

## 【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】 平成26年7月31日

【発行者名】 UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ  
(UBS (Lux) Strategy Xtra SICAV)

【代表者の役職氏名】 取締役会長  
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)  
取締役  
アロイセ・ヘメン (Aloyse Hemmen)

【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 - 1855、J.F. ケネディ通り33A  
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健  
弁護士 大 西 信 治

【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  
弁護士 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)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】 UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ  
- バランスド(米ドル)  
(UBS (Lux) Strategy Xtra SICAV  
- Balanced (USD))

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】 記名式無額面投資証券  
バランスド(米ドル)  
クラス P - a c c 投資証券  
上限見込額は以下のとおりである。  
バランスド(米ドル)  
クラス P - a c c 投資証券  
13億2,500万米ドル(約1,347億円)

(注) 米ドルの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、平成26年5月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=101.66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、半期報告書を提出しましたので、平成26年4月28日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、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】

半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

| 原届出書                                       |                     | 半期報告書         |                                                         | 訂正の方法   |
|--------------------------------------------|---------------------|---------------|---------------------------------------------------------|---------|
| 第二部 ファンド情報<br>第1 ファンドの状況<br>1 外国投資法人の概況    | (1) 主要な経営指標等の推移     | 1 外国投資法人の概況   | (1) 主要な経営指標等の推移                                         | 追加      |
|                                            | (5) 外国投資法人の出資総額     |               | (2) 外国投資法人の出資総額                                         | 追加      |
| 3 投資リスク                                    |                     | 2 外国投資法人の運用状況 | (3) 投資リスク                                               | 更新      |
| 5 運用状況                                     | (1) 投資状況            |               | (1) 投資状況                                                | 更新      |
|                                            | (3) 運用実績            |               | (2) 運用実績                                                | 追加または更新 |
| 第2 財務ハイライト情報                               |                     | 4 外国投資法人の経理状況 | (1) 資産及び負債の状況<br>「純資産計算書」<br>「運用計算書」<br>「重要な会計方針の要約」の注記 | 追加      |
| 第三部 外国投資法人の詳細情報<br>第1 外国投資法人の追加情報<br>5 その他 |                     | 1 外国投資法人の概況   | (5) その他                                                 | 更新      |
| 第4 関係法人の状況<br>1 資産運用会社の概況                  | (1) 名称、資本金の額及び事業の内容 | 3 資産運用会社の概況   | (1) 名称及び資本金の額                                           | 更新      |
| 第5 外国投資法人の経理状況<br>1 財務諸表                   |                     | 4 外国投資法人の経理状況 |                                                         | 追加      |
| 第6 販売及び買戻しの実績                              |                     | 5 販売及び買戻しの実績  |                                                         | 追加      |

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。（原届出書に対する訂正内容に該当しない箇所は省略します。）

[次へ](#)

## 1 外国投資法人の概況

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(米ドル)(以下「UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ」を「本投資法人」、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(米ドル)を「ファンド」または「サブ・ファンド」という。)の概況は以下のとおりである。

(注) ファンドにはP - a c c 投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、以下、ファンドについて「投資証券」という場合は、上記のクラスP - a c c 投資証券を指すものとする。

### (1) 主要な経営指標等の推移

(バランスド(米ドル))

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

|                                                       | 2012年4月末日に<br>終了する<br>中間会計年度末 | 2012年10月末日に<br>終了する<br>会計年度末 | 2013年4月末日に<br>終了する<br>中間会計年度末 | 2013年10月末日に<br>終了する<br>会計年度末 | 2014年4月末日に<br>終了する<br>中間会計年度末 |
|-------------------------------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-------------------------------|
| (a) 営業収益 <sup>(1)</sup>                               | 4,392,079.47                  | 4,782,498.99                 | 6,224,924.72                  | 9,306,326.88                 | 3,400,109.16                  |
| (b) 経常利益金額または<br>経常損失金額                               | 4,392,079.47                  | 4,782,498.99                 | 6,224,924.72                  | 9,306,326.88                 | 3,400,109.16                  |
| (c) 当期純利益金額または<br>当期純損失金額                             | 4,392,079.47                  | 4,782,498.99                 | 6,224,924.72                  | 9,306,326.88                 | 3,400,109.16                  |
| (d) 出資総額 <sup>(2)</sup>                               | 92,640,916.18                 | 85,796,172.77                | 87,322,874.98                 | 91,057,425.43                | 134,333,199.86                |
| (e) 発行済投資株総数<br>(クラスP - a c c 投資証券)                   | □<br>7,461,468.2550           | □<br>6,835,649.5000          | □<br>6,478,511.8470           | □<br>6,431,531.4360          | □<br>9,316,585.7650           |
| (f) 純資産額                                              | 92,640,916.18                 | 85,796,172.77                | 87,322,874.98                 | 91,057,425.43                | 134,333,199.86                |
| (g) 資産総額                                              | 93,372,583.19                 | 85,927,307.23                | 87,878,402.95                 | 91,397,187.72                | 138,356,916.99                |
| (h) 1口当たり純資産価格<br>(クラスP - a c c 投資証券)                 | 0.56                          | 11.92                        | 12.81                         | 13.25                        | 13.65                         |
| (i) 1口当たり当期純利益金<br>額または当期純損失金額<br>(クラスP - a c c 投資証券) | 0.91                          | 0.67                         | 0.91                          | 1.37                         | 0.34                          |
| (j) 分配総額                                              | -                             | -                            | -                             | -                            | -                             |
| (k) 1口当たり分配金額                                         | -                             | -                            | -                             | -                            | -                             |
| (l) 自己資本比率                                            | 99.22%                        | 99.85%                       | 99.37%                        | 99.63%                       | 97.09%                        |
| (m) 自己資本利益率 <sup>(3)</sup><br>(クラスP - a c c 投資証券)     | - 2.39%                       | 5.39%                        | 8.10%                         | 11.16%                       | 6.56%                         |

(1) 営業収益には投資収益および実現および未実現利益(損益)を含めている。以下同じ。

(2) ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

(3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。

(4) 「主要な経営指標等の推移(e)発行済投資株総数、(h)1口当たり純資産価格、(i)1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額および(m)自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

## (2) 外国投資法人の出資総額

2014年5月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

|            | 出資総額(米ドル)                      | 発行済投資証券総数(口)       |                |
|------------|--------------------------------|--------------------|----------------|
| バランスド(米ドル) | 142,726,853.08<br>(約14,510百万円) | クラス P - a c c 投資証券 | 9,806,329.5450 |

(注) 出資総額は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

## (5) その他

## a. 定款の変更

本投資法人の定款は、本投資法人の投資主総会により適用を拡大するかまたはその他の方法で変更することができる。変更は、1915年8月10日法に規定される定足数および過半数の要件に従わなければならない。

## b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人およびそのサブ・ファンドの解散、サブ・ファンドの合併

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

定足数および過半数に関する法律条件を満たす投資主総会は本投資法人を清算することができる。

本投資法人の純資産総額が所定の最低資本金の3分の2または4分の1以下になった場合、本投資法人の取締役会は、本投資法人を清算するか否かについて投資主総会の採決を求めなければならない。本投資法人が解散する場合、清算は投資主総会で指名された一名以上の清算人が実行する。投資主総会では清算人の職務の範囲を決定する。清算人は投資主の最善の利益にかなうように本投資法人の資産を売却して、サブ・ファンドの清算による正味収入を投資主の保有量に比例して当該サブ・ファンドの投資主に分配する。投資主に分配できない清算収入は時効期間の満了までルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に預託される。

取締役会の権利にかかわらず、取締役会の提案に基づいて、サブ・ファンドの投資主総会において、サブ・ファンドが発行した投資証券を回収し、投資主に対して保有する投資証券の純資産価額を返還することにより、当投資法人の資本を減額することができる。純資産価額は上記の決定が効力を発生する日に計算し、サブ・ファンドの資産の処分によって生じた代金および清算に起因する費用を織り込むものとする。

投資主総会による投資証券の回収の決定は、法律が要求する刊行物に公告することによって関係するサブ・ファンドの投資主に通知される。さらに、当投資法人の投資証券が販売される国の制定法上の規則に基づいて必要とされる場合、関係各国の機関紙において公表される。

買戻しのために投資主が提出しなかった換金される投資証券の純資産価額に相当する金額は、6か月間保管銀行に預けられ、かかる期間が経過した後、買戻しのために依然提出されない場合、かかる投資証券に対する権利を有する者に代わって時効期間が経過するまでルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に預託される。

サブ・ファンドと他の投資信託(「UCI」)との合併

「本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散」の項に記載される状況の下で、本投資法人の取締役会は、サブ・ファンドの投資証券の発行を取りやめ、別のUCIまたは別のサブ・ファンドの投資証券として指定することができる。前項の本投資法人の取締役会の権限にかかわらず、上記のサブ・ファンドを合併する決定もまた、当該サブ・ファンドの投資主総会において採択することができる。

合併の決定は投資証券の買戻しに関して既述した方法と同じ方法で投資主に通知する。決定が公告されてから一か月以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、前記「第2 手続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載するガイドラインに従って、買戻手数料またはその他の管理料金を

支払わずに、その時点の純資産価格で買い戻す権限を有する。買い戻しのために提出されなかった投資証券は、決定が有効となる日に計算した関係するサブ・ファンドの投資証券の純資産価格に基づいて交換される。割当てる投資証券が集合的投資ファンド(契約型オープン投資信託)の受益証券である場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

#### 本投資法人の総会

サブ・ファンドの清算および合併のいずれの場合についても、本投資法人の総会の定足数は要求されず、決定は総会で代表されるまたは委任状により代表される投資証券の単純多数によって承認されることができる。

#### その他

投資者が投資証券クラスの要件を満たさない場合(日本において募集される投資証券クラスについては該当しない。)、本投資法人は、さらに当該投資者に以下の事項を行うよう要求する義務を負う。

- a) 投資証券の買い戻しの規定に従い、30暦日以内にその投資証券を返還すること、
- b) 投資証券の取得に関する投資証券クラスの要件を満たす者に対してその投資証券を譲渡すること、または
- c) その投資証券から、当該投資者が満たすことの可能な取得要件を有する関連するサブ・ファンドの他の投資証券クラスに乗り換えること。

さらに、本投資法人は

- a) その裁量により投資証券の購入申込みを拒絶することができる。
- b) 排斥命令に違反して購入または取得された投資証券を常に買い戻すことができる。

#### c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

#### d. 訴訟事件その他の重要事項

本書提出日前6か月以内において、訴訟事件その他ファンドに重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

## 2 外国投資法人の運用状況

## (1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(バランスド(米ドル))

(2014年5月末日現在)

| 資産の種類 | 国・地域名   | 時価合計(米ドル)     | 投資比率(%) |
|-------|---------|---------------|---------|
| 投資信託  | ルクセンブルグ | 62,656,806.77 | 43.32   |
|       | ジャージー島  | 547,233.43    | 0.38    |
|       | アメリカ合衆国 | 34,423.81     | 0.02    |
|       | 日本      | 5,857.78      | 0.00    |
|       | カナダ     | 2,919.63      | 0.00    |
|       | 小計      | 63,247,241.42 | 43.73   |
| 債券    | アメリカ合衆国 | 21,057,711.87 | 14.56   |
|       | 国際機関    | 4,945,997.66  | 3.42    |
|       | カナダ     | 2,135,755.37  | 1.48    |
|       | ドイツ     | 2,068,949.42  | 1.43    |
|       | 大韓民国    | 1,168,900.55  | 0.81    |
|       | オーストリア  | 1,052,365.69  | 0.73    |
|       | イギリス    | 956,647.02    | 0.66    |
|       | オーストラリア | 893,840.24    | 0.62    |
|       | フランス    | 666,331.23    | 0.46    |
|       | ベルギー    | 285,709.48    | 0.20    |
|       | シンガポール  | 157,692.00    | 0.11    |
|       | クロアチア   | 111,625.00    | 0.08    |
|       | ポーランド   | 74,616.32     | 0.05    |
|       | 小計      | 35,576,141.85 | 24.60   |
| その他証券 | アイルランド  | 16,679,586.00 | 11.53   |
|       | 小計      | 16,679,586.00 | 11.53   |

|                 |          |                                |        |
|-----------------|----------|--------------------------------|--------|
| 株式              | アメリカ合衆国  | 7,611,356.86                   | 5.26   |
|                 | イギリス     | 1,132,825.06                   | 0.78   |
|                 | 日本       | 1,111,125.21                   | 0.77   |
|                 | スイス      | 629,516.44                     | 0.44   |
|                 | カナダ      | 585,858.63                     | 0.41   |
|                 | フランス     | 568,726.87                     | 0.39   |
|                 | ドイツ      | 558,315.27                     | 0.39   |
|                 | オーストラリア  | 460,907.81                     | 0.32   |
|                 | オランダ     | 285,154.63                     | 0.20   |
|                 | スペイン     | 222,697.97                     | 0.15   |
|                 | スウェーデン   | 182,667.51                     | 0.13   |
|                 | 香港       | 162,485.69                     | 0.11   |
|                 | イタリア     | 129,032.45                     | 0.09   |
|                 | アイルランド   | 126,444.90                     | 0.09   |
|                 | デンマーク    | 88,703.75                      | 0.06   |
|                 | シンガポール   | 85,502.68                      | 0.06   |
|                 | ベルギー     | 83,173.80                      | 0.06   |
|                 | フィンランド   | 53,039.59                      | 0.04   |
|                 | ノルウェー    | 42,949.58                      | 0.03   |
|                 | イスラエル    | 31,775.00                      | 0.02   |
|                 | バミューダ    | 25,578.41                      | 0.02   |
|                 | ルクセンブルグ  | 21,266.09                      | 0.01   |
|                 | オーストリア   | 17,246.79                      | 0.01   |
|                 | ポルトガル    | 11,853.57                      | 0.01   |
|                 | マカオ      | 8,745.06                       | 0.01   |
|                 | ニュージーランド | 4,287.22                       | 0.00   |
|                 | ジャージー島   | 3,946.44                       | 0.00   |
|                 | ガーンジー    | 3,405.32                       | 0.00   |
|                 | ケイマン諸島   | 2,658.03                       | 0.00   |
|                 | 小計       | 14,251,246.63                  | 9.85   |
| ポートフォリオ合計       |          | 129,754,215.90                 | 89.71  |
| 現金・その他資産(負債控除後) |          | 14,879,395.53                  | 10.29  |
| 資産総額            |          | 144,633,611.43                 | 100.00 |
| 負債総額            |          | 1,906,758.35                   | 1.32   |
| 合計(純資産総額)       |          | 142,726,853.08<br>(約14,510百万円) | 98.68  |

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

## ( 2 ) 運用実績

## 純資産等の推移

2014年5月末日までの1年間における各月末の総資産および純資産の推移は以下のとおりである。

( バランスド ( 米ドル ) )

|           | 資産総額    |        | 純資産総額   |        | 1口当たり純資産価格<br>( クラス P - a c c 投資証券 ) |       |
|-----------|---------|--------|---------|--------|--------------------------------------|-------|
|           | 千米ドル    | 百万円    | 千米ドル    | 百万円    | 米ドル                                  | 円     |
| 2013年6月末日 | 86,242  | 8,767  | 86,051  | 8,748  | 12.56                                | 1,277 |
| 7月末日      | 89,174  | 9,065  | 88,252  | 8,972  | 12.87                                | 1,308 |
| 8月末日      | 87,737  | 8,919  | 87,296  | 8,874  | 12.66                                | 1,287 |
| 9月末日      | 88,283  | 8,975  | 88,169  | 8,963  | 12.97                                | 1,319 |
| 10月末日     | 91,397  | 9,291  | 91,057  | 9,257  | 13.25                                | 1,347 |
| 11月末日     | 97,112  | 9,872  | 96,760  | 9,837  | 13.40                                | 1,362 |
| 12月末日     | 104,351 | 10,608 | 103,876 | 10,560 | 13.48                                | 1,370 |
| 2014年1月末日 | 106,997 | 10,877 | 106,085 | 10,785 | 13.30                                | 1,352 |
| 2月末日      | 123,409 | 12,546 | 121,813 | 12,383 | 13.57                                | 1,380 |
| 3月末日      | 130,075 | 13,223 | 129,500 | 13,165 | 13.63                                | 1,386 |
| 4月末日      | 138,357 | 14,065 | 134,333 | 13,656 | 13.65                                | 1,388 |
| 5月末日      | 144,634 | 14,703 | 142,727 | 14,510 | 13.82                                | 1,405 |

## 分配の推移

バランスド ( 米ドル )

クラス P - a c c 投資証券

該当事項なし

## 自己資本利益率 ( 収益率 ) の推移

2013年6月1日から2014年5月末日までの1年間の自己資本利益率 ( 収益率 ) は以下のとおりである。

|               | 収益率 ( % ) ( 注 )    |      |
|---------------|--------------------|------|
| バランスド ( 米ドル ) | クラス P - a c c 投資証券 | 8.39 |

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

a = 2014年5月末日現在の1口当たり純資産価格 ( 当該期間の分配金の合計金額を加えた額 )

b = 2013年5月末日現在の1口当たり純資産価格 ( 分配額の額 )

## ( 3 ) 投資リスク

本書提出日現在、平成26年4月28日提出の有価証券届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

ファンドが将来にわたり営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他ファンドの経営に重要な影響を及ぼす事象は、本書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

### 3 資産運用会社の概況

#### (1) 名称及び資本金の額

UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ(「管理会社」)

##### a. 資本金(株主資本)の額

2014年2月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ(約18億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、平成26年5月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値  
(1ユーロ=138.33円)による。

##### b. 事業の内容

UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイは、商事会社に関するルクセンブルグの1915年8月10日付法律(以下「1915年法」という。)に基づき、2010年7月1日にルクセンブルグに設立された。1915年法は、設立、運営、株式の募集等商事会社に関する基本的事項を規定している。集合投資事業に関する2010年法第15条に基づき、譲渡性証券集合投資事業の管理会社としての資格を有している。

ユービーエス・エイ・ジー、UBS グローバル・アセット・マネジメント(バーゼル・チューリッヒ)(「投資運用会社」)

##### a. 資本金(株主資本)の額

2013年12月末日現在の株主資本総額は、383,525,023スイスフラン(約434億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、平成26年5月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=113.27円)による。

##### b. 事業の内容

主に年金プラン、財団、政府、金融機関、法人等の機関投資家および投資信託向けに株式、債券の運用を行っている。

[次へ](#)

#### 4 外国投資法人の経理状況

- 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ける法令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 . 原文の中間財務書類は、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンド( バランスド(米ドル) )に関連する部分のみを翻訳している。
- c . 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。
- d . 原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語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、平成26年5月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=101.66円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

## ( 1 ) 資産及び負債の状況

## U B S ( L u x ) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド ( 米ドル )

## 純資産計算書

|                    | 2014年4月30日現在   |            |
|--------------------|----------------|------------|
|                    | ( 米ドル )        | ( 千円 )     |
| 資 産                |                |            |
| 投資有価証券、取得価額        | 114,288,289.40 | 11,618,548 |
| 投資有価証券、未実現評価(損)益   | 10,489,575.44  | 1,066,370  |
| 投資有価証券合計(注1)       | 124,777,864.84 | 12,684,918 |
| 現金預金、要求払預金および預託金勘定 | 9,304,322.64   | 945,877    |
| その他の流動資産(マージン)     | 855,188.28     | 86,938     |
| 投資有価証券売却未収金(注1)    | 2,231,129.96   | 226,817    |
| 発行未収金              | 298,170.31     | 30,312     |
| 有価証券に係る未収利息        | 335,702.15     | 34,127     |
| 流動資産に係る未収利息        | 259.85         | 26         |
| 配当金に係る未収金          | 28,528.00      | 2,900      |
| その他の未収金            | 2,151.92       | 219        |
| 金融先物未実現(損)益(注1)    | 185,039.86     | 18,811     |
| 先渡為替契約未実現(損)益(注1)  | (28,780.95)    | (2,926)    |
| スワップ未実現(損)益(注1)    | 367,340.13     | 37,344     |
| 資産合計               | 138,356,916.99 | 14,065,364 |
| 負 債                |                |            |
| その他の短期負債(マージン)     | (412,974.35)   | (41,983)   |
| 投資有価証券購入未払金(注1)    | (3,111,526.30) | (316,318)  |
| 買戻未払金              | (387,201.42)   | (39,363)   |
| 報酬引当金(注2)          | (108,938.94)   | (11,075)   |
| 年次税引当金(注3)         | (3,076.12)     | (313)      |
| 引当金合計              | (112,015.06)   | (11,387)   |
| 負債合計               | (4,023,717.13) | (409,051)  |
| 期末現在純資産            | 134,333,199.86 | 13,656,313 |

注記は当財務書類の一部である。

## U B S ( L u x ) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド ( 米ドル )

## 運用計算書

|                          | 自2013年11月 1 日 至2014年 4 月30日 |           |
|--------------------------|-----------------------------|-----------|
|                          | ( 米ドル )                     | ( 千円 )    |
| 収 益                      |                             |           |
| 流動資産に係る利息                | 1,564.19                    | 159       |
| 有価証券に係る利息                | 419,119.86                  | 42,608    |
| 配当金                      | 132,376.01                  | 13,457    |
| スワップに係る受取利息(注1)          | 115,250.83                  | 11,716    |
| 貸付証券に係る収益(注12)           | 7,843.92                    | 797       |
| 収益合計                     | 676,154.81                  | 68,738    |
| 費 用                      |                             |           |
| スワップに係る支払利息(注1)          | (40,328.86)                 | (4,100)   |
| 貸付証券に係るコスト(注12)          | (19.49)                     | (2)       |
| 報酬(注2)                   | (1,096,626.67)              | (111,483) |
| 年次税(注3)                  | (17,275.34)                 | (1,756)   |
| 現金流動性資産および当座借越に係る利息      | (135.70)                    | (14)      |
| 費用合計                     | (1,154,386.06)              | (117,355) |
| 投資純(損)益                  | (478,231.25)                | (48,617)  |
| 実現(損)益(注1)               |                             |           |
| 無オプション市場価格証券に係る実現(損)益    | 5,055,705.51                | 513,963   |
| 金融先物に係る実現(損)益            | 413,472.29                  | 42,034    |
| 先渡為替契約に係る実現(損)益          | (483,360.60)                | (49,138)  |
| スワップに係る実現(損)益            | (205,449.66)                | (20,886)  |
| 発行/買戻しに係る実現(損)益(注4)      | 62,956.30                   | 6,400     |
| 投資実現(損)益合計               | 4,843,323.84                | 492,372   |
| 為替差(損)益                  | 116,549.16                  | 11,848    |
| 実現(損)益合計                 | 4,959,873.00                | 504,221   |
| 当期実現純(損)益                | 4,481,641.75                | 455,604   |
| 未実現評価(損)益の変動(注1)         |                             |           |
| 無オプション市場価格証券に係る未実現評価(損)益 | (1,415,540.61)              | (143,904) |
| 金融先物に係る未実現評価(損)益         | 82,437.12                   | 8,381     |
| 先渡為替契約に係る未実現評価(損)益       | 23,529.69                   | 2,392     |
| スワップに係る未実現評価(損)益         | 228,041.21                  | 23,183    |
| 未実現評価(損)益の変動合計           | (1,081,532.59)              | (109,949) |
| 運用の結果による純資産の純増(減)        | 3,400,109.16                | 345,655   |

注記は当財務書類の一部である。

## U B S ( L u x ) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド (米ドル)

## 純資産変動計算書

|                   | 自2013年11月 1 日 至2014年 4 月30日 |             |
|-------------------|-----------------------------|-------------|
|                   | (米ドル)                       | (千円)        |
| 期首現在純資産           | 91,057,425.43               | 9,256,898   |
| 発行額               | 51,499,126.89               | 5,235,401   |
| 買戻額               | (11,623,461.62)             | (1,181,641) |
| 純発行(買戻)合計         | 39,875,665.27               | 4,053,760   |
| 投資純(損)益           | (478,231.25)                | (48,617)    |
| 実現(損)益合計          | 4,959,873.00                | 504,221     |
| 未実現評価(損)益の変動合計    | (1,081,532.59)              | (109,949)   |
| 運用の結果による純資産の純増(減) | 3,400,109.16                | 345,655     |
| 期末現在純資産           | 134,333,199.86              | 13,656,313  |

## 発行済投資証券数の変動表

|              | 自2013年11月 1 日 至2014年 4 月30日 |
|--------------|-----------------------------|
| クラス P -acc   | (口)                         |
| 期首現在発行済投資証券数 | 6,431,531.4360              |
| 期中発行投資証券数    | 3,691,978.8480              |
| 期中買戻投資証券数    | (806,924.5190)              |
| 期末現在発行済投資証券数 | 9,316,585.7650              |
| クラス P -dist  | (口)                         |
| 期首現在発行済投資証券数 | 482,974.3190                |
| 期中発行投資証券数    | 155,798.2690                |
| 期中買戻投資証券数    | (63,299.5490)               |
| 期末現在発行済投資証券数 | 575,473.0390                |

注記は当財務書類の一部である。

## U B S (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド (米ドル)

## 最重要数値

|                                  | ISIN                | 2014年4月30日     | 2013年10月31日    | 2012年10月31日    |
|----------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| 純資産額 (米ドル)                       |                     | 134 333 199.86 | 91 057 425.43  | 85 796 172.77  |
| <b>クラス P -acc</b>                | <b>LU0200191152</b> |                |                |                |
| 発行済投資証券数 (口)                     |                     | 9 316 585.7650 | 6 431 531.4360 | 6 835 649.5000 |
| 1 口当たり純資産価格 (米ドル)                |                     | 13.65          | 13.25          | 11.92          |
| 1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup> |                     | 13.65          | 13.27          | 11.92          |
| <b>クラス P -dist</b>               | <b>LU0234745577</b> |                |                |                |
| 発行済投資証券数 (口)                     |                     | 575 473.0390   | 482 974.3190   | 402 008.2920   |
| 1 口当たり純資産価格 (米ドル)                |                     | 12.39          | 12.03          | 10.81          |
| 1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup> |                     | 12.39          | 12.05          | 10.81          |
| <sup>1</sup> 注記 1 を参照            |                     |                |                |                |

注記は当財務書類の一部である。

## UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ

## 財務書類に対する注記

2014年4月30日現在

## 注1 - 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下のとおり要約される。

## a) 純資産価額の計算

各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券1口当たりの純資産価格、発行価格および買戻価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの計算通貨で表示され、各投資証券クラスに対するサブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの発行済投資証券数で除することにより営業日毎に計算される。

「営業日」は、ルクセンブルグの通常の銀行営業日(即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日)を指し、( )ルクセンブルグの個々の法定外休日、( )関連サブ・ファンドが主に投資する各国の取引所の休業日、( )関連サブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日、( )その運用実績および純資産が主に一または複数の指数に基づくサブ・ファンドの場合、関連指数が公表されない日を含まない。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰する純資産価額の百分率は、投資証券の発行または買戻しの度に変動する。この百分率は、当該投資証券クラスに請求される報酬を考慮し、サブ・ファンドの発行済投資証券総数に対する各投資証券クラスの発行済投資証券の比率によって決定される。

- クラス「P-dist」投資証券に関して分配が行われる場合はいつでも、当該投資証券の純資産価額および発行価格ならびに買戻価格は、分配額が減額される。その結果、「P-dist」投資証券に割当てられる純資産価額の百分率は減少する。その他の投資証券クラスの純資産価額は変動しない。その結果、その他の投資証券に割当てられる純資産価額の百分率は増加する。
- 投資証券の各発行または買戻しに関して、当該投資証券クラスに帰属する純資産価額は、適切に調整される。

あるサブ・ファンドの全投資証券クラスにおける発行または買戻しの総額が、単一の取引日において純資本の流入または流出をもたらす場合、それぞれのサブ・ファンドの純資産価額はそれに伴い増加または減少することがある(いわゆるシングル・スイング・プライシング)。最大調整額は、純資産価額の2%であった。サブ・ファンドが負担する見積取引費用および課税金ならびにファンドが投資する資産の見積呼値スプレッドは、計算上考慮される。ファンドの全投資証券が純増する場合、調整は純資産価額の増加を導く。投資証券が純減する場合、調整は純資産価額の減少となる。2013年3月27日に、取締役会は、以下のとおりスイング・プライシングを生じさせる限界値を設定することを決議した。マルチ・アセット・ファンド:0.2%、エクイティ・ファンド:0.3%およびフィクスト・インカム・ファンド:2.0%。これは、該当サブ・ファンドの純資産に関して1取引日における純増/純減について設けられる。この限界値が1取引日を超過した場合にのみ、純資産価額は調整される。

## b) 評価原則

- 流動資金 - 現金、銀行預金、為替手形および一覧払いの有価証券ならびに未収金、前払費用、現金配当および未受領の宣言または発生した利息のいずれかを問わない - は、その全額で評価される。ただし、当該価額が全額支払われないかまたは受領できない可能性がある場合を除くものとし、この場合、その価値はその正しい価値を表すために適切とみなす控除額を勘案して決定される。
- 証券取引所または他の規制ある市場に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、既知の最終市場価格で評価される。当該証券、派生商品またはその他の投資対象が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における直近の入手可能な価

格が適用される。

証券取引所における取引が僅かな証券、派生商品およびその他の投資対象について、証券取引者間で市場に連動する価格付がなされている流通市場が存在する場合、本投資法人はこれらの価格に基づいて当該証券、派生商品およびその他の投資対象を評価することができる。証券取引所に上場されていないが、公認され、公開され、かつ規制に従い機能している他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、当該市場における最終の入手可能価格により評価される。

- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場で取引されておらず、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、予想販売価格に基づき誠意をもって本投資法人が選ぶその他の原則に従って本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場されていない派生商品（店頭派生商品）は、独立の価格提供業者に基づいて評価される。派生商品について、利用できる独立の価格提供業者がただ1社の場合、得られた評価の妥当性は、派生商品が由来する対象商品の時価に基づき本投資法人が認めた計算方法によって検証される。
- その他の譲渡性証券集合投資事業（UCITS）および／または集合投資事業（UCI）の受益証券は、その最終純資産価額で評価される。その他のUCITSおよび／またはUCIの受益証券は、ポートフォリオ運用会社または投資顧問会社から独立した信頼のおけるサービス提供会社によって提供される見積評価額に基づき評価される（見積評価額）。
- オルタナティブ投資商品により構成される指数連動のインデックス証書（債務商品）は、直近の入手可能な通常の時価（公正価値）で評価される。公正価値は、インデックスの構成要素の直近の入手可能な評価額に基づいている。推定評価に関する報告書が入手可能である場合には、インデックス証書は、有効な評価報告書が入手可能になるまで、当該推定報告書に基づき評価される。
- 投資信託証書は、発行価格（スター・コンパス・UBS・フランクフルトの場合）に基づき評価される。
  - （ ）サブ・ファンドがマネー・マーケット・ファンドである場合、
    - 証券取引所に上場されていないまたは一般に公開されている他の規制市場で取引されていない短期金融商品の評価額は、適切なカーブに基づいて評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの2要素を参照する。このプロセスには次の原則が適用される。各短期金融商品には、残余期間が最も近い金利が補間される。このように計算された金利は、裏付けとなる借り手を反映する信用スプレッドを加えることによって市場価格に転換される。この信用スプレッドは、借り手の信用格付けに重大な変更がある場合には調整される。
    - 該当する注文日とそれぞれの決済日の間にサブ・ファンドが得た利息収入は、該当するサブ・ファンドの資産の評価に含まれる。それ故、評価日における投資証券1口当たりの資産価格は、予定される利子所得を含む。
  - （ ）規制に該当しないその他のサブ・ファンドに関しては、次の規制が適用される。短期金融商品の評価額は、純取得価格をベースに以後の利回りを確保しつつ、買戻価格に向けて漸進的に調整される。市場環境に重大な変動が生じた場合、個々の投資対象の評価基準は、新たな市場利回りに沿ってもたらされる。
- 関連するサブ・ファンドの会計通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券、短期金融商品、派生商品およびその他の投資対象は、ルクセンブルグの為替相場の仲値または、もしルクセンブルグの為替相場の仲値が入手不能な場合は、それに最も近い、当該通貨の為替相場の仲値で評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が第二の独立した評価を提供する。計算はすべての現金流入出額の正味現在価値を基準とする。特別な場合に、内部計算（ブルームバーグから提供されたモデルと市場データに基づく。）および／またはブローカーの

報告評価を利用することができる。評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBSグローバル評価方針に基づき決定される。評価アプローチは、シキャブの取締役会によって承認されている。

特殊な状況または事象により、上記の基準によって該当するサブ・ファンドの評価を正確に判断することが不可能または不適切とみなされる場合、本投資法人は、ファンド全体または個別のサブ・ファンドの資産に対して、誠実に決定され、かつ一般に認められるその他の適切な評価原則を一時的に適用する権利を有する。

c) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約の未実現(損)益は、評価日に適用される先渡為替レートに基づいて評価される。実現または未実現権損益は、運用計算書に計上される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記帳される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

e) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) 外貨換算

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て保有される銀行勘定、その他の純資産および投資有価証券評価額は、評価日の最終現物相場の仲値で換算される。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建て収益および費用は、支払日の最終現物相場の仲値で換算される。為替差損益は運用計算書に計上される。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て証券の取得原価は、取得日の最終現物相場の仲値で換算される。

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

本投資法人の連結財務書類は、ユーロ(EUR)で実証される。本投資法人の2014年4月30日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の各種科目は、決算日の為替レートでユーロに換算された各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目の合計に等しい。

以下の為替レートが、2014年4月30日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1ユーロ = 1.220788 スイスフラン(CHF)

1ユーロ = 1.386550 米ドル(USD)

i) 投資有価証券売却未収金、投資有価証券購入未払金

「投資有価証券売却未収金」の勘定科目には、外貨取引による未収金が含まれる。また「投資有価証券購入未払金」の勘定科目には、外貨取引による未払金が含まれる。

j) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、関連する有価証券が最初に「配当落ち」として計上された時に、収益として認識される。受取利息は、日々ベースで発生する。

注2 - 報酬

本投資法人は、以下の表に表示されるサブ・ファンドの平均純資産額で計算される月次報酬を各サブ・ファンドのために支払う。

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(米ドル)

## 報酬

|                        |        |
|------------------------|--------|
| 名称に「P」が付く投資証券クラス       | 1.980% |
| 名称に「N」が付く投資証券クラス       | 2.100% |
| 名称に「K - 1」が付く投資証券クラス   | 1.300% |
| 名称に「Q」が付く投資証券クラス       | 0.960% |
| 名称に「I - A 1」が付く投資証券クラス | 0.760% |
| 名称に「I - A 2」が付く投資証券クラス | 0.720% |
| 名称に「I - A 3」が付く投資証券クラス | 0.640% |
| 名称に「F」が付く投資証券クラス       | 0.640% |
| 名称に「I - B」が付く投資証券クラス   | 0.065% |
| 名称に「I - X」が付く投資証券クラス   | 0.000% |
| 名称に「U - X」が付く投資証券クラス   | 0.000% |

上記の月次報酬から、本投資法人は、本投資法人の管理、管理事務、ポートフォリオ運用および安全保管ならびに分配に関連して生じる一切の費用を以下のとおり負担する。

- ルクセンブルグ内外での投資信託の認可および監督に係る年間手数料および費用
- 監督官庁により課せられるその他の請求額
- 定款、目論見書、年次報告書および半期報告書の印刷費
- 投資家に対する価格および通知の公告
- ルクセンブルグ内外での本投資法人の上場および販売に関連して発生する手数料
- 本投資法人資産の安全保管、支払の取扱および2010年12月17日付の法律に基づき要求されるその他の義務に関する保管受託銀行の手数料および費用
- 投資主に対する配当の支払に関する手数料および費用
- 監査報酬

販売手数料は、運用手数料から本投資法人の販売会社および資産運用会社に支払われる。

保管受託銀行および管理事務代行会社は、投資主の利益のためこれらが行う個別手配に係る費用の払戻しを受ける権利を有するが、かかる費用は本投資法人に対し直接請求されることもある。

上限報酬を採用していない各ファンドの運用会社の報酬規定を全般的に比較するという目的上、「上限管理報酬」という用語を用いている。上限管理報酬は、上限報酬料率の80%と定められている。

本投資法人はまた、本投資法人資産の管理事務に関連して生じる一切の取引費用(市場、手数料、財務手数料等に沿ったブローカー手数料)も負担する。

本投資法人の収益および資産に対し課せられる一切の税金、特に年次税("taxe d'abonnement")は、これもまた本投資法人が負担する。

個々のサブ・ファンドに正確に割り当てられ得る費用はすべて、それらのサブ・ファンドに請求される。投資証券クラスに割り当てられる費用は、それらの投資証券クラスに請求される。費用が複数またはすべてのサブ・ファンド/投資証券クラスに関連する場合には、これらの費用について当該サブ・ファンド/投資証券クラスがその純資産額に比例して負担する。

特定の支払手数料および費用は、既存のファンドに投資を行う場合には複数回、またはファンド・オブ・ヘッジ・ファンズ、ファンド・オブ・コモディティ・ファンズおよびファンド・オブ・リアルエステート・ファンズに投資を行う場合には三回発生する可能性がある(例えば、保管受託銀行および中央管理事務代行会社、管理報酬/投資顧問報酬ならびに投資が行われるUCIおよび/またはUCITSの発行/買戻手数料)。

そのような支払手数料および費用は、対象ファンドならびにファンド・オブ・ファンズの段階で請求される。UCIおよびUCITSに関しては、サブ・ファンドまたは投資証券クラスおよび本投資法人の段階で支払う報酬合計は、投資証券クラスに関するそれぞれの一定料率の報酬を加えて最大で合計1.000%を超

えないものとする。ファンド・オブ・ヘッジ・ファンズ、ファンド・オブ・コモディティ・ファンズおよびファンド・オブ・リアルエステート・ファンズに関しては、投資証券クラスに関するそれぞれの一定料率の報酬を加えて最大で1.500%を超えないものとする。

本投資法人、または本投資法人との共同経営もしくは支配を通じてまたは大量に直接保有もしくは間接保有することにより管理会社に関係するその他の投資法人が、直接的もしくは間接的に運営するファンドの投資証券に投資を行う場合、投資を行うサブ・ファンドは、対象ファンドの発行または買戻手数料を課されることはない。

### 注3 - 年次税

ルクセンブルグの現行法規に準拠して、本投資法人は、四半期毎に支払われ各四半期末日の本投資法人の純資産額に基づいて計算される年率0.05%の年次税を課されているが、機関筋の投資証券クラスに関しては年率0.01%になる減額された年次税を課されている。

ルクセンブルグ法の法定条項に準拠して、既に年次税を支払っている他の投資信託の受益証券もしくは投資証券に投資されている純資産の部分に関して、年次税は課されない。

### 注4 - 発行 / 買戻しに係る実現損益

関連取引に伴ってサブ・ファンドが負担する平均手数料（ブローカー手数料、証券取引手数料等）は、純資産価格基準で投資者に請求される場合がある。この収益はサブ・ファンドのものであり、「発行 / 買戻しに係る実現損益」として運用計算書に記述されている。

### 注5 - 収益の分配

各サブ・ファンドの投資主総会は、本投資法人の取締役会の提案により年次決算の終了後に、各サブ・ファンドまたは投資証券クラスから分配を行うかおよび支払われる分配金の程度を決定する。本投資法人の純資産額が2010年12月17日付の法律に規定されている最低資産額を下回る場合には、分配の支払は行われない。分配が行われる場合、支払は年度末後4ヵ月以内に行われる。

本投資法人の取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止することを決定する権利を有している。

### 注6 - 金融先物の契約債務

2014年4月30日現在の個々のサブ・ファンドおよび各通貨の金融先物に係る契約債務は、以下のよう

|                                              |                                    |                                   |
|----------------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ<br>- バランスド (米ドル) | 指数関連金融先物 (購入)<br>10,215,233.85 米ドル | 指数関連金融先物 (売却)<br>1,619,898.15 米ドル |
| UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ<br>- バランスド (米ドル) | 債券関連金融先物 (購入)<br>5,598,984.38 米ドル  | 債券関連金融先物 (売却)<br>- 米ドル            |

### 注7 - ソフト・コミッション取決め

2013年11月1日から2014年4月30日までの報告期間中に、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション取決め」はなく、「ソフト・コミッション」の金額は零である。

### 注8 - 総費用比率 (TER)

この比率は、スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション(SFAMA)の「TERおよびPTRの計算ならびに公表に関するガイドライン」現行版に従って計算された。比率はまた、純資産の百分率として遡及的に計算され、純資産(運用費用)に対し継続ベースで請求されるすべての費用および手数料の合計を表す。

過去12ヵ月のTERは、以下のとおりである。

| UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ | 総費用比率(TER) |
|-----------------------------|------------|
| - バランスド(米ドル) P - a c c      | 2.05%      |
| - バランスド(米ドル) P - d i s t    | 2.05%      |

運用期間が12ヵ月未満の投資証券のクラスに関するTERは、年率換算されている。

通貨ヘッジに関連して発生した取引費用およびその他の費用は、TERに含まれていない。

#### 注9 - ポートフォリオ回転率(PTR)

この比率は、スイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション(SFAMA)の「TERおよびPTRの計算ならびに公表に関するガイドライン」現行版に従って計算された。PTRは、投資有価証券を売買する時に負担する追加費用の関連性の指標とみなされる。それは、平均純資産に関連する任意の投資有価証券の転換の結果として生じる証券取引の数量を表す。制御できない発行および買戻しに起因する取引は、この比率に含まれない。

PTRは、以下のとおりである。

| UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ | ポートフォリオ回転率(PTR) |
|-----------------------------|-----------------|
| - バランスド(米ドル)                | 22.11%          |

#### 注10 - 取締役会により零と評価される有価証券

UBS グローバル評価委員会による提案に基づき、管理会社の取締役会は、以下の有価証券を零またはほぼ零と評価することを決定した。

アンハイザー・ブッシュ・インベプSTRIPは、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - グロース(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(スイスフラン)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(スイスフラン)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(米ドル)、およびUBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(米ドル)の有価証券に対する投資報告書を有していた。

インモーイーストAG RIGHTS PRP (AT0000A0GYT7) は、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - グロース(ユーロ)の有価証券に対する投資報告書を有していた。

アイルランド銀行RESOLCP COM EUR0.16 (IE00B06H8J93) は、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(ユーロ)およびUBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - グロース(ユーロ)の有価証券に対する投資報告書を有していた。

ロールス・ロイスHLDGS C SHS ENTITLEMENT JULY 14 (GB00BJFL1R44) は、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - グロース(ユーロ)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(スイスフラン)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(ス

イスフラン)、UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - イールド(米ドル)、およびUBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド(米ドル)の有価証券に対する投資報告書を有していた。

注11 - 適用法、業務地および公認言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、投資主、本投資法人および保管受託銀行との間ですべての法的紛争処理を行う場所である。ルクセンブルグ法が適用される。しかし、他の国の投資者の賠償請求に関する件については、本投資法人および/または保管受託銀行は、本投資法人投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らおよびファンドを服せしめることを選択することができる。

当財務書類についてはドイツ語版が公認されたものである。しかし、本投資法人投資証券の購入および売却が可能なその他の国の投資者に対して投資証券が販売される場合、本投資法人および保管受託銀行は、当該国の言語への承認された翻訳(すなわち、本投資法人および保管受託銀行によって承認されたもの)に自らが拘束されるものと認めることができる。

注12 - 証券貸付

本投資法人は、第三者に本投資法人の組入証券の一部分を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。貸付証券の収益およびコストは、運用計算書に別個に表示される。担保は、貸付証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

貸付証券

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ  
- バランスド(米ドル)

エクスポージャー  
27,273,190.02 米ドル

## ( 2 ) 投資有価証券明細表等

## U B S ( L u x ) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド ( 米ドル )

2014年 4 月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

| 銘柄 | 数量 /<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現 ( 損 ) 益<br>( 注 1 ) | 純資産<br>比率<br>( % ) |
|----|------------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|----|------------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------|

## 公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品

## 無記名株式

## オーストラリア

|           |                                         |          |            |      |
|-----------|-----------------------------------------|----------|------------|------|
| AUD       | AGL ENERGY NPV                          | 297.00   | 4 339.67   | 0.00 |
| AUD       | ALS LIMITED NPV                         | 353.00   | 2 453.04   | 0.00 |
| AUD       | AMCOR LIMITED NPV                       | 564.00   | 5 377.29   | 0.00 |
| AUD       | AMP LIMITED NPV(POST RECON)             | 675.00   | 3 158.38   | 0.00 |
| AUD       | ASX LTD NPV                             | 128.00   | 4 214.99   | 0.00 |
| AUD       | AUST & NZ BANK GRP NPV                  | 1 322.00 | 42 222.27  | 0.03 |
| AUD       | BHP BILLITON LTD NPV                    | 1 504.00 | 52 605.80  | 0.04 |
| AUD       | BRAMBLES LTD NPV                        | 659.00   | 5 757.92   | 0.01 |
| AUD       | CALTEX AUSTRALIA NPV                    | 178.00   | 3 672.90   | 0.00 |
| AUD       | CMNWLTH BK OF AUST NPV                  | 753.00   | 55 047.91  | 0.04 |
| AUD       | COCA-COLA AMATIL NPV                    | 394.00   | 3 376.81   | 0.00 |
| AUD       | COCHLEAR LTD NPV                        | 45.00    | 2 447.06   | 0.00 |
| AUD       | COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)         | 382.00   | 4 371.18   | 0.00 |
| AUD       | CROWN RESORTS LTD NPV                   | 255.00   | 3 789.77   | 0.00 |
| AUD       | CSL NPV                                 | 264.00   | 16 738.61  | 0.01 |
| AUD       | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV      | 71.00    | 3 535.95   | 0.00 |
| AUD       | FORTESCUE METALS G NPV                  | 772.00   | 3 612.24   | 0.00 |
| AUD       | ILUKA RESOURCES NPV                     | 169.00   | 1 392.06   | 0.00 |
| AUD       | INCITEC PIVOT NPV                       | 1 093.00 | 2 916.63   | 0.00 |
| AUD       | LEIGHTON HOLDINGS NPV                   | 127.00   | 2 245.18   | 0.00 |
| AUD       | MACQUARIE GP LTD NPV                    | 173.00   | 9 248.91   | 0.01 |
| AUD       | NATL AUSTRALIA BK NPV                   | 1 138.00 | 37 220.81  | 0.03 |
| AUD       | NEWCREST MINING NPV                     | 237.00   | 2 296.94   | 0.00 |
| AUD       | ORICA LIMITED NPV                       | 142.00   | 2 877.44   | 0.00 |
| AUD       | ORIGIN ENERGY NPV                       | 555.00   | 7 662.11   | 0.01 |
| AUD       | QANTAS AIRWAYS NPV                      | 1 187.00 | 1 341.77   | 0.00 |
| AUD       | QBE INS GROUP NPV                       | 560.00   | 6 008.49   | 0.01 |
| AUD       | RAMSAY HEALTH CARE NPV                  | 97.00    | 4 027.31   | 0.00 |
| AUD       | REA GROUP LIMITED NPV                   | 95.00    | 4 116.80   | 0.00 |
| AUD       | RIO TINTO LIMITED NPV                   | 191.00   | 10 919.11  | 0.01 |
| AUD       | SANTOS LIMITED NPV                      | 480.00   | 6 115.23   | 0.01 |
| AUD       | SEEK LIMITED NPV                        | 336.00   | 5 205.28   | 0.00 |
| AUD       | SONIC HEALTHCARE NPV                    | 313.00   | 5 133.18   | 0.00 |
| AUD       | SUNCORP GROUP                           | 663.00   | 7 998.22   | 0.01 |
| AUD       | SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)    | 184.00   | 719.45     | 0.00 |
| AUD       | TELSTRA CORP NPV                        | 2 356.00 | 11 395.01  | 0.01 |
| AUD       | WESFARMERS LTD NPV                      | 510.00   | 20 182.20  | 0.03 |
| AUD       | WESTFIELD GROUP NPV STAPLED UNITS       | 1 046.00 | 10 612.43  | 0.01 |
| AUD       | WESTFIELD RETAIL TRUST STAPLED SECURITY | 2 264.00 | 6 691.69   | 0.01 |
| AUD       | WESTPAC BKG CORP NPV                    | 1 475.00 | 47 997.14  | 0.04 |
| AUD       | WOODSIDE PETROLEUM NPV                  | 285.00   | 10 773.92  | 0.01 |
| AUD       | WOOLWORTHS LTD NPV                      | 547.00   | 18 914.63  | 0.01 |
| オーストラリア合計 |                                         |          | 460 733.73 | 0.34 |

## オーストリア

|     |                       |        |          |      |
|-----|-----------------------|--------|----------|------|
| EUR | ANDRITZ AG NPV(BR)    | 68.00  | 4 217.86 | 0.00 |
| EUR | ERSTE GROUP BK AG NPV | 158.00 | 5 299.43 | 0.01 |

| 銘柄                                          | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| EUR OMV AG NPV(VAR)                         | 113.00    | 5 282.48                                                      | 0.00             |
| EUR VOESTALPINE AG NPV                      | 65.00     | 2 965.14                                                      | 0.00             |
| <b>オーストリア合計</b>                             |           | <b>17 764.91</b>                                              | <b>0.01</b>      |
| <b>ベルギー</b>                                 |           |                                                               |                  |
| EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)                  | 162.00    | 6 959.88                                                      | 0.01             |
| EUR ANHEUSER-BUSCH INB NPV                  | 357.00    | 38 827.67                                                     | 0.03             |
| EUR BELGACOM SA NPV                         | 28.00     | 856.44                                                        | 0.00             |
| EUR COLRUYT SA NPV                          | 66.00     | 3 728.21                                                      | 0.00             |
| EUR DELHAIZE GROUP NPV                      | 59.00     | 4 379.92                                                      | 0.00             |
| EUR GPE BRUXELLES LAM NPV                   | 53.00     | 5 355.01                                                      | 0.01             |
| EUR KBC GROUP NV NPV                        | 115.00    | 7 001.59                                                      | 0.01             |
| EUR SOLVAY SA NPV                           | 26.00     | 4 207.07                                                      | 0.00             |
| EUR TELENET GRP HLDG NPV                    | 62.00     | 3 631.64                                                      | 0.00             |
| EUR UCB NPV                                 | 52.00     | 4 260.42                                                      | 0.00             |
| EUR UMICORE NPV                             | 80.00     | 3 918.39                                                      | 0.00             |
| <b>ベルギー合計</b>                               |           | <b>83 126.24</b>                                              | <b>0.06</b>      |
| <b>バーミューダ</b>                               |           |                                                               |                  |
| USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01          | 77.00     | 4 413.64                                                      | 0.00             |
| USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125        | 100.00    | 4 575.00                                                      | 0.00             |
| USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002         | 300.00    | 4 758.00                                                      | 0.00             |
| USD NABORS INDS LTD COM USD0.001            | 200.00    | 5 104.00                                                      | 0.00             |
| NOK SEADRILL LTD USD2                       | 177.00    | 6 175.28                                                      | 0.00             |
| <b>バーミューダ合計</b>                             |           | <b>25 025.92</b>                                              | <b>0.00</b>      |
| <b>カナダ</b>                                  |           |                                                               |                  |
| CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM              | 101.00    | 2 979.06                                                      | 0.00             |
| CAD AGRUM INC COM NPV                       | 64.00     | 6 139.03                                                      | 0.01             |
| CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH | 150.00    | 4 222.06                                                      | 0.00             |
| CAD ALTAGAS LTD COM NPV                     | 100.00    | 4 255.32                                                      | 0.00             |
| CAD ARC RESOURCES COM NPV                   | 149.00    | 4 415.22                                                      | 0.00             |
| CAD BANK MONTREAL QUE COM                   | 255.00    | 17 554.56                                                     | 0.01             |
| CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM            | 511.00    | 31 010.62                                                     | 0.02             |
| CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV               | 553.00    | 9 639.52                                                      | 0.01             |
| CAD BAYTEX ENERGY CORP COM NPV              | 100.00    | 4 156.91                                                      | 0.00             |
| CAD BCE INC COM NEW                         | 140.00    | 6 225.34                                                      | 0.01             |
| CAD BELL ALIANT INC COM NPV                 | 159.00    | 3 911.80                                                      | 0.00             |
| CAD BLACKBERRY LTD NPV                      | 200.00    | 1 525.35                                                      | 0.00             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                    | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-------------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| CAD BOMBARDIER INC CLASS ' B ' SUB-VTG NPV            | 900.00    | 3 616.57                                                      | 0.00             |
| CAD BROOKFIELD ASSET MGMT INC CL A LTD VT SH          | 300.00    | 12 577.33                                                     | 0.01             |
| CAD CAE INC COM                                       | 277.00    | 3 652.28                                                      | 0.00             |
| CAD CAMECO CORP COM                                   | 182.00    | 3 869.02                                                      | 0.00             |
| CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV                           | 100.00    | 15 594.33                                                     | 0.01             |
| CAD CANADIAN NAT RES LTD COM                          | 489.00    | 19 899.53                                                     | 0.02             |
| CAD CANADIAN NATL RY CO COM                           | 413.00    | 24 160.19                                                     | 0.02             |
| CAD CANADIAN OIL SANDS COM NPV                        | 200.00    | 4 330.04                                                      | 0.00             |
| CAD CANADIAN UTILS LTD CL A                           | 109.00    | 4 021.51                                                      | 0.00             |
| CAD CATAMARAN CORP COM NPV                            | 100.00    | 3 794.25                                                      | 0.00             |
| CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM                   | 181.00    | 16 116.74                                                     | 0.01             |
| CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV                        | 300.00    | 8 925.24                                                      | 0.01             |
| CAD CGI GROUP INC ' A ' SUB-VTG NPV                   | 178.00    | 6 409.91                                                      | 0.01             |
| CAD CRESCENT POINT EN COM NPV                         | 210.00    | 8 532.42                                                      | 0.01             |
| CAD ELDORADO GOLD CORP NEW COM                        | 300.00    | 1 826.05                                                      | 0.00             |
| CAD ENBRIDGE INC COM                                  | 327.00    | 15 759.29                                                     | 0.01             |
| CAD ENCANA CORP COM NPV                               | 300.00    | 6 940.64                                                      | 0.01             |
| CAD ENERPLUS CORP COM NPV                             | 198.00    | 4 385.97                                                      | 0.00             |
| CAD FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM                    | 196.00    | 3 898.75                                                      | 0.00             |
| CAD FORTIS INC COM                                    | 85.00     | 2 493.96                                                      | 0.00             |
| CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV                        | 75.00     | 3 610.42                                                      | 0.00             |
| CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM                         | 100.00    | 5 105.47                                                      | 0.00             |
| CAD GOLDCORP INC NEW COM                              | 300.00    | 7 399.88                                                      | 0.01             |
| CAD GREAT WEST LIFECO INC COM                         | 127.00    | 3 568.89                                                      | 0.00             |
| CAD HUSKY ENERGY INC COM                              | 200.00    | 6 527.86                                                      | 0.01             |
| CAD IMPERIAL OIL LTD COM NEW                          | 118.00    | 5 754.58                                                      | 0.01             |
| CAD INTACT FINL CORP COM NPV                          | 60.00     | 3 934.76                                                      | 0.00             |
| CAD KINROSS GOLD CORP COM NO PAR                      | 500.00    | 2 027.43                                                      | 0.00             |
| CAD LOBLAW COS LTD COM                                | 125.00    | 5 427.35                                                      | 0.00             |
| CAD MAGNA INTL INC COM NPV                            | 100.00    | 9 784.50                                                      | 0.01             |
| CAD MANULIFE FINL CORP COM                            | 800.00    | 15 002.05                                                     | 0.01             |
| CAD METRO INC CL A SUB                                | 100.00    | 6 156.09                                                      | 0.01             |
| CAD NATIONAL BK CDA MONTREAL QUE COM                  | 200.00    | 8 290.13                                                      | 0.01             |
| CAD NEW GOLD INC COM NPV                              | 300.00    | 1 514.42                                                      | 0.00             |
| CAD PEMBINA PIPELINE C COM NPV                        | 208.00    | 8 163.07                                                      | 0.01             |
| CAD PENN WEST PETROLEU CON NPV                        | 275.00    | 2 483.26                                                      | 0.00             |
| CAD POTASH CORP SASK INC COM                          | 386.00    | 13 935.32                                                     | 0.01             |
| CAD POWER CORP CDA COM                                | 162.00    | 4 555.40                                                      | 0.00             |
| CAD POWER FINANCIAL CORP COM                          | 163.00    | 5 171.68                                                      | 0.01             |
| CAD ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478       | 135.00    | 5 354.73                                                      | 0.01             |
| CAD ROYAL BK OF CANADA COM NPV                        | 629.00    | 41 925.69                                                     | 0.03             |
| CAD SAPUTO INC COM                                    | 100.00    | 5 340.56                                                      | 0.01             |
| CAD SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV                 | 173.00    | 4 185.29                                                      | 0.00             |
| CAD SILVER WHEATON CORP COM                           | 200.00    | 4 430.27                                                      | 0.00             |
| CAD SNC-LAVALIN GROUP INC COM                         | 100.00    | 4 530.50                                                      | 0.00             |
| CAD SUN LIFE FINL INC COM                             | 191.00    | 6 456.88                                                      | 0.01             |
| CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '                 | 667.00    | 25 696.62                                                     | 0.02             |
| CAD TALISMAN ENERGY INC COM                           | 277.00    | 2 859.73                                                      | 0.00             |
| CAD TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV    | 247.00    | 5 622.18                                                      | 0.01             |
| USD TIM HORTONS INC COM NPV                           | 110.00    | 6 037.90                                                      | 0.01             |
| CAD TORONTO-DOMINION COM NPV                          | 794.00    | 38 149.91                                                     | 0.03             |
| CAD TOURMALINE OIL CP COM NPV                         | 88.00     | 4 550.55                                                      | 0.00             |
| CAD TRANSCANADA CORP COM NPV                          | 353.00    | 16 430.12                                                     | 0.01             |
| CAD VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV | 128.00    | 17 095.05                                                     | 0.01             |
| CAD YAMANA GOLD INC COM                               | 400.00    | 2 992.39                                                      | 0.00             |
| <b>カナダ合計</b>                                          |           | <b>576 909.74</b>                                             | <b>0.43</b>      |
| <b>ケイマン諸島</b>                                         |           |                                                               |                  |
| USD HERBALIFE LTD COM USD0.002                        | 41.00     | 2 459.18                                                      | 0.00             |
| <b>ケイマン諸島合計</b>                                       |           | <b>2 459.18</b>                                               | <b>0.00</b>      |

| 銘柄                                              | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>デンマーク</b>                                    |           |                                                               |                  |
| DKK A.P.MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000        | 5.00      | 11 907.75                                                     | 0.01             |
| DKK CARLSBERG SER ' B ' DKK20                   | 60.00     | 5 991.03                                                      | 0.01             |
| DKK COLOPLAST DKK1 B                            | 67.00     | 5 618.34                                                      | 0.01             |
| DKK DANSKE BANK A/S DKK10                       | 330.00    | 9 318.14                                                      | 0.01             |
| DKK DSV DKK1                                    | 116.00    | 3 868.07                                                      | 0.00             |
| DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '            | 903.00    | 40 712.63                                                     | 0.03             |
| DKK NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)    | 113.00    | 5 409.59                                                      | 0.00             |
| DKK TDC A/S DKK1                                | 305.00    | 2 861.30                                                      | 0.00             |
| DKK TRYG A/S DKK25                              | 39.00     | 3 702.17                                                      | 0.00             |
| <b>デンマーク合計</b>                                  |           | <b>89 389.02</b>                                              | <b>0.07</b>      |
| <b>フィンランド</b>                                   |           |                                                               |                  |
| EUR ELISA CORPORATION EURO.50                   | 138.00    | 4 119.63                                                      | 0.00             |
| EUR KONE CORPORATION NPV ORD ' B '              | 123.00    | 5 256.22                                                      | 0.00             |
| EUR METSO OYJ EUR1.70                           | 83.00     | 3 323.62                                                      | 0.00             |
| EUR NOKIA OYJ EURO.06                           | 1 452.00  | 10 861.59                                                     | 0.01             |
| EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV                      | 88.00     | 3 492.11                                                      | 0.00             |
| EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV                     | 171.00    | 8 485.81                                                      | 0.01             |
| EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '                | 505.00    | 5 143.03                                                      | 0.00             |
| EUR UPM-KYMMENE CORP NPV                        | 307.00    | 5 363.45                                                      | 0.01             |
| EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50          | 110.00    | 6 122.17                                                      | 0.01             |
| <b>フィンランド合計</b>                                 |           | <b>52 167.63</b>                                              | <b>0.04</b>      |
| <b>フランス</b>                                     |           |                                                               |                  |
| EUR ACCOR EUR3                                  | 99.00     | 4 837.34                                                      | 0.00             |
| EUR AIR LIQUIDE(L ' ) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION) | 142.00    | 20 299.37                                                     | 0.02             |
| EUR AIRBUS GROUP NV EUR1                        | 260.00    | 17 841.29                                                     | 0.01             |
| EUR ALCATEL-LUCENT EUR2                         | 1 600.00  | 6 393.65                                                      | 0.01             |
| EUR ALSTOM EUR7.00                              | 47.00     | 1 923.75                                                      | 0.00             |
| EUR ARKEMA EUR10                                | 35.00     | 3 900.30                                                      | 0.00             |
| EUR AXA EUR2.29                                 | 705.00    | 18 352.90                                                     | 0.01             |
| EUR BNP PARIBAS EUR2                            | 410.00    | 30 760.75                                                     | 0.02             |
| EUR BOUYGUES EUR1                               | 83.00     | 3 730.44                                                      | 0.00             |
| EUR CAP GEMINI EUR8                             | 97.00     | 6 847.16                                                      | 0.01             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                             | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| EUR CARREFOUR EUR2.50                          | 295.00    | 11 465.17                                                     | 0.01             |
| EUR CGG EURO.40                                | 104.00    | 1 796.75                                                      | 0.00             |
| EUR CHRISTIAN DIOR EUR2                        | 20.00     | 4 108.35                                                      | 0.00             |
| EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4                      | 198.00    | 12 085.11                                                     | 0.01             |
| EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3                    | 531.00    | 8 360.22                                                      | 0.01             |
| EUR DANONE EURO.25                             | 252.00    | 18 574.67                                                     | 0.01             |
| EUR DASSAULT SYSTEMES EUR1                     | 31.00     | 3 809.59                                                      | 0.00             |
| EUR EDENRED EUR2                               | 137.00    | 4 617.86                                                      | 0.00             |
| EUR EDF EURO.5                                 | 109.00    | 4 178.10                                                      | 0.00             |
| EUR ESSILOR INTL EURO.18                       | 107.00    | 11 437.14                                                     | 0.01             |
| EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1                    | 87.00     | 2 983.18                                                      | 0.00             |
| EUR GDF SUEZ EUR1                              | 521.00    | 13 129.49                                                     | 0.01             |
| EUR GROUPE EUROTUNNEL SA EURO.40 (POST CONS)   | 333.00    | 4 464.39                                                      | 0.00             |
| EUR KERING EUR4                                | 25.00     | 5 525.40                                                      | 0.01             |
| EUR L ' OREAL EURO.20                          | 109.00    | 18 740.61                                                     | 0.01             |
| EUR LAFARGE EUR4                               | 107.00    | 9 769.56                                                      | 0.01             |
| EUR LEGRAND SA EUR4                            | 70.00     | 4 513.22                                                      | 0.00             |
| EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30                 | 106.00    | 20 833.61                                                     | 0.02             |
| EUR NATIXIS EUR1.6                             | 621.00    | 4 405.98                                                      | 0.00             |
| EUR ORANGE EUR4                                | 649.00    | 10 506.00                                                     | 0.01             |
| EUR PERNOD RICARD EUR1.55                      | 107.00    | 12 834.70                                                     | 0.01             |
| EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40                 | 65.00     | 5 533.72                                                      | 0.01             |
| EUR RENAULT SA EUR3.81                         | 106.00    | 10 310.25                                                     | 0.01             |
| EUR REXEL EUR5                                 | 143.00    | 3 608.64                                                      | 0.00             |
| EUR SAFRAN EURO.20                             | 121.00    | 8 127.75                                                      | 0.01             |
| EUR SANOFI EUR2                                | 508.00    | 54 954.74                                                     | 0.04             |
| EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8                    | 212.00    | 19 856.23                                                     | 0.02             |
| EUR SOC GENERALE EUR1.25                       | 324.00    | 20 126.05                                                     | 0.01             |
| EUR SODEXO EUR4                                | 37.00     | 3 986.19                                                      | 0.00             |
| EUR SUEZ ENVIRONNEMENT EUR4                    | 204.00    | 4 002.42                                                      | 0.00             |
| EUR TECHNIP NPV                                | 58.00     | 6 522.05                                                      | 0.01             |
| EUR THALES EUR3                                | 89.00     | 5 658.03                                                      | 0.01             |
| EUR TOTAL EUR2.5                               | 897.00    | 64 027.50                                                     | 0.05             |
| EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5                       | 45.00     | 12 132.66                                                     | 0.01             |
| EUR VALEO EUR3                                 | 33.00     | 4 517.96                                                      | 0.00             |
| EUR VALLOUREC USIN A T EUR2 (POST SUBDIVISION) | 62.00     | 3 662.59                                                      | 0.00             |
| EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5                    | 294.00    | 5 478.76                                                      | 0.01             |
| EUR VINCI EUR2.50                              | 209.00    | 15 747.13                                                     | 0.01             |
| EUR VIVENDI SA EUR5.50                         | 386.00    | 10 350.93                                                     | 0.01             |
| <b>フランス合計</b>                                  |           | <b>561 629.65</b>                                             | <b>0.42</b>      |
| <b>ドイツ</b>                                     |           |                                                               |                  |
| EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1           | 152.00    | 19 005.94                                                     | 0.02             |
| EUR BEIERSDORF AG NPV                          | 60.00     | 6 011.53                                                      | 0.01             |
| EUR COMMERZBANK AG NPV                         | 293.00    | 5 202.15                                                      | 0.01             |
| EUR CONTINENTAL AG ORD NPV                     | 48.00     | 11 237.71                                                     | 0.01             |
| EUR FRESENIUS MED CARE NPV                     | 108.00    | 7 419.98                                                      | 0.01             |
| EUR FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV                 | 54.00     | 8 202.41                                                      | 0.01             |
| EUR GEA GROUP AG NPV                           | 89.00     | 3 979.14                                                      | 0.00             |
| EUR HEIDELBERGCEMENT NPV                       | 72.00     | 6 241.47                                                      | 0.01             |
| EUR HENKEL AG & CO KGAA                        | 40.00     | 4 103.08                                                      | 0.00             |
| EUR HOCHTIEF AG NPV                            | 40.00     | 3 715.40                                                      | 0.00             |
| EUR LANXESS AG NPV                             | 56.00     | 4 255.04                                                      | 0.00             |
| EUR LINDE AG NPV                               | 78.00     | 16 163.16                                                     | 0.01             |
| EUR MAN SE ORD NPV                             | 30.00     | 3 842.27                                                      | 0.00             |
| EUR MERCK KGAA NPV                             | 31.00     | 5 224.59                                                      | 0.01             |
| EUR METRO AG ORD NPV                           | 89.00     | 3 554.00                                                      | 0.00             |
| EUR RWE AG (NEU) NPV                           | 240.00    | 9 146.24                                                      | 0.01             |
| EUR SAP AG ORD NPV                             | 388.00    | 31 224.44                                                     | 0.02             |
| EUR THYSSENKRUPP AG NPV                        | 174.00    | 4 950.65                                                      | 0.01             |
| <b>ドイツ合計</b>                                   |           | <b>153 479.20</b>                                             | <b>0.14</b>      |

| 銘柄                                           | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|----------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>ガーンジー</b>                                 |           |                                                               |                  |
| GBP RESOLUTION LTD ORD NPV(NEW)              | 648.00    | 3 263.93                                                      | 0.00             |
| <b>ガーンジー合計</b>                               |           | <b>3 263.93</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>香港</b>                                    |           |                                                               |                  |
| HKD AIA GROUP LTD USD1.00                    | 5 400.00  | 26 189.08                                                     | 0.02             |
| HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5                  | 2 000.00  | 5 855.91                                                      | 0.00             |
| HKD CHEUNG KONG(HLDGS) HKD0.50               | 1 000.00  | 17 026.00                                                     | 0.01             |
| HKD CLP HOLDINGS HKD5                        | 1 000.00  | 7 997.06                                                      | 0.01             |
| HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10               | 1 000.00  | 7 848.73                                                      | 0.01             |
| HKD HANG SENG BANK HKD5                      | 400.00    | 6 516.31                                                      | 0.00             |
| HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1                  | 507.00    | 9 135.72                                                      | 0.01             |
| HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25               | 3 210.00  | 7 403.06                                                      | 0.01             |
| HKD HUTCHISON WHAMPOA HKD0.25                | 1 000.00  | 13 672.39                                                     | 0.01             |
| USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV               | 100.00    | 9 120.00                                                      | 0.01             |
| HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1                  | 4 421.00  | 4 561.94                                                      | 0.00             |
| HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1           | 500.00    | 4 320.99                                                      | 0.00             |
| HKD SINO LAND CO HKD1                        | 2 484.00  | 3 716.62                                                      | 0.00             |
| HKD SUN HUNG KAI PROP HKD0.50                | 1 047.00  | 13 187.35                                                     | 0.01             |
| HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60                | 500.00    | 5 772.07                                                      | 0.00             |
| HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST    | 1 500.00  | 7 458.55                                                      | 0.01             |
| HKD WHARF(HLDGS) HKD1                        | 1 000.00  | 6 997.43                                                      | 0.01             |
| <b>香港合計</b>                                  |           | <b>156 779.21</b>                                             | <b>0.12</b>      |
| <b>アイルランド</b>                                |           |                                                               |                  |
| USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'             | 278.00    | 22 301.16                                                     | 0.02             |
| USD ACTAVIS PLC EUR1                         | 68.00     | 13 894.44                                                     | 0.01             |
| USD COVIDIEN PLC USDO.20(POST CONSOLIDATION) | 208.00    | 14 820.00                                                     | 0.01             |
| EUR CRH ORD EURO.32(DUBLIN LISTING)          | 382.00    | 11 075.23                                                     | 0.01             |
| USD EATON CORP PLC COM USDO.01               | 246.00    | 17 869.44                                                     | 0.01             |
| GBP EXPERIAN ORD USDO.10                     | 251.00    | 4 814.66                                                      | 0.00             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                  | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1     | 119.00    | 7 116.20                                                      | 0.01             |
| USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001 | 200.00    | 10 516.00                                                     | 0.01             |
| GBP SHIRE ORD GBP0.05               | 295.00    | 16 826.57                                                     | 0.01             |
| USD XL GROUP PLC USD0.01            | 200.00    | 6 270.00                                                      | 0.00             |
| <b>アイルランド合計</b>                     |           | <b>125 503.70</b>                                             | <b>0.09</b>      |
| <b>イスラエル</b>                        |           |                                                               |                  |
| ILS BANK HAPOLIM B.M.ILS1           | 720.00    | 4 062.52                                                      | 0.01             |
| ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1            | 439.00    | 3 888.64                                                      | 0.00             |
| <b>イスラエル合計</b>                      |           | <b>7 951.16</b>                                               | <b>0.01</b>      |
| <b>イタリア</b>                         |           |                                                               |                  |
| EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1         | 357.00    | 8 330.82                                                      | 0.01             |
| EUR ATLANTIA SPA EUR1               | 203.00    | 5 277.56                                                      | 0.00             |
| EUR ENEL EUR1                       | 2 637.00  | 14 895.90                                                     | 0.01             |
| EUR ENI SPA EUR1                    | 982.00    | 25 475.39                                                     | 0.02             |
| EUR FIAT SPA EUR3.58                | 486.00    | 5 849.13                                                      | 0.01             |
| EUR FINMECCANICA SPA EUR4.40        | 324.00    | 2 989.71                                                      | 0.00             |
| EUR INTESA SANPAOLO                 | 4 915.00  | 16 764.64                                                     | 0.01             |
| EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06         | 108.00    | 6 180.08                                                      | 0.01             |
| EUR MEDIUMBANCA SPA EURO.5          | 449.00    | 4 968.04                                                      | 0.00             |
| EUR SAIPEM EUR1                     | 141.00    | 3 773.22                                                      | 0.00             |
| EUR SNAM EUR1                       | 678.00    | 4 072.44                                                      | 0.00             |
| EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55      | 5 084.00  | 6 509.95                                                      | 0.01             |
| EUR TERNA SPA ORD EURO.22           | 951.00    | 5 142.58                                                      | 0.00             |
| EUR UBI BANCA EUR2.50               | 615.00    | 5 849.72                                                      | 0.01             |
| EUR UNICREDIT SPA NPV (POST SPLIT)  | 1 799.00  | 16 063.96                                                     | 0.01             |
| <b>イタリア合計</b>                       |           | <b>132 143.14</b>                                             | <b>0.10</b>      |
| <b>日本</b>                           |           |                                                               |                  |
| JPY イオン                             | 400.00    | 4 624.57                                                      | 0.00             |
| JPY イオンフィナンシャルサービス                  | 300.00    | 7 550.66                                                      | 0.01             |
| JPY イオンモール                          | 110.00    | 2 621.05                                                      | 0.00             |
| JPY 旭硝子                             | 1 000.00  | 5 668.14                                                      | 0.01             |
| JPY アサヒグループホールディングス                 | 300.00    | 8 276.06                                                      | 0.01             |
| JPY 旭化成                             | 1 000.00  | 6 803.72                                                      | 0.01             |
| JPY アステラス製薬                         | 1 000.00  | 11 130.69                                                     | 0.01             |
| JPY ベネッセホールディングス                    | 100.00    | 3 803.23                                                      | 0.00             |
| JPY 横浜銀行                            | 1 000.00  | 5 022.03                                                      | 0.00             |
| JPY プリヂストン                          | 300.00    | 10 748.90                                                     | 0.01             |
| JPY カルビー                            | 100.00    | 2 451.30                                                      | 0.00             |
| JPY キヤノン                            | 400.00    | 12 589.33                                                     | 0.01             |
| JPY カシオ計算機                          | 300.00    | 3 424.38                                                      | 0.00             |
| JPY 東海旅客鉄道                          | 100.00    | 12 276.06                                                     | 0.01             |
| JPY 中部電力                            | 300.00    | 3 415.57                                                      | 0.00             |
| JPY 中外製薬                            | 200.00    | 5 045.52                                                      | 0.00             |
| JPY クレディセゾン                         | 100.00    | 2 128.24                                                      | 0.00             |
| JPY 第一生命保険                          | 400.00    | 5 536.96                                                      | 0.01             |
| JPY 第一三共                            | 400.00    | 6 707.78                                                      | 0.01             |
| JPY ダイキン工業                          | 100.00    | 5 776.80                                                      | 0.01             |
| JPY 大和証券グループ本社                      | 1 000.00  | 7 488.99                                                      | 0.01             |
| JPY デンソー                            | 200.00    | 9 108.17                                                      | 0.01             |
| JPY 電通                              | 100.00    | 4 111.60                                                      | 0.00             |
| JPY 東日本旅客鉄道                         | 200.00    | 14 592.27                                                     | 0.01             |
| JPY エーザイ                            | 100.00    | 3 860.01                                                      | 0.00             |
| JPY ファミリーマート                        | 100.00    | 4 155.65                                                      | 0.00             |
| JPY ファナック                           | 100.00    | 18 012.73                                                     | 0.01             |
| JPY 富士フイルムホールディングス                  | 200.00    | 5 168.87                                                      | 0.00             |
| JPY 富士重工業                           | 300.00    | 7 885.46                                                      | 0.01             |
| JPY 富士通                             | 1 000.00  | 5 873.72                                                      | 0.01             |

| 銘柄                     | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| JPY 久光製薬               | 100.00    | 4 189.92                                                      | 0.00             |
| JPY 日立化成工業             | 100.00    | 1 471.37                                                      | 0.00             |
| JPY 日立建機               | 100.00    | 1 857.07                                                      | 0.00             |
| JPY 日立製作所              | 2 000.00  | 14 233.97                                                     | 0.01             |
| JPY 北陸電力               | 100.00    | 1 241.31                                                      | 0.00             |
| JPY 本田技研工業             | 800.00    | 26 470.88                                                     | 0.02             |
| JPY H O Y A            | 300.00    | 8 851.69                                                      | 0.01             |
| JPY ヒューリック             | 200.00    | 2 406.27                                                      | 0.00             |
| JPY イビデン               | 100.00    | 1 802.25                                                      | 0.00             |
| JPY 国際石油開発帝石           | 400.00    | 5 826.73                                                      | 0.01             |
| JPY 三越伊勢丹ホールディングス      | 400.00    | 4 973.08                                                      | 0.00             |
| JPY 伊藤忠商事              | 800.00    | 8 959.37                                                      | 0.01             |
| JPY 日本取引所グループ          | 100.00    | 1 975.53                                                      | 0.00             |
| JPY 日本リテールファンド投資法人     | 2.00      | 4 021.54                                                      | 0.00             |
| JPY 日本たばこ産業            | 500.00    | 16 426.82                                                     | 0.01             |
| JPY ジェイ エフ イー ホールディングス | 200.00    | 3 700.44                                                      | 0.00             |
| JPY J S R              | 200.00    | 3 279.49                                                      | 0.00             |
| JPY ジェイテクト             | 100.00    | 1 458.64                                                      | 0.00             |
| JPY J Xホールディングス        | 600.00    | 3 113.07                                                      | 0.00             |
| JPY カカクコム              | 200.00    | 2 848.75                                                      | 0.00             |
| JPY 関西電力               | 400.00    | 3 351.93                                                      | 0.00             |
| JPY 花王                 | 300.00    | 11 298.09                                                     | 0.01             |
| JPY K D D I            | 300.00    | 15 982.38                                                     | 0.01             |
| JPY コマツ                | 400.00    | 8 818.40                                                      | 0.01             |
| JPY コナミ                | 100.00    | 2 280.96                                                      | 0.00             |
| JPY コニカミノルタ            | 500.00    | 4 645.13                                                      | 0.00             |
| JPY クボタ                | 1 000.00  | 12 863.44                                                     | 0.01             |
| JPY クラレ                | 300.00    | 3 368.58                                                      | 0.00             |
| JPY 栗田工業               | 200.00    | 4 209.50                                                      | 0.00             |
| JPY 京セラ                | 200.00    | 9 411.65                                                      | 0.01             |
| JPY 九州電力               | 300.00    | 3 027.90                                                      | 0.00             |
| JPY L I X I L グループ     | 200.00    | 5 292.22                                                      | 0.00             |
| JPY マキタ                | 100.00    | 5 305.92                                                      | 0.01             |
| JPY 丸紅                 | 1 000.00  | 6 676.46                                                      | 0.01             |
| JPY マツダ                | 1 000.00  | 4 473.81                                                      | 0.00             |
| JPY メディパルホールディングス      | 200.00    | 2 811.55                                                      | 0.00             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                              | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| JPY 三菱商事                        | 700.00    | 12 526.68                                                     | 0.01             |
| JPY 三菱電機                        | 1 000.00  | 11 385.22                                                     | 0.01             |
| JPY 三菱地所                        | 1 000.00  | 22 652.96                                                     | 0.02             |
| JPY 三菱重工業                       | 2 000.00  | 10 533.53                                                     | 0.01             |
| JPY 三菱自動車工業                     | 400.00    | 4 330.89                                                      | 0.00             |
| JPY 田辺三菱製薬                      | 300.00    | 4 111.60                                                      | 0.00             |
| JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ           | 5 300.00  | 28 121.39                                                     | 0.02             |
| JPY 三井物産                        | 600.00    | 8 511.01                                                      | 0.01             |
| JPY 商船三井                        | 1 000.00  | 3 338.23                                                      | 0.00             |
| JPY みずほフィナンシャルグループ              | 8 900.00  | 17 425.35                                                     | 0.01             |
| JPY MS&ADインシュアランス グループ ホールディングス | 300.00    | 6 725.40                                                      | 0.02             |
| JPY 村田製作所                       | 100.00    | 8 321.10                                                      | 0.01             |
| JPY バンダイナムコホールディングス             | 200.00    | 4 315.22                                                      | 0.00             |
| JPY 日本電産                        | 200.00    | 11 387.18                                                     | 0.01             |
| JPY ニコン                         | 100.00    | 1 569.26                                                      | 0.00             |
| JPY 新日鐵住金                       | 4 470.00  | 11 727.46                                                     | 0.01             |
| JPY 日本電信電話                      | 200.00    | 11 083.70                                                     | 0.01             |
| JPY 日本郵船                        | 1 000.00  | 2 711.70                                                      | 0.00             |
| JPY 日産自動車                       | 1 200.00  | 10 302.50                                                     | 0.01             |
| JPY 日清食品ホールディングス                | 100.00    | 4 787.08                                                      | 0.00             |
| JPY ニトリホールディングス                 | 100.00    | 4 586.39                                                      | 0.00             |
| JPY 日東電工                        | 100.00    | 4 317.18                                                      | 0.00             |
| JPY N K S J ホールディングス            | 250.00    | 6 238.37                                                      | 0.01             |
| JPY N O K                       | 100.00    | 1 636.81                                                      | 0.00             |
| JPY 野村ホールディングス                  | 1 700.00  | 9 785.61                                                      | 0.01             |
| JPY 野村不動産ホールディングス               | 200.00    | 3 731.77                                                      | 0.00             |
| JPY N T T ドコモ                   | 700.00    | 11 115.03                                                     | 0.01             |
| JPY N T T 都市開発                  | 200.00    | 1 758.20                                                      | 0.00             |
| JPY オムロン                        | 100.00    | 3 534.02                                                      | 0.00             |
| JPY 小野薬品工業                      | 100.00    | 7 919.73                                                      | 0.01             |
| JPY オリックス                       | 600.00    | 8 675.48                                                      | 0.01             |
| JPY 大阪ガス                        | 1 000.00  | 3 768.97                                                      | 0.00             |
| JPY 大塚ホールディングス                  | 200.00    | 5 762.11                                                      | 0.01             |
| JPY パナソニック                      | 900.00    | 9 859.03                                                      | 0.01             |
| JPY バーク 2 4                     | 200.00    | 3 653.45                                                      | 0.00             |
| JPY 楽天                          | 500.00    | 6 470.88                                                      | 0.01             |
| JPY りそなホールディングス                 | 900.00    | 4 599.12                                                      | 0.00             |
| JPY リコー                         | 300.00    | 3 450.81                                                      | 0.00             |
| JPY 三共                          | 100.00    | 3 999.02                                                      | 0.00             |
| JPY S B I ホールディングス              | 330.00    | 3 763.58                                                      | 0.00             |
| JPY セコム                         | 100.00    | 5 759.18                                                      | 0.01             |
| JPY セガサミーホールディングス               | 200.00    | 4 025.45                                                      | 0.00             |
| JPY 積水ハウス                       | 300.00    | 3 603.52                                                      | 0.00             |
| JPY セブン&アイ・ホールディングス             | 400.00    | 15 784.63                                                     | 0.01             |
| JPY シャープ                        | 1 000.00  | 2 506.12                                                      | 0.00             |
| JPY 信越化学工業                      | 200.00    | 11 743.51                                                     | 0.01             |
| JPY 塩野義製薬                       | 200.00    | 3 504.65                                                      | 0.00             |
| JPY 資生堂                         | 200.00    | 3 571.22                                                      | 0.00             |
| JPY 昭和シェル石油                     | 300.00    | 3 045.52                                                      | 0.00             |
| JPY ソフトバンク                      | 400.00    | 29 721.00                                                     | 0.02             |
| JPY ソニー                         | 400.00    | 7 017.13                                                      | 0.01             |
| JPY ソニーフィナンシャルホールディングス          | 200.00    | 3 207.05                                                      | 0.00             |
| JPY 住友商事                        | 600.00    | 7 794.42                                                      | 0.01             |
| JPY 住友電気工業                      | 400.00    | 5 525.21                                                      | 0.01             |
| JPY 三井住友フィナンシャルグループ             | 500.00    | 19 740.58                                                     | 0.02             |
| JPY 三井住友トラスト・ホールディングス           | 1 000.00  | 4 121.39                                                      | 0.00             |
| JPY 住友ゴム工業                      | 200.00    | 2 778.27                                                      | 0.00             |
| JPY スズキ                         | 200.00    | 5 159.08                                                      | 0.00             |
| JPY T & D ホールディングス              | 500.00    | 5 966.72                                                      | 0.01             |
| JPY 武田薬品工業                      | 300.00    | 13 474.30                                                     | 0.01             |

| 銘柄                                    | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| JPY テルモ                               | 200.00    | 3 972.59                                                      | 0.00             |
| JPY T H K                             | 200.00    | 4 234.95                                                      | 0.00             |
| JPY トーホー                              | 100.00    | 1 927.56                                                      | 0.00             |
| JPY 東北電力                              | 300.00    | 2 854.63                                                      | 0.00             |
| JPY 東京海上ホールディングス                      | 300.00    | 8 842.88                                                      | 0.01             |
| JPY 東京電力                              | 600.00    | 2 267.25                                                      | 0.00             |
| JPY 東京エレクトロン                          | 100.00    | 5 680.86                                                      | 0.01             |
| JPY 東京ガス                              | 1 000.00  | 5 237.40                                                      | 0.00             |
| JPY 東京急行電鉄                            | 1 000.00  | 6 294.66                                                      | 0.01             |
| JPY 東急不動産ホールディングス                     | 300.00    | 2 179.15                                                      | 0.00             |
| JPY 東レ                                | 1 000.00  | 6 529.61                                                      | 0.01             |
| JPY 東芝                                | 2 000.00  | 7 831.62                                                      | 0.01             |
| JPY 東洋製罐グループホールディングス                  | 200.00    | 2 974.06                                                      | 0.00             |
| JPY 豊田合成                              | 200.00    | 3 688.69                                                      | 0.00             |
| JPY 豊田自動織機                            | 100.00    | 4 610.87                                                      | 0.00             |
| JPY トヨタ自動車                            | 1 200.00  | 64 798.83                                                     | 0.05             |
| JPY 豊田通商                              | 200.00    | 5 264.81                                                      | 0.00             |
| JPY ユニ・チャーム                           | 100.00    | 5 423.40                                                      | 0.01             |
| JPY ユー・エス・エス                          | 300.00    | 4 372.98                                                      | 0.00             |
| JPY 西日本旅客鉄道                           | 100.00    | 4 055.80                                                      | 0.00             |
| JPY ヤフー                               | 700.00    | 3 042.58                                                      | 0.00             |
| JPY ヤクルト本社                            | 100.00    | 5 403.82                                                      | 0.01             |
| JPY ヤマダ電機                             | 600.00    | 2 214.39                                                      | 0.00             |
| JPY ヤマハ                               | 200.00    | 2 678.41                                                      | 0.00             |
| JPY ヤマハ発動機                            | 100.00    | 1 543.81                                                      | 0.00             |
| JPY ヤマトホールディングス                       | 200.00    | 4 115.52                                                      | 0.00             |
| JPY 横河電機                              | 500.00    | 6 828.19                                                      | 0.01             |
| <b>日本合計</b>                           |           | <b>1 070 195.86</b>                                           | <b>0.80</b>      |
| <b>ジャージー</b>                          |           |                                                               |                  |
| GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05    | 54.00     | 4 358.49                                                      | 0.00             |
| <b>ジャージー 合計</b>                       |           | <b>4 358.49</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>マカオ</b>                            |           |                                                               |                  |
| HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG ' S ' | 1 200.00  | 8 760.65                                                      | 0.01             |
| <b>マカオ合計</b>                          |           | <b>8 760.65</b>                                               | <b>0.01</b>      |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                | 数量 /<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------------------------|------------|-------------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>オランダ</b>                                       |            |                                                                   |                  |
| EUR AEGON NV                                      | 1 151.00   | 10 429.34                                                         | 0.01             |
| EUR AHOLD(KON)NV EURO.01                          | 305.00     | 5 880.40                                                          | 0.01             |
| EUR AKZO NOBEL NV EUR2                            | 127.00     | 9 771.33                                                          | 0.01             |
| EUR ASML HOLDING NV EURO.09 (POST SPLIT)          | 167.00     | 13 761.25                                                         | 0.01             |
| EUR BOSKALIS WESTMNSTR CVA EURO.80 (POST-SUBD)    | 77.00      | 4 359.19                                                          | 0.00             |
| EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01                 | 458.00     | 5 334.33                                                          | 0.01             |
| EUR CORIO NV EUR10                                | 63.00      | 2 946.85                                                          | 0.00             |
| EUR GEMALTO EUR1                                  | 32.00      | 3 580.62                                                          | 0.00             |
| EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6                       | 64.00      | 4 082.00                                                          | 0.00             |
| EUR HEINEKEN NV EUR1.60                           | 139.00     | 9 636.52                                                          | 0.01             |
| EUR KON KPN NV EURO.24                            | 1 182.00   | 4 198.86                                                          | 0.00             |
| EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5                     | 59.00      | 4 227.76                                                          | 0.00             |
| EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20                | 452.00     | 14 461.58                                                         | 0.01             |
| EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10                     | 60.00      | 3 486.20                                                          | 0.00             |
| EUR REED ELSEVIER ORD EURO.07                     | 262.00     | 5 341.98                                                          | 0.01             |
| GBP ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST) | 1 103.00   | 46 934.26                                                         | 0.04             |
| GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC ' A ' SHS EURO.07       | 1 704.00   | 67 529.98                                                         | 0.05             |
| EUR TNT EXPRESS NV EURO.08                        | 282.00     | 2 537.64                                                          | 0.00             |
| EUR WOLTERS KLUWER EURO.12                        | 142.00     | 3 951.58                                                          | 0.00             |
| EUR ZIGGO NV EUR1                                 | 86.00      | 3 729.93                                                          | 0.00             |
| <b>オランダ合計</b>                                     |            | <b>226 181.60</b>                                                 | <b>0.17</b>      |
| <b>ニュージーランド</b>                                   |            |                                                                   |                  |
| NZD TELECOM CORP OF NZ NPV                        | 1 877.00   | 4 466.71                                                          | 0.00             |
| <b>ニュージーランド合計</b>                                 |            | <b>4 466.71</b>                                                   | <b>0.00</b>      |
| <b>ノルウェー</b>                                      |            |                                                                   |                  |
| NOK DNB ASA NOK10                                 | 216.00     | 3 811.49                                                          | 0.00             |
| NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666                     | 826.00     | 4 411.45                                                          | 0.00             |
| NOK ORKLA ASA NOK1.25                             | 388.00     | 3 197.88                                                          | 0.00             |
| NOK STATOIL ASA NOK2.50                           | 512.00     | 15 507.60                                                         | 0.01             |
| NOK TELENOR ASA ORD NOK6                          | 437.00     | 10 235.14                                                         | 0.01             |
| NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7                     | 107.00     | 5 040.92                                                          | 0.01             |
| <b>ノルウェー合計</b>                                    |            | <b>42 204.48</b>                                                  | <b>0.03</b>      |
| <b>ポルトガル</b>                                      |            |                                                                   |                  |
| EUR GALP ENERGIA EUR1-B                           | 243.00     | 4 206.60                                                          | 0.00             |
| <b>ポルトガル合計</b>                                    |            | <b>4 206.60</b>                                                   | <b>0.00</b>      |
| <b>シンガポール</b>                                     |            |                                                                   |                  |
| USD AV TECH CORP NPV                              | 97.00      | 6 159.50                                                          | 0.01             |
| SGD DBS GROUP HLDGS SGD1                          | 1 140.00   | 15 383.44                                                         | 0.01             |
| USD FLEXTRONICS INTL USD0.01                      | 500.00     | 4 495.00                                                          | 0.00             |
| SGD KEPPEL CORP NPV                               | 1 000.00   | 8 388.10                                                          | 0.01             |
| SGD OVERSEA-CHINESE BK SGD0.5                     | 1 544.00   | 11 868.88                                                         | 0.01             |
| SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01                    | 1 000.00   | 5 512.41                                                          | 0.00             |
| SGD SINGAPORE TELECOMM NPV(POST RE-ORG)           | 4 000.00   | 12 203.77                                                         | 0.01             |
| SGD UTD O/S BANK SGD1                             | 1 098.00   | 19 032.52                                                         | 0.01             |
| <b>シンガポール合計</b>                                   |            | <b>83 043.62</b>                                                  | <b>0.06</b>      |
| <b>スペイン</b>                                       |            |                                                                   |                  |
| EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A                | 166.00     | 3 729.86                                                          | 0.00             |
| EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5                     | 108.00     | 4 623.47                                                          | 0.00             |
| EUR AMADEUS IT HLDGS EURO.01                      | 176.00     | 7 310.00                                                          | 0.01             |
| EUR BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)         | 581.00     | 4 269.60                                                          | 0.00             |
| EUR BANKIA S.A. EUR1                              | 2 050.00   | 4 175.53                                                          | 0.00             |
| EUR BCO DE SABADELL EURO.125                      | 1 256.00   | 4 266.69                                                          | 0.00             |
| EUR CAIXABANK SA EUR1                             | 771.00     | 4 693.04                                                          | 0.01             |
| EUR DISTRIBUIDORA INTL EURO.01                    | 276.00     | 2 463.75                                                          | 0.00             |

| 銘柄              |                                         | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-----------------|-----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| EUR             | ENAGAS SA EUR1.50                       | 167.00    | 5 140.50                                                      | 0.01             |
| EUR             | GAS NATURAL SDG EUR1                    | 252.00    | 7 220.57                                                      | 0.01             |
| EUR             | GRIFOLS SA EURO.5                       | 75.00     | 4 003.66                                                      | 0.00             |
| EUR             | IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION) | 2 065.00  | 14 416.35                                                     | 0.01             |
| EUR             | INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50           | 547.00    | 3 739.12                                                      | 0.00             |
| EUR             | RED ELECTRICA CORPORACION EUR2          | 83.00     | 6 822.16                                                      | 0.01             |
| EUR             | REPSOL SA EUR1                          | 378.00    | 10 167.85                                                     | 0.01             |
| EUR             | TELEFONICA SA EUR1                      | 1 765.00  | 29 538.44                                                     | 0.02             |
| <b>スペイン合計</b>   |                                         |           | <b>116 580.59</b>                                             | <b>0.09</b>      |
| <b>スウェーデン</b>   |                                         |           |                                                               |                  |
| SEK             | ASSA ABLOY SER ' B ' NPV                | 134.00    | 7 077.41                                                      | 0.01             |
| SEK             | ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV            | 309.00    | 8 923.54                                                      | 0.01             |
| SEK             | ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV            | 153.00    | 4 146.11                                                      | 0.00             |
| USD             | AUTOLIV INC COM                         | 41.00     | 4 181.18                                                      | 0.00             |
| SEK             | ELEKTA SER ' B ' NPV                    | 256.00    | 3 574.71                                                      | 0.00             |
| SEK             | ERICSSON SER ' B ' NPV                  | 1 332.00  | 16 044.75                                                     | 0.01             |
| SEK             | GETINGE AB SER ' B ' NPV                | 165.00    | 4 838.42                                                      | 0.00             |
| SEK             | HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV          | 362.00    | 14 709.08                                                     | 0.01             |
| SEK             | HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV              | 379.00    | 3 140.45                                                      | 0.00             |
| SEK             | INVESTOR AB SER ' B ' NPV               | 262.00    | 10 111.10                                                     | 0.01             |
| SEK             | KINNEVIK INV AB SER ' B ' NPV           | 90.00     | 3 155.64                                                      | 0.00             |
| SEK             | LUNDIN PETROLEUM A NPV                  | 152.00    | 3 239.70                                                      | 0.00             |
| SEK             | NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)       | 1 424.00  | 20 528.90                                                     | 0.02             |
| SEK             | SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)             | 486.00    | 6 842.29                                                      | 0.01             |
| SEK             | SCANIA AB SER ' B ' NPV                 | 186.00    | 5 622.61                                                      | 0.00             |
| SEK             | SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV        | 767.00    | 10 539.50                                                     | 0.01             |
| SEK             | SKF AB SER ' B ' NPV                    | 143.00    | 3 686.41                                                      | 0.00             |
| SEK             | SVENSKA CELLULOSA SER ' B ' NPV         | 338.00    | 9 444.64                                                      | 0.01             |
| SEK             | SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV        | 247.00    | 12 367.25                                                     | 0.01             |
| SEK             | SWEDBANK AB SER ' A ' NPV               | 386.00    | 10 229.13                                                     | 0.01             |
| SEK             | SWEDISH MATCH NPV                       | 126.00    | 4 309.63                                                      | 0.00             |
| SEK             | TELE2 AB SHS                            | 210.00    | 2 674.58                                                      | 0.00             |
| SEK             | TELIASONERA AB NPV                      | 1 105.00  | 7 996.41                                                      | 0.01             |
| SEK             | VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)     | 641.00    | 10 081.86                                                     | 0.01             |
| <b>スウェーデン合計</b> |                                         |           | <b>187 465.30</b>                                             | <b>0.14</b>      |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>スイス</b>                                        |           |                                                               |                  |
| GBP GLENCORE XSTRATA PLC USD0.01                  | 4 808.00  | 25 857.58                                                     | 0.02             |
| CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)(POST SUBD)         | 33.00     | 2 990.97                                                      | 0.00             |
| EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04                    | 422.00    | 4 035.01                                                      | 0.00             |
| CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)                      | 16.00     | 10 258.39                                                     | 0.01             |
| CHF SWISS RE AG CHF0.10                           | 171.00    | 14 925.72                                                     | 0.01             |
| GBP WOLSELEY ORD GBP0.108030303(POST CON          | 111.00    | 6 411.95                                                      | 0.01             |
| <b>スイス合計</b>                                      |           | <b>64 479.62</b>                                              | <b>0.05</b>      |
| <b>イギリス</b>                                       |           |                                                               |                  |
| GBP ABERDEEN ASSET MGT ORD GBP0.10                | 572.00    | 4 218.84                                                      | 0.00             |
| GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945                     | 703.00    | 18 779.14                                                     | 0.01             |
| USD AON PLC COM USD0.01 CL A                      | 100.00    | 8 488.00                                                      | 0.01             |
| GBP ARM HLDGS ORD GBP0.0005                       | 587.00    | 8 836.37                                                      | 0.01             |
| GBP ASSOC D BRIT FOODS ORD GBP0.0568              | 242.00    | 12 140.37                                                     | 0.01             |
| GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25                       | 552.00    | 43 472.19                                                     | 0.03             |
| GBP AVIVA ORD GBP0.25                             | 1 484.00  | 13 168.02                                                     | 0.01             |
| GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025                      | 1 673.00  | 11 299.78                                                     | 0.01             |
| GBP BARCLAYS ORD GBP0.25                          | 6 646.00  | 28 302.14                                                     | 0.02             |
| GBP BG GROUP ORD GBP0.10                          | 1 471.00  | 29 756.61                                                     | 0.02             |
| GBP BHP BILLITON PLC USD0.50                      | 902.00    | 29 227.75                                                     | 0.02             |
| GBP BP ORD USD0.25                                | 8 471.00  | 71 404.10                                                     | 0.05             |
| GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25                 | 853.00    | 49 216.18                                                     | 0.04             |
| GBP BRITISH LAND CO PLC REIT                      | 600.00    | 6 995.66                                                      | 0.01             |
| GBP BRITISH SKY BROADCAST ORD GBP0.50             | 604.00    | 8 974.98                                                      | 0.01             |
| GBP BT GROUP ORD GBP0.05                          | 3 658.00  | 22 761.20                                                     | 0.02             |
| GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005                  | 166.00    | 4 162.44                                                      | 0.00             |
| GBP CAPITA PLC ORD GBP0.02066666                  | 408.00    | 7 474.87                                                      | 0.01             |
| GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66                      | 91.00     | 3 635.55                                                      | 0.00             |
| GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395                   | 2 359.00  | 13 144.86                                                     | 0.01             |
| GBP COBHAM ORD GBP0.025                           | 1 026.00  | 5 348.08                                                      | 0.00             |
| GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.10                     | 943.00    | 14 999.49                                                     | 0.01             |
| USD DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01                 | 120.00    | 8 020.80                                                      | 0.01             |
| GBP DIAGEO ORD GBX28.935185                       | 1 052.00  | 32 285.24                                                     | 0.02             |
| USD ENSCO PLC COM USD0.10 'A'                     | 112.00    | 5 650.40                                                      | 0.01             |
| GBP G4S ORD GBP0.25                               | 965.00    | 3 845.50                                                      | 0.00             |
| GBP GKN ORD GBP0.50                               | 754.00    | 4 888.96                                                      | 0.00             |
| GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25                   | 2 147.00  | 59 165.17                                                     | 0.04             |
| GBP HAMMERSON PLC REIT                            | 556.00    | 5 356.05                                                      | 0.01             |
| GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)                | 8 207.00  | 83 715.76                                                     | 0.06             |
| GBP ICAP ORD GBP0.10                              | 440.00    | 3 076.61                                                      | 0.00             |
| GBP IMPERIAL TOBACCO ORD GBP0.10                  | 344.00    | 14 852.62                                                     | 0.01             |
| GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.14589665(POST CON) | 116.00    | 3 952.69                                                      | 0.00             |
| GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01                    | 80.00     | 3 925.54                                                      | 0.00             |
| GBP INVESTEC ORD GBP0.0002                        | 587.00    | 5 169.01                                                      | 0.00             |
| GBP ITV ORD GBP0.10                               | 1 558.00  | 4 787.98                                                      | 0.00             |
| GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.047619 (POST CONS)   | 135.00    | 7 460.94                                                      | 0.01             |
| GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857                 | 964.00    | 6 805.67                                                      | 0.01             |
| GBP LAND SECURITIES GROUP PLC REIT                | 518.00    | 9 288.98                                                      | 0.01             |
| GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025               | 3 480.00  | 12 445.69                                                     | 0.01             |
| USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C                  | 300.00    | 11 529.00                                                     | 0.01             |
| GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBP0.25          | 22 394.00 | 28 496.17                                                     | 0.02             |
| GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25                | 681.00    | 5 072.22                                                      | 0.00             |
| GBP MEGGITT ORD GBP0.05                           | 424.00    | 3 412.91                                                      | 0.00             |
| GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBP0.10                | 1 269.00  | 4 304.82                                                      | 0.00             |
| GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.11395                  | 1 626.00  | 23 076.62                                                     | 0.02             |
| GBP NEXT ORD GBP0.10                              | 40.00     | 4 403.74                                                      | 0.00             |
| USD NOBLE CORP PLC USD0.01                        | 200.00    | 6 162.00                                                      | 0.01             |
| GBP OLD MUTUAL PLC ORD GBP0.114285714(POST CON    | 1 609.00  | 5 425.60                                                      | 0.01             |

| 銘柄                                             | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| GBP PEARSON ORD GBP0.25                        | 434.00    | 8 127.09                                                      | 0.01             |
| GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05                     | 1 162.00  | 26 655.06                                                     | 0.02             |
| GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10              | 272.00    | 21 930.89                                                     | 0.02             |
| GBP REED ELSEVIER ORD GBP0.14                  | 384.00    | 5 654.08                                                      | 0.01             |
| GBP REXAM ORD GBP0.714285714 (POST R/          | 454.00    | 3 802.34                                                      | 0.00             |
| GBP RIO TINTO ORD GBP0.10                      | 582.00    | 31 688.33                                                     | 0.02             |
| GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20              | 904.00    | 16 027.72                                                     | 0.01             |
| GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)     | 971.00    | 4 899.07                                                      | 0.00             |
| GBP RSA INSURANCE GROUP PLC                    | 3 224.00  | 5 343.18                                                      | 0.00             |
| GBP SABMILLER ORD USD0.10                      | 447.00    | 24 307.76                                                     | 0.02             |
| GBP SAGE GROUP GBP0.01051948                   | 903.00    | 6 501.58                                                      | 0.01             |
| GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428             | 651.00    | 3 690.17                                                      | 0.00             |
| GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789                 | 131.00    | 4 081.14                                                      | 0.00             |
| GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20                 | 306.00    | 4 751.02                                                      | 0.00             |
| GBP SSE PLC ORD GBP0.50                        | 480.00    | 12 360.19                                                     | 0.01             |
| GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50             | 1 055.00  | 22 828.91                                                     | 0.02             |
| GBP STANDARD LIFE ORD GBP0.10                  | 1 016.00  | 6 556.89                                                      | 0.01             |
| GBP TESCO ORD GBP0.05                          | 3 639.00  | 18 000.70                                                     | 0.01             |
| GBP TULLOW OIL ORD GBP0.10                     | 436.00    | 6 478.63                                                      | 0.01             |
| GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111               | 486.00    | 21 697.60                                                     | 0.02             |
| GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05             | 467.00    | 6 276.88                                                      | 0.01             |
| GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS) | 11 502.00 | 43 494.90                                                     | 0.03             |
| GBP WEIR GROUP ORD GBP0.125                    | 106.00    | 4 814.73                                                      | 0.00             |
| GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385                | 76.00     | 5 235.86                                                      | 0.00             |
| GBP WILLIAM HILL ORD GBP0.10                   | 675.00    | 4 042.78                                                      | 0.00             |
| USD WILLIS GROUP HOLDI ORD SHS USD0.000115     | 103.00    | 4 221.97                                                      | 0.00             |
| GBP WPP PLC ORD GBP0.10                        | 638.00    | 13 724.74                                                     | 0.01             |
| <b>イギリス合計</b>                                  |           | <b>1 119 577.52</b>                                           | <b>0.83</b>      |

**アメリカ合衆国**

|                                            |        |           |      |
|--------------------------------------------|--------|-----------|------|
| USD 3M CO COM                              | 279.00 | 38 806.11 | 0.03 |
| USD ABBOTT LABS COM                        | 676.00 | 26 188.24 | 0.02 |
| USD ABBVIE INC COM USD0.01                 | 690.00 | 35 935.20 | 0.03 |
| USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001 | 400.00 | 8 004.00  | 0.01 |
| USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001        | 200.00 | 12 338.00 | 0.01 |
| USD ADT CORP COM USD0.01                   | 100.00 | 3 024.00  | 0.00 |
| USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM             | 52.00  | 6 307.08  | 0.01 |
| USD AES CORP COM                           | 400.00 | 5 780.00  | 0.00 |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                     | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD AETNA INC COM USD0.01              | 163.00    | 11 646.35                                                     | 0.01             |
| USD AFLAC INC COM USD0.10              | 199.00    | 12 481.28                                                     | 0.01             |
| USD AGCO CORP COM USD0.01              | 100.00    | 5 570.00                                                      | 0.00             |
| USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM       | 137.00    | 7 403.48                                                      | 0.01             |
| USD AIR PRODS & CHEMS INC COM          | 100.00    | 11 752.00                                                     | 0.01             |
| USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM        | 100.00    | 5 307.00                                                      | 0.00             |
| USD ALCOA INC COM USD1                 | 500.00    | 6 735.00                                                      | 0.02             |
| USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001   | 79.00     | 12 497.80                                                     | 0.01             |
| USD ALLERGAN INC COM USD0.01           | 132.00    | 21 890.88                                                     | 0.02             |
| USD ALLIANT ENERGY CORP COM            | 100.00    | 5 848.00                                                      | 0.00             |
| USD ALLSTATE CORP COM                  | 208.00    | 11 845.60                                                     | 0.01             |
| USD ALTERA COM USD0.001                | 100.00    | 3 252.00                                                      | 0.00             |
| USD ALTRIA GROUP INC COM               | 858.00    | 34 414.38                                                     | 0.03             |
| USD AMAZON COM INC COM USD0.01         | 155.00    | 47 140.15                                                     | 0.04             |
| USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50      | 203.00    | 10 923.43                                                     | 0.01             |
| USD AMER INTL GRP COM USD2.50          | 608.00    | 32 303.04                                                     | 0.02             |
| USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01    | 195.00    | 16 286.40                                                     | 0.01             |
| USD AMEREN CORP COM                    | 129.00    | 5 328.99                                                      | 0.00             |
| USD AMERICAN EXPRESS CO COM            | 421.00    | 36 808.03                                                     | 0.03             |
| USD AMERICAN RLTY CAP COM USD0.001     | 218.00    | 2 853.62                                                      | 0.00             |
| USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01 | 88.00     | 4 006.64                                                      | 0.00             |
| USD AMERIPRISE FINL INC COM            | 100.00    | 11 163.00                                                     | 0.01             |
| USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01  | 126.00    | 8 212.68                                                      | 0.01             |
| USD AMETEK INC COM USD0.01             | 97.00     | 5 113.84                                                      | 0.00             |
| USD AMGEN INC COM USD0.0001            | 328.00    | 36 654.00                                                     | 0.03             |
| USD AMPHENOL CORP NEW CL A             | 100.00    | 9 535.00                                                      | 0.01             |
| USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10     | 218.00    | 21 586.36                                                     | 0.02             |
| USD ANALOG DEVICES INC COM             | 100.00    | 5 129.00                                                      | 0.00             |
| USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01     | 400.00    | 4 620.00                                                      | 0.00             |
| USD APACHE CORP COM USD0.625           | 128.00    | 11 110.40                                                     | 0.01             |
| USD APPLE INC COM NPV                  | 395.00    | 233 085.55                                                    | 0.17             |
| USD APPLIED MATLS INC COM              | 500.00    | 9 530.00                                                      | 0.01             |
| USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM      | 294.00    | 12 856.62                                                     | 0.01             |
| USD ARROW ELECTRS INC COM              | 100.00    | 5 675.00                                                      | 0.00             |
| USD ASSURANT INC COM                   | 100.00    | 6 741.00                                                      | 0.02             |
| USD AT&T INC COM USD1                  | 2 271.00  | 81 074.70                                                     | 0.06             |
| USD AUTODESK INC COM USD0.01           | 100.00    | 4 802.00                                                      | 0.00             |
| USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC COM  | 206.00    | 16 059.76                                                     | 0.01             |
| USD AUTOZONE INC COM USD0.01           | 14.00     | 7 474.46                                                      | 0.01             |
| USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01      | 52.00     | 7 100.60                                                      | 0.01             |
| USD AVNET INC COM                      | 100.00    | 4 313.00                                                      | 0.00             |
| USD AVON PRODUCTS INC COM USD0.25      | 100.00    | 1 528.00                                                      | 0.00             |
| USD BAKER HUGHES INC COM USD1          | 180.00    | 12 582.00                                                     | 0.01             |
| USD BALL CORP COM                      | 108.00    | 6 068.52                                                      | 0.01             |
| USD BAXTER INTL INC COM USD1           | 241.00    | 17 542.39                                                     | 0.01             |
| USD BB&T CORP COM USD5                 | 312.00    | 11 646.96                                                     | 0.01             |
| USD BEAM INC COM USD3.125              | 100.00    | 8 347.00                                                      | 0.01             |
| USD BECTON DICKINSON COM USD1          | 100.00    | 11 303.00                                                     | 0.01             |
| USD BED BATH & BEYOND INC COM          | 100.00    | 6 213.00                                                      | 0.01             |
| USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20        | 100.00    | 4 424.00                                                      | 0.00             |
| USD BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B        | 475.00    | 61 203.75                                                     | 0.05             |
| USD BEST BUY CO INC COM USD0.10        | 100.00    | 2 593.00                                                      | 0.00             |
| USD BIOGEN IDEC INC COM STK USD0.0005  | 97.00     | 27 850.64                                                     | 0.02             |
| USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001       | 100.00    | 5 823.00                                                      | 0.00             |
| USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01     | 4 600.00  | 69 644.00                                                     | 0.05             |
| USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01 | 400.00    | 13 548.00                                                     | 0.01             |
| USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01      | 47.00     | 14 147.00                                                     | 0.01             |
| USD BLOCK(H&R)INC COM NPV              | 100.00    | 2 842.00                                                      | 0.00             |
| USD BOEING CO COM USD5                 | 306.00    | 39 480.12                                                     | 0.03             |
| USD BORG WARNER INC COM                | 200.00    | 12 428.00                                                     | 0.01             |

| 銘柄                                           | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|----------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01             | 100.00    | 11 714.00                                                     | 0.01             |
| USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01            | 800.00    | 10 088.00                                                     | 0.01             |
| USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO COM              | 712.00    | 35 664.08                                                     | 0.03             |
| USD BROADCOM CORP CL A COM USD0.0001         | 127.00    | 3 912.87                                                      | 0.00             |
| USD BUNGE LIMITED COM USD0.01                | 59.00     | 4 699.35                                                      | 0.00             |
| USD CA INC COM USD0.10                       | 200.00    | 6 028.00                                                      | 0.01             |
| USD CABLEVISION SYS CORP CL A NY CABLVS      | 200.00    | 3 340.00                                                      | 0.00             |
| USD CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10           | 191.00    | 7 502.48                                                      | 0.01             |
| USD CALPINE CORP COM STK USD0.001            | 196.00    | 4 494.28                                                      | 0.00             |
| USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375           | 100.00    | 4 549.00                                                      | 0.00             |
| USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01             | 253.00    | 18 696.70                                                     | 0.01             |
| USD CARDINAL HEALTH INC COM                  | 121.00    | 8 410.71                                                      | 0.01             |
| USD CAREFUSION CORP COM USD0.01              | 100.00    | 3 906.00                                                      | 0.00             |
| USD CARMAX INC COM USD0.50                   | 100.00    | 4 378.00                                                      | 0.00             |
| USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)   | 200.00    | 7 862.00                                                      | 0.01             |
| USD CATERPILLAR INC DEL COM                  | 290.00    | 30 566.00                                                     | 0.02             |
| USD CBRE GROUP INC CLASS ' A ' USD0.01       | 128.00    | 3 409.92                                                      | 0.00             |
| USD CBS CORP NEW CL B                        | 222.00    | 12 822.72                                                     | 0.01             |
| USD CELANESE CORP COM SERIES ' A ' USD0.0001 | 100.00    | 6 143.00                                                      | 0.01             |
| USD CELGENE CORP COM USD0.01                 | 175.00    | 25 726.75                                                     | 0.02             |
| USD CENTERPOINT ENERGY INC COM               | 160.00    | 3 961.60                                                      | 0.00             |
| USD CENTURYLINK INC COM                      | 187.00    | 6 528.17                                                      | 0.01             |
| USD CERNER CORP COM                          | 115.00    | 5 899.50                                                      | 0.01             |
| USD CF INDS HLDGS INC COM                    | 16.00     | 3 922.72                                                      | 0.00             |
| USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1            | 58.00     | 3 416.20                                                      | 0.00             |
| USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW              | 100.00    | 5 645.00                                                      | 0.00             |
| USD CHESAPEAKE ENERGY CORP COM               | 162.00    | 4 657.50                                                      | 0.00             |
| USD CHEVRON CORP COM USD0.75                 | 837.00    | 105 060.24                                                    | 0.08             |
| USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A          | 6.00      | 2 991.00                                                      | 0.00             |
| USD CHUBB CORP COM                           | 100.00    | 9 208.00                                                      | 0.01             |
| USD CHURCH & DWIGHT INC COM                  | 58.00     | 4 002.58                                                      | 0.00             |
| USD CIGNA CORP COM USD0.25                   | 100.00    | 8 004.00                                                      | 0.01             |
| USD CIMAREX ENERGY CO COM                    | 59.00     | 7 028.08                                                      | 0.01             |
| USD CINCINNATI FINL CORP COM                 | 100.00    | 4 874.00                                                      | 0.00             |
| USD CINTAS CORP COM                          | 100.00    | 5 893.00                                                      | 0.00             |
| USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001               | 2 315.00  | 53 499.65                                                     | 0.04             |
| USD CIT GROUP INC COM NEW USD0.01            | 100.00    | 4 305.00                                                      | 0.00             |
| USD CITIGROUP INC COM USD0.01                | 1 329.00  | 63 672.39                                                     | 0.05             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                               | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|--------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001              | 100.00    | 5 931.00                                                      | 0.00             |
| USD CLOROX CO DEL COM                            | 51.00     | 4 625.70                                                      | 0.00             |
| USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS 'A '     | 135.00    | 9 502.65                                                      | 0.01             |
| USD CMS ENERGY CORP COM                          | 135.00    | 4 091.85                                                      | 0.00             |
| USD COACH INC COM USD0.01                        | 100.00    | 4 465.00                                                      | 0.00             |
| USD COCA-COLA CO COM USD0.25                     | 1 711.00  | 69 791.69                                                     | 0.05             |
| USD COCA-COLA ENTERPR COM USD1.00                | 200.00    | 9 088.00                                                      | 0.01             |
| USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL 'A ' USD0.01       | 276.00    | 13 221.78                                                     | 0.01             |
| USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1                   | 383.00    | 25 775.90                                                     | 0.02             |
| USD COMCAST CORP 'A ' SPL COM USD0.01            | 212.00    | 10 818.36                                                     | 0.01             |
| USD COMCAST CORP COM CLS 'A ' USD0.01            | 931.00    | 48 188.56                                                     | 0.04             |
| USD COMERICA INC COM                             | 85.00     | 4 100.40                                                      | 0.00             |
| USD COMPUTER SCIENCES COM USD1                   | 63.00     | 3 728.34                                                      | 0.00             |
| USD CONAGRA FOODS INC COM                        | 200.00    | 6 102.00                                                      | 0.01             |
| USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001              | 37.00     | 4 826.65                                                      | 0.00             |
| USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01                   | 502.00    | 37 303.62                                                     | 0.03             |
| USD CONSOL ENERGY INC COM                        | 100.00    | 4 451.00                                                      | 0.00             |
| USD CONSOLIDATED EDISON INC COM                  | 100.00    | 5 803.00                                                      | 0.00             |
| USD CONSTELLATION BRDS CLASS 'A ' COM USD0.01    | 44.00     | 3 512.96                                                      | 0.00             |
| USD CORNING INC COM USD0.50                      | 500.00    | 10 455.00                                                     | 0.01             |
| USD COSTCO WHSL CORP NEW COM                     | 180.00    | 20 822.40                                                     | 0.02             |
| USD CREE INC COM                                 | 54.00     | 2 547.18                                                      | 0.00             |
| USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01                | 153.00    | 11 127.69                                                     | 0.01             |
| USD CROWN HOLDINGS INC COM                       | 100.00    | 4 717.00                                                      | 0.00             |
| USD CSX CORP COM                                 | 440.00    | 12 416.80                                                     | 0.01             |
| USD CUMMINS INC COM                              | 69.00     | 10 408.65                                                     | 0.01             |
| USD CVS/CAREMARK CORP COM STK USD0.01            | 524.00    | 38 105.28                                                     | 0.03             |
| USD D R HORTON INC COM                           | 100.00    | 2 228.00                                                      | 0.00             |
| USD DANAHER CORP COM USD0.01                     | 258.00    | 18 932.04                                                     | 0.01             |
| USD DARDEN RESTAURANTS INC COM                   | 100.00    | 4 971.00                                                      | 0.00             |
| USD DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC               | 116.00    | 8 038.80                                                      | 0.01             |
| USD DEERE & CO COM USD1                          | 170.00    | 15 867.80                                                     | 0.01             |
| USD DELTA AIR LINES INC                          | 112.00    | 4 124.96                                                      | 0.00             |
| USD DENBURY RES INC COM NEW                      | 200.00    | 3 364.00                                                      | 0.00             |
| USD DENTSPLY INTL INC NEW COM                    | 100.00    | 4 463.00                                                      | 0.00             |
| USD DEVON ENERGY CORP NEW COM                    | 173.00    | 12 110.00                                                     | 0.01             |
| USD DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC COM            | 53.00     | 2 894.33                                                      | 0.00             |
| USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01           | 71.00     | 3 791.40                                                      | 0.00             |
| USD DIRECTV COM USD0.01                          | 195.00    | 15 132.00                                                     | 0.01             |
| USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01           | 250.00    | 13 975.00                                                     | 0.01             |
| USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01          | 100.00    | 7 590.00                                                      | 0.01             |
| USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01          | 100.00    | 7 013.00                                                      | 0.01             |
| USD DISH NETWORK CORPO CLASS 'A ' COM USD0.01    | 200.00    | 11 372.00                                                     | 0.01             |
| USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875               | 128.00    | 7 224.32                                                      | 0.01             |
| USD DOLLAR TREE INC                              | 136.00    | 7 081.52                                                      | 0.01             |
| USD DOMINION RES(VIR) COM STK NPV                | 235.00    | 17 046.90                                                     | 0.01             |
| USD DOVER CORP COM                               | 100.00    | 8 640.00                                                      | 0.01             |
| USD DOW CHEMICAL CO COM USD2.50                  | 533.00    | 26 596.70                                                     | 0.02             |
| USD DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01            | 100.00    | 5 542.00                                                      | 0.00             |
| USD DTE ENERGY CO COM                            | 60.00     | 4 688.40                                                      | 0.00             |
| USD DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30               | 406.00    | 27 331.92                                                     | 0.02             |
| USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT | 294.00    | 21 900.06                                                     | 0.02             |
| USD DUKE REALTY CORP COM USD0.01                 | 235.00    | 4 117.20                                                      | 0.00             |
| USD EASTMAN CHEM CO COM                          | 69.00     | 6 014.73                                                      | 0.01             |
| USD EATON VANCE CORP COM NON VTG                 | 100.00    | 3 607.00                                                      | 0.00             |
| USD EBAY INC COM USD0.001                        | 507.00    | 26 277.81                                                     | 0.02             |
| USD ECOLAB INC COM                               | 100.00    | 10 464.00                                                     | 0.01             |
| USD EDISON INTL COM                              | 100.00    | 5 656.00                                                      | 0.00             |
| USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM                | 48.00     | 3 910.56                                                      | 0.00             |
| USD ELECTRONIC ARTS INC COM                      | 100.00    | 2 830.00                                                      | 0.00             |

| 銘柄  |                                                  | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-----|--------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD | ELI LILLY AND CO COM NPV                         | 435.00    | 25 708.50                                                     | 0.02             |
| USD | EMC CORP(MASS) COM USD0.01                       | 873.00    | 22 523.40                                                     | 0.02             |
| USD | EMERSON ELEC CO COM                              | 316.00    | 21 544.88                                                     | 0.02             |
| USD | ENTERGY CORP NEW COM                             | 90.00     | 6 525.00                                                      | 0.01             |
| USD | EOG RESOURCES INC COM USD0.01                    | 200.00    | 19 600.00                                                     | 0.01             |
| USD | EQT CORPORATION                                  | 100.00    | 10 899.00                                                     | 0.01             |
| USD | EQUIFAX INC COM                                  | 100.00    | 7 081.00                                                      | 0.01             |
| USD | EQUITY RESIDENTIAL-SBI                           | 166.00    | 9 867.04                                                      | 0.01             |
| USD | ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01         | 120.00    | 8 708.40                                                      | 0.01             |
| USD | EXELON CORP COM NPV                              | 347.00    | 12 155.41                                                     | 0.01             |
| USD | EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)            | 50.00     | 3 549.50                                                      | 0.00             |
| USD | EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01                   | 100.00    | 4 124.00                                                      | 0.00             |
| USD | EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01                   | 360.00    | 23 968.80                                                     | 0.02             |
| USD | EXXON MOBIL CORP COM NPV                         | 1 918.00  | 196 422.38                                                    | 0.15             |
| USD | F M C CORP COM NEW                               | 56.00     | 4 312.00                                                      | 0.00             |
| USD | F5 NETWORK INC COM STK NPV                       | 37.00     | 3 891.29                                                      | 0.00             |
| USD | FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL ' A '            | 752.00    | 44 954.56                                                     | 0.03             |
| USD | FAMILY DOLLAR STRS COM USD0.10                   | 53.00     | 3 113.75                                                      | 0.00             |
| USD | FASTENAL CO COM                                  | 200.00    | 10 016.00                                                     | 0.01             |
| USD | FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW            | 34.00     | 3 996.36                                                      | 0.00             |
| USD | FEDEX CORP COM USD0.10                           | 128.00    | 17 440.00                                                     | 0.01             |
| USD | FIDELITY NATL FINL CLASS ' A ' COM STK USD0.0001 | 189.00    | 6 082.02                                                      | 0.01             |
| USD | FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01                | 200.00    | 10 686.00                                                     | 0.01             |
| USD | FIFTH THIRD BANCORP COM                          | 200.00    | 4 122.00                                                      | 0.00             |
| USD | FIRSTENERGY CORP COM USD0.10                     | 166.00    | 5 602.50                                                      | 0.00             |
| USD | FISERV INC COM USD0.01                           | 200.00    | 12 156.00                                                     | 0.01             |
| USD | FLIR SYS INC COM                                 | 118.00    | 4 016.72                                                      | 0.00             |
| USD | FLOWSERVE CORP COM                               | 62.00     | 4 529.10                                                      | 0.00             |
| USD | FLUOR CORP NEW COM                               | 100.00    | 7 570.00                                                      | 0.01             |
| USD | FMC TECHNOLOGIES INC COM                         | 126.00    | 7 144.20                                                      | 0.01             |
| USD | FORD MOTOR CO COM STK USD0.01                    | 1 506.00  | 24 321.90                                                     | 0.02             |
| USD | FOREST LABS INC COM                              | 100.00    | 9 191.00                                                      | 0.01             |
| USD | FRANKLIN RES INC COM                             | 198.00    | 10 365.30                                                     | 0.01             |
| USD | FREEPORT-MCMOR C&G COM STK USD0.10               | 465.00    | 15 982.05                                                     | 0.01             |
| USD | FRONTIER COMMUNICA COM USD0.25                   | 324.00    | 1 927.80                                                      | 0.00             |
| USD | GAMESTOP CORP COM USD0.001 CLASS ' A '           | 127.00    | 5 039.36                                                      | 0.00             |
| USD | GAP INC DEL COM                                  | 100.00    | 3 930.00                                                      | 0.00             |
| USD | GEN DYNAMICS CORP COM USD1                       | 125.00    | 13 681.25                                                     | 0.01             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                      | 数量 /<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡し為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-----------------------------------------|------------|--------------------------------------------------------------------|------------------|
| USD GEN ELEC CO COM USD0.06             | 4 385.00   | 117 912.65                                                         | 0.09             |
| USD GEN GROWTH PPTYS COM USD0.01 NEW    | 207.00     | 4 754.79                                                           | 0.00             |
| USD GENERAL MLS INC COM                 | 283.00     | 15 004.66                                                          | 0.01             |
| USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01       | 412.00     | 14 205.76                                                          | 0.01             |
| USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1       | 100.00     | 8 712.00                                                           | 0.01             |
| USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001        | 666.00     | 52 274.34                                                          | 0.04             |
| USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01       | 181.00     | 28 927.42                                                          | 0.02             |
| USD GOOGLE INC COM USD0.001 CL 'A '     | 118.00     | 63 115.84                                                          | 0.05             |
| USD GOOGLE INC COM USD0.001 CL 'C '     | 118.00     | 62 145.88                                                          | 0.05             |
| USD HALLIBURTON COM STK USD2.50         | 377.00     | 23 777.39                                                          | 0.02             |
| USD HARLEY DAVIDSON INC COM             | 100.00     | 7 394.00                                                           | 0.01             |
| USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01      | 212.00     | 7 604.44                                                           | 0.01             |
| USD HASBRO INC COM                      | 76.00      | 4 199.76                                                           | 0.00             |
| USD HCA HLDGS INC COM USD0.01           | 130.00     | 6 760.00                                                           | 0.02             |
| USD HCP INC COM USD1                    | 200.00     | 8 372.00                                                           | 0.01             |
| USD HELMERICH & PAYNE INC COM           | 100.00     | 10 865.00                                                          | 0.01             |
| USD HERSHEY CO COM                      | 100.00     | 9 624.00                                                           | 0.01             |
| USD HERTZ GLOBAL HOLDI COM STK USD0.01  | 190.00     | 5 409.30                                                           | 0.00             |
| USD HESS CORPORATION COM USD1           | 100.00     | 8 916.00                                                           | 0.01             |
| USD HEWLETT PACKARD CO COM USD0.01      | 829.00     | 27 406.74                                                          | 0.02             |
| USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01      | 83.00      | 4 364.97                                                           | 0.00             |
| USD HOLOGIC INC COM USD0.01             | 100.00     | 2 098.50                                                           | 0.00             |
| USD HOME DEPOT INC COM USD0.05          | 642.00     | 51 045.42                                                          | 0.04             |
| USD HONEYWELL INTL INC COM              | 329.00     | 30 564.10                                                          | 0.02             |
| USD HORMEL FOODS CORP COM               | 113.00     | 5 388.97                                                           | 0.00             |
| USD HOSPIRA INC COM                     | 100.00     | 4 580.00                                                           | 0.00             |
| USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01  | 357.00     | 7 657.65                                                           | 0.01             |
| USD HUMANA INC COM USD0.166             | 62.00      | 6 804.50                                                           | 0.01             |
| USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM         | 100.00     | 7 610.00                                                           | 0.01             |
| USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV           | 202.00     | 17 216.46                                                          | 0.01             |
| USD ILLUMINA INC COM USD0.01            | 100.00     | 13 585.00                                                          | 0.01             |
| USD INTEL CORP COM USD0.001             | 2 089.00   | 55 755.41                                                          | 0.04             |
| USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01      | 38.00      | 7 768.72                                                           | 0.01             |
| USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10       | 400.00     | 6 968.00                                                           | 0.01             |
| USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20      | 452.00     | 88 804.44                                                          | 0.07             |
| USD INTL GAME TECH COM USD0.000625      | 100.00     | 1 255.00                                                           | 0.00             |
| USD INTL PAPER CO COM                   | 200.00     | 9 330.00                                                           | 0.01             |
| USD INTUIT COM                          | 99.00      | 7 499.25                                                           | 0.01             |
| USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001     | 11.00      | 3 978.70                                                           | 0.00             |
| USD INVESCO LTD COM STK USD0.20         | 200.00     | 7 042.00                                                           | 0.01             |
| USD IRON MTN INC COM                    | 108.00     | 3 071.52                                                           | 0.00             |
| USD JACOBS ENG GROUP COM USD1           | 100.00     | 5 770.00                                                           | 0.00             |
| USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1          | 1 217.00   | 123 269.93                                                         | 0.09             |
| USD JOHNSON CONTROLS COM STK USD0.01388 | 300.00     | 13 542.00                                                          | 0.01             |
| USD JOY GLOBAL INC COM                  | 60.00      | 3 622.80                                                           | 0.00             |
| USD JP MORGAN CHASE & COM USD1          | 1 639.00   | 91 751.22                                                          | 0.07             |
| USD JUNIPER NETWORKS INC COM            | 200.00     | 4 938.00                                                           | 0.00             |
| USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01      | 44.00      | 4 438.72                                                           | 0.00             |
| USD KBR INC COM STK USD0.001            | 100.00     | 2 537.00                                                           | 0.00             |
| USD KELLOGG CO COM USD0.25              | 100.00     | 6 683.00                                                           | 0.01             |
| USD KEURIG GREEN MTN I COM USD0.1       | 46.00      | 4 309.28                                                           | 0.00             |
| USD KEYCORP NEW COM                     | 300.00     | 4 092.00                                                           | 0.00             |
| USD KIMBERLY CLARK CORP COM             | 151.00     | 16 949.75                                                          | 0.01             |
| USD KIMCO REALTY COM USD0.01            | 300.00     | 6 876.00                                                           | 0.01             |
| USD KINDER MORGAN INC USD0.01           | 307.00     | 10 026.62                                                          | 0.01             |
| USD KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC SHS    | 50.94      | 3 677.51                                                           | 0.00             |
| USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001        | 100.00     | 6 399.00                                                           | 0.01             |
| USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01       | 90.00      | 4 931.10                                                           | 0.00             |
| USD KRAFT FOODS GROUP COM NPV           | 264.00     | 15 011.04                                                          | 0.01             |
| USD KROGER CO COM USD1                  | 200.00     | 9 208.00                                                           | 0.01             |

| 銘柄                                          | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD L BRANDS INC COM USD0.50                | 100.00    | 5 420.00                                                      | 0.00             |
| USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1           | 34.00     | 3 355.80                                                      | 0.00             |
| USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001          | 100.00    | 5 761.00                                                      | 0.00             |
| USD LAS VEGAS SANDS CORP COM                | 176.00    | 13 926.88                                                     | 0.01             |
| USD LEGG MASON INC COM                      | 100.00    | 4 689.00                                                      | 0.00             |
| USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01          | 100.00    | 3 286.00                                                      | 0.00             |
| USD LENNAR CORP COM CL 'A' USD0.10          | 100.00    | 3 859.00                                                      | 0.00             |
| USD LEUCADIA NATL CORP COM                  | 100.00    | 2 552.00                                                      | 0.00             |
| USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A            | 100.00    | 3 982.00                                                      | 0.00             |
| USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A      | 300.00    | 8 718.00                                                      | 0.01             |
| USD LINCOLN NATL CORP COM NPV               | 100.00    | 4 851.00                                                      | 0.00             |
| USD LINEAR TECHNOLOGY COM USD0.001          | 100.00    | 4 450.00                                                      | 0.00             |
| USD LINKEDIN CORP COM USD0.0001             | 37.00     | 5 678.39                                                      | 0.00             |
| USD LKQ CORP COM                            | 200.00    | 5 824.00                                                      | 0.00             |
| USD LOCKHEED MARTIN CORP COM                | 108.00    | 17 727.12                                                     | 0.01             |
| USD LOEWS CORP COM                          | 100.00    | 4 397.00                                                      | 0.00             |
| USD LORILLARD INC COM USD0.01               | 150.00    | 8 913.00                                                      | 0.01             |
| USD LOWE 'S COS INC COM USD0.50             | 414.00    | 19 006.74                                                     | 0.01             |
| USD LSI CORPORATION COM STK USD0.01         | 600.00    | 6 684.00                                                      | 0.01             |
| USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01          | 179.00    | 16 557.50                                                     | 0.01             |
| USD M & T BANK CORP COM USD0.50             | 37.00     | 4 514.37                                                      | 0.00             |
| USD MACERICH CO COM USD0.01                 | 81.00     | 5 257.71                                                      | 0.00             |
| USD MACY 'S INC COM STK USD0.01             | 200.00    | 11 486.00                                                     | 0.01             |
| USD MANPOWER GROUP COM USD0.01              | 40.00     | 3 253.60                                                      | 0.00             |
| USD MARATHON OIL CORP COM USD1              | 318.00    | 11 495.70                                                     | 0.01             |
| USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01          | 100.00    | 9 295.00                                                      | 0.01             |
| USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A' | 118.00    | 6 835.74                                                      | 0.01             |
| USD MARSH & MCLENNAN COM USD1               | 200.00    | 9 862.00                                                      | 0.01             |
| USD MASCO CORP COM                          | 200.00    | 4 018.00                                                      | 0.00             |
| USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'  | 451.00    | 33 171.05                                                     | 0.02             |
| USD MATTEL INC COM USD1                     | 200.00    | 7 843.00                                                      | 0.01             |
| USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001           | 125.00    | 4 055.00                                                      | 0.00             |
| USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV        | 100.00    | 7 120.00                                                      | 0.01             |
| USD MCDONALD 'S CORP COM USD0.01            | 433.00    | 43 897.54                                                     | 0.03             |
| USD MCGRAW HILL FINANCIAL INC COM           | 100.00    | 7 393.00                                                      | 0.01             |
| USD MCKESSON CORP COM                       | 96.00     | 16 242.24                                                     | 0.01             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                   | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD MDU RES GROUP INC COM USD1                       | 100.00    | 3 542.00                                                      | 0.00             |
| USD MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01                   | 55.00     | 4 854.30                                                      | 0.00             |
| USD MEADWESTVACO CORP COM                            | 100.00    | 3 907.00                                                      | 0.00             |
| USD MEDTRONIC INC COM USD0.10                        | 446.00    | 26 233.72                                                     | 0.02             |
| USD MERCK & CO INC COM USD0.50                       | 1 260.00  | 73 785.60                                                     | 0.05             |
| USD METLIFE INC COM USD0.01                          | 403.00    | 21 097.05                                                     | 0.02             |
| USD MGM RESORTS INTL COM                             | 176.00    | 4 440.48                                                      | 0.00             |
| USD MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001                 | 100.00    | 4 754.00                                                      | 0.00             |
| USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10                    | 500.00    | 13 060.00                                                     | 0.01             |
| USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125                  | 3 440.00  | 138 976.00                                                    | 0.10             |
| USD MOHAWK INDS COM USD0.01                          | 26.00     | 3 442.66                                                      | 0.00             |
| USD MOLSON COORS BREWI COM CLS 'B' COM NON-V USD0.01 | 100.00    | 5 997.00                                                      | 0.01             |
| USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01                    | 694.00    | 24 741.10                                                     | 0.02             |
| USD MONSANTO COM STK USD0.01                         | 230.00    | 25 461.00                                                     | 0.02             |
| USD MONSTER BEV CORP COM USD0.005                    | 94.00     | 6 294.24                                                      | 0.01             |
| USD MOODYS CORP COM USD0.01                          | 100.00    | 7 850.00                                                      | 0.01             |
| USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01                   | 636.00    | 19 671.48                                                     | 0.01             |
| USD MOSAIC CO COM USD0.01                            | 100.00    | 5 004.00                                                      | 0.00             |
| USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01                | 109.00    | 6 930.22                                                      | 0.01             |
| USD MURPHY OIL CORP COM                              | 47.00     | 2 981.21                                                      | 0.00             |
| USD MYLAN INC USD0.50                                | 159.00    | 8 074.02                                                      | 0.01             |
| USD NASDAQ OMX GROUP INC COM USD0.01 '144A'          | 112.00    | 4 132.80                                                      | 0.00             |
| USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM                   | 196.00    | 15 391.88                                                     | 0.01             |
| USD NETAPP INC COM USD0.001                          | 103.00    | 3 667.83                                                      | 0.00             |
| USD NETFLIX INC COM USD0.001                         | 17.00     | 5 474.68                                                      | 0.00             |
| USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM                   | 100.00    | 1 541.00                                                      | 0.00             |
| USD NEWELL RUBBERMAID INC COM                        | 200.00    | 6 022.00                                                      | 0.01             |
| USD NEWMONT MINING CORP COM                          | 137.00    | 3 401.71                                                      | 0.00             |
| USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL 'A'                 | 150.00    | 2 553.00                                                      | 0.00             |
| USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01                   | 168.00    | 16 774.80                                                     | 0.01             |
| USD NIELSEN HLDGS NV EURO.07                         | 122.00    | 5 727.90                                                      | 0.00             |
| USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV                       | 300.00    | 21 885.00                                                     | 0.02             |
| USD NISOURCE INC COM NPV                             | 200.00    | 7 264.00                                                      | 0.01             |
| USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01                     | 200.00    | 14 356.00                                                     | 0.01             |
| USD NORDSTROM INC COM NPV                            | 100.00    | 6 128.00                                                      | 0.01             |
| USD NORFOLK SOUTHERN CORP COM                        | 140.00    | 13 234.20                                                     | 0.01             |
| USD NORTHEAST UTILS COM                              | 100.00    | 4 726.00                                                      | 0.00             |
| USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666                   | 100.00    | 6 025.00                                                      | 0.01             |
| USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1                        | 100.00    | 12 151.00                                                     | 0.01             |
| USD NRG ENERGY INC COM NEW                           | 100.00    | 3 272.00                                                      | 0.00             |
| USD NUCOR CORP COM                                   | 112.00    | 5 796.00                                                      | 0.00             |
| USD NVIDIA CORP COM USD0.001                         | 200.00    | 3 694.00                                                      | 0.00             |
| USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20                    | 346.00    | 33 129.50                                                     | 0.02             |
| USD OCEANEERING INTL INC COM                         | 100.00    | 7 328.00                                                      | 0.01             |
| USD OCWEN FINANCIAL CO COM STK USD0.01               | 100.00    | 3 790.00                                                      | 0.00             |
| USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01                      | 100.00    | 3 733.00                                                      | 0.00             |
| USD OMNICARE COM USD1                                | 61.00     | 3 615.47                                                      | 0.00             |
| USD OMNICO GROUP INC COM USD0.15                     | 100.00    | 6 768.00                                                      | 0.02             |
| USD ONEOK INC                                        | 116.00    | 7 333.52                                                      | 0.01             |
| USD ORACLE CORP COM USD0.01                          | 1 509.00  | 61 687.92                                                     | 0.05             |
| USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01                     | 72.00     | 10 712.88                                                     | 0.01             |
| USD OWENS ILL INC COM NEW                            | 100.00    | 3 178.00                                                      | 0.00             |
| USD PACCAR INC COM STK USD1                          | 136.00    | 8 701.28                                                      | 0.01             |
| USD PALL CORP COM USD0.10                            | 100.00    | 8 415.00                                                      | 0.01             |
| USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50                  | 100.00    | 12 688.00                                                     | 0.01             |
| USD PAYCHEX INC COM                                  | 190.00    | 7 943.90                                                      | 0.01             |
| USD PEABODY ENERGY COR COM STK USD0.01               | 100.00    | 1 901.00                                                      | 0.00             |
| USD PEP CO HOLDINGS COM USD0.01                      | 200.00    | 5 352.00                                                      | 0.00             |
| USD PEPSICO INC CAP USD0.016666                      | 663.00    | 56 945.07                                                     | 0.04             |
| USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001                      | 66.00     | 9 560.76                                                      | 0.01             |

| 銘柄                                        | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-------------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD PETSART INC COM                       | 100.00    | 6 768.00                                                      | 0.02             |
| USD PFIZER INC COM USD0.05                | 2 825.00  | 88 366.00                                                     | 0.07             |
| USD PG&E CORP COM                         | 187.00    | 8 523.46                                                      | 0.01             |
| USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV ' WI ' | 703.00    | 60 057.29                                                     | 0.04             |
| USD PHILLIPS 66 COM USD0.01               | 240.00    | 19 972.80                                                     | 0.02             |
| USD PINNACLE WEST CAP CORP COM            | 100.00    | 5 595.00                                                      | 0.00             |
| USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01    | 59.00     | 11 402.93                                                     | 0.01             |
| USD PLUM CREEK TIMBER COMPANY INC REIT    | 100.00    | 4 360.00                                                      | 0.00             |
| USD PNC FINL SVCS GROUP INC COM           | 228.00    | 19 161.12                                                     | 0.01             |
| USD PPG INDS INC COM                      | 100.00    | 19 362.00                                                     | 0.01             |
| USD PPL CORP COM                          | 241.00    | 8 034.94                                                      | 0.01             |
| USD PRAXAIR INC COM USD0.01               | 100.00    | 13 055.00                                                     | 0.01             |
| USD PRECISION CASTPART COM NPV            | 65.00     | 16 450.85                                                     | 0.01             |
| USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008        | 20.00     | 23 155.00                                                     | 0.02             |
| USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01         | 100.00    | 4 684.00                                                      | 0.00             |
| USD PROCTER & GAMBLE COM NPV              | 1 169.00  | 96 500.95                                                     | 0.07             |
| USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1           | 200.00    | 4 850.00                                                      | 0.00             |
| USD PROLOGIS INC COM USD0.01              | 233.00    | 9 466.79                                                      | 0.01             |
| USD PRUDENTIAL FINL INC COM               | 197.00    | 15 893.96                                                     | 0.01             |
| USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10            | 68.00     | 11 934.68                                                     | 0.01             |
| USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM       | 211.00    | 8 644.67                                                      | 0.01             |
| USD PULTE GROUP INC USD0.01               | 185.00    | 3 402.15                                                      | 0.00             |
| USD PVH CORP COM USD1                     | 32.00     | 4 018.24                                                      | 0.00             |
| USD QEP RESOURCES INC COM USD0.01         | 100.00    | 3 069.00                                                      | 0.00             |
| USD QUALCOMM INC COM USD0.0001            | 754.00    | 59 347.34                                                     | 0.04             |
| USD QUANTA SVCS INC COM                   | 120.00    | 4 233.60                                                      | 0.00             |
| USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM             | 100.00    | 5 593.00                                                      | 0.00             |
| USD RANGE RES CORP COM USD0.01            | 100.00    | 9 045.00                                                      | 0.01             |
| USD RAYTHEON CO COM NEW                   | 133.00    | 12 698.84                                                     | 0.01             |
| USD REALOGY HLDGS CORP COM USD0.01        | 100.00    | 4 205.00                                                      | 0.00             |
| USD REALTY INCOME CORP                    | 125.00    | 5 431.25                                                      | 0.00             |
| USD RED HAT INC COM                       | 100.00    | 4 865.00                                                      | 0.00             |
| USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM         | 30.00     | 8 906.70                                                      | 0.01             |
| USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM        | 400.00    | 4 056.00                                                      | 0.00             |
| USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01         | 200.00    | 7 018.00                                                      | 0.01             |
| USD RESMED INC COM USD0.004               | 100.00    | 4 985.00                                                      | 0.00             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                       | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡し為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------------------------------|-----------|----------------------------------------------------------------|------------------|
| USD REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001      | 200.00    | 11 286.00                                                      | 0.01             |
| USD ROBERT HALF INTL INC COM             | 118.00    | 5 286.40                                                       | 0.00             |
| USD ROCKWELL AUTOMATION INC COM          | 63.00     | 7 508.34                                                       | 0.01             |
| USD ROCKWELL COLLINS INC COM             | 100.00    | 7 765.00                                                       | 0.01             |
| USD ROPER INDUSTRIES COM USD0.01         | 57.00     | 7 920.15                                                       | 0.01             |
| USD ROSS STORES INC COM USD0.01          | 126.00    | 8 578.08                                                       | 0.01             |
| USD ROWAN COS PLC COM USD0.125 CLASS 'A' | 100.00    | 3 092.00                                                       | 0.00             |
| USD ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01          | 100.00    | 5 313.00                                                       | 0.00             |
| USD SAFEWAY INC COM NEW                  | 100.00    | 3 406.00                                                       | 0.00             |
| USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001      | 246.00    | 12 705.90                                                      | 0.01             |
| USD SANDISK CORP COM USD0.001            | 100.00    | 8 497.00                                                       | 0.01             |
| USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01       | 64.00     | 5 744.64                                                       | 0.00             |
| USD SCANA CORP NEW COM                   | 100.00    | 5 368.00                                                       | 0.00             |
| USD SCHEIN HENRY INC COM                 | 100.00    | 11 423.00                                                      | 0.01             |
| USD SCHLUMBERGER COM USD0.01             | 581.00    | 59 000.55                                                      | 0.04             |
| USD SCHWAB CHARLES CORP NEW COM          | 500.00    | 13 275.00                                                      | 0.01             |
| USD SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A  | 63.00     | 4 729.41                                                       | 0.00             |
| USD SEALED AIR CORP NEW COM              | 149.00    | 5 112.19                                                       | 0.00             |
| USD SEI INVESTMENT COM USD0.01           | 110.00    | 3 561.80                                                       | 0.00             |
| USD SEMPRA ENERGY COM                    | 100.00    | 9 861.00                                                       | 0.01             |
| USD SERVICENOW INC COM USD0.001          | 100.00    | 4 972.00                                                       | 0.00             |
| USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1            | 54.00     | 10 791.36                                                      | 0.01             |
| USD SIGMA ALDRICH CORP COM               | 100.00    | 9 621.00                                                       | 0.01             |
| USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001       | 128.00    | 22 169.60                                                      | 0.02             |
| USD SLM CORP COM USD0.20                 | 300.00    | 7 725.00                                                       | 0.01             |
| USD SMUCKER(JM)CO COM NPV                | 39.00     | 3 770.52                                                       | 0.00             |
| USD SOUTHERN CO COM                      | 300.00    | 13 749.00                                                      | 0.01             |
| USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1          | 178.00    | 4 302.26                                                       | 0.00             |
| USD SPECTRA ENERGY COR COM USD0.001      | 300.00    | 11 913.00                                                      | 0.01             |
| USD SPRINT CORPORATION COM USD0.01       | 390.00    | 3 315.00                                                       | 0.00             |
| USD ST JUDE MED INC COM                  | 100.00    | 6 347.00                                                       | 0.01             |
| USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50       | 100.00    | 8 589.00                                                       | 0.01             |
| USD STAPLES INC COM STK USD0.0006        | 200.00    | 2 500.00                                                       | 0.00             |
| USD STARBUCKS CORP COM                   | 323.00    | 22 810.26                                                      | 0.02             |
| USD STARWOOD HTLS WRLD COM STK USD0.01   | 100.00    | 7 665.00                                                       | 0.01             |
| USD STATE STREET CORP COM STK USD1       | 201.00    | 12 976.56                                                      | 0.01             |
| USD STERICYCLE INC COM                   | 52.00     | 6 054.88                                                       | 0.01             |
| USD STHWESTN ENERGY CO COM USD0.01       | 188.00    | 9 001.44                                                       | 0.01             |
| USD STRYKER CORP COM USD0.10             | 100.00    | 7 775.00                                                       | 0.01             |
| USD SUNTRUST BKS INC COM                 | 246.00    | 9 411.96                                                       | 0.01             |
| USD SUPERIOR ENERGY SVCS INC COM         | 158.00    | 5 201.36                                                       | 0.00             |
| USD SYMANTEC CORP COM                    | 376.00    | 7 625.28                                                       | 0.01             |
| USD SYNOPSYS INC COM USD0.01             | 100.00    | 3 762.00                                                       | 0.00             |
| USD SYSCO CORP COM                       | 200.00    | 7 286.00                                                       | 0.01             |
| USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20       | 100.00    | 8 213.00                                                       | 0.01             |
| USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001        | 100.00    | 2 929.00                                                       | 0.00             |
| USD TARGET CORP COM                      | 200.00    | 12 350.00                                                      | 0.01             |
| USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01       | 109.00    | 3 477.10                                                       | 0.00             |
| USD TERADATA CORP COM STK USD0.01 'WI'   | 100.00    | 4 546.00                                                       | 0.00             |
| USD TESORO CORP COM                      | 73.00     | 4 109.17                                                       | 0.00             |
| USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1           | 490.00    | 22 270.50                                                      | 0.02             |
| USD THERMO FISHER SCIE COM USD1          | 154.00    | 17 556.00                                                      | 0.01             |
| CAD THOMSON-REUTERS CO COM NPV           | 194.00    | 7 012.60                                                       | 0.01             |
| USD TIFFANY & CO NEW COM                 | 50.00     | 4 374.50                                                       | 0.00             |
| USD TIME WARNER CABLE USD0.01            | 107.00    | 15 136.22                                                      | 0.01             |
| USD TIME WARNER INC COM USD0.01          | 402.00    | 26 716.92                                                      | 0.02             |
| USD TJX COS INC COM USD1                 | 297.00    | 17 279.46                                                      | 0.01             |
| USD TOLL BROS INC COM USD0.01            | 142.00    | 4 862.08                                                       | 0.00             |
| USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10    | 148.00    | 4 701.96                                                       | 0.00             |
| USD TRACTOR SUPPLY CO COM                | 100.00    | 6 724.00                                                       | 0.02             |

| 銘柄  |                                        | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-----|----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| USD | TRAVELERS CO INC COM NPV               | 162.00    | 14 673.96                                                     | 0.01             |
| USD | TRIMBLE NAVIGATION LTD COM             | 100.00    | 3 843.00                                                      | 0.00             |
| USD | TRIPADVISOR INC COM USD0.001           | 48.00     | 3 875.52                                                      | 0.00             |
| USD | TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL 'A'  | 600.00    | 19 212.00                                                     | 0.01             |
| USD | TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL 'B'  | 184.00    | 5 762.88                                                      | 0.00             |
| USD | TYSON FOODS INC CL A                   | 124.00    | 5 204.28                                                      | 0.00             |
| USD | UDR INC                                | 152.00    | 3 930.72                                                      | 0.00             |
| USD | UNION PACIFIC CORP COM USD2.50         | 197.00    | 37 514.71                                                     | 0.03             |
| USD | UNITED PARCEL SERVICE INC CL B         | 314.00    | 30 929.00                                                     | 0.02             |
| USD | UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01           | 443.00    | 33 242.72                                                     | 0.02             |
| USD | UNUM GROUP COM USD0.10                 | 100.00    | 3 322.00                                                      | 0.00             |
| USD | URBAN OUTFITTERS INC COM               | 112.00    | 3 993.36                                                      | 0.00             |
| USD | US BANCORP COM USD0.01                 | 794.00    | 32 379.32                                                     | 0.02             |
| USD | UTD TECHNOLOGIES COM USD1              | 379.00    | 44 847.07                                                     | 0.03             |
| USD | VALERO ENERGY CORP NEW COM             | 200.00    | 11 434.00                                                     | 0.01             |
| USD | VARIAN MEDICAL SYS COM USD1            | 100.00    | 7 955.00                                                      | 0.01             |
| USD | VENTAS INC COM USD0.25                 | 159.00    | 10 506.72                                                     | 0.01             |
| USD | VERISIGN INC COM                       | 100.00    | 4 718.00                                                      | 0.00             |
| USD | VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001       | 59.00     | 3 545.31                                                      | 0.00             |
| USD | VERIZON COMMUN COM USD0.10             | 1 788.00  | 83 553.24                                                     | 0.06             |
| USD | VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01         | 100.00    | 6 770.00                                                      | 0.02             |
| USD | VF CORP COM NPV                        | 184.00    | 11 240.56                                                     | 0.01             |
| USD | VIACOM INC NEW CL 'B' NON-VTG USD0.001 | 184.00    | 15 636.32                                                     | 0.01             |
| USD | VISA INC COM STK USD0.0001             | 217.00    | 43 966.37                                                     | 0.03             |
| USD | VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'   | 42.00     | 3 885.42                                                      | 0.00             |
| USD | VULCAN MATLS CO COM                    | 61.00     | 3 936.33                                                      | 0.00             |
| USD | WAL-MART STORES IN COM USD0.10         | 698.00    | 55 637.58                                                     | 0.04             |
| USD | WALGREEN CO COM USD0.078125            | 385.00    | 26 141.50                                                     | 0.02             |
| USD | WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01      | 740.00    | 58 711.60                                                     | 0.04             |
| USD | WASTE MGMT INC DEL COM                 | 200.00    | 8 890.00                                                      | 0.01             |
| USD | WATERS CORP COM                        | 57.00     | 5 616.78                                                      | 0.00             |
| USD | WELLPOINT INC COM                      | 100.00    | 10 068.00                                                     | 0.01             |
| USD | WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3          | 2 186.00  | 108 513.04                                                    | 0.08             |
| USD | WESTERN DIGITAL CORP COM               | 100.00    | 8 813.00                                                      | 0.01             |
| USD | WESTERN UN CO COM                      | 300.00    | 4 761.00                                                      | 0.00             |
| USD | WEYERHAEUSER CO COM USD1.25            | 331.00    | 9 880.35                                                      | 0.01             |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                     | 数量 /<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|----------------------------------------|------------|-------------------------------------------------------------------|------------------|
| USD WHIRLPOOL CORP COM                 | 28.00      | 4 294.64                                                          | 0.00             |
| USD WHITING PETROLEUM COM USD0.001     | 64.00      | 4 718.08                                                          | 0.00             |
| USD WHOLE FOODS MKT INC COM            | 138.00     | 6 858.60                                                          | 0.01             |
| USD WILLIAMS COS INC COM USD1          | 300.00     | 12 651.00                                                         | 0.01             |
| USD WINDSTREAM HLDGS I USD0.0001       | 300.00     | 2 721.00                                                          | 0.00             |
| USD WISCONSIN ENERGY COM USD0.01       | 200.00     | 9 696.00                                                          | 0.01             |
| USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM         | 55.00      | 3 923.70                                                          | 0.00             |
| USD WYNN RESORTS LTD COM               | 22.00      | 4 485.58                                                          | 0.00             |
| USD XCEL ENERGY INC COM                | 300.00     | 9 561.00                                                          | 0.01             |
| USD XEROX CORP COM                     | 700.00     | 8 463.00                                                          | 0.01             |
| USD XILINX INC COM USD0.01             | 100.00     | 4 719.00                                                          | 0.00             |
| USD XYLEM INC COM USD0.01 WI           | 100.00     | 3 759.00                                                          | 0.00             |
| USD YAHOO INC COM STK USD0.001         | 488.00     | 17 543.60                                                         | 0.01             |
| USD YUM BRANDS INC COM                 | 159.00     | 12 241.41                                                         | 0.01             |
| USD ZIMMER HLDGS INC COM USD0.01       | 55.00      | 5 324.00                                                          | 0.00             |
| USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'      | 205.00     | 6 203.30                                                          | 0.01             |
| <b>アメリカ合衆国合計</b>                       |            | <b>7 470 178.61</b>                                               | <b>5.56</b>      |
| <b>無記名株式合計</b>                         |            | <b>12 850 026.01</b>                                              | <b>9.57</b>      |
| <b>その他の株式</b>                          |            |                                                                   |                  |
| <b>オランダ</b>                            |            |                                                                   |                  |
| EUR FUGRO NV EURO.05                   | 70.00      | 4 631.14                                                          | 0.00             |
| EUR ING GROEP NV CVA EURO.24           | 1 674.00   | 23 756.30                                                         | 0.02             |
| EUR UNILEVER NV CVA EURO.16            | 718.00     | 30 747.34                                                         | 0.02             |
| <b>オランダ合計</b>                          |            | <b>59 134.78</b>                                                  | <b>0.04</b>      |
| <b>スイス</b>                             |            |                                                                   |                  |
| CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV   | 311.00     | 91 132.94                                                         | 0.07             |
| <b>スイス合計</b>                           |            | <b>91 132.94</b>                                                  | <b>0.07</b>      |
| <b>その他の株式合計</b>                        |            | <b>150 267.72</b>                                                 | <b>0.11</b>      |
| <b>優先株式</b>                            |            |                                                                   |                  |
| <b>ドイツ</b>                             |            |                                                                   |                  |
| EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV  | 100.00     | 11 129.84                                                         | 0.01             |
| EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV | 94.00      | 10 342.14                                                         | 0.01             |
| EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV      | 67.00      | 18 031.67                                                         | 0.01             |
| <b>ドイツ合計</b>                           |            | <b>39 503.65</b>                                                  | <b>0.03</b>      |
| <b>優先株式合計</b>                          |            | <b>39 503.65</b>                                                  | <b>0.03</b>      |
| <b>記名株式</b>                            |            |                                                                   |                  |
| <b>フランス</b>                            |            |                                                                   |                  |
| EUR MICHELIN (CGDE) EUR2(REGD)         | 104.00     | 12 689.70                                                         | 0.01             |
| <b>フランス合計</b>                          |            | <b>12 689.70</b>                                                  | <b>0.01</b>      |
| <b>ドイツ</b>                             |            |                                                                   |                  |
| EUR ADIDAS AG NPV (REGD)               | 110.00     | 11 733.40                                                         | 0.01             |
| EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)   | 201.00     | 34 795.27                                                         | 0.03             |
| EUR BASF SE NPV                        | 417.00     | 48 238.50                                                         | 0.04             |
| EUR BAYER AG NPV (REGD)                | 366.00     | 50 747.73                                                         | 0.04             |
| EUR BRENNTAG AG                        | 22.00      | 3 976.21                                                          | 0.00             |
| EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)           | 428.00     | 39 600.48                                                         | 0.03             |
| EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)         | 465.00     | 20 477.13                                                         | 0.02             |
| EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)       | 80.00      | 5 855.68                                                          | 0.00             |

| 銘柄               |                                         | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------|-----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| EUR              | DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK) | 171.00    | 4 286.77                                                      | 0.00             |
| EUR              | DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)              | 437.00    | 16 441.71                                                     | 0.01             |
| EUR              | DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)              | 1 237.00  | 20 727.74                                                     | 0.02             |
| EUR              | E.ON SE NPV                             | 841.00    | 16 074.53                                                     | 0.01             |
| EUR              | HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)        | 58.00     | 5 396.98                                                      | 0.00             |
| EUR              | INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)        | 507.00    | 5 890.28                                                      | 0.01             |
| EUR              | K&S AG NPV                              | 80.00     | 2 795.84                                                      | 0.00             |
| EUR              | MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)            | 85.00     | 19 617.26                                                     | 0.02             |
| EUR              | OSRAM LICHT AG NPV                      | 80.00     | 4 185.16                                                      | 0.00             |
| EUR              | PROSIEBENSAT1 MEDI NPV                  | 69.00     | 3 015.11                                                      | 0.00             |
| EUR              | SIEMENS AG NPV(REGD)                    | 338.00    | 44 522.12                                                     | 0.03             |
| EUR              | SKY DEUTSCHLAND AG NPV (REGD)           | 298.00    | 2 548.56                                                      | 0.00             |
| EUR              | UNITED INTERNET AG NPV(REGD)            | 80.00     | 3 431.99                                                      | 0.00             |
| <b>ドイツ合計</b>     |                                         |           | <b>364 358.45</b>                                             | <b>0.27</b>      |
| <b>イスラエル</b>     |                                         |           |                                                               |                  |
| ILS              | MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01              | 252.00    | 3 366.50                                                      | 0.00             |
| <b>イスラエル合計</b>   |                                         |           | <b>3 366.50</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>ルクセンブルグ</b>   |                                         |           |                                                               |                  |
| EUR              | ARCELORMITTAL NPV                       | 638.00    | 10 354.47                                                     | 0.01             |
| <b>ルクセンブルグ合計</b> |                                         |           | <b>10 354.47</b>                                              | <b>0.01</b>      |
| <b>ポルトガル</b>     |                                         |           |                                                               |                  |
| EUR              | EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)           | 1 296.00  | 6 289.39                                                      | 0.01             |
| EUR              | PORTUGAL TCOM SGPS EURO.03              | 391.00    | 1 626.42                                                      | 0.00             |
| <b>ポルトガル合計</b>   |                                         |           | <b>7 915.81</b>                                               | <b>0.01</b>      |
| <b>スペイン</b>      |                                         |           |                                                               |                  |
| EUR              | BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)        | 5 201.00  | 51 684.44                                                     | 0.04             |
| EUR              | BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49              | 2 645.00  | 32 438.38                                                     | 0.03             |
| EUR              | INDITEX EURO.15                         | 110.00    | 16 495.09                                                     | 0.01             |
| <b>スペイン合計</b>    |                                         |           | <b>100 617.91</b>                                             | <b>0.08</b>      |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                             | 数量 /<br>額面    | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|----------------------------------------------------------------|---------------|-------------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>スイス</b>                                                     |               |                                                                   |                  |
| CHF ABB LTD CHF1.03(REGD)                                      | 1 050.00      | 25 210.97                                                         | 0.02             |
| USD ACE LIMITED ORD CHF27.04                                   | 121.00        | 12 380.72                                                         | 0.01             |
| CHF ACTELION CHF0.50(REGD)                                     | 50.00         | 4 909.42                                                          | 0.00             |
| CHF ADECCO SA CHF1(REGD)                                       | 76.00         | 6 348.80                                                          | 0.00             |
| CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)                            | 689.00        | 21 841.09                                                         | 0.02             |
| USD GARMIN LTD COM CHF0.005                                    | 100.00        | 5 710.00                                                          | 0.00             |
| CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)                                      | 23.00         | 7 661.88                                                          | 0.01             |
| CHF GIVAUDAN AG CHF10                                          | 5.00          | 7 876.65                                                          | 0.01             |
| CHF HOLCIM CHF2(REGD)                                          | 120.00        | 10 985.29                                                         | 0.01             |
| CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)                          | 133.00        | 6 216.08                                                          | 0.00             |
| CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)                    | 34.00         | 4 641.72                                                          | 0.00             |
| CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)                                  | 16.00         | 1 670.96                                                          | 0.00             |
| CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)                                    | 1 399.00      | 107 969.84                                                        | 0.08             |
| CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)                                  | 1 000.00      | 86 660.23                                                         | 0.06             |
| USD PENTAIR LTD COM USD0.16 3/4                                | 47.00         | 3 491.63                                                          | 0.00             |
| CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'                   | 235.00        | 23 834.97                                                         | 0.02             |
| CHF SGS LTD CHF1(REGD)                                         | 3.00          | 7 479.13                                                          | 0.01             |
| CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)                                 | 41.00         | 4 936.11                                                          | 0.00             |
| CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)                               | 25.00         | 6 138.91                                                          | 0.00             |
| CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)                                     | 12.00         | 7 291.73                                                          | 0.01             |
| CHF SYNGENTA CHF0.1(REGD)                                      | 43.00         | 17 025.16                                                         | 0.01             |
| USD TE CONNECTIVITY LTD CHF0.77                                | 200.00        | 11 796.00                                                         | 0.01             |
| USD TRANSOCEAN LTD COM CHF15                                   | 149.00        | 6 417.43                                                          | 0.00             |
| USD TYCO INTL LTD COM CHF6.70                                  | 200.00        | 8 180.00                                                          | 0.01             |
| CHF UBS AG CHF0.1                                              | 1 630.00      | 34 064.40                                                         | 0.03             |
| USD WEATHERFORD INT LT CHF0.01                                 | 400.00        | 8 400.00                                                          | 0.01             |
| CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10                               | 72.00         | 20 615.82                                                         | 0.02             |
| <b>スイス合計</b>                                                   |               | <b>469 754.94</b>                                                 | <b>0.35</b>      |
| <b>アメリカ合衆国</b>                                                 |               |                                                                   |                  |
| USD CAMERON INTL CORP COM USD0.01                              | 100.00        | 6 496.00                                                          | 0.00             |
| <b>アメリカ合衆国合計</b>                                               |               | <b>6 496.00</b>                                                   | <b>0.00</b>      |
| <b>記名株式合計</b>                                                  |               | <b>975 553.78</b>                                                 | <b>0.73</b>      |
| <b>預託証券</b>                                                    |               |                                                                   |                  |
| <b>イスラエル</b>                                                   |               |                                                                   |                  |
| USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)                     | 402.00        | 19 641.72                                                         | 0.01             |
| <b>イスラエル合計</b>                                                 |               | <b>19 641.72</b>                                                  | <b>0.01</b>      |
| <b>ルクセンブルグ</b>                                                 |               |                                                                   |                  |
| SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50                  | 49.00         | 4 834.66                                                          | 0.00             |
| EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV                            | 192.00        | 7 226.48                                                          | 0.01             |
| <b>ルクセンブルグ合計</b>                                               |               | <b>12 061.14</b>                                                  | <b>0.01</b>      |
| <b>預託証券合計</b>                                                  |               | <b>31 702.86</b>                                                  | <b>0.02</b>      |
| <b>投資信託証書</b>                                                  |               |                                                                   |                  |
| <b>アイルランド</b>                                                  |               |                                                                   |                  |
| USD STAR COMPASS PLC/ UBS DYN DIV (USD) LKD NOTES DUE 30.09.14 | 13 710 000.00 | 16 915 398.00                                                     | 12.59            |
| <b>アイルランド合計</b>                                                |               | <b>16 915 398.00</b>                                              | <b>12.59</b>     |
| <b>投資信託証書合計</b>                                                |               | <b>16 915 398.00</b>                                              | <b>12.59</b>     |
| <b>投資証書、クローズド・エンド型</b>                                         |               |                                                                   |                  |

| 銘柄                                                       | 数量/<br>額面  | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|----------------------------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>カナダ</b>                                               |            |                                                               |                  |
| CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                  | 116.00     | 2 878.20                                                      | 0.00             |
| <b>カナダ合計</b>                                             |            | <b>2 878.20</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>日本</b>                                                |            |                                                               |                  |
| JPY 日本ビルファンド投資法人                                         | 1.00       | 5 540.87                                                      | 0.00             |
| <b>日本合計</b>                                              |            | <b>5 540.87</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>アメリカ合衆国</b>                                           |            |                                                               |                  |
| USD AMERICAN CAPITAL A COM STK USD0.01                   | 200.00     | 4 542.00                                                      | 0.01             |
| USD HEALTH CARE REIT INC                                 | 143.00     | 9 021.87                                                      | 0.01             |
| USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001                        | 104.00     | 3 900.00                                                      | 0.00             |
| USD RAYONIER INC COM NPV                                 | 88.00      | 3 968.80                                                      | 0.00             |
| USD VORNADO REALTY TRUST-SBI                             | 116.00     | 11 901.60                                                     | 0.01             |
| <b>アメリカ合衆国合計</b>                                         |            | <b>33 334.27</b>                                              | <b>0.03</b>      |
| <b>投資証券、クローズド・エンド型合計</b>                                 |            | <b>41 753.34</b>                                              | <b>0.03</b>      |
| <b>新株引受権</b>                                             |            |                                                               |                  |
| <b>スペイン</b>                                              |            |                                                               |                  |
| EUR BANCO SANTANDER SA RIGHTS (STOCK DIVD) 28.04.14      | 5 170.00   | 1 075.27                                                      | 0.00             |
| <b>スペイン合計</b>                                            |            | <b>1 075.27</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>新株引受権合計</b>                                           |            | <b>1 075.27</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>ノート、固定利付債</b>                                         |            |                                                               |                  |
| <b>豪ドル</b>                                               |            |                                                               |                  |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 4.00000% 13-20.04.23   | 250 000.00 | 227 648.70                                                    | 0.17             |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 10-21.04.16        | 60 000.00  | 58 852.97                                                     | 0.04             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.50000% 13-17.11.17 | 80 000.00  | 74 689.57                                                     | 0.06             |
| <b>豪ドル合計</b>                                             |            | <b>361 191.24</b>                                             | <b>0.27</b>      |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                              | 数量 / 額面      | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-----------------------------------------------------------------|--------------|-------------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>英ポンド</b>                                                     |              |                                                                   |                  |
| GBP EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.00000% 98-07.12.28               | 100 000.00   | 216 564.98                                                        | 0.16             |
| <b>英ポンド合計</b>                                                   |              | <b>216 564.98</b>                                                 | <b>0.16</b>      |
| <b>米ドル</b>                                                      |              |                                                                   |                  |
| USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22          | 100 000.00   | 93 484.00                                                         | 0.07             |
| USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 10-14.07.20             | 100 000.00   | 109 000.00                                                        | 0.08             |
| USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 13-15.03.18        | 100 000.00   | 97 964.90                                                         | 0.07             |
| USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.75000% 05-15.02.35 | 700 000.00   | 810 513.90                                                        | 0.60             |
| USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 2.87500% 10-09.11.15          | 1 000 000.00 | 1 026 900.00                                                      | 0.76             |
| USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 12-12.09.17         | 250 000.00   | 247 775.00                                                        | 0.19             |
| USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22                  | 50 000.00    | 47 620.50                                                         | 0.04             |
| <b>米ドル合計</b>                                                    |              | <b>2 433 258.30</b>                                               | <b>1.81</b>      |
| <b>ノート、固定利付債合計</b>                                              |              | <b>3 011 014.52</b>                                               | <b>2.24</b>      |
| <b>ミディアム・ターム・ノート、固定利付債</b>                                      |              |                                                                   |                  |
| <b>豪ドル</b>                                                      |              |                                                                   |                  |
| AUD HYPOTHEKENBANK FRANKFURT AG 6.00000% 06-30.11.16            | 50 000.00    | 48 099.99                                                         | 0.03             |
| <b>豪ドル合計</b>                                                    |              | <b>48 099.99</b>                                                  | <b>0.03</b>      |
| <b>カナダ・ドル</b>                                                   |              |                                                                   |                  |
| CAD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 4.45000% 06-26.10.18  | 40 000.00    | 39 533.46                                                         | 0.03             |
| <b>カナダ・ドル合計</b>                                                 |              | <b>39 533.46</b>                                                  | <b>0.03</b>      |
| <b>ユーロ</b>                                                      |              |                                                                   |                  |
| EUR ABBEY NATIONAL TREASURY SERVICES-REG-S 2.62500% 13-16.07.20 | 100 000.00   | 145 216.16                                                        | 0.11             |
| EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.12500% 12-30.11.17 | 25 000.00    | 35 284.92                                                         | 0.03             |
| EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.37500% 12-09.07.24              | 50 000.00    | 74 710.78                                                         | 0.05             |
| EUR UBS AG LONDON BRANCH 3.00000% 09-06.10.14                   | 50 000.00    | 70 090.10                                                         | 0.05             |
| <b>ユーロ合計</b>                                                    |              | <b>325 301.96</b>                                                 | <b>0.24</b>      |
| <b>米ドル</b>                                                      |              |                                                                   |                  |
| USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.50000% 11-16.05.16               | 2 500 000.00 | 2 600 775.00                                                      | 1.94             |
| USD GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 1.60000% 12-20.11.17          | 150 000.00   | 150 807.30                                                        | 0.11             |
| USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.37500% 12-21.06.17              | 250 000.00   | 251 890.00                                                        | 0.19             |
| <b>米ドル合計</b>                                                    |              | <b>3 003 472.30</b>                                               | <b>2.24</b>      |
| <b>ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計</b>                                    |              | <b>3 416 407.71</b>                                               | <b>2.54</b>      |
| <b>債券、固定利付債</b>                                                 |              |                                                                   |                  |
| <b>豪ドル</b>                                                      |              |                                                                   |                  |
| AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17                              | 80 000.00    | 76 910.32                                                         | 0.06             |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 11-21.07.22               | 50 000.00    | 52 048.02                                                         | 0.04             |
| AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23         | 110 000.00   | 101 032.78                                                        | 0.08             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.75000% 04-15.11.16              | 25 000.00    | 24 703.68                                                         | 0.02             |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 03-17.10.22              | 80 000.00    | 83 996.58                                                         | 0.06             |
| AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 7.000000% 01-15.10.19      | 80 000.00    | 85 964.56                                                         | 0.06             |
| <b>豪ドル合計</b>                                                    |              | <b>424 655.94</b>                                                 | <b>0.32</b>      |
| <b>カナダ・ドル</b>                                                   |              |                                                                   |                  |
| CAD CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 08-01.06.19                     | 230 000.00   | 230 638.39                                                        | 0.17             |
| CAD CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21                     | 600 000.00   | 591 852.33                                                        | 0.44             |
| CAD CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 01-01.06.33                     | 65 000.00    | 84 661.09                                                         | 0.07             |
| <b>カナダ・ドル合計</b>                                                 |              | <b>907 151.81</b>                                                 | <b>0.68</b>      |

銘柄

数量 /  
額面米ドル建評価額  
先物 / オプション /  
先渡為替契約 /  
スワップに係る  
未実現(損)益  
(注1)純資産  
比率  
(%)

**ユーロ**

|     |                                                |            |            |      |
|-----|------------------------------------------------|------------|------------|------|
| EUR | AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.20000% 10-20.02.17      | 200 000.00 | 299 480.94 | 0.22 |
| EUR | BELGIUM, KINGDOM OF 2.75000% 10-28.03.16       | 200 000.00 | 290 385.17 | 0.22 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.00000% 00-25.10.16   | 300 000.00 | 464 304.30 | 0.35 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 98-04.07.28      | 500 000.00 | 933 356.13 | 0.69 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37      | 100 000.00 | 179 871.59 | 0.13 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 08-04.07.40      | 100 000.00 | 204 389.95 | 0.15 |
| EUR | KOREA, REPUBLIC OF 3.62500% 05-02.11.15        | 100 000.00 | 144 478.51 | 0.11 |
| EUR | QUEBEC, PROVINCE OF-REG-S 2.25000% 13-17.07.23 | 100 000.00 | 142 705.11 | 0.11 |

|              |  |  |                     |             |
|--------------|--|--|---------------------|-------------|
| <b>ユーロ合計</b> |  |  | <b>2 658 971.70</b> | <b>1.98</b> |
|--------------|--|--|---------------------|-------------|

**英ポンド**

|     |                                                              |            |            |      |
|-----|--------------------------------------------------------------|------------|------------|------|
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19 | 200 000.00 | 380 025.07 | 0.28 |
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.75000% 11-07.09.21 | 40 000.00  | 74 113.83  | 0.05 |
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 10-07.12.40 | 150 000.00 | 290 109.77 | 0.22 |

|               |  |  |                   |             |
|---------------|--|--|-------------------|-------------|
| <b>英ポンド合計</b> |  |  | <b>744 248.67</b> | <b>0.55</b> |
|---------------|--|--|-------------------|-------------|

**米ドル**

|     |                                                      |            |            |      |
|-----|------------------------------------------------------|------------|------------|------|
| USD | INTERNATIONAL FINANCE CORP 1.75000% 13-04.09.18      | 50 000.00  | 50 373.25  | 0.04 |
| USD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.37500% 11-04.08.15 | 450 000.00 | 456 111.00 | 0.34 |
| USD | ONTARIO, PROVINCE OF 1.10000% 12-25.10.17            | 50 000.00  | 49 651.00  | 0.03 |
| USD | TEMASEK FINANCIAL LTD-REG-S 4.50000% 05-21.09.15     | 150 000.00 | 157 980.00 | 0.12 |

|              |  |  |                   |             |
|--------------|--|--|-------------------|-------------|
| <b>米ドル合計</b> |  |  | <b>714 115.25</b> | <b>0.53</b> |
|--------------|--|--|-------------------|-------------|

|                    |  |  |                     |             |
|--------------------|--|--|---------------------|-------------|
| <b>ボンド、固定利付債合計</b> |  |  | <b>5 449 143.37</b> | <b>4.06</b> |
|--------------------|--|--|---------------------|-------------|

**財務省証券(T-note)、固定利付債****米ドル**

|     |                                                |              |              |      |
|-----|------------------------------------------------|--------------|--------------|------|
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31 | 1 000 000.00 | 1 292 344.00 | 0.96 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38 | 1 600 000.00 | 1 873 750.40 | 1.40 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 05-15.05.15 | 1 500 000.00 | 1 562 284.50 | 1.17 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 5.12500% 06-15.05.16 | 2 000 000.00 | 2 190 000.00 | 1.63 |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                     | 数量 / 額面      | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡し為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|--------------------------------------------------------|--------------|--------------------------------------------------------------------|------------------|
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 08-15.02.18     | 2 000 000.00 | 2 166 876.00                                                       | 1.61             |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 09-15.02.19     | 2 300 000.00 | 2 421 467.60                                                       | 1.80             |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 09-31.03.16     | 1 360 000.00 | 1 411 956.08                                                       | 1.05             |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 09-31.12.14     | 2 500 000.00 | 2 542 285.00                                                       | 1.89             |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20     | 2 500 000.00 | 2 737 500.00                                                       | 2.04             |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.11.18     | 1 500 000.00 | 1 488 750.00                                                       | 1.11             |
| <b>米ドル合計</b>                                           |              | <b>19 687 213.58</b>                                               | <b>14.66</b>     |
| <b>財務省証券(T-note)、固定利付債合計</b>                           |              | <b>19 687 213.58</b>                                               | <b>14.66</b>     |
| <b>公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある証券および短期金融商品合計</b>             |              | <b>62 569 059.81</b>                                               | <b>46.58</b>     |
| <b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品</b>               |              |                                                                    |                  |
| <b>ノート、固定利付債</b>                                       |              |                                                                    |                  |
| <b>豪ドル</b>                                             |              |                                                                    |                  |
| AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 6.00000% 11-01.02.18 | 90 000.00    | 91 301.50                                                          | 0.07             |
| <b>豪ドル合計</b>                                           |              | <b>91 301.50</b>                                                   | <b>0.07</b>      |
| <b>米ドル</b>                                             |              |                                                                    |                  |
| USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22           | 100 000.00   | 97 723.00                                                          | 0.07             |
| USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.25000% 12-05.10.17      | 150 000.00   | 149 932.05                                                         | 0.11             |
| <b>米ドル合計</b>                                           |              | <b>247 655.05</b>                                                  | <b>0.18</b>      |
| <b>ノート、固定利付債合計</b>                                     |              | <b>338 956.55</b>                                                  | <b>0.25</b>      |
| <b>ミディアム・ターム・ノート、固定利付債</b>                             |              |                                                                    |                  |
| <b>米ドル</b>                                             |              |                                                                    |                  |
| USD BANK OF MONTREAL 0.80000% 12-06.11.15              | 100 000.00   | 100 466.20                                                         | 0.07             |
| USD ROYAL BANK OF CANADA 1.50000% 13-16.01.18          | 50 000.00    | 49 786.30                                                          | 0.04             |
| USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.37500% 13-10.01.18      | 50 000.00    | 49 297.80                                                          | 0.04             |
| <b>米ドル合計</b>                                           |              | <b>199 550.30</b>                                                  | <b>0.15</b>      |
| <b>ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計</b>                           |              | <b>199 550.30</b>                                                  | <b>0.15</b>      |
| <b>ミディアム・ターム・ノート、変動利付債</b>                             |              |                                                                    |                  |
| <b>米ドル</b>                                             |              |                                                                    |                  |
| USD BNP PARIBAS 3M LIBOR+275BP 11-20.12.14             | 167 000.00   | 169 746.48                                                         | 0.12             |
| <b>米ドル合計</b>                                           |              | <b>169 746.48</b>                                                  | <b>0.12</b>      |
| <b>ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計</b>                           |              | <b>169 746.48</b>                                                  | <b>0.12</b>      |
| <b>ボンド、固定利付債</b>                                       |              |                                                                    |                  |
| <b>カナダ・ドル</b>                                          |              |                                                                    |                  |
| CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.09.17            | 190 000.00   | 174 148.64                                                         | 0.13             |
| CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.06.23            | 90 000.00    | 76 718.85                                                          | 0.06             |
| <b>カナダ・ドル合計</b>                                        |              | <b>250 867.49</b>                                                  | <b>0.19</b>      |
| <b>米ドル</b>                                             |              |                                                                    |                  |
| USD BANK OF MONTREAL-REG-S 2.62500% 11-25.01.16        | 500 000.00   | 518 105.00                                                         | 0.39             |
| <b>米ドル合計</b>                                           |              | <b>518 105.00</b>                                                  | <b>0.39</b>      |
| <b>ボンド、固定利付債合計</b>                                     |              | <b>768 972.49</b>                                                  | <b>0.58</b>      |

| 銘柄                                                           | 数量/<br>額面  | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|--------------------------------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>財務省証券(T-note)、固定利付債</b>                                   |            |                                                               |                  |
| <b>米ドル</b>                                                   |            |                                                               |                  |
| USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 12-15.12.15           | 500 000.00 | 499 824.00                                                    | 0.37             |
| <b>米ドル合計</b>                                                 |            | <b>499 824.00</b>                                             | <b>0.37</b>      |
| <b>財務省証券(T-note)、固定利付債合計</b>                                 |            | <b>499 824.00</b>                                             | <b>0.37</b>      |
| <b>他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券および短期金融商品</b>                     |            |                                                               |                  |
| <b>合計</b>                                                    |            | <b>1 977 049.82</b>                                           | <b>1.47</b>      |
| <b>公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある証券および短期金融商品</b> |            |                                                               |                  |
| <b>無記名株式</b>                                                 |            |                                                               |                  |
| <b>カナダ</b>                                                   |            |                                                               |                  |
| CAD TELUS CORPORATION COM NPV                                | 108.00     | 3 792.72                                                      | 0.00             |
| <b>カナダ合計</b>                                                 |            | <b>3 792.72</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>無記名株式合計</b>                                               |            | <b>3 792.72</b>                                               | <b>0.00</b>      |
| <b>優先株式</b>                                                  |            |                                                               |                  |
| <b>イギリス</b>                                                  |            |                                                               |                  |
| GBP ROLLS ROYCE HLDGS C SHS ENTITLEMENT JULY 14              | 121 136.00 | 204.55                                                        | 0.00             |
| <b>イギリス合計</b>                                                |            | <b>204.55</b>                                                 | <b>0.00</b>      |
| <b>優先株式合計</b>                                                |            | <b>204.55</b>                                                 | <b>0.00</b>      |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                               | 数量/<br>額面  | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>株式ストリップ</b>                                                   |            |                                                               |                  |
| <b>ベルギー</b>                                                      |            |                                                               |                  |
| EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV STRIP                                   | 880.00     | 1.22                                                          | 0.00             |
| <b>ベルギー合計</b>                                                    |            | <b>1.22</b>                                                   | <b>0.00</b>      |
| <b>株式ストリップ合計</b>                                                 |            | <b>1.22</b>                                                   | <b>0.00</b>      |
| <b>新株引受権</b>                                                     |            |                                                               |                  |
| <b>オランダ</b>                                                      |            |                                                               |                  |
| EUR CORIO NV RIGHTS (STOCK DIVIDEND) 28.05.14                    | 63.00      | 196.42                                                        | 0.00             |
| EUR RANDSTAD HOLDINGS NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 25.04.14        | 60.00      | 79.03                                                         | 0.00             |
| EUR REED ELSEVIER NV DRIP (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 23.05.14       | 262.00     | 135.87                                                        | 0.00             |
| EUR TNT EXPRESS NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 05.05.14              | 282.00     | 9.15                                                          | 0.00             |
| EUR WOLTERS KLUWER NV RIGHTS (STOCK DIVIDEND) 13.05.14           | 142.00     | 138.75                                                        | 0.00             |
| <b>オランダ合計</b>                                                    |            | <b>559.22</b>                                                 | <b>0.00</b>      |
| <b>新株引受権合計</b>                                                   |            | <b>559.22</b>                                                 | <b>0.00</b>      |
| 公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある<br>証券および短期金融商品合計      |            | 4 557.71                                                      | 0.00             |
| <b>ルクセンブルグ2010年12月17日法の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs</b>         |            |                                                               |                  |
| <b>投資証券、オープン・エンド型</b>                                            |            |                                                               |                  |
| <b>ルクセンブルグ</b>                                                   |            |                                                               |                  |
| USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC                | 75.00      | 914 315.25                                                    | 0.68             |
| USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC                | 450.40     | 6 775 338.65                                                  | 5.04             |
| USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC | 346.00     | 4 009 883.96                                                  | 2.99             |
| USD UBS (LUX) EQUITY FUND - EMERGING MARKETS U-X-ACC             | 519.00     | 5 295 549.03                                                  | 3.94             |
| USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD)-U-X-ACC             | 131.00     | 2 489 031.44                                                  | 1.85             |
| USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA QUANTITATIVE (USD)-U-X-ACC      | 103.00     | 1 517 472.22                                                  | 1.13             |
| USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL.GLOBAL EQUITY FA-USD             | 812.00     | 14 237 494.32                                                 | 10.60            |
| USD UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV 2 - GLOBAL QUANTITATIVE I-X-AC | 9.80       | 14 641 783.39                                                 | 10.90            |
| USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC                    | 710.00     | 7 317 153.50                                                  | 5.45             |
| <b>ルクセンブルグ合計</b>                                                 |            | <b>57 198 021.76</b>                                          | <b>42.58</b>     |
| <b>投資証券、オープン・エンド型合計</b>                                          |            | <b>57 198 021.76</b>                                          | <b>42.58</b>     |
| <b>ルクセンブルグ2010年12月17日法の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計</b>       |            | <b>57 198 021.76</b>                                          | <b>42.58</b>     |
| <b>その他のUCIs (集合投資事業)</b>                                         |            |                                                               |                  |
| <b>投資証券、オープン・エンド型</b>                                            |            |                                                               |                  |
| <b>ジャージー</b>                                                     |            |                                                               |                  |
| USD UBS WEALTH MANAGEMENT-GLOBAL PROPERTY FUND LTD H-USD         | 106 942.10 | 540 988.01                                                    | 0.41             |
| <b>ジャージー 合計</b>                                                  |            | <b>540 988.01</b>                                             | <b>0.41</b>      |
| <b>ルクセンブルグ</b>                                                   |            |                                                               |                  |
| EUR UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV-GLOBAL ALPHA OPP (EUR) U-X-ACC | 150.42     | 2 488 187.73                                                  | 1.85             |
| <b>ルクセンブルグ合計</b>                                                 |            | <b>2 488 187.73</b>                                           | <b>1.85</b>      |
| <b>投資証券、オープン・エンド型合計</b>                                          |            | <b>3 029 175.74</b>                                           | <b>2.26</b>      |
| <b>その他のUCIs (集合投資事業) 合計</b>                                      |            | <b>3 029 175.74</b>                                           | <b>2.26</b>      |
| <b>投資有価証券合計</b>                                                  |            | <b>124 777 864.84</b>                                         | <b>92.89</b>     |

注記は当財務書類の一部である。

| 銘柄                                                      | 数量 /<br>額面   | 米ドル建評価額<br>先物 / オプション /<br>先渡為替契約 /<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|---------------------------------------------------------|--------------|-------------------------------------------------------------------|------------------|
| <b>金融派生商品</b>                                           |              |                                                                   |                  |
| <b>公認の証券取引所に上場されている金融派生商品</b>                           |              |                                                                   |                  |
| <b>債券関連金融先物</b>                                         |              |                                                                   |                  |
| USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.06.14               | 45.00        | 11 906.37                                                         | 0.01             |
| <b>債券関連金融先物合計</b>                                       |              | <b>11 906.37</b>                                                  | <b>0.01</b>      |
| <b>指数関連金融先物</b>                                         |              |                                                                   |                  |
| JPY NIKKEI 225 (SGX) INDEX FUTURE 12.06.14              | -2.00        | 5 115.03                                                          | 0.00             |
| EUR DJ EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.06.14              | 62.00        | 101 148.82                                                        | 0.08             |
| GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 20.06.14                      | -13.00       | -40 280.36                                                        | -0.03            |
| USD S&P500 EMINI FUTURE 20.06.14                        | 80.00        | 107 150.00                                                        | 0.08             |
| <b>指数関連金融先物合計</b>                                       |              | <b>173 133.49</b>                                                 | <b>0.13</b>      |
| <b>公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計</b>                         |              | <b>185 039.86</b>                                                 | <b>0.14</b>      |
| <b>公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品</b>       |              |                                                                   |                  |
| <b>クレジット・デフォルト・スワップ*</b>                                |              |                                                                   |                  |
| USD DB/CDX.NA.HY.21 DEC18 CDI REC 5.00000% 13-20.12.18  | 1 700 000.00 | 136 104.63                                                        | 0.10             |
| USD CME/CDX.NA.IG.22 JUN19 CDI REC 1.00000% 14-20.06.19 | 1 000 000.00 | 18 781.30                                                         | 0.01             |
| USD CME/CDX.NA.HY.22 JUN19 CDI REC 5.00000% 14-20.06.19 | 2 800 000.00 | 212 454.20                                                        | 0.16             |
| <b>クレジット・デフォルト・スワップ合計</b>                               |              | <b>367 340.13</b>                                                 | <b>0.27</b>      |
| <b>公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない金融派生商品合計</b>     |              | <b>367 340.13</b>                                                 | <b>0.27</b>      |
| <b>金融派生商品合計</b>                                         |              | <b>552 379.99</b>                                                 | <b>0.41</b>      |

**先渡為替契約****先渡為替契約(購入/売却)**

|     |               |     |                |           |            |       |
|-----|---------------|-----|----------------|-----------|------------|-------|
| USD | 2 687 975.28  | GBP | 1 620 000.00   | 22.5.2014 | -47 046.05 | -0.04 |
| USD | 1 811 278.19  | CAD | 2 004 000.00   | 22.5.2014 | -13 880.47 | -0.01 |
| USD | 271 463.89    | SEK | 1 730 000.00   | 22.5.2014 | 6 103.24   | 0.00  |
| USD | 5 700 836.20  | JPY | 577 855 000.00 | 22.5.2014 | 43 192.09  | 0.03  |
| USD | 1 789 783.46  | CHF | 1 563 000.00   | 22.5.2014 | 14 300.62  | 0.01  |
| USD | 7 386 984.47  | EUR | 5 310 052.87   | 22.5.2014 | 24 600.79  | 0.02  |
| USD | 713 746.37    | HKD | 5 542 000.00   | 22.5.2014 | -1 124.41  | 0.00  |
| USD | 1 190 892.08  | AUD | 1 318 000.00   | 22.5.2014 | -28 581.17 | -0.02 |
| USD | 205 505.45    | MXN | 2 720 000.00   | 22.5.2014 | -1 956.21  | 0.00  |
| USD | 483 039.90    | EUR | 350 000.00     | 22.5.2014 | -2 234.80  | 0.00  |
| USD | 33 536.24     | HKD | 260 000.00     | 19.6.2014 | -3.88      | 0.00  |
| USD | 1 424 752.51  | CHF | 1 259 881.57   | 19.6.2014 | -6 740.42  | -0.01 |
| USD | 277 436.78    | GBP | 165 000.00     | 19.6.2014 | -1 068.03  | 0.00  |
| USD | 111 490.71    | SGD | 140 000.00     | 19.6.2014 | -32.45     | 0.00  |
| USD | 955 349.85    | AUD | 1 024 945.71   | 19.6.2014 | 8 930.63   | 0.01  |
| USD | 266 531.09    | NOK | 1 600 000.00   | 19.6.2014 | -1 572.79  | 0.00  |
| USD | 4 346 955.89  | EUR | 3 149 691.87   | 19.6.2014 | -19 817.19 | -0.01 |
| USD | 60 591.83     | SEK | 400 000.00     | 19.6.2014 | -735.72    | 0.00  |
| USD | 229 886.09    | ZAR | 2 450 000.00   | 19.6.2014 | -938.15    | 0.00  |
| USD | 870 168.19    | CAD | 960 000.00     | 19.6.2014 | -3 565.70  | 0.00  |
| JPY | 66 864 386.00 | USD | 652 224.75     | 19.6.2014 | 2 539.49   | 0.00  |

| 銘柄                                |            |     |               | 数量/<br>額面 | 米ドル建評価額<br>先物/オプション/<br>先渡為替契約/<br>スワップに係る<br>未実現(損)益<br>(注1) | 純資産<br>比率<br>(%) |
|-----------------------------------|------------|-----|---------------|-----------|---------------------------------------------------------------|------------------|
| DKK                               | 120 000.00 | USD | 22 200.88     | 19.6.2014 | 96.25                                                         | 0.00             |
| USD                               | 207 636.85 | MXN | 2 720 000.00  | 19.6.2014 | 650.49                                                        | 0.00             |
| USD                               | 837 114.22 | JPY | 85 500 000.00 | 22.5.2014 | 3.58                                                          | 0.00             |
| USD                               | 499 239.00 | EUR | 360 000.00    | 22.5.2014 | 99.31                                                         | 0.00             |
| <b>先渡為替契約(購入/売却)合計</b>            |            |     |               |           | <b>-28 780.95</b>                                             | <b>-0.02</b>     |
| <b>現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産</b> |            |     |               |           | <b>10 159 510.92</b>                                          | <b>7.56</b>      |
| <b>当座借越およびその他の短期負債</b>            |            |     |               |           | <b>-412 974.35</b>                                            | <b>-0.31</b>     |
| <b>その他の資産および負債</b>                |            |     |               |           | <b>-714 800.59</b>                                            | <b>-0.53</b>     |
| <b>純資産総額</b>                      |            |     |               |           | <b>134 333 199.86</b>                                         | <b>100.00</b>    |

\* 額面が正：サブ・ファンドは「受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「支払側」

注記は当財務書類の一部である。

## U B S ( L u x ) ストラテジー・エクストラ・シキャブ - バランスド (米ドル)

## 組入証券の構造

| 通貨別分類表      | (純資産に対する百分率 %) |
|-------------|----------------|
| 米ドル         | 81.81          |
| ユーロ         | 5.45           |
| 英ポンド        | 1.65           |
| カナダ・ドル      | 1.33           |
| 豪ドル         | 1.03           |
| 日本円         | 0.80           |
| スイス・フラン     | 0.40           |
| スウェーデン・クローナ | 0.14           |
| 香港ドル        | 0.12           |
| デンマーク・クローネ  | 0.07           |
| シンガポール・ドル   | 0.05           |
| ノルウェー・クローネ  | 0.03           |
| イスラエル・シェケル  | 0.01           |
| 合計          | 92.89          |

| 投資商品分類表             | (純資産に対する百分率 %) |
|---------------------|----------------|
| 投資証券、オープン・エンド型      | 44.84          |
| 財務省証券(T-note)、固定利付債 | 15.03          |
| 投資信託証券              | 12.59          |
| 無記名株式               | 9.57           |
| 債券、固定利付債            | 4.63           |
| ミディアム・ターム・ノート、固定利付債 | 2.69           |
| ノート、固定利付債           | 2.49           |
| 記名株式                | 0.73           |
| ミディアム・ターム・ノート、変動利付債 | 0.13           |
| その他の株式              | 0.11           |
| 投資証券、クローズド・エンド型     | 0.03           |
| 優先株式                | 0.03           |
| 預託証券                | 0.02           |
| 合計                  | 92.89          |

注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

## 5 販売及び買戻しの実績

2013年6月1日から2014年5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2014年5月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

( バランスド ( 米ドル ) )

|                    | 販売口数                               | 買戻し口数                   | 発行済口数                              |
|--------------------|------------------------------------|-------------------------|------------------------------------|
| クラス P - a c c 投資証券 | 4,859,948.0650<br>( 255,650.0000 ) | 1,514,167.7240<br>( 0 ) | 9,806,329.5450<br>( 255,650.0000 ) |

( 注 ) ( ) 内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数である。