,694 | 2,786,694 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -92,596.64000 | | 9/14/2015 | | -92,596.64 | -7,883,126 | 1.000000000 ^S | -92,596.64 | -7,434,694 | 0 | 448,432 | 448,432 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -636,341.83000 | | 9/15/2015 | | -636,341.83 | -54,620,063 | 1.000000000 ^S | -636,341.83 | -51,092,637 | 0 | 3,527,426 | 3,527,426 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -57,680.52000 | | 9/16/2015 | | -57,680.52 | -4,915,496 | 1.000000000 ^S | -57,680.52 | -4,631,237 | 0 | 284,259 | 284,259 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -148,138.07000 | | 9/17/2015 | | -148,138.07 | -12,842,800 | 1.000000000 ^S | -148,138.07 | -11,894,181 | 0 | 948,619 | 948,619 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -888,355.94000 | | 9/18/2015 | | -888,355.94 | -76,774,291 | 1.000000000 ^S | -888,355.94 | -71,327,148 | 0 | 5,447,143 | 5,447,143 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -252,646.81000 | | 9/24/2015 | | -252,646.81 | -21,364,671 | 1.000000000 ^S | -252,646.81 | -20,285,311 | 0 | 1,079,360 | 1,079,360 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -49,056.91000 | | 9/25/2015 | | -49,056.91 | -4,093,695 | 1.000000000 ^S | -49,056.91 | -3,938,837 | 0 | 154,858 | 154,858 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -72,142.91000 | | 9/28/2015 | | -72,142.91 | -6,115,979 | 1.000000000 ^S | -72,142.91 | -5,792,439 | 0 | 323,540 | 323,540 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -70,823.93000 | | 9/30/2015 | | -70,823.93 | -5,954,410 | 1.000000000 ^S | -70,823.93 | -5,686,537 | 0 | 267,873 | 267,873 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -198,025.63000 | | 10/1/2015 | | -198,025.63 | -16,654,940 | 1.000000000 ^S | -198,025.63 | -15,899,712 | 0 | 755,228 | 755,228 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -122,307.91000 | | 10/6/2015 | | -122,307.91 | -10,416,695 | 1.000000000 ^S | -122,307.91 | -9,820,247 | 0 | 596,448 | 596,448 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -39,456.54000 | | 10/6/2015 | | -39,456.54 | -3,360,426 | 1.000000000 ^S | -39,456.54 | -3,168,012 | 0 | 192,414 | 192,414 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,998.66000 | | 10/7/2015 | | -17,998.66 | -1,543,637 | 1.000000000 ^S | -17,998.66 | -1,445,134 | 0 | 98,503 | 98,503 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -94,044.65000 | | 10/8/2015 | | -94,044.65 | -8,145,767 | 1.000000000 ^S | -94,044.65 | -7,550,956 | 0 | 594,811 | 594,811 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -413,942.78000 | | 10/9/2015 | | -413,942.78 | -35,732,854 | 1.000000000 ^S | -413,942.78 | -33,235,955 | 0 | 2,496,899 | 2,496,899 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -18,029.52000 | | 10/9/2015 | | -18,029.52 | -1,556,365 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -18,029.52 | -1,447,611 | 0 | 108,754 | 108,754 |
| -201,846.72000 | | 10/15/2015 | | -201,846.72 | -17,479,324 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -201,846.72 | -16,206,512 | 0 | 1,272,812 | 1,272,812 |
| -106,109.09000 | | 10/15/2015 | | -106,109.09 | -9,188,731 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -106,109.09 | -8,519,624 | 0 | 669,107 | 669,107 |
| -13,046.14000 | | 10/16/2015 | | -13,046.14 | -1,131,560 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -13,046.14 | -1,047,490 | 0 | 84,070 | 84,070 |
| -938,332.24000 | | 10/22/2015 | | -938,332.24 | -81,210,340 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -938,332.24 | -75,339,804 | 0 | 5,870,536 | 5,870,536 |
| -52,217.18000 | | 10/26/2015 | | -52,217.18 | -4,570,998 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -52,217.18 | -4,192,579 | 0 | 378,419 | 378,419 |
| -156,124.38000 | | 10/27/2015 | | -156,124.38 | -13,705,268 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -156,124.38 | -12,535,411 | 0 | 1,169,857 | 1,169,857 |
| -221,516.12000 | | 10/30/2015 | | -221,516.12 | -18,997,458 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -221,516.12 | -17,785,791 | 0 | 1,211,667 | 1,211,667 |
| -22,603.85000 | | 11/5/2015 | | -22,603.85 | -1,966,401 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -22,603.85 | -1,814,890 | 0 | 151,511 | 151,511 |
| -28,494.89000 | | 11/6/2015 | | -28,494.89 | -2,474,770 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -28,494.89 | -2,287,888 | 0 | 186,882 | 186,882 |
| -33,113.93000 | | 11/10/2015 | | -33,113.93 | -2,878,332 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -33,113.93 | -2,658,757 | 0 | 219,575 | 219,575 |
| -908,189.06000 | | 11/12/2015 | | -908,189.06 | -78,762,965 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -908,189.06 | -72,919,572 | 0 | 5,843,393 | 5,843,393 |
| -377,515.60000 | | 11/12/2015 | | -377,515.60 | -32,740,152 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -377,515.60 | -30,311,173 | 0 | 2,428,979 | 2,428,979 |
| -6,155.13000 | | 11/13/2015 | | -6,155.13 | -537,849 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -6,155.13 | -494,203 | 0 | 43,646 | 43,646 |
| -156,394.49000 | | 11/17/2015 | | -156,394.49 | -13,637,532 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -156,394.49 | -12,557,098 | 0 | 1,080,434 | 1,080,434 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -16,749.47000 | | 11/18/2015 | | -16,749.47 | -1,472,174 | 1.000000000 ^S | -16,749.47 | -1,344,835 | 0 | 127,339 | 127,339 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -535,263.52000 | | 11/19/2015 | | -535,263.52 | -46,835,996 | 1.000000000 ^S | -535,263.52 | -42,976,940 | 0 | 3,859,056 | 3,859,056 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -171,111.94000 | | 11/20/2015 | | -171,111.94 | -15,132,801 | 1.000000000 ^S | -171,111.94 | -13,738,780 | 0 | 1,394,021 | 1,394,021 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -74,491.46000 | | 11/24/2015 | | -74,491.46 | -6,589,055 | 1.000000000 ^S | -74,491.46 | -5,981,007 | 0 | 608,048 | 608,048 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -907,253.22000 | | 11/25/2015 | | -907,253.22 | -80,284,748 | 1.000000000 ^S | -907,253.22 | -72,844,432 | 0 | 7,440,316 | 7,440,316 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -124,050.79000 | | 11/27/2015 | | -124,050.79 | -10,988,000 | 1.000000000 ^S | -124,050.79 | -9,960,184 | 0 | 1,027,816 | 1,027,816 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -125,483.80000 | | 12/1/2015 | | -125,483.80 | -11,209,303 | 1.000000000 ^S | -125,483.80 | -10,075,242 | 0 | 1,134,061 | 1,134,061 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -29,511.79000 | | 12/3/2015 | | -29,511.79 | -2,666,440 | 1.000000000 ^S | -29,511.79 | -2,369,536 | 0 | 296,904 | 296,904 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -33,063.02000 | | 12/4/2015 | | -33,063.02 | -2,969,898 | 1.000000000 ^S | -33,063.02 | -2,654,669 | 0 | 315,229 | 315,229 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -33,111.98000 | | 12/8/2015 | | -33,111.98 | -2,969,410 | 1.000000000 ^S | -33,111.98 | -2,658,600 | 0 | 310,810 | 310,810 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -329,209.04000 | | 12/9/2015 | | -329,209.04 | -29,234,099 | 1.000000000 ^S | -329,209.04 | -26,432,583 | 0 | 2,801,516 | 2,801,516 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -29,648.06000 | | 12/10/2015 | | -29,648.06 | -2,614,894 | 1.000000000 ^S | -29,648.06 | -2,380,478 | 0 | 234,416 | 234,416 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -327,000.00000 | | 12/11/2015 | | -327,000.00 | -28,998,504 | 1.000000000 ^S | -327,000.00 | -26,255,216 | 0 | 2,743,288 | 2,743,288 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -92,475.65000 | | 12/11/2015 | | -92,475.65 | -8,200,781 | 1.000000000 ^S | -92,475.65 | -7,424,979 | 0 | 775,802 | 775,802 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -57,766.60000 | | 12/11/2015 | | -57,766.60 | -5,122,768 | 1.000000000 ^S | -57,766.60 | -4,638,149 | 0 | 484,619 | 484,619 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -34,992.57000 | | 12/14/2015 | | -34,992.57 | -3,051,138 | 1.000000000 ^S | -34,992.57 | -2,809,595 | 0 | 241,543 | 241,543 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -288,079.45000 | | 12/15/2015 | | -288,079.45 | -25,176,774 | 1.000000000 ^S | -288,079.45 | -23,130,239 | 0 | 2,046,535 | 2,046,535 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -109,269.69000 | | 12/16/2015 | | -109,269.69 | -9,536,047 | 1.000000000 ^S | -109,269.69 | -8,773,392 | 0 | 762,655 | 762,655 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -26,796.21000 | | 12/18/2015 | | -26,796.21 | -2,338,039 | 1.000000000 ^S | -26,796.21 | -2,151,499 | 0 | 186,540 | 186,540 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -35,901.50000 | | 12/30/2015 | | -35,901.50 | -3,154,307 | 1.000000000 ^S | -35,901.50 | -2,882,574 | 0 | 271,733 | 271,733 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -191,729.95000 | | 1/4/2016 | | -191,729.95 | -16,780,325 | 1.000000000 ^S | -191,729.95 | -15,394,224 | 0 | 1,386,101 | 1,386,101 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -223,008.99000 | | 1/5/2016 | | -223,008.99 | -19,064,056 | 1.000000000 ^S | -223,008.99 | -17,905,655 | 0 | 1,158,401 | 1,158,401 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,213.36000 | | 1/7/2016 | | -17,213.36 | -1,442,564 | 1.000000000 ^S | -17,213.36 | -1,382,081 | 0 | 60,483 | 60,483 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -379,405.26000 | | 1/12/2016 | | -379,405.26 | -31,131,953 | 1.000000000 ^S | -379,405.26 | -30,462,896 | 0 | 669,057 | 669,057 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -189,599.29000 | | 1/15/2016 | | -189,599.29 | -15,584,866 | 1.000000000 ^S | -189,599.29 | -15,223,151 | 0 | 361,715 | 361,715 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -8,880.25000 | | 1/19/2016 | | -8,880.25 | -716,821 | 1.000000000 ^S | -8,880.25 | -713,006 | 0 | 3,815 | 3,815 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -90,489.83000 | | 1/21/2016 | | -90,489.83 | -7,198,238 | 1.000000000 ^S | -90,489.83 | -7,265,535 | 0 | -67,297 | -67,297 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -57,779.34000 | | 1/21/2016 | | -57,779.34 | -4,596,201 | 1.000000000 ^S | -57,779.34 | -4,639,171 | 0 | -42,970 | -42,970 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,629.83000 | | 1/21/2016 | | -7,629.83 | -606,934 | 1.000000000 ^S | -7,629.83 | -612,608 | 0 | -5,674 | -5,674 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -121,619.56000 | | 1/22/2016 | | -121,619.56 | -9,910,282 | 1.000000000 ^S | -121,619.56 | -9,764,978 | 0 | 145,304 | 145,304 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -214,100.94000 | | 2/1/2016 | | -214,100.94 | -18,334,604 | 1.000000000 ^S | -214,100.94 | -17,190,417 | 0 | 1,144,187 | 1,144,187 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -21,646.66000 | | 2/4/2016 | | -21,646.66 | -1,815,370 | 1.000000000 ^S | -21,646.66 | -1,738,036 | 0 | 77,334 | 77,334 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -14,653.90000 | | 2/5/2016 | | -14,653.90 | -1,240,675 | 1.000000000 ^S | -14,653.90 | -1,176,579 | 0 | 64,096 | 64,096 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -30,116.40000 | | 2/10/2016 | | -30,116.40 | -2,445,030 | 1.000000000 ^S | -30,116.40 | -2,418,081 | 0 | 26,949 | 26,949 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -381,805.81000 | | 2/12/2016 | | -381,805.81 | -30,235,477 | 1.000000000 ^S | -381,805.81 | -30,655,639 | 0 | -420,162 | -420,162 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -152,354.76000 | | 2/12/2016 | | -152,354.76 | -12,065,083 | 1.000000000 ^S | -152,354.76 | -12,232,744 | 0 | -167,661 | -167,661 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -16,916.50000 | | 2/17/2016 | | -16,916.50 | -1,364,954 | 1.000000000 ^S | -16,916.50 | -1,358,246 | 0 | 6,708 | 6,708 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -114,575.44000 | | 2/22/2016 | | -114,575.44 | -9,163,101 | 1.000000000 ^S | -114,575.44 | -9,199,397 | 0 | -36,296 | -36,296 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -37,349.25000 | | 2/23/2016 | | -37,349.25 | -3,051,565 | 1.000000000 ^S | -37,349.25 | -2,998,815 | 0 | 52,750 | 52,750 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -123,804.34000 | | 3/2/2016 | | -123,804.34 | -10,057,811 | 1.000000000 ^S | -123,804.34 | -9,940,397 | 0 | 117,414 | 117,414 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -27,289.30000 | | 3/3/2016 | | -27,289.30 | -2,257,397 | 1.000000000 ^S | -27,289.30 | -2,191,090 | 0 | 66,307 | 66,307 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -10,054.65000 | | 3/7/2016 | | -10,054.65 | -847,732 | 1.000000000 ^S | -10,054.65 | -807,300 | 0 | 40,432 | 40,432 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -211,885.31000 | | 3/9/2016 | | -211,885.31 | -17,733,243 | 1.000000000 ^S | -211,885.31 | -17,012,522 | 0 | 720,721 | 720,721 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -377,078.03000 | | 3/11/2016 | | -377,078.03 | -31,843,855 | 1.000000000 ^S | -377,078.03 | -30,276,040 | 0 | 1,567,815 | 1,567,815 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -74,706.21000 | | 3/14/2016 | | -74,706.21 | -6,403,880 | 1.000000000 ^S | -74,706.21 | -5,998,250 | 0 | 405,630 | 405,630 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -73,687.89000 | | 3/15/2016 | | -73,687.89 | -6,289,651 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -73,687.89 | -5,916,488 | 0 | 373,163 | 373,163 |
| -45,075.31000 | | 3/16/2016 | | -45,075.31 | -3,796,491 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -45,075.31 | -3,619,150 | 0 | 177,341 | 177,341 |
| -29,125.30000 | | 3/18/2016 | | -29,125.30 | -2,475,492 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -29,125.30 | -2,338,505 | 0 | 136,987 | 136,987 |
| -97,821.68000 | | 3/22/2016 | | -97,821.68 | -8,292,500 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -97,821.68 | -7,854,218 | 0 | 438,282 | 438,282 |
| -112,039.68000 | | 3/23/2016 | | -112,039.68 | -9,552,811 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -112,039.68 | -8,995,798 | 0 | 557,013 | 557,013 |
| -159,202.44000 | | 3/24/2016 | | -159,202.44 | -13,507,411 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -159,202.44 | -12,782,552 | 0 | 724,859 | 724,859 |
| -32,177.14000 | | 3/31/2016 | | -32,177.14 | -2,784,601 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -32,177.14 | -2,583,541 | 0 | 201,060 | 201,060 |
| -64,762.22000 | | 4/5/2016 | | -64,762.22 | -5,485,619 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -64,762.22 | -5,199,835 | 0 | 285,784 | 285,784 |
| -26,208.62000 | | 4/6/2016 | | -26,208.62 | -2,182,406 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -26,208.62 | -2,104,321 | 0 | 78,085 | 78,085 |
| -373,765.27000 | | 4/11/2016 | | -373,765.27 | -30,674,974 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -373,765.27 | -30,010,055 | 0 | 664,919 | 664,919 |
| -204,881.37000 | | 4/11/2016 | | -204,881.37 | -16,814,646 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -204,881.37 | -16,450,167 | 0 | 364,479 | 364,479 |
| -43,019.52000 | | 4/12/2016 | | -43,019.52 | -3,527,545 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -43,019.52 | -3,454,088 | 0 | 73,457 | 73,457 |
| -33,801.18000 | | 4/13/2016 | | -33,801.18 | -2,800,107 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -33,801.18 | -2,713,937 | 0 | 86,170 | 86,170 |
| -141,797.35000 | | 4/14/2016 | | -141,797.35 | -11,838,108 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -141,797.35 | -11,385,077 | 0 | 453,031 | 453,031 |
| -3,319.09000 | | 4/18/2016 | | -3,319.09 | -278,038 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -3,319.09 | -266,494 | 0 | 11,544 | 11,544 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -83,104.57000 | | 4/19/2016 | | -83,104.57 | -6,999,836 | 1.000000000 ^S | -83,104.57 | -6,672,564 | 0 | 327,272 | 327,272 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,007.13000 | | 4/19/2016 | | -7,007.13 | -590,205 | 1.000000000 ^S | -7,007.13 | -562,611 | 0 | 27,594 | 27,594 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -32,699.55000 | | 4/20/2016 | | -32,699.55 | -2,792,082 | 1.000000000 ^S | -32,699.55 | -2,625,485 | 0 | 166,597 | 166,597 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -2,677,613.47000 | | 4/21/2016 | | -2,677,613.47 | -228,369,211 | 1.000000000 ^S | -2,677,613.47 | -214,988,748 | 0 | 13,380,463 | 13,380,463 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -92,321.29000 | | 4/21/2016 | | -92,321.29 | -7,873,930 | 1.000000000 ^S | -92,321.29 | -7,412,585 | 0 | 461,345 | 461,345 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -51,467.98000 | | 4/26/2016 | | -51,467.98 | -4,411,808 | 1.000000000 ^S | -51,467.98 | -4,132,425 | 0 | 279,383 | 279,383 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -15,428.24000 | | 5/9/2016 | | -15,428.24 | -1,209,910 | 1.000000000 ^S | -15,428.24 | -1,238,752 | 0 | -28,842 | -28,842 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -102,314.26000 | | 5/11/2016 | | -102,314.26 | -8,222,605 | 1.000000000 ^S | -102,314.26 | -8,214,933 | 0 | 7,672 | 7,672 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -352,627.83000 | | 5/12/2016 | | -352,627.83 | -28,284,357 | 1.000000000 ^S | -352,627.83 | -28,312,905 | 0 | -28,548 | -28,548 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -32,453.42000 | | 5/17/2016 | | -32,453.42 | -2,578,702 | 1.000000000 ^S | -32,453.42 | -2,605,723 | 0 | -27,021 | -27,021 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -184,519.95000 | | 5/18/2016 | | -184,519.95 | -14,755,931 | 1.000000000 ^S | -184,519.95 | -14,815,325 | 0 | -59,394 | -59,394 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -346,026.04000 | | 5/23/2016 | | -346,026.04 | -27,596,972 | 1.000000000 ^S | -346,026.04 | -27,782,839 | 0 | -185,867 | -185,867 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -349,425.52000 | | 6/10/2016 | | -349,425.52 | -27,668,680 | 1.000000000 ^S | -349,425.52 | -28,055,788 | 0 | -387,108 | -387,108 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -205,061.01000 | | 6/14/2016 | | -205,061.01 | -16,138,898 | 1.000000000 ^S | -205,061.01 | -16,464,591 | 0 | -325,693 | -325,693 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -27,132.00000 | | 6/17/2016 | | -27,132.00 | -2,060,548 | 1.000000000 ^S | -27,132.00 | -2,178,460 | 0 | -117,912 | -117,912 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -3,725.24000 | | 7/7/2016 | | -3,725.24 | -281,556 | 1.000000000 ^S | -3,725.24 | -299,104 | 0 | -17,548 | -17,548 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -359,882.81000 | | 7/11/2016 | | -359,882.81 | -27,321,043 | 1.000000000 ^S | -359,882.81 | -28,895,416 | 0 | -1,574,373 | -1,574,373 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,042.19000 | | 7/11/2016 | | -11,042.19 | -838,284 | 1.000000000 ^S | -11,042.19 | -886,590 | 0 | -48,306 | -48,306 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -123,264.71000 | | 7/12/2016 | | -123,264.71 | -9,538,466 | 1.000000000 ^S | -123,264.71 | -9,897,069 | 0 | -358,603 | -358,603 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -253,623.43000 | | 7/14/2016 | | -253,623.43 | -20,172,228 | 1.000000000 ^S | -253,623.43 | -20,363,725 | 0 | -191,497 | -191,497 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -78,638.63000 | | 7/14/2016 | | -78,638.63 | -6,254,613 | 1.000000000 ^S | -78,638.63 | -6,313,988 | 0 | -59,375 | -59,375 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -6,630.58000 | | 7/14/2016 | | -6,630.58 | -527,371 | 1.000000000 ^S | -6,630.58 | -532,377 | 0 | -5,006 | -5,006 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -105,691.38000 | | 7/20/2016 | | -105,691.38 | -8,420,947 | 1.000000000 ^S | -105,691.38 | -8,486,086 | 0 | -65,139 | -65,139 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -26,928.63000 | | 7/22/2016 | | -26,928.63 | -2,148,021 | 1.000000000 ^S | -26,928.63 | -2,162,132 | 0 | -14,111 | -14,111 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,865.10000 | | 7/29/2016 | | -11,865.10 | -934,463 | 1.000000000 ^S | -11,865.10 | -952,663 | 0 | -18,200 | -18,200 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -64,818.19000 | | 8/2/2016 | | -64,818.19 | -5,014,401 | 1.000000000 ^S | -64,818.19 | -5,204,329 | 0 | -189,928 | -189,928 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -19,853.51000 | | 8/2/2016 | | -19,853.51 | -1,535,888 | 1.000000000 ^S | -19,853.51 | -1,594,062 | 0 | -58,174 | -58,174 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -181,375.34000 | | 8/3/2016 | | -181,375.34 | -13,938,155 | 1.000000000 ^S | -181,375.34 | -14,562,840 | 0 | -624,685 | -624,685 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -25,260.07000 | | 8/4/2016 | | -25,260.07 | -1,938,997 | 1.000000000 ^S | -25,260.07 | -2,028,161 | 0 | -89,164 | -89,164 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -356,084.08000 | | 8/12/2016 | | -356,084.08 | -27,843,105 | 1.000000000 ^S | -356,084.08 | -28,590,411 | 0 | -747,306 | -747,306 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -42,406.06000 | | 8/12/2016 | | -42,406.06 | -3,315,836 | 1.000000000 ^S | -42,406.06 | -3,404,833 | 0 | -88,997 | -88,997 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -33,369.43000 | | 8/16/2016 | | -33,369.43 | -2,591,016 | 1.000000000 ^S | -33,369.43 | -2,679,271 | 0 | -88,255 | -88,255 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -146,047.78000 | | 8/17/2016 | | -146,047.78 | -11,265,304 | 1.000000000 ^S | -146,047.78 | -11,726,349 | 0 | -461,045 | -461,045 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -12,365.22000 | | 8/18/2016 | | -12,365.22 | -946,746 | 1.000000000 ^S | -12,365.22 | -992,818 | 0 | -46,072 | -46,072 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -25,656.87000 | | 8/19/2016 | | -25,656.87 | -1,972,799 | 1.000000000 ^S | -25,656.87 | -2,060,020 | 0 | -87,221 | -87,221 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -62,280.99000 | | 8/22/2016 | | -62,280.99 | -4,755,276 | 1.000000000 ^S | -62,280.99 | -5,000,614 | 0 | -245,338 | -245,338 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -115,979.16000 | | 8/23/2016 | | -115,979.16 | -8,883,458 | 1.000000000 ^S | -115,979.16 | -9,312,104 | 0 | -428,646 | -428,646 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -45,244.15000 | | 8/24/2016 | | -45,244.15 | -3,466,822 | 1.000000000 ^S | -45,244.15 | -3,632,706 | 0 | -165,884 | -165,884 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -118,911.22000 | | 8/25/2016 | | -118,911.22 | -9,101,467 | 1.000000000 ^S | -118,911.22 | -9,547,522 | 0 | -446,055 | -446,055 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -18,695.42000 | | 9/2/2016 | | -18,695.42 | -1,456,164 | 1.000000000 ^S | -18,695.42 | -1,501,077 | 0 | -44,913 | -44,913 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -647,737.56000 | | 9/8/2016 | | -647,737.56 | -50,558,123 | 1.000000000 ^S | -647,737.56 | -52,007,614 | 0 | -1,449,491 | -1,449,491 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -349,412.93000 | | 9/12/2016 | | -349,412.93 | -27,165,953 | 1.000000000 ^S | -349,412.93 | -28,054,777 | 0 | -888,824 | -888,824 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,748.89000 | | 9/15/2016 | | -17,748.89 | -1,360,703 | 1.000000000 ^S | -17,748.89 | -1,425,079 | 0 | -64,376 | -64,376 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -179,125.75000 | | 9/21/2016 | | -179,125.75 | -13,765,066 | 1.000000000 ^S | -179,125.75 | -14,382,218 | 0 | -617,152 | -617,152 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -355,570.37000 | | 10/12/2016 | | -355,570.37 | -27,813,188 | 1.000000000 ^S | -355,570.37 | -28,549,165 | 0 | -735,977 | -735,977 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -87,209.56000 | | 10/14/2016 | | -87,209.56 | -6,810,737 | 1.000000000 ^S | -87,209.56 | -7,002,159 | 0 | -191,422 | -191,422 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -49,550.92000 | | 10/20/2016 | | -49,550.92 | -3,937,169 | 1.000000000 ^S | -49,550.92 | -3,978,502 | 0 | -41,333 | -41,333 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -108,096.46000 | | 10/26/2016 | | -108,096.46 | -8,631,787 | 1.000000000 ^S | -108,096.46 | -8,679,192 | 0 | -47,405 | -47,405 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -6,022.62000 | | 11/9/2016 | | -6,022.62 | -486,973 | 1.000000000 ^S | -6,022.62 | -483,563 | 0 | 3,410 | 3,410 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -358,077.71000 | | 11/14/2016 | | -358,077.71 | -28,775,830 | 1.000000000 ^S | -358,077.71 | -28,750,482 | 0 | 25,348 | 25,348 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -105,736.37000 | | 11/15/2016 | | -105,736.37 | -8,633,411 | 1.000000000 ^S | -105,736.37 | -8,489,698 | 0 | 143,713 | 143,713 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -8,950.00000 | | 11/16/2016 | | -8,950.00 | -735,749 | 1.000000000 ^S | -8,950.00 | -718,606 | 0 | 17,143 | 17,143 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -43,039.27000 | | 11/18/2016 | | -43,039.27 | -3,517,706 | 1.000000000 ^S | -43,039.27 | -3,455,674 | 0 | 62,032 | 62,032 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -29,290.91000 | | 11/25/2016 | | -29,290.91 | -2,456,555 | 1.000000000 ^S | -29,290.91 | -2,351,802 | 0 | 104,753 | 104,753 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -51,254.81000 | | 11/30/2016 | | -51,254.81 | -4,320,135 | 1.000000000 ^S | -51,254.81 | -4,115,309 | 0 | 204,826 | 204,826 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -156,086.08000 | | 12/1/2016 | | -156,086.08 | -13,140,616 | 1.000000000 ^S | -156,086.08 | -12,532,336 | 0 | 608,280 | 608,280 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -99,004.27000 | | 12/2/2016 | | -99,004.27 | -8,385,070 | 1.000000000 ^S | -99,004.27 | -7,949,170 | 0 | 435,900 | 435,900 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -241,950.12000 | | 12/6/2016 | | -241,950.12 | -20,677,187 | 1.000000000 ^S | -241,950.12 | -19,426,461 | 0 | 1,250,726 | 1,250,726 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -52,956.42000 | | 12/7/2016 | | -52,956.42 | -4,499,736 | 1.000000000 ^S | -52,956.42 | -4,251,934 | 0 | 247,802 | 247,802 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -352,726.96000 | | 12/9/2016 | | -352,726.96 | -29,973,125 | 1.000000000 ^S | -352,726.96 | -28,320,864 | 0 | 1,652,261 | 1,652,261 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -9,409.35000 | | 12/12/2016 | | -9,409.35 | -807,660 | 1.000000000 ^S | -9,409.35 | -755,488 | 0 | 52,172 | 52,172 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -242,673.60000 | | 12/14/2016 | | -242,673.60 | -20,968,061 | 1.000000000 ^S | -242,673.60 | -19,484,550 | 0 | 1,483,511 | 1,483,511 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -8,765.00000 | | 12/16/2016 | | -8,765.00 | -764,049 | 1.000000000 ^S | -8,765.00 | -703,752 | 0 | 60,297 | 60,297 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -63,041.53000 | | 12/19/2016 | | -63,041.53 | -5,432,127 | 1.000000000 ^S | -63,041.53 | -5,061,679 | 0 | 370,448 | 370,448 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -113,105.55000 | | 12/22/2016 | | -113,105.55 | -9,651,835 | 1.000000000 ^S | -113,105.55 | -9,081,378 | 0 | 570,457 | 570,457 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -202,488.26000 | | 12/28/2016 | | -202,488.26 | -17,117,239 | 1.000000000 ^S | -202,488.26 | -16,258,022 | 0 | 859,217 | 859,217 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,327.64000 | | 12/29/2016 | | -17,327.64 | -1,462,733 | 1.000000000 ^S | -17,327.64 | -1,391,257 | 0 | 71,476 | 71,476 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -1,900.70000 | | 12/30/2016 | | -1,900.70 | -159,632 | 1.000000000 ^S | -1,900.70 | -152,609 | 0 | 7,023 | 7,023 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,618.00000 | | 1/4/2017 | | -17,618.00 | -1,501,301 | 1.000000000 ^S | -17,618.00 | -1,414,570 | 0 | 86,731 | 86,731 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -550,762.83000 | | 1/5/2017 | | -550,762.83 | -47,018,808 | 1.000000000 ^S | -550,762.83 | -44,221,398 | 0 | 2,797,410 | 2,797,410 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -46,205.35000 | | 1/6/2017 | | -46,205.35 | -3,920,910 | 1.000000000 ^S | -46,205.35 | -3,709,882 | 0 | 211,028 | 211,028 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -75,551.78000 | | 1/11/2017 | | -75,551.78 | -6,438,078 | 1.000000000 ^S | -75,551.78 | -6,066,142 | 0 | 371,936 | 371,936 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -349,599.06000 | | 1/12/2017 | | -349,599.06 | -30,063,342 | 1.000000000 ^S | -349,599.06 | -28,069,721 | 0 | 1,993,621 | 1,993,621 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,816.04000 | | 1/12/2017 | | -11,816.04 | -1,016,106 | 1.000000000 ^S | -11,816.04 | -948,724 | 0 | 67,382 | 67,382 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -78,835.06000 | | 1/18/2017 | | -78,835.06 | -6,719,133 | 1.000000000 ^S | -78,835.06 | -6,329,760 | 0 | 389,373 | 389,373 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -11,222.99000 | | 1/18/2017 | | -11,222.99 | -956,538 | 1.000000000 ^S | -11,222.99 | -901,107 | 0 | 55,431 | 55,431 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -6,647.14000 | | 1/18/2017 | | -6,647.14 | -566,537 | 1.000000000 ^S | -6,647.14 | -533,707 | 0 | 32,830 | 32,830 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -57,843.82000 | | 1/20/2017 | | -57,843.82 | -5,033,172 | 1.000000000 ^S | -57,843.82 | -4,644,349 | 0 | 388,823 | 388,823 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -59,564.39000 | | 1/23/2017 | | -59,564.39 | -5,172,781 | 1.000000000 ^S | -59,564.39 | -4,782,495 | 0 | 390,286 | 390,286 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -120,856.84000 | | 1/24/2017 | | -120,856.84 | -10,353,246 | 1.000000000 ^S | -120,856.84 | -9,703,738 | 0 | 649,508 | 649,508 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -105,955.38000 | | 1/24/2017 | | -105,955.38 | -9,076,707 | 1.000000000 ^S | -105,955.38 | -8,507,283 | 0 | 569,424 | 569,424 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -186,290.44000 | | 1/27/2017 | | -186,290.44 | -16,102,463 | 1.000000000 ^S | -186,290.44 | -14,957,479 | 0 | 1,144,984 | 1,144,984 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -72,198.29000 | | 1/27/2017 | | -72,198.29 | -6,240,633 | 1.000000000 ^S | -72,198.29 | -5,796,886 | 0 | 443,747 | 443,747 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -66,189.39000 | | 2/1/2017 | | -66,189.39 | -5,656,632 | 1.000000000 ^S | -66,189.39 | -5,314,424 | 0 | 342,208 | 342,208 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,013.34000 | | 2/2/2017 | | -17,013.34 | -1,460,104 | 1.000000000 ^S | -17,013.34 | -1,366,021 | 0 | 94,083 | 94,083 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -10,224.17000 | | 2/7/2017 | | -10,224.17 | -877,520 | 1.000000000 ^S | -10,224.17 | -820,911 | 0 | 56,609 | 56,609 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -177,969.53000 | | 2/9/2017 | | -177,969.53 | -15,213,556 | 1.000000000 ^S | -177,969.53 | -14,289,384 | 0 | 924,172 | 924,172 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -344,229.20000 | | 2/10/2017 | | -344,229.20 | -29,662,809 | 1.000000000 ^S | -344,229.20 | -27,638,569 | 0 | 2,024,240 | 2,024,240 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -152,291.16000 | | 2/13/2017 | | -152,291.16 | -13,270,154 | 1.000000000 ^S | -152,291.16 | -12,227,637 | 0 | 1,042,517 | 1,042,517 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -967,326.20000 | | 2/15/2017 | | -967,326.20 | -84,398,304 | 1.000000000 ^S | -967,326.20 | -77,667,763 | 0 | 6,730,541 | 6,730,541 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -71,449.49000 | | 2/16/2017 | | -71,449.49 | -6,292,028 | 1.000000000 ^S | -71,449.49 | -5,736,764 | 0 | 555,264 | 555,264 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -34,639.01000 | | 2/23/2017 | | -34,639.01 | -3,017,462 | 1.000000000 ^S | -34,639.01 | -2,781,207 | 0 | 236,255 | 236,255 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -52,248.31000 | | 3/1/2017 | | -52,248.31 | -4,494,545 | 1.000000000 ^S | -52,248.31 | -4,195,079 | 0 | 299,466 | 299,466 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -44,953.93000 | | 3/3/2017 | | -44,953.93 | -3,898,960 | 1.000000000 ^S | -44,953.93 | -3,609,404 | 0 | 289,556 | 289,556 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -185,905.53000 | | 3/8/2017 | | -185,905.53 | -16,102,616 | 1.000000000 ^S | -185,905.53 | -14,926,575 | 0 | 1,176,041 | 1,176,041 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,158.43000 | | 3/9/2017 | | -11,158.43 | -965,561 | 1.000000000 ^S | -11,158.43 | -895,924 | 0 | 69,637 | 69,637 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -334,340.29000 | | 3/10/2017 | | -334,340.29 | -28,791,636 | 1.000000000 ^S | -334,340.29 | -26,844,577 | 0 | 1,947,059 | 1,947,059 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -189,359.17000 | | 3/14/2017 | | -189,359.17 | -16,457,305 | 1.000000000 ^S | -189,359.17 | -15,203,871 | 0 | 1,253,434 | 1,253,434 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -201,782.17000 | | 3/15/2017 | | -201,782.17 | -17,521,607 | 1.000000000 ^S | -201,782.17 | -16,201,329 | 0 | 1,320,278 | 1,320,278 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -93,724.51000 | | 3/16/2017 | | -93,724.51 | -8,160,137 | 1.000000000 ^S | -93,724.51 | -7,525,252 | 0 | 634,885 | 634,885 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -951,148.84000 | | 3/17/2017 | | -951,148.84 | -82,485,587 | 1.000000000 ^S | -951,148.84 | -76,368,864 | 0 | 6,116,723 | 6,116,723 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -49,845.77000 | | 3/21/2017 | | -49,845.77 | -4,339,671 | 1.000000000 ^S | -49,845.77 | -4,002,176 | 0 | 337,495 | 337,495 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -97,972.14000 | | 3/22/2017 | | -97,972.14 | -8,458,699 | 1.000000000 ^S | -97,972.14 | -7,866,299 | 0 | 592,400 | 592,400 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -129,338.35000 | | 3/24/2017 | | -129,338.35 | -10,986,556 | 1.000000000 ^S | -129,338.35 | -10,384,729 | 0 | 601,827 | 601,827 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -35,149.28000 | | 3/29/2017 | | -35,149.28 | -2,959,437 | 1.000000000 ^S | -35,149.28 | -2,822,177 | 0 | 137,260 | 137,260 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -121,963.21000 | | 4/3/2017 | | -121,963.21 | -10,367,407 | 1.000000000 ^S | -121,963.21 | -9,792,570 | 0 | 574,837 | 574,837 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,011.29000 | | 4/4/2017 | | -17,011.29 | -1,434,849 | 1.000000000 ^S | -17,011.29 | -1,365,857 | 0 | 68,992 | 68,992 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -99,836.86000 | | 4/5/2017 | | -99,836.86 | -8,339,503 | 1.000000000 ^S | -99,836.86 | -8,016,019 | 0 | 323,484 | 323,484 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -321,826.20000 | | 4/11/2017 | | -321,826.20 | -26,821,039 | 1.000000000 ^S | -321,826.20 | -25,839,806 | 0 | 981,233 | 981,233 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -2,535.89000 | | 4/13/2017 | | -2,535.89 | -208,025 | 1.000000000 ^S | -2,535.89 | -203,610 | 0 | 4,415 | 4,415 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,906.57000 | | 4/24/2017 | | -17,906.57 | -1,469,466 | 1.000000000 ^S | -17,906.57 | -1,437,740 | 0 | 31,726 | 31,726 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -97,737.47000 | | 4/26/2017 | | -97,737.47 | -8,168,487 | 1.000000000 ^S | -97,737.47 | -7,847,457 | 0 | 321,030 | 321,030 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -72,720.60000 | | 4/26/2017 | | -72,720.60 | -6,077,682 | 1.000000000 ^S | -72,720.60 | -5,838,823 | 0 | 238,859 | 238,859 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -6,131.59000 | | 4/26/2017 | | -6,131.59 | -512,453 | 1.000000000 ^S | -6,131.59 | -492,313 | 0 | 20,140 | 20,140 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -5,770,905.72000 | | 5/2/2017 | | -5,770,905.72 | -481,079,087 | 1.000000000 ^S | -5,770,905.72 | -463,352,836 | 0 | 17,726,251 | 17,726,251 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -757,937.72000 | | 5/8/2017 | | -757,937.72 | -63,229,524 | 1.000000000 ^S | -757,937.72 | -60,855,715 | 0 | 2,373,809 | 2,373,809 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -93,372.59000 | | 5/11/2017 | | -93,372.59 | -7,870,999 | 1.000000000 ^S | -93,372.59 | -7,496,996 | 0 | 374,003 | 374,003 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -277,865.98000 | | 5/12/2017 | | -277,865.98 | -23,283,752 | 1.000000000 ^S | -277,865.98 | -22,310,188 | 0 | 973,564 | 973,564 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -83,218.51000 | | 5/12/2017 | | -83,218.51 | -6,973,287 | 1.000000000 ^S | -83,218.51 | -6,681,712 | 0 | 291,575 | 291,575 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -87,633.54000 | | 5/15/2017 | | -87,633.54 | -7,339,187 | 1.000000000 ^S | -87,633.54 | -7,036,200 | 0 | 302,987 | 302,987 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -161,718.79000 | | 5/16/2017 | | -161,718.79 | -13,634,189 | 1.000000000 ^S | -161,718.79 | -12,984,593 | 0 | 649,596 | 649,596 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -51,805.98000 | | 5/17/2017 | | -51,805.98 | -4,351,820 | 1.000000000 ^S | -51,805.98 | -4,159,563 | 0 | 192,257 | 192,257 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -215,576.55000 | | 5/19/2017 | | -215,576.55 | -17,787,680 | 1.000000000 ^S | -215,576.55 | -17,308,896 | 0 | 478,784 | 478,784 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -339,293.20000 | | 5/22/2017 | | -339,293.20 | -28,164,073 | 1.000000000 ^S | -339,293.20 | -27,242,252 | 0 | 921,821 | 921,821 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -105,085.63000 | | 5/24/2017 | | -105,085.63 | -8,748,278 | 1.000000000 ^S | -105,085.63 | -8,437,449 | 0 | 310,829 | 310,829 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -35,824.15000 | | 5/26/2017 | | -35,824.15 | -2,994,583 | 1.000000000 ^S | -35,824.15 | -2,876,363 | 0 | 118,220 | 118,220 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -85,534.03000 | | 6/1/2017 | | -85,534.03 | -7,041,589 | 1.000000000 ^S | -85,534.03 | -6,867,628 | 0 | 173,961 | 173,961 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -184,424.56000 | | 6/6/2017 | | -184,424.56 | -15,242,969 | 1.000000000 ^S | -184,424.56 | -14,807,666 | 0 | 435,303 | 435,303 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -268,856.14000 | | 6/9/2017 | | -268,856.14 | -22,316,945 | 1.000000000 ^S | -268,856.14 | -21,586,777 | 0 | 730,168 | 730,168 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -48,274.55000 | | 6/16/2017 | | -48,274.55 | -4,048,407 | 1.000000000 ^S | -48,274.55 | -3,876,021 | 0 | 172,386 | 172,386 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -28,558.93000 | | 6/19/2017 | | -28,558.93 | -2,409,398 | 1.000000000 ^S | -28,558.93 | -2,293,030 | 0 | 116,368 | 116,368 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -32,535.99000 | | 6/22/2017 | | -32,535.99 | -2,741,102 | 1.000000000 ^S | -32,535.99 | -2,612,353 | 0 | 128,749 | 128,749 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -36,028.00000 | | 6/27/2017 | | -36,028.00 | -3,046,343 | 1.000000000 ^S | -36,028.00 | -2,892,731 | 0 | 153,612 | 153,612 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -85,677.03000 | | 6/28/2017 | | -85,677.03 | -7,298,656 | 1.000000000 ^S | -85,677.03 | -6,879,110 | 0 | 419,546 | 419,546 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -50,207.38000 | | 6/29/2017 | | -50,207.38 | -4,284,996 | 1.000000000 ^S | -50,207.38 | -4,031,210 | 0 | 253,786 | 253,786 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -17,179.10000 | | 6/30/2017 | | -17,179.10 | -1,485,268 | 1.000000000 ^S | -17,179.10 | -1,379,330 | 0 | 105,938 | 105,938 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -24,916.13000 | | 7/6/2017 | | -24,916.13 | -2,139,501 | 1.000000000 ^S | -24,916.13 | -2,000,546 | 0 | 138,955 | 138,955 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -70,337.04000 | | 7/7/2017 | | -70,337.04 | -6,033,979 | 1.000000000 ^S | -70,337.04 | -5,647,444 | 0 | 386,535 | 386,535 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -268,122.83000 | | 7/11/2017 | | -268,122.83 | -23,253,058 | 1.000000000 ^S | -268,122.83 | -21,527,899 | 0 | 1,725,159 | 1,725,159 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -94,299.32000 | | 7/12/2017 | | -94,299.32 | -8,216,368 | 1.000000000 ^S | -94,299.32 | -7,571,404 | 0 | 644,964 | 644,964 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -48,129.04000 | | 7/13/2017 | | -48,129.04 | -4,176,056 | 1.000000000 ^S | -48,129.04 | -3,864,337 | 0 | 311,719 | 311,719 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -94,307.37000 | | 7/14/2017 | | -94,307.37 | -8,260,227 | 1.000000000 ^S | -94,307.37 | -7,572,050 | 0 | 688,177 | 688,177 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -224,064.11000 | | 7/18/2017 | | -224,064.11 | -19,759,163 | 1.000000000 ^S | -224,064.11 | -17,990,372 | 0 | 1,768,791 | 1,768,791 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -62,985.03000 | | 7/18/2017 | | -62,985.03 | -5,554,354 | 1.000000000 ^S | -62,985.03 | -5,057,142 | 0 | 497,212 | 497,212 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -5,310.71000 | | 7/18/2017 | | -5,310.71 | -468,327 | 1.000000000 ^S | -5,310.71 | -426,403 | 0 | 41,924 | 41,924 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -84,652.73000 | | 7/19/2017 | | -84,652.73 | -7,503,258 | 1.000000000 ^S | -84,652.73 | -6,796,868 | 0 | 706,390 | 706,390 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -57,508.35000 | | 7/24/2017 | | -57,508.35 | -5,058,492 | 1.000000000 ^S | -57,508.35 | -4,617,413 | 0 | 441,079 | 441,079 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -34,173.40000 | | 7/27/2017 | | -34,173.40 | -3,033,016 | 1.000000000 ^S | -34,173.40 | -2,743,823 | 0 | 289,193 | 289,193 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -42,955.96000 | | 7/28/2017 | | -42,955.96 | -3,821,788 | 1.000000000 ^S | -42,955.96 | -3,448,985 | 0 | 372,803 | 372,803 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -34,563.35000 | | 8/1/2017 | | -34,563.35 | -3,048,960 | 1.000000000 ^S | -34,563.35 | -2,775,132 | 0 | 273,828 | 273,828 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -11,898.68000 | | 8/2/2017 | | -11,898.68 | -1,046,921 | 1.000000000 ^S | -11,898.68 | -955,359 | 0 | 91,562 | 91,562 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -251,943.26000 | | 8/8/2017 | | -251,943.26 | -22,077,618 | 1.000000000 ^S | -251,943.26 | -20,228,822 | 0 | 1,848,796 | 1,848,796 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -129,223.68000 | | 8/8/2017 | | -129,223.68 | -11,323,784 | 1.000000000 ^S | -129,223.68 | -10,375,522 | 0 | 948,262 | 948,262 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -26,983.86000 | | 8/9/2017 | | -26,983.86 | -2,360,030 | 1.000000000 ^S | -26,983.86 | -2,166,566 | 0 | 193,464 | 193,464 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -5,436.08000 | | 8/10/2017 | | -5,436.08 | -470,606 | 1.000000000 ^S | -5,436.08 | -436,469 | 0 | 34,137 | 34,137 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -261,862.81000 | | 8/14/2017 | | -261,862.81 | -22,503,263 | 1.000000000 ^S | -261,862.81 | -21,025,274 | 0 | 1,477,989 | 1,477,989 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -38,687.10000 | | 8/14/2017 | | -38,687.10 | -3,324,588 | 1.000000000 ^S | -38,687.10 | -3,106,233 | 0 | 218,355 | 218,355 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -234,673.89000 | | 8/16/2017 | | -234,673.89 | -20,287,202 | 1.000000000 ^S | -234,673.89 | -18,842,244 | 0 | 1,444,958 | 1,444,958 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -151,106.11000 | | 8/17/2017 | | -151,106.11 | -13,198,995 | 1.000000000 ^S | -151,106.11 | -12,132,488 | 0 | 1,066,507 | 1,066,507 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -23,853.89000 | | 8/18/2017 | | -23,853.89 | -2,076,341 | 1.000000000 ^S | -23,853.89 | -1,915,257 | 0 | 161,084 | 161,084 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -128,055.35000 | | 8/22/2017 | | -128,055.35 | -11,058,464 | 1.000000000 ^S | -128,055.35 | -10,281,715 | 0 | 776,749 | 776,749 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -20,640.91000 | | 8/23/2017 | | -20,640.91 | -1,790,067 | 1.000000000 ^S | -20,640.91 | -1,657,283 | 0 | 132,784 | 132,784 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -47,297.81000 | | 8/29/2017 | | -47,297.81 | -4,106,488 | 1.000000000 ^S | -47,297.81 | -3,797,597 | 0 | 308,891 | 308,891 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -1,347,714.81000 | | 8/30/2017 | | -1,347,714.81 | -116,950,732 | 1.000000000 ^S | -1,347,714.81 | -108,209,614 | 0 | 8,741,118 | 8,741,118 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -1,203,000.00000 | | 8/30/2017 | | -1,203,000.00 | -104,392,806 | 1.000000000 ^S | -1,203,000.00 | -96,590,291 | 0 | 7,802,515 | 7,802,515 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -30,083.55000 | | 8/30/2017 | | -30,083.55 | -2,610,562 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -30,083.55 | -2,415,444 | 0 | 195,118 | 195,118 |
| -83,968.93000 | | 9/5/2017 | | -83,968.93 | -7,314,593 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -83,968.93 | -6,741,965 | 0 | 572,628 | 572,628 |
| -61,112.18000 | | 9/8/2017 | | -61,112.18 | -5,325,375 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -61,112.18 | -4,906,769 | 0 | 418,606 | 418,606 |
| -245,747.74000 | | 9/11/2017 | | -245,747.74 | -21,382,314 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -245,747.74 | -19,731,376 | 0 | 1,650,938 | 1,650,938 |
| -18,460.20000 | | 9/11/2017 | | -18,460.20 | -1,606,207 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -18,460.20 | -1,482,191 | 0 | 124,016 | 124,016 |
| -110,577.39000 | | 9/12/2017 | | -110,577.39 | -9,667,378 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -110,577.39 | -8,878,389 | 0 | 788,989 | 788,989 |
| -140,374.85000 | | 9/14/2017 | | -140,374.85 | -12,413,249 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -140,374.85 | -11,270,862 | 0 | 1,142,387 | 1,142,387 |
| -93,807.37000 | | 9/15/2017 | | -93,807.37 | -8,281,886 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -93,807.37 | -7,531,905 | 0 | 749,981 | 749,981 |
| -94,643.60000 | | 9/20/2017 | | -94,643.60 | -8,441,750 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -94,643.60 | -7,599,046 | 0 | 842,704 | 842,704 |
| -37,527.78000 | | 9/26/2017 | | -37,527.78 | -3,332,691 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -37,527.78 | -3,013,150 | 0 | 319,541 | 319,541 |
| -20,531.50000 | | 9/28/2017 | | -20,531.50 | -1,818,416 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -20,531.50 | -1,648,498 | 0 | 169,918 | 169,918 |
| -233,742.95000 | | 9/29/2017 | | -233,742.95 | -20,642,355 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -233,742.95 | -18,767,498 | 0 | 1,874,857 | 1,874,857 |
| -149,591.47000 | | 10/5/2017 | | -149,591.47 | -13,246,493 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -149,591.47 | -12,010,876 | 0 | 1,235,617 | 1,235,617 |
| -25,802.59000 | | 10/6/2017 | | -25,802.59 | -2,268,258 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -25,802.59 | -2,071,720 | 0 | 196,538 | 196,538 |
| -250,526.60000 | | 10/12/2017 | | -250,526.60 | -21,872,667 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -250,526.60 | -20,115,077 | 0 | 1,757,590 | 1,757,590 |

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -150,522.57000 | | 10/12/2017 | | -150,522.57 | -13,141,639 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -150,522.57 | -12,085,635 | 0 | 1,056,004 | 1,056,004 |
| -58,012.04000 | | 10/16/2017 | | -58,012.04 | -5,122,230 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -58,012.04 | -4,657,855 | 0 | 464,375 | 464,375 |
| -4,891.40000 | | 10/16/2017 | | -4,891.40 | -431,891 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -4,891.40 | -392,736 | 0 | 39,155 | 39,155 |
| -8,629.54000 | | 10/19/2017 | | -8,629.54 | -763,983 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -8,629.54 | -692,876 | 0 | 71,107 | 71,107 |
| -79,173.19000 | | 10/20/2017 | | -79,173.19 | -7,021,242 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -79,173.19 | -6,356,909 | 0 | 664,333 | 664,333 |
| -73,221.02000 | | 10/24/2017 | | -73,221.02 | -6,498,544 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -73,221.02 | -5,879,002 | 0 | 619,542 | 619,542 |
| -53,753.51000 | | 10/24/2017 | | -53,753.51 | -4,770,755 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -53,753.51 | -4,315,933 | 0 | 454,822 | 454,822 |
| -1,778,714.81000 | | 10/25/2017 | | -1,778,714.81 | -157,587,713 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -1,778,714.81 | -142,815,113 | 0 | 14,772,600 | 14,772,600 |
| -1,390,000.00000 | | 10/25/2017 | | -1,390,000.00 | -123,148,983 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -1,390,000.00 | -111,604,742 | 0 | 11,544,241 | 11,544,241 |
| -59,387.12000 | | 10/25/2017 | | -59,387.12 | -5,261,485 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -59,387.12 | -4,768,262 | 0 | 493,223 | 493,223 |
| -7,958.77000 | | 10/31/2017 | | -7,958.77 | -691,905 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -7,958.77 | -639,019 | 0 | 52,886 | 52,886 |
| -30,242.86000 | | 11/2/2017 | | -30,242.86 | -2,647,087 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -30,242.86 | -2,428,235 | 0 | 218,852 | 218,852 |
| -98,737.84000 | | 11/8/2017 | | -98,737.84 | -8,600,813 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -98,737.84 | -7,927,778 | 0 | 673,035 | 673,035 |
| -9,009.98000 | | 11/9/2017 | | -9,009.98 | -785,309 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -9,009.98 | -723,422 | 0 | 61,887 | 61,887 |
| -247,808.62000 | | 11/10/2017 | | -247,808.62 | -21,573,723 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -247,808.62 | -19,896,847 | 0 | 1,676,876 | 1,676,876 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -141,305.97000 | | 11/14/2017 | | -141,305.97 | -12,248,394 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -141,305.97 | -11,345,623 | 0 | 902,771 | 902,771 |
| -64,748.95000 | | 11/20/2017 | | -64,748.95 | -5,487,267 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -64,748.95 | -5,198,770 | 0 | 288,497 | 288,497 |
| -32,436.77000 | | 11/22/2017 | | -32,436.77 | -2,764,939 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -32,436.77 | -2,604,387 | 0 | 160,552 | 160,552 |
| -203,554.78000 | | 11/24/2017 | | -203,554.78 | -17,261,865 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -203,554.78 | -16,343,654 | 0 | 918,211 | 918,211 |
| -42,562.46000 | | 11/28/2017 | | -42,562.46 | -3,600,917 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -42,562.46 | -3,417,390 | 0 | 183,527 | 183,527 |
| -99,582.58000 | | 12/1/2017 | | -99,582.58 | -8,459,807 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -99,582.58 | -7,995,603 | 0 | 464,204 | 464,204 |
| -47,244.20000 | | 12/7/2017 | | -47,244.20 | -4,017,059 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -47,244.20 | -3,793,293 | 0 | 223,766 | 223,766 |
| -13,390.76000 | | 12/8/2017 | | -13,390.76 | -1,135,904 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -13,390.76 | -1,075,160 | 0 | 60,744 | 60,744 |
| -246,793.05000 | | 12/11/2017 | | -246,793.05 | -21,044,157 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -246,793.05 | -19,815,305 | 0 | 1,228,852 | 1,228,852 |
| -30,330.71000 | | 12/11/2017 | | -30,330.71 | -2,586,314 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -30,330.71 | -2,435,289 | 0 | 151,025 | 151,025 |
| -85,954.84000 | | 12/12/2017 | | -85,954.84 | -7,349,616 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -85,954.84 | -6,901,416 | 0 | 448,200 | 448,200 |
| -55,703.20000 | | 12/13/2017 | | -55,703.20 | -4,782,497 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -55,703.20 | -4,472,476 | 0 | 310,021 | 310,021 |
| -126,098.54000 | | 12/19/2017 | | -126,098.54 | -10,875,723 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -126,098.54 | -10,124,601 | 0 | 751,122 | 751,122 |
| -39,931.85000 | | 12/20/2017 | | -39,931.85 | -3,451,152 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -39,931.85 | -3,206,175 | 0 | 244,977 | 244,977 |
| -28,911.07000 | | 1/5/2018 | | -28,911.07 | -2,563,200 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -28,911.07 | -2,321,304 | 0 | 241,896 | 241,896 |

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

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

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

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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -245,282.90000 | | 1/12/2018 | | -245,282.90 | -21,514,923 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -245,282.90 | -19,694,054 | 0 | 1,820,869 | 1,820,869 |
| -12,441.34000 | | 1/12/2018 | | -12,441.34 | -1,091,289 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -12,441.34 | -998,930 | 0 | 92,359 | 92,359 |
| -35,513.33000 | | 1/16/2018 | | -35,513.33 | -3,129,459 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -35,513.33 | -2,851,407 | 0 | 278,052 | 278,052 |
| -56,303.33000 | | 1/22/2018 | | -56,303.33 | -4,983,918 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -56,303.33 | -4,520,661 | 0 | 463,257 | 463,257 |
| -73,732.89000 | | 1/24/2018 | | -73,732.89 | -6,506,404 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -73,732.89 | -5,920,101 | 0 | 586,303 | 586,303 |
| -54,860.23000 | | 1/24/2018 | | -54,860.23 | -4,841,026 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -54,860.23 | -4,404,793 | 0 | 436,233 | 436,233 |
| -4,625.65000 | | 1/24/2018 | | -4,625.65 | -408,181 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -4,625.65 | -371,399 | 0 | 36,782 | 36,782 |
| 104,867.61000 | | 1/29/2018 | | -104,867.61 | -9,216,108 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -104,867.61 | -8,419,944 | 0 | 796,164 | 796,164 |
| 315,218.62000 | | 1/30/2018 | | -315,218.62 | -27,821,128 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -315,218.62 | -25,309,275 | 0 | 2,511,853 | 2,511,853 |
| -92,606.37000 | | 1/31/2018 | | -92,606.37 | -8,151,384 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -92,606.37 | -7,435,475 | 0 | 715,909 | 715,909 |
| -42,223.81000 | | 2/8/2018 | | -42,223.81 | -3,622,522 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -42,223.81 | -3,390,200 | 0 | 232,322 | 232,322 |
| -240,819.94000 | | 2/9/2018 | | -240,819.94 | -20,510,385 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -240,819.94 | -19,335,717 | 0 | 1,174,668 | 1,174,668 |
| -114,626.90000 | | 2/9/2018 | | -114,626.90 | -9,762,655 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -114,626.90 | -9,203,529 | 0 | 559,126 | 559,126 |
| -54,329.53000 | | 2/15/2018 | | -54,329.53 | -4,574,151 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -54,329.53 | -4,362,182 | 0 | 211,969 | 211,969 |
| -8,354.61000 | | 2/23/2018 | | -8,354.61 | -701,268 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -8,354.61 | -670,802 | 0 | 30,466 | 30,466 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -241,131.03000 | | 3/9/2018 | | -241,131.03 | -19,903,757 | 1.000000000 ^S | -241,131.03 | -19,360,695 | 0 | 543,062 | 543,062 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,810.63000 | | 3/15/2018 | | -11,810.63 | -987,676 | 1.000000000 ^S | -11,810.63 | -948,289 | 0 | 39,387 | 39,387 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -71,875.05000 | | 3/23/2018 | | -71,875.05 | -5,825,270 | 1.000000000 ^S | -71,875.05 | -5,770,933 | 0 | 54,337 | 54,337 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -42,568.15000 | | 3/26/2018 | | -42,568.15 | -3,447,582 | 1.000000000 ^S | -42,568.15 | -3,417,847 | 0 | 29,735 | 29,735 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -50,297.76000 | | 3/27/2018 | | -50,297.76 | -4,076,366 | 1.000000000 ^S | -50,297.76 | -4,038,467 | 0 | 37,899 | 37,899 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -1,535.28000 | | 4/9/2018 | | -1,535.28 | -126,334 | 1.000000000 ^S | -1,535.28 | -123,269 | 0 | 3,065 | 3,065 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -88,985.26000 | | 4/10/2018 | | -88,985.26 | -7,326,140 | 1.000000000 ^S | -88,985.26 | -7,144,732 | 0 | 181,408 | 181,408 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -240,542.88000 | | 4/11/2018 | | -240,542.88 | -19,991,243 | 1.000000000 ^S | -240,542.88 | -19,313,472 | 0 | 677,771 | 677,771 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -106,173.13000 | | 4/12/2018 | | -106,173.13 | -8,804,183 | 1.000000000 ^S | -106,173.13 | -8,524,766 | 0 | 279,417 | 279,417 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -160,886.21000 | | 4/16/2018 | | -160,886.21 | -13,449,333 | 1.000000000 ^S | -160,886.21 | -12,917,744 | 0 | 531,589 | 531,589 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -51,033.60000 | | 4/17/2018 | | -51,033.60 | -4,256,750 | 1.000000000 ^S | -51,033.60 | -4,097,548 | 0 | 159,202 | 159,202 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -4,303.00000 | | 4/17/2018 | | -4,303.00 | -358,916 | 1.000000000 ^S | -4,303.00 | -345,493 | 0 | 13,423 | 13,423 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -103,980.92000 | | 4/18/2018 | | -103,980.92 | -8,658,256 | 1.000000000 ^S | -103,980.92 | -8,348,751 | 0 | 309,505 | 309,505 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -134,354.93000 | | 4/20/2018 | | -134,354.93 | -11,212,243 | 1.000000000 ^S | -134,354.93 | -10,787,516 | 0 | 424,727 | 424,727 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -68,589.85000 | | 4/23/2018 | | -68,589.85 | -5,669,514 | 1.000000000 ^S | -68,589.85 | -5,507,160 | 0 | 162,354 | 162,354 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -40,543.60000 | | 5/2/2018 | | -40,543.60 | -3,348,880 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -40,543.60 | -3,255,294 | 0 | 93,586 | 93,586 |
| -237,079.40000 | | 5/15/2018 | | -237,079.40 | -19,620,584 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -237,079.40 | -19,035,385 | 0 | 585,199 | 585,199 |
| -104,464.09000 | | 5/16/2018 | | -104,464.09 | -8,615,124 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -104,464.09 | -8,387,545 | 0 | 227,579 | 227,579 |
| -42,940.74000 | | 5/17/2018 | | -42,940.74 | -3,555,049 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -42,940.74 | -3,447,763 | 0 | 107,286 | 107,286 |
| -259,940.71000 | | 5/25/2018 | | -259,940.71 | -21,430,186 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -259,940.71 | -20,870,947 | 0 | 559,239 | 559,239 |
| -40,016.55000 | | 5/29/2018 | | -40,016.55 | -3,302,356 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -40,016.55 | -3,212,976 | 0 | 89,380 | 89,380 |
| -7,569.94000 | | 6/4/2018 | | -7,569.94 | -627,097 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -7,569.94 | -607,799 | 0 | 19,298 | 19,298 |
| -234,723.65000 | | 6/8/2018 | | -234,723.65 | -19,730,048 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -234,723.65 | -18,846,239 | 0 | 883,809 | 883,809 |
| -354,424.37000 | | 6/13/2018 | | -354,424.37 | -29,758,065 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -354,424.37 | -28,457,151 | 0 | 1,300,914 | 1,300,914 |
| -26,321.04000 | | 6/21/2018 | | -26,321.04 | -2,136,994 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -26,321.04 | -2,113,347 | 0 | 23,647 | 23,647 |
| -62,568.05000 | | 6/27/2018 | | -62,568.05 | -5,082,558 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -62,568.05 | -5,023,663 | 0 | 58,895 | 58,895 |
| -33,424.92000 | | 6/28/2018 | | -33,424.92 | -2,725,829 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -33,424.92 | -2,683,726 | 0 | 42,103 | 42,103 |
| -59,587.09000 | | 6/29/2018 | | -59,587.09 | -4,831,738 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -59,587.09 | -4,784,318 | 0 | 47,420 | 47,420 |
| -230,807.11000 | | 7/11/2018 | | -230,807.11 | -19,164,246 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -230,807.11 | -18,531,775 | 0 | 632,471 | 632,471 |
| -12,445.25000 | | 7/11/2018 | | -12,445.25 | -1,033,347 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -12,445.25 | -999,244 | 0 | 34,103 | 34,103 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -48,245.27000 | | 7/13/2018 | | -48,245.27 | -4,015,011 | 1.000000000 ^S | -48,245.27 | -3,873,670 | 0 | 141,341 | 141,341 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -31,820.25000 | | 7/13/2018 | | -31,820.25 | -2,648,107 | 1.000000000 ^S | -31,820.25 | -2,554,885 | 0 | 93,222 | 93,222 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -4,067.90000 | | 7/13/2018 | | -4,067.90 | -338,534 | 1.000000000 ^S | -4,067.90 | -326,616 | 0 | 11,918 | 11,918 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -64,842.30000 | | 7/19/2018 | | -64,842.30 | -5,396,805 | 1.000000000 ^S | -64,842.30 | -5,206,265 | 0 | 190,540 | 190,540 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -779,961.50000 | | 7/23/2018 | | -779,961.50 | -64,630,841 | 1.000000000 ^S | -779,961.50 | -62,624,030 | 0 | 2,006,811 | 2,006,811 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -71,225.84000 | | 7/24/2018 | | -71,225.84 | -5,858,481 | 1.000000000 ^S | -71,225.84 | -5,718,807 | 0 | 139,674 | 139,674 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -38,008.43000 | | 8/2/2018 | | -38,008.43 | -3,151,351 | 1.000000000 ^S | -38,008.43 | -3,051,742 | 0 | 99,609 | 99,609 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -46,911.01000 | | 8/7/2018 | | -46,911.01 | -3,862,706 | 1.000000000 ^S | -46,911.01 | -3,766,540 | 0 | 96,166 | 96,166 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -230,631.58000 | | 8/10/2018 | | -230,631.58 | -18,925,734 | 1.000000000 ^S | -230,631.58 | -18,517,682 | 0 | 408,052 | 408,052 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -32,792.89000 | | 8/17/2018 | | -32,792.89 | -2,641,480 | 1.000000000 ^S | -32,792.89 | -2,632,980 | 0 | 8,500 | 8,500 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -27,692.84000 | | 8/20/2018 | | -27,692.84 | -2,226,969 | 1.000000000 ^S | -27,692.84 | -2,223,491 | 0 | 3,478 | 3,478 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -9,664.19000 | | 8/22/2018 | | -9,664.19 | -784,528 | 1.000000000 ^S | -9,664.19 | -775,949 | 0 | 8,579 | 8,579 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -18,900.99000 | | 8/30/2018 | | -18,900.99 | -1,539,099 | 1.000000000 ^S | -18,900.99 | -1,517,583 | 0 | 21,516 | 21,516 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -54,937.84000 | | 8/31/2018 | | -54,937.84 | -4,456,768 | 1.000000000 ^S | -54,937.84 | -4,411,024 | 0 | 45,744 | 45,744 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -232,403.15000 | | 9/11/2018 | | -232,403.15 | -18,379,859 | 1.000000000 ^S | -232,403.15 | -18,659,923 | 0 | -280,064 | -280,064 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -31,758.92000 | | 9/19/2018 | | -31,758.92 | -2,571,503 | 1.000000000 ^S | -31,758.92 | -2,549,961 | 0 | 21,542 | 21,542 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -12,327.35000 | | 9/25/2018 | | -12,327.35 | -1,007,913 | 1.000000000 ^S | -12,327.35 | -989,777 | 0 | 18,136 | 18,136 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -16,004.18000 | | 9/27/2018 | | -16,004.18 | -1,313,144 | 1.000000000 ^S | -16,004.18 | -1,284,995 | 0 | 28,149 | 28,149 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -48,724.25000 | | 10/2/2018 | | -48,724.25 | -4,008,359 | 1.000000000 ^S | -48,724.25 | -3,912,128 | 0 | 96,231 | 96,231 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -23,470.68000 | | 10/4/2018 | | -23,470.68 | -1,915,543 | 1.000000000 ^S | -23,470.68 | -1,884,489 | 0 | 31,054 | 31,054 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -231,419.36000 | | 10/12/2018 | | -231,419.36 | -18,468,092 | 1.000000000 ^S | -231,419.36 | -18,580,934 | 0 | -112,842 | -112,842 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -53,598.82000 | | 10/12/2018 | | -53,598.82 | -4,277,377 | 1.000000000 ^S | -53,598.82 | -4,303,513 | 0 | -26,136 | -26,136 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -46,892.60000 | | 10/12/2018 | | -46,892.60 | -3,742,197 | 1.000000000 ^S | -46,892.60 | -3,765,062 | 0 | -22,865 | -22,865 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,953.84000 | | 10/12/2018 | | -3,953.84 | -315,531 | 1.000000000 ^S | -3,953.84 | -317,458 | 0 | -1,927 | -1,927 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -63,024.29000 | | 10/16/2018 | | -63,024.29 | -5,032,717 | 1.000000000 ^S | -63,024.29 | -5,060,295 | 0 | -27,578 | -27,578 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -20,113.75000 | | 10/17/2018 | | -20,113.75 | -1,610,303 | 1.000000000 ^S | -20,113.75 | -1,614,957 | 0 | -4,654 | -4,654 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -664,259.35000 | | 10/18/2018 | | -664,259.35 | -53,018,344 | 1.000000000 ^S | -664,259.35 | -53,334,168 | 0 | -315,824 | -315,824 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -18,070.52000 | | 10/24/2018 | | -18,070.52 | -1,429,780 | 1.000000000 ^S | -18,070.52 | -1,450,903 | 0 | -21,123 | -21,123 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -30,359.39000 | | 10/26/2018 | | -30,359.39 | -2,418,580 | 1.000000000 ^S | -30,359.39 | -2,437,591 | 0 | -19,011 | -19,011 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -104,308.20000 | | 10/31/2018 | | -104,308.20 | -8,365,512 | 1.000000000 ^S | -104,308.20 | -8,375,029 | 0 | -9,517 | -9,517 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -50,401.50000 | | 11/8/2018 | | -50,401.50 | -4,159,745 | 1.000000000 ^S | -50,401.50 | -4,046,796 | 0 | 112,949 | 112,949 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -224,392.25000 | | 11/9/2018 | | -224,392.25 | -18,614,349 | 1.000000000 ^S | -224,392.25 | -18,016,719 | 0 | 597,630 | 597,630 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -9,986.37000 | | 11/9/2018 | | -9,986.37 | -828,414 | 1.000000000 ^S | -9,986.37 | -801,817 | 0 | 26,597 | 26,597 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -10,134.32000 | | 11/19/2018 | | -10,134.32 | -836,189 | 1.000000000 ^S | -10,134.32 | -813,697 | 0 | 22,492 | 22,492 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -1,139,616.57000 | | 11/20/2018 | | -1,139,616.57 | -93,691,893 | 1.000000000 ^S | -1,139,616.57 | -91,501,160 | 0 | 2,190,733 | 2,190,733 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -42,170.11000 | | 11/20/2018 | | -42,170.11 | -3,466,953 | 1.000000000 ^S | -42,170.11 | -3,385,888 | 0 | 81,065 | 81,065 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -38,005.37000 | | 11/21/2018 | | -38,005.37 | -3,108,318 | 1.000000000 ^S | -38,005.37 | -3,051,496 | 0 | 56,822 | 56,822 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -8,931.98000 | | 12/3/2018 | | -8,931.98 | -740,639 | 1.000000000 ^S | -8,931.98 | -717,159 | 0 | 23,480 | 23,480 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -73,433.24000 | | 12/5/2018 | | -73,433.24 | -6,104,102 | 1.000000000 ^S | -73,433.24 | -5,896,042 | 0 | 208,060 | 208,060 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -190,442.27000 | | 12/11/2018 | | -190,442.27 | -15,458,291 | 1.000000000 ^S | -190,442.27 | -15,290,835 | 0 | 167,456 | 167,456 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -12,136.99000 | | 12/11/2018 | | -12,136.99 | -985,165 | 1.000000000 ^S | -12,136.99 | -974,493 | 0 | 10,672 | 10,672 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -76,869.70000 | | 12/13/2018 | | -76,869.70 | -6,289,951 | 1.000000000 ^S | -76,869.70 | -6,171,959 | 0 | 117,992 | 117,992 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -459,000.00000 | | 12/19/2018 | | -459,000.00 | -37,076,503 | 1.000000000 ^S | -459,000.00 | -36,853,652 | 0 | 222,851 | 222,851 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -31,261.26000 | | 12/21/2018 | | -31,261.26 | -2,482,585 | 1.000000000 ^S | -31,261.26 | -2,510,003 | 0 | -27,418 | -27,418 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -34,959.38000 | | 12/27/2018 | | -34,959.38 | -2,721,231 | 1.000000000 ^S | -34,959.38 | -2,806,930 | 0 | -85,699 | -85,699 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -13,486.62000 | | 1/8/2019 | | -13,486.62 | -1,043,413 | 1.000000000 ^S | -13,486.62 | -1,082,857 | 0 | -39,444 | -39,444 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -228,095.44000 | | 1/11/2019 | | -228,095.44 | -17,745,273 | 1.000000000 ^S | -228,095.44 | -18,314,052 | 0 | -568,779 | -568,779 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -31,995.00000 | | 1/16/2019 | | -31,995.00 | -2,501,010 | 1.000000000 ^S | -31,995.00 | -2,568,916 | 0 | -67,906 | -67,906 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -44,669.19000 | | 1/17/2019 | | -44,669.19 | -3,490,929 | 1.000000000 ^S | -44,669.19 | -3,586,542 | 0 | -95,613 | -95,613 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -60,036.00000 | | 1/22/2019 | | -60,036.00 | -4,709,139 | 1.000000000 ^S | -60,036.00 | -4,820,361 | 0 | -111,222 | -111,222 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -25,634.10000 | | 1/22/2019 | | -25,634.10 | -2,010,703 | 1.000000000 ^S | -25,634.10 | -2,058,192 | 0 | -47,489 | -47,489 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -254,230.16000 | | 1/31/2019 | | -254,230.16 | -20,035,819 | 1.000000000 ^S | -254,230.16 | -20,412,440 | 0 | -376,621 | -376,621 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -226,610.05000 | | 2/12/2019 | | -226,610.05 | -17,678,793 | 1.000000000 ^S | -226,610.05 | -18,194,789 | 0 | -515,996 | -515,996 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -46,516.42000 | | 2/12/2019 | | -46,516.42 | -3,628,939 | 1.000000000 ^S | -46,516.42 | -3,734,858 | 0 | -105,919 | -105,919 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -221,553.53000 | | 2/20/2019 | | -221,553.53 | -17,494,299 | 1.000000000 ^S | -221,553.53 | -17,788,795 | 0 | -294,496 | -294,496 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -38,774.55000 | | 3/1/2019 | | -38,774.55 | -3,070,891 | 1.000000000 ^S | -38,774.55 | -3,113,254 | 0 | -42,363 | -42,363 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -63,764.01000 | | 3/4/2019 | | -63,764.01 | -5,062,062 | 1.000000000 ^S | -63,764.01 | -5,119,688 | 0 | -57,626 | -57,626 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -231,531.52000 | | 3/11/2019 | | -231,531.52 | -18,113,517 | 1.000000000 ^S | -231,531.52 | -18,589,939 | 0 | -476,422 | -476,422 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -15,693.27000 | | 3/14/2019 | | -15,693.27 | -1,237,080 | 1.000000000 ^S | -15,693.27 | -1,260,031 | 0 | -22,951 | -22,951 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,606.00000 | | 3/15/2019 | | -11,606.00 | -915,480 | 1.000000000 ^S | -11,606.00 | -931,859 | 0 | -16,379 | -16,379 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -600,999.98000 | | 3/26/2019 | | -600,999.98 | -47,070,099 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -600,999.98 | -48,254,998 | 0 | -1,184,899 | -1,184,899 |
| -515,784.59000 | | 3/29/2019 | | -515,784.59 | -40,357,721 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -515,784.59 | -41,412,954 | 0 | -1,055,233 | -1,055,233 |
| -73,349.53000 | | 4/8/2019 | | -73,349.53 | -5,822,604 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -73,349.53 | -5,889,320 | 0 | -66,716 | -66,716 |
| -225,346.84000 | | 4/11/2019 | | -225,346.84 | -17,858,735 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -225,346.84 | -18,093,364 | 0 | -234,629 | -234,629 |
| -35,132.62000 | | 4/17/2019 | | -35,132.62 | -2,821,296 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -35,132.62 | -2,820,840 | 0 | 456 | 456 |
| -58,870.03000 | | 4/18/2019 | | -58,870.03 | -4,734,422 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -58,870.03 | -4,726,744 | 0 | 7,678 | 7,678 |
| -43,801.67000 | | 4/18/2019 | | -43,801.67 | -3,522,600 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -43,801.67 | -3,516,888 | 0 | 5,712 | 5,712 |
| -3,693.23000 | | 4/18/2019 | | -3,693.23 | -297,015 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -3,693.23 | -296,534 | 0 | 481 | 481 |
| -225,082.95000 | | 5/14/2019 | | -225,082.95 | -17,085,005 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -225,082.95 | -18,072,176 | 0 | -987,171 | -987,171 |
| -94,910.58000 | | 5/17/2019 | | -94,910.58 | -7,205,523 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -94,910.58 | -7,620,483 | 0 | -414,960 | -414,960 |
| -87,834.76000 | | 5/23/2019 | | -87,834.76 | -6,662,312 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -87,834.76 | -7,052,357 | 0 | -390,045 | -390,045 |
| -55,793.55000 | | 5/31/2019 | | -55,793.55 | -4,229,298 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -55,793.55 | -4,479,730 | 0 | -250,432 | -250,432 |
| -226,601.48000 | | 6/12/2019 | | -226,601.48 | -17,112,794 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -226,601.48 | -18,194,100 | 0 | -1,081,306 | -1,081,306 |
| -15,197.25000 | | 6/25/2019 | | -15,197.25 | -1,134,949 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -15,197.25 | -1,220,205 | 0 | -85,256 | -85,256 |
| -11,644.71000 | | 7/8/2019 | | -11,644.71 | -880,468 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -11,644.71 | -934,968 | 0 | -54,500 | -54,500 |

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリー・グループ別 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -121,556.01000 | | 7/11/2019 | | -121,556.01 | -9,176,397 | 1.000000000 ^S | -121,556.01 | -9,759,876 | 0 | -583,479 | -583,479 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -44,689.00000 | | 7/18/2019 | | -44,689.00 | -3,384,444 | 1.000000000 ^S | -44,689.00 | -3,588,133 | 0 | -203,689 | -203,689 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,768.04000 | | 7/18/2019 | | -3,768.04 | -285,366 | 1.000000000 ^S | -3,768.04 | -302,540 | 0 | -17,174 | -17,174 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -29,373.95000 | | 7/19/2019 | | -29,373.95 | -2,230,106 | 1.000000000 ^S | -29,373.95 | -2,358,469 | 0 | -128,363 | -128,363 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -441,467.63000 | | 7/22/2019 | | -441,467.63 | -33,520,533 | 1.000000000 ^S | -441,467.63 | -35,445,957 | 0 | -1,925,424 | -1,925,424 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -175,549.92000 | | 7/30/2019 | | -175,549.92 | -13,177,136 | 1.000000000 ^S | -175,549.92 | -14,095,110 | 0 | -917,974 | -917,974 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -60,062.61000 | | 7/31/2019 | | -60,062.61 | -4,485,957 | 1.000000000 ^S | -60,062.61 | -4,822,498 | 0 | -336,541 | -336,541 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -232,223.94000 | | 8/9/2019 | | -232,223.94 | -16,768,953 | 1.000000000 ^S | -232,223.94 | -18,645,534 | 0 | -1,876,581 | -1,876,581 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -205,109.53000 | | 9/11/2019 | | -205,109.53 | -15,096,651 | 1.000000000 ^S | -205,109.53 | -16,468,486 | 0 | -1,371,835 | -1,371,835 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -17,578.68000 | | 9/17/2019 | | -17,578.68 | -1,302,835 | 1.000000000 ^S | -17,578.68 | -1,411,413 | 0 | -108,578 | -108,578 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -10,884.12000 | | 9/19/2019 | | -10,884.12 | -805,883 | 1.000000000 ^S | -10,884.12 | -873,899 | 0 | -68,016 | -68,016 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -778,958.02000 | | 9/24/2019 | | -778,958.02 | -56,646,058 | 1.000000000 ^S | -778,958.02 | -62,543,459 | 0 | -5,897,401 | -5,897,401 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,509.72000 | | 10/3/2019 | | -7,509.72 | -539,891 | 1.000000000 ^S | -7,509.72 | -602,964 | 0 | -63,073 | -63,073 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -205,806.16000 | | 10/11/2019 | | -205,806.16 | -15,010,764 | 1.000000000 ^S | -205,806.16 | -16,524,420 | 0 | -1,513,656 | -1,513,656 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -32,085.08000 | | 10/11/2019 | | -32,085.08 | -2,340,171 | 1.000000000 ^S | -32,085.08 | -2,576,149 | 0 | -235,978 | -235,978 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -47,442.98000 | | 10/15/2019 | | -47,442.98 | -3,480,370 | 1.000000000 ^S | -47,442.98 | -3,809,253 | 0 | -328,883 | -328,883 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -4,000.25000 | | 10/15/2019 | | -4,000.25 | -293,454 | 1.000000000 ^S | -4,000.25 | -321,185 | 0 | -27,731 | -27,731 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -63,764.01000 | | 10/17/2019 | | -63,764.01 | -4,680,782 | 1.000000000 ^S | -63,764.01 | -5,119,688 | 0 | -438,906 | -438,906 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -88,188.28000 | | 10/24/2019 | | -88,188.28 | -6,556,354 | 1.000000000 ^S | -88,188.28 | -7,080,741 | 0 | -524,387 | -524,387 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -997,183.01000 | | 10/29/2019 | | -997,183.01 | -74,336,492 | 1.000000000 ^S | -997,183.01 | -80,065,002 | 0 | -5,728,510 | -5,728,510 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -18,077.89000 | | 10/30/2019 | | -18,077.89 | -1,350,202 | 1.000000000 ^S | -18,077.89 | -1,451,495 | 0 | -101,293 | -101,293 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -200,251.64000 | | 11/12/2019 | | -200,251.64 | -14,964,007 | 1.000000000 ^S | -200,251.64 | -16,078,441 | 0 | -1,114,434 | -1,114,434 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -49,082.82000 | | 11/13/2019 | | -49,082.82 | -3,665,794 | 1.000000000 ^S | -49,082.82 | -3,940,918 | 0 | -275,124 | -275,124 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -20,180.00000 | | 11/25/2019 | | -20,180.00 | -1,487,718 | 1.000000000 ^S | -20,180.00 | -1,620,276 | 0 | -132,558 | -132,558 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -202,741.20000 | | 12/11/2019 | | -202,741.20 | -15,005,931 | 1.000000000 ^S | -202,741.20 | -16,278,330 | 0 | -1,272,399 | -1,272,399 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -574,851.64000 | | 12/16/2019 | | -574,851.64 | -43,181,511 | 1.000000000 ^S | -574,851.64 | -46,155,517 | 0 | -2,974,006 | -2,974,006 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -4,780.63000 | | 12/17/2019 | | -4,780.63 | -361,393 | 1.000000000 ^S | -4,780.63 | -383,842 | 0 | -22,449 | -22,449 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -494,616.57000 | | 12/19/2019 | | -494,616.57 | -37,192,781 | 1.000000000 ^S | -494,616.57 | -39,713,349 | 0 | -2,520,568 | -2,520,568 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -13,059.23000 | | 12/20/2019 | | -13,059.23 | -981,935 | 1.000000000 ^S | -13,059.23 | -1,048,541 | 0 | -66,606 | -66,606 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,061.85000 | | 12/24/2019 | | -3,061.85 | -231,660 | 1.000000000 ^S | -3,061.85 | -245,840 | 0 | -14,180 | -14,180 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -26,661.23000 | | 12/27/2019 | | -26,661.23 | -2,028,365 | 1.000000000 ^S | -26,661.23 | -2,140,662 | 0 | -112,297 | -112,297 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -143,370.03000 | | 1/7/2020 | | -143,370.03 | -10,767,119 | 1.000000000 ^S | -143,370.03 | -11,511,349 | 0 | -744,230 | -744,230 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -14,950.87000 | | 1/8/2020 | | -14,950.87 | -1,115,419 | 1.000000000 ^S | -14,950.87 | -1,200,423 | 0 | -85,004 | -85,004 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -197,898.31000 | | 1/10/2020 | | -197,898.31 | -14,857,545 | 1.000000000 ^S | -197,898.31 | -15,889,489 | 0 | -1,031,944 | -1,031,944 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -62,954.74000 | | 1/29/2020 | | -62,954.74 | -4,639,562 | 1.000000000 ^S | -62,954.74 | -5,054,710 | 0 | -415,148 | -415,148 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -58,342.15000 | | 2/4/2020 | | -58,342.15 | -4,246,537 | 1.000000000 ^S | -58,342.15 | -4,684,360 | 0 | -437,823 | -437,823 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -199,630.11000 | | 2/12/2020 | | -199,630.11 | -14,748,546 | 1.000000000 ^S | -199,630.11 | -16,028,537 | 0 | -1,279,991 | -1,279,991 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -16,163.64000 | | 2/28/2020 | | -16,163.64 | -1,169,196 | 1.000000000 ^S | -16,163.64 | -1,297,798 | 0 | -128,602 | -128,602 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -1,683,616.57000 | | 3/10/2020 | | -1,683,616.57 | -114,922,117 | 1.000000000 ^S | -1,683,616.57 | -135,179,563 | 0 | -20,257,446 | -20,257,446 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -341,601.08000 | | 3/11/2020 | | -341,601.08 | -22,956,980 | 1.000000000 ^S | -341,601.08 | -27,427,554 | 0 | -4,470,574 | -4,470,574 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -199,895.77000 | | 3/11/2020 | | -199,895.77 | -13,433,808 | 1.000000000 ^S | -199,895.77 | -16,049,867 | 0 | -2,616,059 | -2,616,059 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -9,798.00000 | | 3/24/2020 | | -9,798.00 | -627,957 | 1.000000000 ^S | -9,798.00 | -786,693 | 0 | -158,736 | -158,736 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -198,161.35000 | | 4/14/2020 | | -198,161.35 | -13,606,730 | 1.000000000 ^S | -198,161.35 | -15,910,609 | 0 | -2,303,879 | -2,303,879 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -59,967.25000 | | 4/28/2020 | | -59,967.25 | -4,154,860 | 1.000000000 ^S | -59,967.25 | -4,814,841 | 0 | -659,981 | -659,981 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -44,618.04000 | | 4/28/2020 | | -44,618.04 | -3,091,383 | 1.000000000 ^S | -44,618.04 | -3,582,435 | 0 | -491,052 | -491,052 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -3,762.06000 | | 4/28/2020 | | -3,762.06 | -260,656 | 1.000000000 ^S | -3,762.06 | -302,060 | 0 | -41,404 | -41,404 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -198,664.80000 | | 5/14/2020 | | -198,664.80 | -13,775,595 | 1.000000000 ^S | -198,664.80 | -15,951,031 | 0 | -2,175,436 | -2,175,436 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -44,195.22000 | | 5/19/2020 | | -44,195.22 | -3,085,605 | 1.000000000 ^S | -44,195.22 | -3,548,486 | 0 | -462,881 | -462,881 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -198,852.82000 | | 6/11/2020 | | -198,852.82 | -14,907,920 | 1.000000000 ^S | -198,852.82 | -15,966,128 | 0 | -1,058,208 | -1,058,208 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -162.06000 | | 6/11/2020 | | -162.06 | -12,150 | 1.000000000 ^S | -162.06 | -13,012 | 0 | -862 | -862 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -8,754.11000 | | 6/12/2020 | | -8,754.11 | -644,312 | 1.000000000 ^S | -8,754.11 | -702,878 | 0 | -58,566 | -58,566 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,750.00000 | | 6/15/2020 | | -7,750.00 | -568,998 | 1.000000000 ^S | -7,750.00 | -622,257 | 0 | -53,259 | -53,259 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -15,511.80000 | | 6/16/2020 | | -15,511.80 | -1,142,240 | 1.000000000 ^S | -15,511.80 | -1,245,461 | 0 | -103,221 | -103,221 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -23,202.00000 | | 6/17/2020 | | -23,202.00 | -1,704,897 | 1.000000000 ^S | -23,202.00 | -1,862,916 | 0 | -158,019 | -158,019 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -35,546.52000 | | 6/18/2020 | | -35,546.52 | -2,635,936 | 1.000000000 ^S | -35,546.52 | -2,854,072 | 0 | -218,136 | -218,136 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -605,404.68000 | | 6/19/2020 | | -605,404.68 | -44,361,785 | 1.000000000 ^S | -605,404.68 | -48,608,657 | 0 | -4,246,872 | -4,246,872 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -152,267.88000 | | 6/22/2020 | | -152,267.88 | -11,176,599 | 1.000000000 ^S | -152,267.88 | -12,225,768 | 0 | -1,049,169 | -1,049,169 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,662.50000 | | 6/25/2020 | | -11,662.50 | -859,904 | 1.000000000 ^S | -11,662.50 | -936,396 | 0 | -76,492 | -76,492 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,777.00000 | | 6/26/2020 | | -7,777.00 | -571,793 | 1.000000000 ^S | -7,777.00 | -624,425 | 0 | -52,632 | -52,632 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -19,286.41000 | | 6/30/2020 | | -19,286.41 | -1,423,771 | 1.000000000 ^S | -19,286.41 | -1,548,529 | 0 | -124,758 | -124,758 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -11,667.00000 | | 7/1/2020 | | -11,667.00 | -866,611 | 1.000000000 ^S | -11,667.00 | -936,757 | 0 | -70,146 | -70,146 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,891.50000 | | 7/2/2020 | | -3,891.50 | -289,661 | 1.000000000 ^S | -3,891.50 | -312,453 | 0 | -22,792 | -22,792 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,784.00000 | | 7/6/2020 | | -7,784.00 | -580,762 | 1.000000000 ^S | -7,784.00 | -624,987 | 0 | -44,225 | -44,225 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,591.56000 | | 7/7/2020 | | -11,591.56 | -870,380 | 1.000000000 ^S | -11,591.56 | -930,700 | 0 | -60,320 | -60,320 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,784.00000 | | 7/8/2020 | | -7,784.00 | -583,408 | 1.000000000 ^S | -7,784.00 | -624,987 | 0 | -41,579 | -41,579 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -7,812.00000 | | 7/9/2020 | | -7,812.00 | -585,149 | 1.000000000 ^S | -7,812.00 | -627,235 | 0 | -42,086 | -42,086 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -192,699.63000 | | 7/10/2020 | | -192,699.63 | -14,392,052 | 1.000000000 ^S | -192,699.63 | -15,472,081 | 0 | -1,080,029 | -1,080,029 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -5,968.29000 | | 7/10/2020 | | -5,968.29 | -445,750 | 1.000000000 ^S | -5,968.29 | -479,201 | 0 | -33,451 | -33,451 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -67,490.38000 | | 7/13/2020 | | -67,490.38 | -5,013,915 | 1.000000000 ^S | -67,490.38 | -5,418,882 | 0 | -404,967 | -404,967 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -42,642.14000 | | 7/15/2020 | | -42,642.14 | -3,186,186 | 1.000000000 ^S | -42,642.14 | -3,423,788 | 0 | -237,602 | -237,602 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,595.46000 | | 7/15/2020 | | -3,595.46 | -268,650 | 1.000000000 ^S | -3,595.46 | -288,684 | 0 | -20,034 | -20,034 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -24,622.52000 | | 7/16/2020 | | -24,622.52 | -1,847,388 | 1.000000000 ^S | -24,622.52 | -1,976,971 | 0 | -129,583 | -129,583 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,893.00000 | | 7/17/2020 | | -3,893.00 | -291,913 | 1.000000000 ^S | -3,893.00 | -312,574 | 0 | -20,661 | -20,661 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,896.50000 | | 7/20/2020 | | -3,896.50 | -291,596 | 1.000000000 ^S | -3,896.50 | -312,855 | 0 | -21,259 | -21,259 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -2,922.04000 | | 7/21/2020 | | -2,922.04 | -219,589 | 1.000000000 ^S | -2,922.04 | -234,614 | 0 | -15,025 | -15,025 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -57,311.61000 | | 7/22/2020 | | -57,311.61 | -4,354,693 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -57,311.61 | -4,601,617 | 0 | -246,924 | -246,924 |
| -34,354.75000 | | 7/22/2020 | | -34,354.75 | -2,610,368 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -34,354.75 | -2,758,383 | 0 | -148,015 | -148,015 |
| -3,910.00000 | | 7/27/2020 | | -3,910.00 | -293,843 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -3,910.00 | -313,939 | 0 | -20,096 | -20,096 |
| -5,740.95000 | | 7/28/2020 | | -5,740.95 | -431,446 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -5,740.95 | -460,948 | 0 | -29,502 | -29,502 |
| -10,962.84000 | | 8/6/2020 | | -10,962.84 | -835,391 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -10,962.84 | -880,219 | 0 | -44,828 | -44,828 |
| -177,143.44000 | | 8/12/2020 | | -177,143.44 | -13,510,058 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -177,143.44 | -14,223,056 | 0 | -712,998 | -712,998 |
| -12,122.71000 | | 8/12/2020 | | -12,122.71 | -924,553 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -12,122.71 | -973,347 | 0 | -48,794 | -48,794 |
| -52,384.44000 | | 8/13/2020 | | -52,384.44 | -4,016,526 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -52,384.44 | -4,206,009 | 0 | -189,483 | -189,483 |
| -10,958.81000 | | 8/18/2020 | | -10,958.81 | -837,510 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -10,958.81 | -879,896 | 0 | -42,386 | -42,386 |
| -275,950.40000 | | 8/20/2020 | | -275,950.40 | -21,100,323 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -275,950.40 | -22,156,384 | 0 | -1,056,061 | -1,056,061 |
| -62,870.83000 | | 8/21/2020 | | -62,870.83 | -4,770,834 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -62,870.83 | -5,047,973 | 0 | -277,139 | -277,139 |
| -116,678.12000 | | 8/24/2020 | | -116,678.12 | -8,843,608 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -116,678.12 | -9,368,224 | 0 | -524,616 | -524,616 |
| -8,315.43000 | | 8/26/2020 | | -8,315.43 | -635,712 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -8,315.43 | -667,656 | 0 | -31,944 | -31,944 |
| -109,281.13000 | | 9/2/2020 | | -109,281.13 | -8,546,704 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -109,281.13 | -8,774,311 | 0 | -227,607 | -227,607 |
| -19,071.87000 | | 9/8/2020 | | -19,071.87 | -1,475,930 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -19,071.87 | -1,531,303 | 0 | -55,373 | -55,373 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -8,897.24000 | | 9/9/2020 | | -8,897.24 | -681,843 | 1.000000000 ^S | -8,897.24 | -714,370 | 0 | -32,527 | -32,527 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -45,660.91000 | | 9/10/2020 | | -45,660.91 | -3,527,735 | 1.000000000 ^S | -45,660.91 | -3,666,168 | 0 | -138,433 | -138,433 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -188,962.41000 | | 9/14/2020 | | -188,962.41 | -14,604,347 | 1.000000000 ^S | -188,962.41 | -15,172,015 | 0 | -567,668 | -567,668 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -107,002.10000 | | 9/14/2020 | | -107,002.10 | -8,269,877 | 1.000000000 ^S | -107,002.10 | -8,591,325 | 0 | -321,448 | -321,448 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -18,939.51000 | | 9/15/2020 | | -18,939.51 | -1,459,669 | 1.000000000 ^S | -18,939.51 | -1,520,676 | 0 | -61,007 | -61,007 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -324,702.88000 | | 9/25/2020 | | -324,702.88 | -24,054,108 | 1.000000000 ^S | -324,702.88 | -26,070,778 | 0 | -2,016,670 | -2,016,670 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -147,989.86000 | | 9/29/2020 | | -147,989.86 | -11,019,376 | 1.000000000 ^S | -147,989.86 | -11,882,281 | 0 | -862,905 | -862,905 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -227,232.20000 | | 10/2/2020 | | -227,232.20 | -17,241,455 | 1.000000000 ^S | -227,232.20 | -18,244,742 | 0 | -1,003,287 | -1,003,287 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -18,568.42000 | | 10/7/2020 | | -18,568.42 | -1,404,641 | 1.000000000 ^S | -18,568.42 | -1,490,880 | 0 | -86,239 | -86,239 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -164,820.58000 | | 10/9/2020 | | -164,820.58 | -12,507,804 | 1.000000000 ^S | -164,820.58 | -13,233,639 | 0 | -725,835 | -725,835 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -900,000.00000 | | 10/13/2020 | | -900,000.00 | -68,336,634 | 1.000000000 ^S | -900,000.00 | -72,262,063 | 0 | -3,925,429 | -3,925,429 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -766,101.00000 | | 10/13/2020 | | -766,101.00 | -58,169,738 | 1.000000000 ^S | -766,101.00 | -61,511,154 | 0 | -3,341,416 | -3,341,416 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -417,000.00000 | | 10/13/2020 | | -417,000.00 | -31,662,641 | 1.000000000 ^S | -417,000.00 | -33,481,422 | 0 | -1,818,781 | -1,818,781 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -82,580.92000 | | 10/16/2020 | | -82,580.92 | -6,153,555 | 1.000000000 ^S | -82,580.92 | -6,630,520 | 0 | -476,965 | -476,965 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -38,339.77000 | | 10/19/2020 | | -38,339.77 | -2,862,050 | 1.000000000 ^S | -38,339.77 | -3,078,345 | 0 | -216,295 | -216,295 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| -16,380.30000 | | 10/20/2020 | | -16,380.30 | -1,224,976 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -16,380.30 | -1,315,194 | 0 | -90,218 | -90,218 |
| -23,702.06000 | | 10/22/2020 | | -23,702.06 | -1,763,044 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -23,702.06 | -1,903,066 | 0 | -140,022 | -140,022 |
| -42,912.29000 | | 10/27/2020 | | -42,912.29 | -3,204,223 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -42,912.29 | -3,445,478 | 0 | -241,255 | -241,255 |
| -105,280.79000 | | 11/4/2020 | | -105,280.79 | -7,891,026 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -105,280.79 | -8,453,119 | 0 | -562,093 | -562,093 |
| -191,831.31000 | | 11/12/2020 | | -191,831.31 | -14,718,133 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -191,831.31 | -15,402,362 | 0 | -684,229 | -684,229 |
| -18,083.02000 | | 11/19/2020 | | -18,083.02 | -1,373,287 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -18,083.02 | -1,451,907 | 0 | -78,620 | -78,620 |
| -10,528.10000 | | 11/20/2020 | | -10,528.10 | -795,260 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -10,528.10 | -845,314 | 0 | -50,054 | -50,054 |
| -86,099.46000 | | 11/24/2020 | | -86,099.46 | -6,549,885 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -86,099.46 | -6,913,027 | 0 | -363,142 | -363,142 |
| -91,592.32000 | | 12/1/2020 | | -91,592.32 | -7,037,499 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -91,592.32 | -7,354,056 | 0 | -316,557 | -316,557 |
| -25,208.93000 | | 12/3/2020 | | -25,208.93 | -1,946,115 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -25,208.93 | -2,024,055 | 0 | -77,940 | -77,940 |
| -194,203.63000 | | 12/11/2020 | | -194,203.63 | -15,238,300 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -194,203.63 | -15,592,839 | 0 | -354,539 | -354,539 |
| -18,310.66000 | | 12/11/2020 | | -18,310.66 | -1,436,757 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -18,310.66 | -1,470,185 | 0 | -33,428 | -33,428 |
| -168,440.90000 | | 12/14/2020 | | -168,440.90 | -13,192,722 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -168,440.90 | -13,524,319 | 0 | -331,597 | -331,597 |
| -17,581.87000 | | 12/17/2020 | | -17,581.87 | -1,376,729 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -17,581.87 | -1,411,669 | 0 | -34,940 | -34,940 |
| -37,104.53000 | | 12/21/2020 | | -37,104.53 | -2,919,710 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -37,104.53 | -2,979,167 | 0 | -59,457 | -59,457 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -33,859.61000 | | 12/22/2020 | | -33,859.61 | -2,648,853 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -33,859.61 | -2,718,628 | 0 | -69,775 | -69,775 |
| -39,098.57000 | | 12/29/2020 | | -39,098.57 | -3,071,479 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -39,098.57 | -3,139,270 | 0 | -67,791 | -67,791 |
| -196,013.94000 | | 1/12/2021 | | -196,013.94 | -15,725,988 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -196,013.94 | -15,738,191 | 0 | -12,203 | -12,203 |
| -53,466.66000 | | 1/29/2021 | | -53,466.66 | -4,277,362 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -53,466.66 | -4,292,901 | 0 | -15,539 | -15,539 |
| -43,285.99000 | | 1/29/2021 | | -43,285.99 | -3,462,903 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -43,285.99 | -3,475,483 | 0 | -12,580 | -12,580 |
| -3,649.75000 | | 1/29/2021 | | -3,649.75 | -291,982 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -3,649.75 | -293,043 | 0 | -1,061 | -1,061 |
| -58,176.95000 | | 2/3/2021 | | -58,176.95 | -4,634,102 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -58,176.95 | -4,671,096 | 0 | -36,994 | -36,994 |
| -24,989.49000 | | 2/8/2021 | | -24,989.49 | -2,018,410 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -24,989.49 | -2,006,436 | 0 | 11,974 | 11,974 |
| -190,925.71000 | | 2/12/2021 | | -190,925.71 | -15,518,883 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -190,925.71 | -15,329,651 | 0 | 189,232 | 189,232 |
| -18,869.59000 | | 2/12/2021 | | -18,869.59 | -1,533,764 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -18,869.59 | -1,515,062 | 0 | 18,702 | 18,702 |
| -17,961.37000 | | 2/22/2021 | | -17,961.37 | -1,491,625 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -17,961.37 | -1,442,140 | 0 | 49,485 | 49,485 |
| -96,401.33000 | | 2/24/2021 | | -96,401.33 | -8,013,355 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -96,401.33 | -7,740,177 | 0 | 273,178 | 273,178 |
| -21,439.86000 | | 2/25/2021 | | -21,439.86 | -1,798,475 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -21,439.86 | -1,721,432 | 0 | 77,043 | 77,043 |
| -43,520.35000 | | 3/5/2021 | | -43,520.35 | -3,653,747 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -43,520.35 | -3,494,300 | 0 | 159,447 | 159,447 |
| -92,848.25000 | | 3/8/2021 | | -92,848.25 | -7,702,804 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -92,848.25 | -7,454,896 | 0 | 247,908 | 247,908 |

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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -182,141.45000 | | 3/11/2021 | | -182,141.45 | -15,261,248 | 1.000000000 ^S | -182,141.45 | -14,624,352 | 0 | 636,896 | 636,896 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -11,345.80000 | | 3/11/2021 | | -11,345.80 | -950,641 | 1.000000000 ^S | -11,345.80 | -910,968 | 0 | 39,673 | 39,673 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -101,280.78000 | | 3/15/2021 | | -101,280.78 | -8,553,965 | 1.000000000 ^S | -101,280.78 | -8,131,953 | 0 | 422,012 | 422,012 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -36,648.89000 | | 3/17/2021 | | -36,648.89 | -3,095,884 | 1.000000000 ^S | -36,648.89 | -2,942,583 | 0 | 153,301 | 153,301 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -36,551.22000 | | 3/23/2021 | | -36,551.22 | -3,078,004 | 1.000000000 ^S | -36,551.22 | -2,934,741 | 0 | 143,263 | 143,263 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -14,560.07000 | | 3/25/2021 | | -14,560.07 | -1,207,674 | 1.000000000 ^S | -14,560.07 | -1,169,045 | 0 | 38,629 | 38,629 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -98,235.00000 | | 3/26/2021 | | -98,235.00 | -8,116,240 | 1.000000000 ^S | -98,235.00 | -7,887,404 | 0 | 228,836 | 228,836 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -181,210.69000 | | 4/12/2021 | | -181,210.69 | -15,149,346 | 1.000000000 ^S | -181,210.69 | -14,549,620 | 0 | 599,726 | 599,726 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -40,556.29000 | | 4/12/2021 | | -40,556.29 | -3,390,536 | 1.000000000 ^S | -40,556.29 | -3,256,312 | 0 | 134,224 | 134,224 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -9,353.32000 | | 4/21/2021 | | -9,353.32 | -783,728 | 1.000000000 ^S | -9,353.32 | -750,989 | 0 | 32,739 | 32,739 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -57,927.10000 | | 4/22/2021 | | -57,927.10 | -4,856,219 | 1.000000000 ^S | -57,927.10 | -4,651,035 | 0 | 205,184 | 205,184 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -43,100.09000 | | 4/22/2021 | | -43,100.09 | -3,613,222 | 1.000000000 ^S | -43,100.09 | -3,460,557 | 0 | 152,665 | 152,665 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,634.07000 | | 4/22/2021 | | -3,634.07 | -304,656 | 1.000000000 ^S | -3,634.07 | -291,784 | 0 | 12,872 | 12,872 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -62,487.79000 | | 4/30/2021 | | -62,487.79 | -5,287,225 | 1.000000000 ^S | -62,487.79 | -5,017,218 | 0 | 270,007 | 270,007 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -12,614.45000 | | 5/6/2021 | | -12,614.45 | -1,067,845 | 1.000000000 ^S | -12,614.45 | -1,012,829 | 0 | 55,016 | 55,016 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -606,097.00000 | | 5/11/2021 | | -606,097.00 | -51,843,348 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -606,097.00 | -48,664,244 | 0 | 3,179,104 | 3,179,104 |
| -230,000.00000 | | 5/11/2021 | | -230,000.00 | -19,673,369 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -230,000.00 | -18,466,972 | 0 | 1,206,397 | 1,206,397 |
| -227,000.00000 | | 5/11/2021 | | -227,000.00 | -19,416,760 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -227,000.00 | -18,226,098 | 0 | 1,190,662 | 1,190,662 |
| -178,000.00000 | | 5/11/2021 | | -178,000.00 | -15,225,477 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -178,000.00 | -14,291,830 | 0 | 933,647 | 933,647 |
| -181,230.96000 | | 5/12/2021 | | -181,230.96 | -15,399,353 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -181,230.96 | -14,551,248 | 0 | 848,105 | 848,105 |
| -92,511.77000 | | 5/25/2021 | | -92,511.77 | -7,795,140 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -92,511.77 | -7,427,879 | 0 | 367,261 | 367,261 |
| -29,889.56000 | | 5/27/2021 | | -29,889.56 | -2,522,635 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -29,889.56 | -2,399,868 | 0 | 122,767 | 122,767 |
| -30,023.89000 | | 6/1/2021 | | -30,023.89 | -2,542,339 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -30,023.89 | -2,410,654 | 0 | 131,685 | 131,685 |
| -25,520.59000 | | 6/8/2021 | | -25,520.59 | -2,163,778 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -25,520.59 | -2,049,078 | 0 | 114,700 | 114,700 |
| -9,103.42000 | | 6/10/2021 | | -9,103.42 | -771,299 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -9,103.42 | -730,924 | 0 | 40,375 | 40,375 |
| -173,262.44000 | | 6/11/2021 | | -173,262.44 | -14,703,340 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -173,262.44 | -13,911,446 | 0 | 791,894 | 791,894 |
| -124,557.16000 | | 6/11/2021 | | -124,557.16 | -10,570,129 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -124,557.16 | -10,000,841 | 0 | 569,288 | 569,288 |
| -45,424.93000 | | 6/15/2021 | | -45,424.93 | -3,857,209 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -45,424.93 | -3,647,221 | 0 | 209,988 | 209,988 |
| -17,660.59000 | | 6/15/2021 | | -17,660.59 | -1,499,630 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -17,660.59 | -1,417,990 | 0 | 81,640 | 81,640 |
| -183,243.85000 | | 7/12/2021 | | -183,243.85 | -15,100,530 | 1.000000000 ^S 80.291180997 | -183,243.85 | -14,712,865 | 0 | 387,665 | 387,665 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -89,853.93000 | | 7/15/2021 | | -89,853.93 | -7,394,779 | 1.000000000 ^S | -89,853.93 | -7,214,478 | 0 | 180,301 | 180,301 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -43,329.45000 | | 7/15/2021 | | -43,329.45 | -3,565,918 | 1.000000000 ^S | -43,329.45 | -3,478,973 | 0 | 86,945 | 86,945 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -3,653.41000 | | 7/15/2021 | | -3,653.41 | -300,668 | 1.000000000 ^S | -3,653.41 | -293,337 | 0 | 7,331 | 7,331 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -33,912.35000 | | 7/19/2021 | | -33,912.35 | -2,765,901 | 1.000000000 ^S | -33,912.35 | -2,722,863 | 0 | 43,038 | 43,038 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -302,874.92000 | | 7/21/2021 | | -302,874.92 | -24,364,754 | 1.000000000 ^S | -302,874.92 | -24,318,185 | 0 | 46,569 | 46,569 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -58,235.37000 | | 7/21/2021 | | -58,235.37 | -4,684,741 | 1.000000000 ^S | -58,235.37 | -4,675,787 | 0 | 8,954 | 8,954 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -170,752.21000 | | 7/27/2021 | | -170,752.21 | -13,916,109 | 1.000000000 ^S | -170,752.21 | -13,709,897 | 0 | 206,212 | 206,212 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -87,399.68000 | | 8/3/2021 | | -87,399.68 | -7,043,401 | 1.000000000 ^S | -87,399.68 | -7,017,424 | 0 | 25,977 | 25,977 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -47,414.31000 | | 8/3/2021 | | -47,414.31 | -3,821,043 | 1.000000000 ^S | -47,414.31 | -3,806,951 | 0 | 14,092 | 14,092 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -4,800.77000 | | 8/10/2021 | | -4,800.77 | -388,292 | 1.000000000 ^S | -4,800.77 | -385,459 | 0 | 2,833 | 2,833 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -180,149.01000 | | 8/12/2021 | | -180,149.01 | -14,676,038 | 1.000000000 ^S | -180,149.01 | -14,464,377 | 0 | 211,661 | 211,661 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -151,641.92000 | | 8/18/2021 | | -151,641.92 | -12,061,932 | 1.000000000 ^S | -151,641.92 | -12,175,509 | 0 | -113,577 | -113,577 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -39,042.50000 | | 8/20/2021 | | -39,042.50 | -3,065,800 | 1.000000000 ^S | -39,042.50 | -3,134,768 | 0 | -68,968 | -68,968 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -75,244.96000 | | 8/24/2021 | | -75,244.96 | -5,945,999 | 1.000000000 ^S | -75,244.96 | -6,041,507 | 0 | -95,508 | -95,508 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |
| -218,532.26000 | | 8/25/2021 | | -218,532.26 | -17,423,973 | 1.000000000 ^S | -218,532.26 | -17,546,213 | 0 | -122,240 | -122,240 |
| | | | | | | 80.291180997 | | | | | |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 321,814.59000 | 合計 | | | 321,815 | -298,722,182 | | 321,815 | 25,838,862 | 0 | 324,561,044 | 324,561,044 |
| 0.00000 | | | | | | | | | | | |
| 284,358.60 | BRITISH POUND GBP | 7/27/2021 | | 284,358.60 | 43,354,328 | 1.000000000 ^S 151.194825005 | 284,358.60 | 42,993,549 | 0 | -360,779 | -360,779 |
| 7,338.40 | | 8/19/2021 | | 7,338.40 | 1,109,438 | 1.000000000 ^S 151.194825005 | 7,338.40 | 1,109,528 | 0 | 90 | 90 |
| 291,697.00000 | 合計 | | | 291,697 | 44,463,766 | | 291,697 | 44,103,077 | 0 | -360,689 | -360,689 |
| 0.00000 | | | | | | | | | | | |
| 50.00 | CANADIAN DOLLAR CAD | 8/13/2014 | | 50.00 | 4,670 | 1.000000000 ^S 0.011502367 | 50.00 | 4,347 | 0 | -323 | -323 |
| 750,149.41000 | EURO EUR | 8/31/2021 | | 750,149.41 | 97,277,057 | 1.000000000 ^S 129.684236999 | 750,149.41 | 97,282,554 | 0 | 5,497 | 5,497 |
| 636,473.57000 | UNITED STATES DOLLAR USD | 7/27/2021 | | 636,473.57 | 70,206,219 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 636,473.57 | 69,922,987 | 0 | -283,232 | -283,232 |
| 818,692.50000 | | 7/27/2021 | | 818,692.50 | 90,305,878 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 818,692.50 | 89,941,559 | 0 | -364,319 | -364,319 |
| 907,613.73000 | | 7/27/2021 | | 907,613.73 | 100,114,334 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 907,613.73 | 99,710,445 | 0 | -403,889 | -403,889 |
| 1,260,864.28000 | | 7/27/2021 | | 1,260,864.28 | 139,079,637 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,260,864.28 | 138,518,551 | 0 | -561,086 | -561,086 |
| 1,382,989.41000 | | 7/27/2021 | | 1,382,989.41 | 152,550,650 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,382,989.41 | 151,935,218 | 0 | -615,432 | -615,432 |
| 1,606,419.32000 | | 7/27/2021 | | 1,606,419.32 | 177,196,087 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,606,419.32 | 176,481,228 | 0 | -714,859 | -714,859 |
| 1,743,410.36000 | | 7/27/2021 | | 1,743,410.36 | 192,306,884 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,743,410.36 | 191,531,064 | 0 | -775,820 | -775,820 |
| 87,125.00000 | | 7/29/2021 | | 87,125.00 | 9,593,334 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 87,125.00 | 9,571,553 | 0 | -21,781 | -21,781 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 310,000.00000 | | 7/30/2021 | | 310,000.00 | 33,982,200 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 310,000.00 | 34,056,600 | 0 | 74,400 | 74,400 |
| 2,830,913.03000 | | 8/3/2021 | | 2,830,913.03 | 309,319,696 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 2,830,913.03 | 311,004,108 | 0 | 1,684,412 | 1,684,412 |
| 29,041.67000 | | 8/5/2021 | | 29,041.67 | 3,181,660 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 29,041.67 | 3,190,518 | 0 | 8,858 | 8,858 |
| 1,671.12000 | | 8/6/2021 | | 1,671.12 | 183,322 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,671.12 | 183,589 | 0 | 267 | 267 |
| 122,902.50000 | | 8/9/2021 | | 122,902.50 | 13,559,218 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 122,902.50 | 13,502,069 | 0 | -57,149 | -57,149 |
| 7.94000 | | 8/10/2021 | | 7.94 | 871 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 7.94 | 872 | 0 | 1 | 1 |
| 7.94000 | | 8/10/2021 | | 7.94 | 876 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 7.94 | 872 | 0 | -4 | -4 |
| 537.81000 | | 8/12/2021 | | 537.81 | 59,412 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 537.81 | 59,084 | 0 | -328 | -328 |
| 21,533.87000 | | 8/12/2021 | | 21,533.87 | 2,378,847 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 21,533.87 | 2,365,711 | 0 | -13,136 | -13,136 |
| 61,353.78000 | | 8/12/2021 | | 61,353.78 | 6,777,753 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 61,353.78 | 6,740,326 | 0 | -37,427 | -37,427 |
| 1,204,956.26000 | | 8/12/2021 | | 1,204,956.26 | 133,111,523 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,204,956.26 | 132,376,496 | 0 | -735,027 | -735,027 |
| 1,504,637.02000 | | 8/12/2021 | | 1,504,637.02 | 166,217,258 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 1,504,637.02 | 165,299,425 | 0 | -917,833 | -917,833 |
| 15,128.32000 | | 8/15/2021 | | 15,128.32 | 1,662,073 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 15,128.32 | 1,661,997 | 0 | -76 | -76 |
| 66,937.50000 | | 8/15/2021 | | 66,937.50 | 7,354,088 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 66,937.50 | 7,353,754 | 0 | -334 | -334 |
| 83,250.00000 | | 8/15/2021 | | 83,250.00 | 9,146,261 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 83,250.00 | 9,145,845 | 0 | -416 | -416 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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> | | | | | | | | | | | |
| 163,383.75000 | | 8/15/2021 | | 163,383.75 | 17,950,155 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 163,383.75 | 17,949,339 | 0 | -816 | -816 |
| 10,030.57000 | | 8/16/2021 | | 10,030.57 | 1,102,009 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 10,030.57 | 1,101,958 | 0 | -51 | -51 |
| 100,000.00000 | | 8/16/2021 | | 100,000.00 | 10,986,500 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 100,000.00 | 10,986,000 | 0 | -500 | -500 |
| 440,000.00000 | | 8/16/2021 | | 440,000.00 | 48,340,599 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 440,000.00 | 48,338,400 | 0 | -2,199 | -2,199 |
| 127,925.00000 | | 8/19/2021 | | 127,925.00 | 14,058,318 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 127,925.00 | 14,053,841 | 0 | -4,477 | -4,477 |
| 40,286.46000 | | 8/21/2021 | | 40,286.46 | 4,423,655 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 40,286.46 | 4,425,871 | 0 | 2,216 | 2,216 |
| 41,976.00000 | | 8/21/2021 | | 41,976.00 | 4,609,175 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 41,976.00 | 4,611,483 | 0 | 2,308 | 2,308 |
| 90,747.25000 | | 8/23/2021 | | 90,747.25 | 9,964,502 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 90,747.25 | 9,969,493 | 0 | 4,991 | 4,991 |
| 44,661.46000 | | 8/25/2021 | | 44,661.46 | 4,899,139 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 44,661.46 | 4,906,508 | 0 | 7,369 | 7,369 |
| 2,765,100.00000 | | 8/25/2021 | | 2,765,100.00 | 303,317,637 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 2,765,100.00 | 303,773,889 | 0 | 456,252 | 456,252 |
| 50,000.00000 | | 8/26/2021 | | 50,000.00 | 5,505,000 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 50,000.00 | 5,493,000 | 0 | -12,000 | -12,000 |
| 260,000.00000 | | 8/26/2021 | | 260,000.00 | 28,626,000 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 260,000.00 | 28,563,600 | 0 | -62,400 | -62,400 |
| 842,013.92000 | | 8/26/2021 | | 842,013.92 | 92,705,734 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 842,013.92 | 92,503,650 | 0 | -202,084 | -202,084 |
| 29,700.00000 | | 8/27/2021 | | 29,700.00 | 3,268,485 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | 29,700.00 | 3,262,842 | 0 | -5,643 | -5,643 |
| -1,596,452.35000 | | 5/11/2021 | | -1,596,452.35 | -173,590,243 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -1,596,452.35 | -175,386,257 | 0 | -1,796,014 | -1,796,014 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -995,942.01000 | | 5/12/2021 | | -995,942.01 | -108,044,772 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -995,942.01 | -109,414,190 | 0 | -1,369,418 | -1,369,418 |
| -16.88000 | | 5/17/2021 | | -16.88 | -1,843 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -16.88 | -1,854 | 0 | -11 | -11 |
| -20,941.23000 | | 6/10/2021 | | -20,941.23 | -2,295,159 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -20,941.23 | -2,300,604 | 0 | -5,445 | -5,445 |
| -962,339.10000 | | 6/11/2021 | | -962,339.10 | -105,477,181 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -962,339.10 | -105,722,574 | 0 | -245,393 | -245,393 |
| -506,285.67000 | | 6/11/2021 | | -506,285.67 | -55,491,443 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -506,285.67 | -55,620,544 | 0 | -129,101 | -129,101 |
| -428,727.11000 | | 6/11/2021 | | -428,727.11 | -46,990,637 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -428,727.11 | -47,099,961 | 0 | -109,324 | -109,324 |
| -81,727.99000 | | 6/11/2021 | | -81,727.99 | -8,957,797 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -81,727.99 | -8,978,637 | 0 | -20,840 | -20,840 |
| -50,528.35000 | | 6/11/2021 | | -50,528.35 | -5,538,160 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -50,528.35 | -5,551,045 | 0 | -12,885 | -12,885 |
| -888.00000 | | 6/11/2021 | | -888.00 | -97,329 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -888.00 | -97,556 | 0 | -227 | -227 |
| -8,971.70000 | | 6/18/2021 | | -8,971.70 | -988,906 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -8,971.70 | -985,631 | 0 | 3,275 | 3,275 |
| -33,665.86000 | | 6/21/2021 | | -33,665.86 | -3,711,324 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -33,665.86 | -3,698,531 | 0 | 12,793 | 12,793 |
| -100,277.81000 | | 6/28/2021 | | -100,277.81 | -11,108,274 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -100,277.81 | -11,016,520 | 0 | 91,754 | 91,754 |
| -131,794.08000 | | 7/2/2021 | | -131,794.08 | -14,700,311 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -131,794.08 | -14,478,898 | 0 | 221,413 | 221,413 |
| -6,524.14000 | | 7/8/2021 | | -6,524.14 | -721,961 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -6,524.14 | -716,742 | 0 | 5,219 | 5,219 |
| -1,283,413.01000 | | 7/12/2021 | | -1,283,413.01 | -141,355,102 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -1,283,413.01 | -140,995,755 | 0 | 359,347 | 359,347 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -971,304.86000 | | 7/12/2021 | | -971,304.86 | -106,979,512 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -971,304.86 | -106,707,553 | 0 | 271,959 | 271,959 |
| -854,684.84000 | | 7/12/2021 | | -854,684.84 | -94,134,984 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -854,684.84 | -93,895,677 | 0 | 239,307 | 239,307 |
| -495,812.14000 | | 7/12/2021 | | -495,812.14 | -54,608,746 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -495,812.14 | -54,469,922 | 0 | 138,824 | 138,824 |
| -53,232.18000 | | 7/12/2021 | | -53,232.18 | -5,862,992 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -53,232.18 | -5,848,087 | 0 | 14,905 | 14,905 |
| -17,739.06000 | | 7/12/2021 | | -17,739.06 | -1,953,780 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -17,739.06 | -1,948,813 | 0 | 4,967 | 4,967 |
| -7,943.88000 | | 7/12/2021 | | -7,943.88 | -874,939 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -7,943.88 | -872,715 | 0 | 2,224 | 2,224 |
| -5,109.26000 | | 7/12/2021 | | -5,109.26 | -562,734 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -5,109.26 | -561,303 | 0 | 1,431 | 1,431 |
| -913,282.63000 | | 7/15/2021 | | -913,282.63 | -100,543,286 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -913,282.63 | -100,333,231 | 0 | 210,055 | 210,055 |
| -228,672.66000 | | 7/15/2021 | | -228,672.66 | -25,174,574 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -228,672.66 | -25,121,979 | 0 | 52,595 | 52,595 |
| -19,281.00000 | | 7/15/2021 | | -19,281.00 | -2,122,645 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -19,281.00 | -2,118,211 | 0 | 4,434 | 4,434 |
| -94,735.98000 | | 7/19/2021 | | -94,735.98 | -10,430,905 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -94,735.98 | -10,407,695 | 0 | 23,210 | 23,210 |
| -307,339.14000 | | 7/21/2021 | | -307,339.14 | -33,787,329 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -307,339.14 | -33,764,278 | 0 | 23,051 | 23,051 |
| -62,332.68000 | | 7/27/2021 | | -62,332.68 | -6,875,606 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -62,332.68 | -6,847,868 | 0 | 27,738 | 27,738 |
| -36,906.87000 | | 7/28/2021 | | -36,906.87 | -4,052,559 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -36,906.87 | -4,054,589 | 0 | -2,030 | -2,030 |
| -4,418.20000 | | 8/2/2021 | | -4,418.20 | -484,897 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -4,418.20 | -485,383 | 0 | -486 | -486 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -1,390.75000 | | 8/4/2021 | | -1,390.75 | -151,515 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -1,390.75 | -152,788 | 0 | -1,273 | -1,273 |
| -984,414.29000 | | 8/12/2021 | | -984,414.29 | -108,748,251 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -984,414.29 | -108,147,755 | 0 | 600,496 | 600,496 |
| -433,212.64000 | | 8/12/2021 | | -433,212.64 | -47,857,002 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -433,212.64 | -47,592,741 | 0 | 264,261 | 264,261 |
| -200,675.92000 | | 8/12/2021 | | -200,675.92 | -22,168,670 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -200,675.92 | -22,046,257 | 0 | 122,413 | 122,413 |
| -115,508.33000 | | 8/12/2021 | | -115,508.33 | -12,760,206 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -115,508.33 | -12,689,745 | 0 | 70,461 | 70,461 |
| -16,158.36000 | | 8/12/2021 | | -16,158.36 | -1,785,014 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -16,158.36 | -1,775,157 | 0 | 9,857 | 9,857 |
| -9,736.47000 | | 8/12/2021 | | -9,736.47 | -1,075,588 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -9,736.47 | -1,069,649 | 0 | 5,939 | 5,939 |
| -195,879.67000 | | 8/16/2021 | | -195,879.67 | -21,520,320 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -195,879.67 | -21,519,341 | 0 | 979 | 979 |
| -75,367.11000 | | 8/17/2021 | | -75,367.11 | -8,225,943 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -75,367.11 | -8,279,831 | 0 | -53,888 | -53,888 |
| -232,040.04000 | | 8/20/2021 | | -232,040.04 | -25,460,594 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -232,040.04 | -25,491,919 | 0 | -31,325 | -31,325 |
| -36,793.28000 | | 8/25/2021 | | -36,793.28 | -4,036,039 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -36,793.28 | -4,042,110 | 0 | -6,071 | -6,071 |
| -89,762.02000 | | 8/31/2021 | | -89,762.02 | -9,865,295 | 1.000000000 ^S 0.009102494 | -89,762.02 | -9,861,256 | 0 | 4,039 | 4,039 |
| 7,030,061.79000 0.00000 | 合計 ----- | | | 7,030,062 | 776,870,622 | | 7,030,062 | 772,322,593 | 0 | -4,548,029 | -4,548,029 |
| 8,393,772.79000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 8,393,773 | 619,893,933 | | 8,393,773 | 939,551,433 | 0 | 319,657,500 | 319,657,500 |
| 8,393,772.79000 | 外貨建現金勘定合計 | | | 8,393,773 | 619,893,933 | | 8,393,773 | 939,551,433 | 0 | 319,657,500 | 319,657,500 |

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

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

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

保有有価証券残高明細
東京海上ストラテジック・トラスト -
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
クラス・カテゴリ・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| -141,000.00000 | AUD FORWARD 14 SEP FAU14SEP | 8/3/2021 | | -141,000.00 | -11,377,279 | 1.000000000F 80.287989808 | -141,000.00 | -11,320,607 | 0 | 56,672 | 56,672 |
| -456,000.00000 | | 8/17/2021 | | -456,000.00 | -36,299,967 | 1.000000000F 80.287989808 | -456,000.00 | -36,611,323 | 0 | -311,356 | -311,356 |
| -597,000.00000 0.00000 | 合計 ----- | | | -597,000 | -47,677,246 | | -597,000 | -47,931,930 | 0 | -254,684 | -254,684 |
| -31,634,146.41000 | EUR FORWARD 14 SEP FEU14SEP | 7/16/2021 | | -31,634,146.41 | -4,118,256,986 | 1.000000000F 129.705673184 | -31,634,146.41 | -4,103,128,256 | 0 | 15,128,730 | 15,128,730 |
| -28,815,646.40000 | | 7/16/2021 | | -28,815,646.40 | -3,751,151,912 | 1.000000000F 129.705673184 | -28,815,646.40 | -3,737,552,815 | 0 | 13,599,097 | 13,599,097 |
| -26,964,238.15000 | | 7/16/2021 | | -26,964,238.15 | -3,510,038,577 | 1.000000000F 129.705673184 | -26,964,238.15 | -3,497,414,661 | 0 | 12,623,916 | 12,623,916 |
| -26,864,238.15000 | | 7/16/2021 | | -26,864,238.15 | -3,497,378,578 | 1.000000000F 129.705673184 | -26,864,238.15 | -3,484,444,094 | 0 | 12,934,484 | 12,934,484 |
| -2,285,000.00000 | | 8/27/2021 | | -2,285,000.00 | -295,934,431 | 1.000000000F 129.705673184 | -2,285,000.00 | -296,377,463 | 0 | -443,032 | -443,032 |
| -116,563,269.11000 0.00000 | 合計 ----- | | | -116,563,269 | -15,172,760,484 | | -116,563,269 | -15,118,917,289 | 0 | 53,843,195 | 53,843,195 |
| -9,932,563.69 | GBP FORWARD 14 SEP FGB14SEP | 7/16/2021 | | -9,932,563.69 | -1,513,162,862 | 1.000000000F 151.181201404 | -9,932,563.69 | -1,501,616,912 | 0 | 11,545,950 | 11,545,950 |
| -9,867,634.54 | | 7/16/2021 | | -9,867,634.54 | -1,503,132,778 | 1.000000000F 151.181201404 | -9,867,634.54 | -1,491,800,845 | 0 | 11,331,933 | 11,331,933 |
| -9,080,000.00 | | 7/16/2021 | | -9,080,000.00 | -1,382,159,108 | 1.000000000F 151.181201404 | -9,080,000.00 | -1,372,725,309 | 0 | 9,433,799 | 9,433,799 |
| -515,713.70 | | 7/16/2021 | | -515,713.70 | -78,301,829 | 1.000000000F 151.181201404 | -515,713.70 | -77,966,217 | 0 | 335,612 | 335,612 |
| -29,395,911.93000 0.00000 | 合計 ----- | | | -29,395,912 | -4,476,756,577 | | -29,395,912 | -4,444,109,283 | 0 | 32,647,294 | 32,647,294 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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・グループ別 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 517,196.11000 | USD FORWARD 14 SEP FUS14SEP | 7/16/2021 | | 517,196.11 | 56,923,479 | 1.000000000F 0.009103670 | 517,196.11 | 56,811,825 | 0 | -111,654 | -111,654 |
| 635,928.20000 | | 7/16/2021 | | 635,928.20 | 70,000,001 | 1.000000000F 0.009103670 | 635,928.20 | 69,854,048 | 0 | -145,953 | -145,953 |
| 711,608.58000 | | 7/16/2021 | | 711,608.58 | 78,301,828 | 1.000000000F 0.009103670 | 711,608.58 | 78,167,220 | 0 | -134,608 | -134,608 |
| 1,176,331.58000 | | 7/16/2021 | | 1,176,331.58 | 129,472,584 | 1.000000000F 0.009103670 | 1,176,331.58 | 129,215,095 | 0 | -257,489 | -257,489 |
| 2,290,304.23000 | | 7/16/2021 | | 2,290,304.23 | 252,089,232 | 1.000000000F 0.009103670 | 2,290,304.23 | 251,580,322 | 0 | -508,910 | -508,910 |
| 12,561,089.49000 | | 7/16/2021 | | 12,561,089.49 | 1,382,159,094 | 1.000000000F 0.009103670 | 12,561,089.49 | 1,379,783,042 | 0 | -2,376,052 | -2,376,052 |
| 13,660,500.65000 | | 7/16/2021 | | 13,660,500.65 | 1,503,132,767 | 1.000000000F 0.009103670 | 13,660,500.65 | 1,500,548,751 | 0 | -2,584,016 | -2,584,016 |
| 13,751,654.29000 | | 7/16/2021 | | 13,751,654.29 | 1,513,162,855 | 1.000000000F 0.009103670 | 13,751,654.29 | 1,510,561,597 | 0 | -2,601,258 | -2,601,258 |
| 31,784,246.06000 | | 7/16/2021 | | 31,784,246.06 | 3,497,378,533 | 1.000000000F 0.009103670 | 31,784,246.06 | 3,491,366,236 | 0 | -6,012,297 | -6,012,297 |
| 31,899,300.43000 | | 7/16/2021 | | 31,899,300.43 | 3,510,038,538 | 1.000000000F 0.009103670 | 31,899,300.43 | 3,504,004,476 | 0 | -6,034,062 | -6,034,062 |
| 34,090,543.54000 | | 7/16/2021 | | 34,090,543.54 | 3,751,151,905 | 1.000000000F 0.009103670 | 34,090,543.54 | 3,744,703,349 | 0 | -6,448,556 | -6,448,556 |
| 37,426,801.50000 | | 7/16/2021 | | 37,426,801.50 | 4,118,256,947 | 1.000000000F 0.009103670 | 37,426,801.50 | 4,111,177,305 | 0 | -7,079,642 | -7,079,642 |
| 1,052,000.00000 | | 7/21/2021 | | 1,052,000.00 | 115,810,691 | 1.000000000F 0.009103670 | 1,052,000.00 | 115,557,792 | 0 | -252,899 | -252,899 |
| 68,820.41000 | | 8/3/2021 | | 68,820.41 | 7,500,000 | 1.000000000F 0.009103670 | 68,820.41 | 7,559,634 | 0 | 59,634 | 59,634 |

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

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

(注2) 基準通貨とは、サブ・ファンド計理上の基準通貨をいいます。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 2021年8月31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 | | | | | | | | | | | |
| 104,125.54000 | | 8/3/2021 | | 104,125.54 | 11,377,279 | 1.000000000F 0.009103670 | 104,125.54 | 11,437,754 | 0 | 60,475 | 60,475 |
| 1,359,619.31000 | | 8/9/2021 | | 1,359,619.31 | 149,612,318 | 1.000000000F 0.009103670 | 1,359,619.31 | 149,348,484 | 0 | -263,834 | -263,834 |
| 332,584.65000 | | 8/17/2021 | | 332,584.65 | 36,299,967 | 1.000000000F 0.009103670 | 332,584.65 | 36,533,030 | 0 | 233,063 | 233,063 |
| 352,480.31000 | | 8/17/2021 | | 352,480.31 | 38,500,000 | 1.000000000F 0.009103670 | 352,480.31 | 38,718,485 | 0 | 218,485 | 218,485 |
| 2,689,091.05000 | | 8/27/2021 | | 2,689,091.05 | 295,934,429 | 1.000000000F 0.009103670 | 2,689,091.05 | 295,385,383 | 0 | -549,046 | -549,046 |
| -1,406,000.00000 | | 7/16/2021 | | -1,406,000.00 | -154,779,285 | 1.000000000F 0.009103670 | -1,406,000.00 | -154,443,208 | 0 | 336,077 | 336,077 |
| -1,890,000.00000 | | 7/26/2021 | | -1,890,000.00 | -208,354,318 | 1.000000000F 0.009103670 | -1,890,000.00 | -207,608,580 | 0 | 745,738 | 745,738 |
| 183,168,225.93000 0.00000 | 合計 ----- | | | 183,168,226 | 20,153,968,844 | | 183,168,226 | 20,120,262,040 | 0 | -33,706,804 | -33,706,804 |
| 36,612,044.89000 | 非グループ化の有価証券小計 | | | 36,612,045 | 456,774,537 | | 36,612,045 | 509,303,538 | 0 | 52,529,001 | 52,529,001 |
| 36,612,044.89000 | 先物(ポジション)合計 | | | 36,612,045 | 456,774,537 | | 36,612,045 | 509,303,538 | 0 | 52,529,001 | 52,529,001 |
| 証拠金勘定 | | | | | | | | | | | |
| 証拠金勘定 | | | | | | | | | | | |
| -50,000.00 | USD MARGIN | 8/26/2021 | | -50,000.00 | -5,505,000 | 1.000000000S 0.009102494 | -50,000.00 | -5,493,000 | 0 | 12,000 | 12,000 |
| -50,000.00000 | USD MAR | | | -50,000 | -5,505,000 | | -50,000 | -5,493,000 | 0 | 12,000 | 12,000 |
| -50,000.00000 | 証拠金勘定小計 | | | -50,000 | -5,505,000 | | -50,000 | -5,493,000 | 0 | 12,000 | 12,000 |
| 551,732,222.68000 | 証拠金勘定合計 | | | -50,000 | -5,505,000 | | -50,000 | -5,493,000 | 0 | 12,000 | 12,000 |
| 987,728,197.96000 | クラスに割当てられていない資産合計 | | | 560,789,326 | 35,573,317,833 | | 579,561,440 | 39,116,504,996 | 2,246,648,772 | 1,296,538,393 | 3,543,187,165 |
| | ポートフォリオ合計 | | | 996,785,301 | 27,510,573,157 | | 1,015,557,415 | 31,023,442,711 | 2,246,648,772 | 1,266,220,784 | 3,512,869,556 |

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

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

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

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額(2021年9月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約209億円)

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、2021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 | 27 | 4,743,413,324.05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、2021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=111.92円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

[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)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

米ドル

千円

| | | 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 | 7,246,028,529.00 | 810,975,513 |
| 020 | 手元現金 | | |
| 030 | 中央銀行における現金残高 | 5,362,012,390.00 | 600,116,427 |
| 040 | その他の要求払預金 | 1,884,016,139.00 | 210,859,086 |
| 050 | 売買目的で保有される金融資産 | 107,280,955.27 | 12,006,885 |
| 060 | デリバティブ | 107,280,955.27 | 12,006,885 |
| 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 | 0.00 | 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 | 0.00 | 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 | 2,939.77 | 329 |
| 142 | 持分証券 | 2,939.77 | 329 |
| 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 | 1,466,622,700.00 | 164,144,413 |
| 182 | 債務証券 | | |
| 183 | ローンおよび貸付金 | 1,466,622,700.00 | 164,144,413 |
| 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 | 4,109,560.00 | 459,942 |
| 280 | 有形固定資産 | 4,109,560.00 | 459,942 |
| 290 | 投資不動産 | | |
| 300 | 無形資産 | 3,715,285.88 | 415,815 |
| 310 | 営業権 | | |
| 320 | その他の無形資産 | 3,715,285.88 | 415,815 |
| 330 | 税金資産 | 634.46 | 71 |
| 340 | 現行税金資産 | 634.46 | 71 |
| 350 | 繰延税金資産 | | |
| 360 | その他の資産 | 28,126,532.00 | 3,147,921 |
| 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 | 8,855,887,136.38 | 991,150,888 |

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)

2021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 | 43,403,070.62 | 4,857,672 |
| 020 | デリバティブ | 43,403,070.62 | 4,857,672 |
| 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 | 0.00 | 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 | 8,290,907,401.92 | 927,918,356 |
| 120 | 預金 | 8,287,410,580.92 | 927,526,992 |
| 130 | 発行済み債務証券 | | |
| 140 | その他の金融負債 | 3,496,821.00 | 391,364 |
| 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 | 0.00 | 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 | 6,001,713.00 | 671,712 |
| 250 | 現行税金負債 | 5,196,887.00 | 581,636 |
| 260 | 繰延税金負債 | 804,826.00 | 90,076 |
| 270 | 要求払株式資本 | | |
| 280 | その他の負債 | 26,055,829.00 | 2,916,168 |
| 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 | 8,366,368,014.54 | 936,363,908 |

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)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

米ドル

千円

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|---|----------------|------------|
| 010 | 資本 | 187,117,965.90 | 20,942,243 |
| 020 | 払込資本 | 187,117,965.90 | 20,942,243 |
| 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 | 0.00 | 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 | 0.00 | 0 |
| 095 | 損益に再分類されることがない項目 | 0.00 | 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 | 0.00 | 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 | 51,012.00 | 5,709 |
| 200 | 再評価準備金 | | |
| 210 | その他の準備金 | 287,051,461.95 | 32,126,800 |
| 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 | 287,051,461.95 | 32,126,800 |
| 240 | (-)自己株式 | | |
| 250 | 親会社株主に帰属する損益 | 15,298,683.00 | 1,712,229 |

米ドル

千円

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|---------------|------------------|-------------|
| 260 | (-) 中間配当 | 0.00 | 0 |
| 270 | 少数株主持分〔非支配持分〕 | 0.00 | 0 |
| 280 | その他の累積包括利益 | | |
| 290 | その他の項目 | | |
| 300 | 資本合計 | 489,519,122.85 | 54,786,980 |
| 310 | 資本および負債合計 | 8,855,887,137.00 | 991,150,888 |

(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

2021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 | 24,982,244.29 | 2,796,013 |
| 020 | 売買目的で保有される金融資産 | 14,527,723.86 | 1,625,943 |
| 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 | 2,856,428.89 | 319,692 |
| 070 | デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク | | |
| 080 | その他の資産 | 274,086.66 | 30,676 |
| 085 | 負債に係る利息収益 | 7,324,004.88 | 819,703 |
| 090 | (支払利息) | 19,004,963.84 | 2,127,036 |
| 100 | (売買目的で保有される金融負債) | 84,365.71 | 9,442 |
| 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) | 75,371.77 | 8,436 |
| 130 | (デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク) | | |
| 140 | (その他の負債) | 2,730.93 | 306 |
| 145 | (資産に係る支払利息) | 18,842,495.43 | 2,108,852 |
| 150 | (要求払株式資本に係る費用) | | |
| 160 | 受取配当 | 0.00 | 0 |
| 170 | 売買目的で保有される金融資産 | | |
| 175 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産 | | |
| 191 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産 | | |
| 192 | 持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合弁会社および 関連会社への投資 | | |
| 200 | 受取手数料 | 78,830,139.63 | 8,822,669 |
| 210 | (支払手数料) | 41,110,599.86 | 4,601,098 |
| 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 | 0.00 | 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 | 8,302,578.19 | 929,225 |
| 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 | | |
| 320 | 子会社、合弁会社および関連会社への投資に係る利益または (-)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 | 3,261,533.33 | 365,031 |

米ドル

千円

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|---|---------------|-----------|
| 350 | (その他の事業費用) | 1,727,802.18 | 193,376 |
| 355 | 事業収益合計、純額 | 53,533,129.56 | 5,991,428 |
| 360 | (管理費用) | 29,465,307.91 | 3,297,757 |
| 370 | (従業員費用) | 12,612,334.22 | 1,411,572 |
| 380 | (その他の管理費用) | 16,852,973.69 | 1,886,185 |
| 385 | (破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金) | 1,973,595.71 | 220,885 |
| 390 | (減価償却) | 1,394,486.93 | 156,071 |
| 400 | (有形固定資産) | 749,949.70 | 83,934 |
| 410 | (投資不動産) | | |
| 420 | (その他の無形資産) | 644,537.23 | 72,137 |
| 425 | 修正利益または(-)損失、純額 | 0.00 | 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) | 0.00 | 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) | 314,583.91 | 35,208 |
| 481 | (その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産) | | |
| 491 | (償却後原価における金融資産) | 314,583.91 | 35,208 |
| 510 | (子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または(-)減損の戻入) | | |
| 520 | (非金融資産に係る減損または(-)減損の戻入) | 0.00 | 0 |
| 530 | (有形固定資産) | | |
| 540 | (投資不動産) | | |
| 550 | (営業権) | | |
| 560 | (その他の無形資産) | | |
| 570 | (その他) | | |
| 580 | 損益認識されるマイナスの営業権 | | |
| 590 | 持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または(-)損失の持分 | | |
| 600 | 非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される売却グループからの利益または(-)損失 | | |
| 610 | 継続事業からの税引前利益または(-)損失 | 20,385,155.10 | 2,281,507 |
| 620 | (継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入) | 5,086,471.60 | 569,278 |
| 630 | 継続事業からの税引後利益または(-)損失 | 15,298,683.50 | 1,712,229 |
| 640 | 非継続事業からの税引後利益または(-)損失 | 0.00 | 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 | 15,298,683.50 | 1,712,229 |
| 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 | 15,298,683.50 | 1,712,229 |

[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 (2021年 6 月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約207億円)

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 (2021年 9 月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約209億円)

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、2021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 = 111.92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

2021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

2021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

(2021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 | The 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 | 122.91 | 849,302,643 | 2.16 |
| 2 | 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 | 177.79 | 835,622,471 | 2.12 |
| 3 | Goldman Sachs Capital I | 米国 | 社債 | 6.345 | 2034/2/15 | 5,150,000 | 139.56 | 718,749,937 | 154.91 | 797,802,894 | 2.02 |
| 4 | BPCE SA | フランス | 社債 | 4.500 | 2025/3/15 | 6,240,000 | 110.91 | 692,056,012 | 122.50 | 764,425,579 | 1.94 |
| 5 | Standard Chartered PLC | 英国 | 社債 | 4.300 | 2027/2/19 | 5,950,000 | 99.87 | 594,216,645 | 121.77 | 724,527,588 | 1.84 |
| 6 | 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 | 117.88 | 618,865,518 | 1.57 |
| 7 | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand | メキシコ | 社債 | 5.375 | 2025/4/17 | 4,850,000 | 120.31 | 583,481,444 | 126.20 | 612,081,090 | 1.55 |
| 8 | UniCredit SpA | イタリア | 社債 | 2.000 (2024年9月以降変動金利) | 2029/9/23 | 4,550,000 | 123.61 | 562,443,768 | 132.75 | 604,029,264 | 1.53 |
| 9 | 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 | 113.40 | 595,336,182 | 1.51 |
| 10 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | オーストラリア | 社債 | 0.669 (2026年5月以降変動金利) | 2031/5/5 | 4,500,000 | 126.46 | 569,080,991 | 131.11 | 590,005,543 | 1.50 |
| 11 | 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 | 137.59 | 550,363,301 | 1.40 |
| 12 | BNP Paribas SA | フランス | 社債 | 4.375 | 2025/9/28 | 4,350,000 | 114.43 | 497,758,656 | 123.09 | 535,427,573 | 1.36 |
| 13 | 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 | 138.18 | 525,095,913 | 1.33 |
| 14 | Bank of America Corp | 米国 | 社債 | 7.750 | 2038/5/14 | 2,950,000 | 168.19 | 496,152,228 | 175.47 | 517,645,269 | 1.31 |
| 15 | HSBC Bank USA NA | 米国 | 社債 | 7.000 | 2039/1/15 | 3,000,000 | 137.73 | 413,185,215 | 171.82 | 515,456,855 | 1.31 |
| 16 | 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 | 150.82 | 497,702,518 | 1.26 |
| 17 | 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 | 119.52 | 496,020,082 | 1.26 |

| | 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 | |
| 18 | Bank of Ireland Group PLC | 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 | 137.42 | 494,725,195 | 1.26 |
| 19 | HSBC Holdings PLC | 英国 | 社債 | 6.800 | 2038/6/1 | 3,050,000 | 141.19 | 430,633,498 | 160.02 | 488,060,483 | 1.24 |
| 20 | Hastings Group Finance PLC | ジャージー | 社債 | 3.000 | 2025/5/24 | 2,800,000 | 131.62 | 368,529,829 | 162.97 | 456,302,795 | 1.16 |
| 21 | Deutsche Bank AG | ドイツ | 社債 | 1.375 (2025年9月以降変動金利) | 2026/9/3 | 3,300,000 | 124.98 | 412,439,286 | 136.47 | 450,353,362 | 1.14 |
| 22 | Banco Santander SA | スペイン | 社債 | 3.125 | 2027/1/19 | 3,000,000 | 121.54 | 364,610,750 | 149.54 | 448,626,599 | 1.14 |
| 23 | Phoenix Group Holdings PLC | 英国 | 社債 | 4.375 | 2029/1/24 | 2,870,000 | 132.74 | 380,970,967 | 155.00 | 444,863,081 | 1.13 |
| 24 | Credit Suisse Group AG | スイス | 社債 | 2.250 (2027年6月以降変動金利) | 2028/6/9 | 2,800,000 | 136.53 | 382,293,772 | 157.58 | 441,229,504 | 1.12 |
| 25 | Virgin Money UK PLC | 英国 | 社債 | 3.125 (2024年6月以降変動金利) | 2025/6/22 | 2,650,000 | 143.99 | 381,572,058 | 161.05 | 426,787,163 | 1.08 |
| 26 | Barclays PLC | 英国 | 社債 | 3.811 (2041年3月以降変動金利) | 2042/3/10 | 3,600,000 | 106.96 | 385,056,019 | 117.28 | 422,211,271 | 1.07 |
| 27 | Chubb INA Holdings Inc | 米国 | 社債 | 2.500 | 2038/3/15 | 2,600,000 | 130.39 | 339,008,298 | 158.56 | 412,244,937 | 1.05 |
| 28 | LSEGA Financing PLC | 英国 | 社債 | 3.200 | 2041/4/6 | 3,550,000 | 108.59 | 385,499,865 | 115.98 | 411,734,107 | 1.04 |
| 29 | Morgan Stanley | 米国 | 社債 | 3.217 (2041年4月以降変動金利) | 2042/4/22 | 3,500,000 | 108.03 | 378,104,998 | 117.19 | 410,160,753 | 1.04 |
| 30 | Assicurazioni Generali SpA | イタリア | 社債 | 5.000 (2028年6月以降変動金利) | 2048/6/8 | 2,550,000 | 148.35 | 378,289,811 | 160.09 | 408,240,762 | 1.04 |

投資不動産物件

該当事項なし。(2021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。(2021年6月末日現在)

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄

(2021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 | The 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 | 122.88 | 849,099,323 | 2.23 |
| 2 | 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 | 174.62 | 820,733,829 | 2.15 |
| 3 | Goldman Sachs Capital I | 米国 | 社債 | 6.345 | 2034/2/15 | 5,150,000 | 139.56 | 718,749,937 | 156.75 | 807,248,337 | 2.12 |
| 4 | Standard Chartered PLC | 英国 | 社債 | 4.300 | 2027/2/19 | 5,950,000 | 99.87 | 594,216,645 | 121.66 | 723,885,235 | 1.90 |
| 5 | BPCE SA | フランス | 社債 | 4.500 | 2025/3/15 | 5,440,000 | 110.91 | 603,330,882 | 122.48 | 666,305,214 | 1.75 |
| 6 | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand | メキシコ | 社債 | 5.375 | 2025/4/17 | 4,850,000 | 120.31 | 583,481,444 | 124.99 | 606,183,625 | 1.59 |
| 7 | UniCredit SpA | イタリア | 社債 | 2.000 (2024年9月以降変動金利) | 2029/9/23 | 4,550,000 | 123.61 | 562,443,768 | 131.87 | 599,991,658 | 1.57 |
| 8 | 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 | 113.23 | 594,461,580 | 1.56 |
| 9 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | オーストラリア | 社債 | 0.669 (2026年5月以降変動金利) | 2031/5/5 | 4,500,000 | 126.46 | 569,080,991 | 129.17 | 581,283,300 | 1.53 |
| 10 | 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 | 134.88 | 539,501,373 | 1.42 |
| 11 | Bank of America Corp | 米国 | 社債 | 7.750 | 2038/5/14 | 2,950,000 | 168.19 | 496,152,228 | 175.74 | 518,431,674 | 1.36 |
| 12 | HSBC Bank USA NA | 米国 | 社債 | 7.000 | 2039/1/15 | 3,000,000 | 137.73 | 413,185,215 | 172.18 | 516,544,286 | 1.36 |
| 13 | 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 | 135.80 | 516,034,723 | 1.35 |
| 14 | 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 | 118.68 | 492,503,882 | 1.29 |
| 15 | 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 | 148.10 | 488,738,060 | 1.28 |
| 16 | HSBC Holdings PLC | 英国 | 社債 | 6.800 | 2038/6/1 | 3,050,000 | 141.19 | 430,633,498 | 159.53 | 486,573,102 | 1.28 |
| 17 | Bank of Ireland Group PLC | 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 | 134.87 | 485,541,930 | 1.27 |
| 18 | NatWest Group PLC | 英国 | 社債 | 1.043 (2027年9月以降変動金利) | 2032/9/14 | 3,550,000 | 130.53 | 463,380,573 | 128.99 | 457,916,093 | 1.20 |

| | 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 | |
| 19 | Banco Santander SA | スペイン | 社債 | 3.125 | 2027/1/19 | 3,000,000 | 121.54 | 364,610,750 | 146.47 | 439,419,437 | 1.15 |
| 20 | Phoenix Group Holdings PLC | 英国 | 社債 | 4.375 | 2029/1/24 | 2,870,000 | 132.74 | 380,970,967 | 153.10 | 439,394,081 | 1.15 |
| 21 | Barclays PLC | 英国 | 社債 | 3.811 (2041年3月以降変動金利) | 2042/3/10 | 3,600,000 | 106.96 | 385,056,019 | 119.13 | 428,879,145 | 1.13 |
| 22 | Credit Suisse Group AG | スイス | 社債 | 2.250 (2027年6月以降変動金利) | 2028/6/9 | 2,800,000 | 136.53 | 382,293,772 | 153.08 | 428,630,739 | 1.13 |
| 23 | Virgin Money UK PLC | 英国 | 社債 | 3.125 (2024年6月以降変動金利) | 2025/6/22 | 2,650,000 | 143.99 | 381,572,058 | 157.22 | 416,619,896 | 1.09 |
| 24 | Morgan Stanley | 米国 | 社債 | 3.217 (2041年4月以降変動金利) | 2042/4/22 | 3,500,000 | 108.03 | 378,104,998 | 117.33 | 410,651,231 | 1.08 |
| 25 | LSEGA Financing PLC | 英国 | 社債 | 3.200 | 2041/4/6 | 3,550,000 | 108.59 | 385,499,865 | 115.00 | 408,261,164 | 1.07 |
| 26 | Chubb INA Holdings Inc | 米国 | 社債 | 2.500 | 2038/3/15 | 2,600,000 | 130.39 | 339,008,298 | 155.24 | 403,628,274 | 1.06 |
| 27 | Assicurazioni Generali SpA | イタリア | 社債 | 5.000 (2028年6月以降変動金利) | 2048/6/8 | 2,550,000 | 148.35 | 378,289,811 | 157.55 | 401,758,656 | 1.05 |
| 28 | Commonwealth Bank of Australia | オーストラリア | 社債 | 3.610 (2029年9月以降変動金利) | 2034/9/12 | 3,400,000 | 107.05 | 363,970,009 | 118.00 | 401,198,283 | 1.05 |
| 29 | Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd | 日本 | 社債 | 4.950 (2029年3月以降変動金利) | 永久債 | 3,100,000 | 110.90 | 343,774,504 | 127.16 | 394,184,988 | 1.03 |
| 30 | JPMorgan Chase & Co | 米国 | 社債 | 2.956 (2030年5月以降変動金利) | 2031/5/13 | 3,400,000 | 106.05 | 360,570,015 | 115.90 | 394,074,743 | 1.03 |

投資不動産物件

該当事項なし。(2021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。(2021年9月末日現在)