

【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27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】 メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
マイケル・ケール (Michael Kehl)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
カイ・ギャメルリン (Kai Gammelinn)

【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
14億4,100万米ドル(約1,783億円)

(注) 米ドルの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、平成27年5月29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=123.73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27年4月30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 第1 ファンドの状況 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
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
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 「純資産計算書」 「運用計算書」 「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 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員の状況	更新
5 その他			(5) その他	更新
第4 関係法人の状況 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
	(3) 大株主の状況		(2) 大株主の状況	更新
	(4) 役員の状況		(3) 役員の状況	更新
	(5) 事業の内容及び営業の概況		(4) 事業の内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況 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)

	2013年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2013年10月末日に 終了する 会計年度末	2014年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2014年10月末日に 終了する 会計年度末	2015年4月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	6,224,924.72	9,306,326.88	3,400,109.16	7,483,045.95	6,364,768.56
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	6,224,924.72	9,306,326.88	3,400,109.16	7,483,045.95	6,364,768.56
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	6,224,924.72	9,306,326.88	3,400,109.16	7,483,045.95	6,364,768.56
(d) 出資総額 ^(2)	87,322,874.98	91,057,425.43	134,333,199.86	181,342,553.95	220,508,200.57
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	□ 6,478,511.847	□ 6,431,531.436	□ 9,316,585.765	□ 12,170,057.014	□ 14,363,444.090
(f) 純資産額	87,322,874.98	91,057,425.43	134,333,199.86	181,342,553.95	220,508,200.57
(g) 資産総額	87,878,402.95	91,397,187.72	138,356,916.99	182,334,326.66	221,302,874.28
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	12.81	13.25	13.65	14.03	14.49
(i) 1口当たり当期純利益金 額または当期純損失金額 (クラス P - a c c 投資証券)	0.91	1.37	0.34	0.58	0.42
(j) 分配総額	-	-	-	-	-
(k) 1口当たり分配金額	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	99.37%	99.63%	97.09%	99.46%	99.64%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	8.10%	11.16%	6.56%	5.89%	6.15%

(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) 発行済投資口総数、(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、(k) 1口当たり分配金額および (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。

(注 1) クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は2015年6月2日に設定された。

(注 2) 各取引日に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある (財務書類に対する注記 1 参照)。以下同じ。

(2) 外国投資法人の出資総額

2015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)	
バランズ(米ドル)	220,982,755.73 (約27,342百万円)	クラス P - a c c 投資証券	14,533,681.364
		クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	-

(注) クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は2015年6月2日に設定された。

(3) 主要な投資主の状況

1993年4月5日付ルクセンブルグ法第41条により課されるルクセンブルグ銀行機密規定(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

(4) 役員の状況

(2015年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	チェアマン	ユービーエス・エイ・ジー、パーゼ ル・アンド・チューリッヒ マネージング・ディレクター	該当なし
マイケル・ケール (Michael Kehl)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	ユービーエス・エイ・ジー、パーゼ ル・アンド・チューリッヒ エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
トーマス・ポートマン (Thomas Portmann)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	UBS ファンド・マネジメント(スイ ス)エイ・ジー、パーゼル エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
カイ・ギャメルリン (Kai Gammelín)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	ユービーエス・エイ・ジー、パーゼ ル・アンド・チューリッヒ エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人はアーンスト・アンド・ヤング・エス・エイである。

(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規定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消却の決定は、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、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・ファンドの合併またはサブ・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消却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、決定は総会に出席するまたは委任状によ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注文を拒絶することができる。
- b) 排斥条項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、訴訟事件その他本投資法人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))

(2015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	99,061,289.44	44.27
	アイルランド	6,456,871.35	2.89
	ジャージー島	181,106.02	0.08
	アメリカ合衆国	44,535.50	0.02
	日本	10,680.53	0.00
	カナダ	2,574.16	0.00
	小計	105,757,057.00	47.27
債券	アメリカ合衆国	31,451,707.75	14.06
	ドイツ	5,323,534.25	2.38
	国際機関	5,005,636.43	2.24
	カナダ	3,383,937.66	1.51
	オーストラリア	1,673,134.99	0.75
	イギリス	1,410,275.34	0.63
	スウェーデン	1,301,477.00	0.58
	フランス	1,130,665.11	0.51
	大韓民国	1,120,144.93	0.50
	オランダ	1,004,540.00	0.45
	オーストリア	982,651.13	0.44
	イタリア	764,370.00	0.34
	英領バージン諸島	695,765.00	0.31
	ベルギー	224,543.44	0.10
	シンガポール	151,744.50	0.07
	クロアチア	110,500.00	0.05
	小計	55,734,627.53	24.91
その他証券	アイルランド	31,251,096.00	13.97
	小計	31,251,096.00	13.97

株式	アメリカ合衆国	13,304,986.61	5.95
	日本	2,090,342.27	0.93
	イギリス	1,715,208.57	0.77
	スイス	1,002,856.24	0.45
	カナダ	863,524.68	0.39
	フランス	859,254.51	0.38
	ドイツ	852,051.82	0.38
	オーストラリア	653,919.43	0.29
	オランダ	429,270.08	0.19
	スペイン	334,131.16	0.15
	スウェーデン	293,251.29	0.13
	香港	289,039.55	0.13
	アイルランド	266,043.58	0.12
	イタリア	181,810.03	0.08
	デンマーク	160,564.86	0.07
	シンガポール	146,274.78	0.07
	ベルギー	132,752.62	0.06
	フィンランド	76,293.81	0.03
	イスラエル	60,231.04	0.03
	ノルウェー	51,087.28	0.02
	バミューダ	48,821.92	0.02
	ルクセンブルグ	23,966.30	0.01
	オーストリア	14,673.42	0.01
	ポルトガル	13,107.34	0.01
	マカオ	10,745.21	0.00
	ジャージー島	3,901.70	0.00
	ニュージーランド	3,692.88	0.00
	小計	23,881,802.98	10.67
ポートフォリオ合計		216,624,583.51	96.82
現金・その他資産(負債控除後)		7,126,215.60	3.18
資産総額		223,750,799.11	100.00
負債総額		2,768,043.38	1.24
合計(純資産総額)		220,982,755.73 (約27,342百万円)	98.76

(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

2015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 (クラスP - a c c 投資証券)		1口当たり純資産価格 (クラス(日本円・ヘッジ) 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	円
2014年6月末日	154,224	19,082	153,518	18,995	13.96	1,727	-
7月末日	164,210	20,318	163,149	20,186	13.90	1,720	-
8月末日	175,301	21,690	172,916	21,395	14.10	1,745	-
9月末日	178,863	22,131	177,732	21,991	13.92	1,722	-
10月末日	182,334	22,560	181,343	22,438	14.03	1,736	-
11月末日	180,720	22,360	178,574	22,095	14.21	1,758	-
12月末日	178,395	22,073	176,660	21,858	14.11	1,746	-
2015年1月末日	186,657	23,095	185,492	22,951	14.09	1,743	-
2月末日	212,014	26,232	207,366	25,657	14.41	1,783	-
3月末日	216,722	26,815	214,674	26,562	14.43	1,785	-
4月末日	221,303	27,382	220,508	27,283	14.49	1,793	-
5月末日	223,751	27,685	220,983	27,342	14.54	1,799	-

(注) クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は2015年6月2日に設定された。

分配の推移

バランスド(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券 / クラス(日本円・ヘッジ) 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

2014年6月1日から2015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。

バランスド(米ドル)	収益率(%) (注)	
	クラスP - a c c 投資証券	5.21
	クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	-

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

a = 2015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 = 2014年5月末日現在の1口当たり純資産価格(分配前の額)

(注2) クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は2015年6月2日に設定された。

(3) 投資リスク

本書提出日現在、平成27年4月30日提出の有価証券報告書「第一部ファンド情報 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。

本投資法人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、その他本投資法人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」)

資本金(株主資本)の額

2015年4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27年5月末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=135.61円)による。

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」)

資本金(株主資本)の額

2015年4月末日現在の株主資本総額は、384,456,091スイスフラン(約504億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、平成27年5月末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=131.21円)による。

(2) 大株主の状況

UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(2015年5月末日現在)

名 称	住 所	所有株式数(株)	比率 (%)
ユービーエス・エイ・ジー (UBS AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、CH-8001 チューリッヒ、スイス および エッシェンフォアシュタット1、CH- 4051バーゼル、スイス	6,500	100

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)

該当事項なし。

(3) 役員の状況

UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2015年 5 月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレアス・シュラター (Andreas Schlatter)	チェアマン	ユービーエス・エイ・ジー、バーゼル・アンド・チューリッヒ、グループ・マネージング・ディレクター	該当なし
マリオ・クエニ (Mario Cueni)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	ユービーエス・エイ・ジー、バーゼル・アンド・チューリッヒ、グループ・マネージング・ディレクター	該当なし
マーティン・トメン (Martin Thommen)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	ユービーエス・エイ・ジー、バーゼル・アンド・チューリッヒ、マネージング・ディレクター	該当なし
ギルバート・シントゲン (Gilbert Schintgen)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ、ルクセンブルグ、マネージング・ディレクター	該当なし
クリスティアン・アイベル (Christian Eibel)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	ユービーエス・エイ・ジー、バーゼル・アンド・チューリッヒ、エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
アーンスト・アンド・ヤング・エス・エイ (Ernst & Young S.A.)	監査役	2014年 管理会社監査役に就任	該当なし

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)

(2015年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
セルジオ・ピー・エルモッティ (Sergio P. Ermotti)	ユービーエス・エイ・ジーグループ・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの任命 2011年ユービーエス・エイ・ジーへの任命	523,360株 (2013年12月31日現在)
アクセル・ウェーバー (Axel Weber)	ユービーエス・エイ・ジーチェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの選出 2012年ユービーエス・エイ・ジーへの選出	233,333株 (2013年12月31日現在)
ウルリッヒ・ケルナー (Ulrich Koerner)	UBS グローバル・アセット・マネジメント プレジデントおよび UBS グループ・ヨーロッパ・ミドル・イースト・アンド・アフリカプレジデント	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの任命 2009年ユービーエス・エイ・ジーへの任命	非公開
ジョン・レナード (John Leonard)	UBS グローバル・アセット・マネジメントエクイティ責任者	UBS グローバル・アセット・マネジメント上級経営委員会、エクイティ経営委員会、北米小委員会ならびにグローバル・コーポレート・ガバナンス委員会のメンバー 1991年UBS 入社	非公開
カリン・エルトリ (Karin Oertli)	グローバル・アセット・マネジメント・スイス責任者	UBS グローバル・アセット・マネジメント上級経営委員会、スイス・マネジメント委員会委員長およびUBS スイスマネジメント委員会会員 1966年UBS 入社	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

UBS ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ

管理会社の主な目的は、複数の要素から構成されるルクセンブルグまたは海外の法律に準拠する投資信託 (UCI) またはオルタナティブ投資信託運用者に関する法律2013年7月12日法の意味の範囲内におけるオルタナティブ投資信託 (AIF) のために、設立、販売、管理、運営ならびに助言を行い、当該UCIまたはAIFの証券発行または証券の表章もしくは記録の確認を行うことである。

2015年5月末日現在、管理会社は以下のとおり、262本のサブファンドの管理・運用を行っている。

国別 (設立国)	種類別 (基本的性格)	本数	純資産額の合計 (通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託 / 投資法人	262	1,279,712,909.19オーストラリア・ドル
			904,223,739.31カナダ・ドル
			14,995,056,987.65スイス・フラン
			473,916,770.97中国元
			36,854,225,323.88ユーロ
			2,194,724,799.86英ポンド
			125,257,568,212.28日本円
			57,066,469.57シンガポール・ドル
			62,671,162,464.73米ドル

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)

2015年5月末日現在、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) は126本のサブファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月25日	3,304,010,997
2	UBS(Lux)Bond Sicav - Convert Global(EUR)	変動資本を有する投資法人	2004年11月23日	3,092,825,107
3	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する投資法人	2006年10月26日	2,605,029,388
4	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield(CHF)	契約型投資信託	1991年9月10日	2,374,370,153
5	UBS(Lux)Strategy Xtra Sicav - Yield(CHF)	変動資本を有する投資法人	2004年6月25日	1,963,899,652
6	UBS(Lux)Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月9日	1,880,124,570
7	UBS(Lux)Institutional Fund - Key Selection Global Equity	契約型投資信託	2002年11月19日	1,788,707,306
8	UBS(Lux)Equity Fund - Biotech(USD)	契約型投資信託	1996年10月18日	1,628,271,619
9	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced(CHF)	契約型投資信託	1994年7月7日	1,538,102,464

10	UBS(Lux)Money Market Fund - CHF	契約型投資信託	1991年9月16日	1,484,002,262
----	------------------------------------	---------	------------	---------------

(注) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

[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 . ファンドの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(バランスト(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 . ファンドの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27年5月29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=123.73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

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)

純資産計算書

	2015年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	200,250,068.77	24,776,941
投資有価証券、未実現評価(損)益	14,805,812.24	1,831,923
投資有価証券合計(注1)	215,055,881.01	26,608,864
現金預金、要求払預金および預託金勘定	6,821,424.28	844,015
その他の流動資産(マージン)	919,986.83	113,830
有価証券売却未収金(注1)	13,779.53	1,705
発行未収金	130,501.87	16,147
有価証券に係る未収利息	452,134.65	55,943
流動資産に係る未収利息	203.80	25
配当金に係る未収金	45,404.11	5,618
その他の未収金	1,516.07	188
金融先物未実現(損)益(注1)	26,807.63	3,317
先渡為替契約未実現(損)益(注1)	(2,515,208.30)	(311,207)
スワップ未実現(損)益(注1)	350,442.80	43,360
資産合計	221,302,874.28	27,381,805
負 債		
当座借越に係る未払利息	(37.03)	(5)
有価証券購入未払金(注1)	(266,737.20)	(33,003)
買戻未払金	(325,560.71)	(40,282)
報酬引当金(注2)	(181,289.15)	(22,431)
年次税引当金(注3)	(21,049.62)	(2,604)
引当金合計	(202,338.77)	(25,035)
負債合計	(794,673.71)	(98,325)
期末現在純資産	220,508,200.57	27,283,480

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 - バランスド(米ドル)

運用計算書

自2014年11月1日 至2015年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,957.53	242
有価証券に係る利息	766,228.53	94,805
配当金	212,661.14	26,313
スワップに係る受取利息(注1)	143,282.58	17,728
貸付証券に係る収益(注13)	28,525.90	3,530
収益合計	1,152,655.68	142,618
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(5,977.31)	(740)
貸付証券に係るコスト(注13)	(11,410.36)	(1,412)
報酬(注2)	(1,908,630.10)	(236,155)
年次税(注3)	(29,026.80)	(3,591)
現金および当座借越に係る利息	(628.16)	(78)
費用合計	(1,955,672.73)	(241,975)
投資純(損)益	(803,017.05)	(99,357)
実現利益(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現利益	174,784.56	21,626
金融先物に係る実現利益	1,718,920.77	212,682
先渡為替契約に係る実現利益	6,317,420.90	781,654
スワップに係る実現利益	129,901.94	16,073
発行/買戻しに係る実現利益(注4)	56,304.42	6,967
為替差益	6,466,939.89	800,154
実現利益合計	14,864,272.48	1,839,156
実現損失(注1)		
無オプション市場価格証券に係る実現損失	(289,045.07)	(35,764)
金融先物に係る実現損失	(627,856.62)	(77,685)
先渡為替契約に係る実現損失	(1,117,812.17)	(138,307)
スワップに係る実現損失	(83,002.40)	(10,270)
為替差損	(6,096,170.56)	(754,279)
実現損失合計	(8,213,886.82)	(1,016,304)
当期実現純(損)益	5,847,368.61	723,495
未実現評価益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価益	18,511,132.21	2,290,382
金融先物に係る未実現評価益	33,414.29	4,134
スワップに係る未実現評価益	327,847.24	40,565
未実現評価益の変動合計	18,872,393.74	2,335,081
未実現評価損の変動(注1)		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価損	(14,002,540.91)	(1,732,534)
金融先物に係る未実現評価損	(379,086.71)	(46,904)
先渡為替契約に係る未実現評価損	(3,466,178.21)	(428,870)
スワップに係る未実現評価損	(507,187.96)	(62,754)
未実現評価損の変動合計	(18,354,993.79)	(2,271,063)
運用の結果による純資産の純増(減)	6,364,768.56	787,513

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 - バランスド (米ドル)

純資産変動計算書

	自2014年11月1日 至2015年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	181,342,553.95	22,437,514
発行額	54,504,128.08	6,743,796
買戻額	(21,703,250.02)	(2,685,343)
純発行(買戻)合計	32,800,878.06	4,058,453
投資純(損)益	(803,017.05)	(99,357)
実現利益合計	14,864,272.48	1,839,156
実現損失合計	(8,213,886.82)	(1,016,304)
未実現評価益の変動合計	18,872,393.74	2,335,081
未実現評価損の変動合計	(18,354,993.79)	(2,271,063)
運用の結果による純資産の純増(減)	6,364,768.56	787,513
期末現在純資産	220,508,200.57	27,283,480

発行済投資証券数の変動表

	自2014年11月1日 至2015年4月30日	
	(口)	
クラスP-acc		
期首現在発行済投資証券数	12,170,057.0140	
期中発行投資証券数	3,644,557.7430	
期中買戻投資証券数	(1,451,170.6670)	
期末現在発行済投資証券数	14,363,444.0900	
クラスP-dist		
期首現在発行済投資証券数	829,172.2510	
期中発行投資証券数	189,980.9850	
期中買戻投資証券数	(78,449.7390)	
期末現在発行済投資証券数	940,703.4970	

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 - バランスド (米ドル)

最重要数値

	ISIN	2015年4月30日	2014年10月31日	2013年10月31日
純資産額 (米ドル)		220 508 200.57	181 342 553.95	91 057 425.43
クラスP-acc	LU0200191152			
発行済投資証券数 (口)		14 363 444.0900	12 170 057.0140	6 431 531.4360
1口当たり純資産価格 (米ドル)		14.49	14.03	13.25
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		14.49	14.03	13.27
クラスP-dist	LU0234745577			
発行済投資証券数 (口)		940 703.4970	829 172.2510	482 974.3190
1口当たり純資産価格 (米ドル)		13.15	12.73	12.03
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		13.15	12.73	12.05

¹ 注記1を参照

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)

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	82.86
ユーロ	9.18
英ポンド	1.55
カナダ・ドル	1.22
日本円	0.94
豪ドル	0.94
スイス・フラン	0.40
香港ドル	0.14
スウェーデン・クローナ	0.13
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	0.02
合計	97.53

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	47.89
投資信託証券	13.55
財務省証券 (T-note)、固定利付債	12.22
無記名株式	9.98
債券、固定利付債	6.40
中期債券、固定利付債	4.24
ノート、固定利付債	2.38
記名株式	0.68
その他の株式	0.12
投資証券、クローズド・エンド型	0.03
優先株式	0.02
預託証券	0.02
合計	97.53

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

2015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属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評価スプレッドは、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。管理会社の取締役会は、各サブ・ファンドの限界値を設定することができる。これは、ファンドの純資産または該当するサブ・ファンドの通貨の絶対量に関して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資産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通常の取引がない証券、派生商品およびその他の資産について、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、規則的に運営され、公認され、公開され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および本投資法人の監査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の特定の受益証券または投資証券は、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。
- 証券取引所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は、関連する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。該当する注文日と該当する評価日の間にサブ・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。
- 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資産は、ルクセンブルグの為替相場の仲値（買呼値と売呼値の仲値）または、入手不能な場合は、当該通貨の最も代表的な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出入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。

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。

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2015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、2015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 = 1.049843 スイスフラン(CHF)

1 ユーロ = 1.120550 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)

	上限年率報酬
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「K - X」が付く投資証券クラス	0.000%
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（改訂済）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

2015年4月1日以降、以下の規則が、上記の各規定に取って代わった。

1. 本投資法人の運用、ポートフォリオの管理および販売（該当する場合）、ならびに保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、支払取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されているその他一切の職務等）に関して、管理会社は、本投資法人の資産から、本投資法人の純資産価額に基づく上限報酬料率を受領する。当該報酬は、純資産の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる（上限報酬料率）。

2. 上限報酬料率は、以下の報酬および本投資法人にも請求される追加費用を含まない。

- a) 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用(市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値スプレッド、仲介手数料)。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくシングル・スイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
- b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
- c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの事務管理に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われ、かつ法律によって許可される一切のその他の報酬。
- d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト(翻訳コストを含む)。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト(目論見書、KIID、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む)。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利により生じた費用(外部顧問報酬を含む)。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じる費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求できる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、当該コストは、証明可能かつ開示されており、本投資法人の総費用比率(TER)の開示において考慮される。

3. 管理会社は、本投資法人の販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。

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。

定率管理報酬を有していない他のファンドのプロバイダーの報酬規定との一般的な比較可能性の目的のために、管理報酬の上限は、定率管理報酬の80%で設定している。

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 - 金融先物およびスワップの契約債務

2015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およびスワップに係る契約債務は、以下のように要約できる。

a) 金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ	債券関連金融先物	
	(購入)	(売却)
- バランスド (米ドル)	5 006 625.00 米ドル	- 米ドル
UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ	指数関連金融先物	
	(購入)	(売却)
- バランスド (米ドル)	15 795 508.18 米ドル	2 768 516.60 米ドル

b) スワップ

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ	クレジット・デフォルト・スワップ	
	(購入)	(売却)
- バランスド (米ドル)	- 米ドル	6 055 847.24 米ドル

注7 - ソフト・コミッション取決め

2014年11月1日から2015年4月30日までの期間中に、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	2.08%
- バランスド (米ドル) P - d i s t	2.08%

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)	-7.02%

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。

ISIN	有価証券
PTBES0AM0007	BCO ESPIRITO SANTO EUR
BE0005582532	ANHEUSER - BUSCH INBEV STRIP
IE00B06H8J93	IRISH BK RESOL CP COM EURO.16
AT0000A0GYT7	IMMOEAST RTS PRP

注11 - レバレッジ (未監査)

以下は、2013年7月12日付の法律により要求される投資者に対するレバレッジの開示に従った2015年4月30日終了期間におけるレバレッジの水準である。

サブ・ファンド	コミットメント・メソッド (%)	グロス・メソッド (%)
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)	131.82	136.49

注12 - 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13 - 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。

UBS (ルクセンブルグ) エス・エイは、証券の貸付機関として行為する。

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ	時価
- バランスド(米ドル)	37 556 209.71 米ドル

(2) 投資有価証券明細表等

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)

2015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 / 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 (%)
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	356.00	4 265.28	0.00
AUD ALS LIMITED NPV	369.00	1 533.83	0.00
AUD AMCOR LIMITED NPV	1 310.00	13 980.04	0.01
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	675.00	3 428.70	0.00
AUD APA GROUP NPV	1 494.00	11 312.57	0.01
AUD ASX LTD NPV	128.00	4 255.46	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	2 100.00	56 300.19	0.03
AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	542.00	5 168.51	0.00
AUD BHP BILLITON LTD NPV	2 437.00	61 452.21	0.03
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	504.00	5 175.84	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 664.00	14 214.16	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	178.00	4 974.28	0.00
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	80.00	1 330.78	0.00
AUD CMNWLT BK OF AUST NPV	1 198.00	83 975.27	0.04
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	394.00	3 191.58	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	45.00	2 968.34	0.00
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	382.00	3 709.03	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	255.00	2 616.72	0.00
AUD CSL NPV	400.00	28 704.19	0.01
AUD DEXUS PROPERTY GP NPV (STAPLED)	1 386.00	8 067.87	0.00
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	71.00	2 432.13	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	772.00	1 321.35	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 748.00	8 617.09	0.01
AUD ILUKA RESOURCES NPV	169.00	1 087.72	0.00
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 093.00	3 439.80	0.00
AUD LEND LEASE GROUP NPV	572.00	7 241.20	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	173.00	10 639.30	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	1 817.00	52 697.25	0.02
AUD NEWCREST MINING NPV	804.00	9 163.54	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	444.00	7 074.14	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	555.00	5 577.01	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	1 187.00	3 173.87	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	1 405.00	15 182.25	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	97.00	4 788.68	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	95.00	3 539.00	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	329.00	14 830.35	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	480.00	3 142.38	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	3 381.00	9 973.70	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	336.00	4 306.58	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	313.00	4 905.48	0.00
AUD SUNCORP GROUP	1 308.00	13 535.71	0.01
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	184.00	782.25	0.00
AUD TELSTRA CORP NPV	2 356.00	11 577.18	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	1 048.00	8 199.97	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	762.00	26 270.91	0.01
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	1 966.00	14 653.95	0.01
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	2 340.00	67 293.31	0.03
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	499.00	13 795.20	0.01
AUD WOOLWORTHS LTD NPV	862.00	20 043.53	0.01
AUD WORLEYPARSONS LTD NPV	340.00	3 070.60	0.00
オーストラリア合計		672 980.28	0.31

オーストリア

EUR	ANDRITZ AG NPV(BR)	68.00	3 977.50	0.00
EUR	ERSTE GROUP BK AG NPV	158.00	4 493.45	0.01
EUR	OMV AG NPV(VAR)	113.00	3 767.01	0.00
EUR	VOESTALPINE AG NPV	65.00	2 725.51	0.00

オーストリア合計			14 963.47	0.01
-----------------	--	--	------------------	-------------

ベルギー

EUR	AGEAS NPV (POST SPLIT)	162.00	6 084.86	0.00
EUR	ANHEUSER-BUSCH INB NPV	598.00	72 972.68	0.03
EUR	BELGACOM SA NPV	228.00	8 508.95	0.01
EUR	COLRUYT SA NPV	66.00	3 120.22	0.00
EUR	DELHAIZE GROUP NPV	59.00	4 766.05	0.00
EUR	GPE BRUXELLES LAM NPV	53.00	4 652.55	0.00
EUR	KBC GROUP NV NPV	226.00	14 911.02	0.01
EUR	SOLVAY SA NPV	60.00	8 847.87	0.01
EUR	TELENET GRP HLDG NPV	62.00	3 719.64	0.00
EUR	UCB NPV	52.00	3 747.84	0.00
EUR	UMICORE NPV	80.00	3 977.06	0.00

ベルギー合計			135 308.74	0.06
---------------	--	--	-------------------	-------------

バミューダ

USD	ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	77.00	4 672.36	0.00
USD	AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	100.00	5 206.00	0.00
USD	MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	300.00	4 203.00	0.00
USD	NABORS INDS LTD COM USD0.001	200.00	3 340.00	0.00
USD	PARTNERRE LTD COM USD1	67.00	8 576.00	0.01
USD	RENAISSANCE RE HLG COM USD1	54.00	5 534.46	0.00
NOK	SEADRILL LTD USD2	331.00	4 172.91	0.00
USD	SIGNET JEWELERS LT ORD USD0.18	100.00	13 413.00	0.01

バーミューダ合計			49 117.73	0.02
-----------------	--	--	------------------	-------------

カナダ

CAD	AGNICO EAGLE MINES LTD COM	101.00	3 045.22	0.00
CAD	AGRIUM INC COM NPV	129.00	13 312.69	0.01

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 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 （％）
CAD	ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	333.00	12 695.93	0.01
CAD	ALTAGAS LTD COM NPV	100.00	3 384.93	0.00
CAD	ARC RESOURCES COM NPV	149.00	3 037.20	0.00
CAD	BANK MONTREAL QUE COM	527.00	34 293.62	0.02
CAD	BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	940.00	51 631.12	0.02
CAD	BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 181.00	15 288.40	0.01
CAD	BAYTEX ENERGY CORP COM NPV	100.00	1 945.92	0.00
CAD	BCE INC COM NEW	215.00	9 441.36	0.01
CAD	BLACKBERRY LTD NPV	200.00	2 022.70	0.00
CAD	BOMBARDIER INC CLASS ' B ' SUB-VTG NPV	900.00	1 813.00	0.00
CAD	BROOKFIELD ASSET MGMT INC CL A LTD VT SH	459.00	24 620.21	0.01
CAD	CAE INC COM	277.00	3 423.48	0.00
CAD	CAMECO CORP COM	182.00	3 188.48	0.00
CAD	CAN PACIFIC RYS COM NPV	138.00	26 207.75	0.01
CAD	CANADIAN NAT RES LTD COM	899.00	29 755.14	0.01
CAD	CANADIAN NATL RY CO COM	633.00	40 710.59	0.02
CAD	CANADIAN OIL SANDS COM NPV	200.00	2 164.70	0.00
CAD	CANADIAN UTILS LTD CL A	109.00	3 527.60	0.00
CAD	CATAMARAN CORP COM NPV	100.00	5 914.55	0.00
CAD	CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	340.00	27 194.39	0.01
CAD	CENOVUS ENERGY INC COM NPV	489.00	9 176.45	0.01
CAD	CGI GROUP INC ' A ' SUB-VTG NPV	178.00	7 462.41	0.00
CAD	CI FINANCIAL CORP COM NPV	191.00	5 591.63	0.00
CAD	CRESCENT POINT EN COM NPV	210.00	5 463.03	0.00
CAD	ELDORADO GOLD CORP NEW COM	300.00	1 488.54	0.00
CAD	ENBRIDGE INC COM	670.00	34 881.49	0.02
CAD	ENCANA CORP COM NPV	573.00	8 103.60	0.01
CAD	ENERPLUS CORP COM NPV	198.00	2 494.51	0.00
CAD	FINNING INTL INC COM NEW	203.00	4 142.96	0.00
CAD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	447.00	6 819.86	0.00
CAD	FORTIS INC COM	334.00	10 828.63	0.01
CAD	FRANCO NEVADA CORP COM NPV	75.00	3 878.64	0.00
CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	200.00	6 314.14	0.00
CAD	GOLDCORP INC NEW COM	557.00	10 443.32	0.01
CAD	GREAT WEST LIFECO INC COM	127.00	3 880.51	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	200.00	4 454.90	0.00
CAD	IGM FINANCIAL INC COM	124.00	4 671.31	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	118.00	5 180.80	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	60.00	4 603.34	0.00
CAD	INTER PIPELINE LTD COM NPV	200.00	5 217.75	0.00
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NO PAR	500.00	1 209.49	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	125.00	6 329.21	0.00
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	110.00	7 000.40	0.00
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	200.00	10 039.22	0.01
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	1 539.00	27 902.12	0.01
CAD	MEG ENERGY CORP COM NPV	169.00	3 246.75	0.00
CAD	METHANEX CORP COM	100.00	5 994.63	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	300.00	8 639.01	0.01
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	200.00	8 049.54	0.01
CAD	NEW GOLD INC COM NPV	300.00	1 003.10	0.00
CAD	OPEN TEXT CORP COM	100.00	5 032.82	0.00
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	208.00	7 210.67	0.00
CAD	POTASH CORP SASK INC COM	549.00	17 858.08	0.01
CAD	POWER CORP CDA COM	364.00	9 962.11	0.01
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	163.00	5 022.22	0.00
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	88.00	3 588.64	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	288.00	10 247.93	0.01
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	1 083.00	71 627.76	0.03
CAD	SAPUTO INC COM	200.00	5 902.99	0.00
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	401.00	9 130.72	0.01
CAD	SILVER WHEATON CORP COM	200.00	3 929.82	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	100.00	3 591.33	0.00
CAD	SUN LIFE FINL INC COM	566.00	18 041.91	0.01
CAD	SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	1 146.00	37 173.45	0.02
CAD	TALISMAN ENERGY INC COM	1 192.00	9 476.95	0.01
CAD	TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	495.00	7 474.55	0.00

CAD	TORONTO-DOMINION COM NPV	1	394.00	64	103.86	0.03
CAD	TOURMALINE OIL CP COM NPV		88.00	3	025.24	0.00
CAD	TRANSCANADA CORP COM NPV		473.00	21	868.32	0.01
CAD	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV		230.00	49	680.00	0.02
CAD	VERMILION ENERGY I COM NPV		100.00	4	795.05	0.00
CAD	YAMANA GOLD INC COM		400.00	1	522.39	0.00
カナダ合計				913	397.08	0.41

デンマーク

DKK	A.P.MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000		5.00	9	917.42	0.01
DKK	A.P.MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000		4.00	7	711.71	0.00
DKK	CARLSBERG SER ' B ' DKK20		60.00	5	468.47	0.00
DKK	COLOPLAST DKK1 B		67.00	5	472.67	0.00
DKK	DANSKE BANK A/S DKK10		630.00	17	878.38	0.01
DKK	DSV DKK1		116.00	4	028.65	0.00
DKK	NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	1	504.00	85	520.24	0.04
DKK	NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)		113.00	5	222.43	0.00
DKK	PANDORA A/S DKK1		77.00	7	971.70	0.01
DKK	TDC A/S DKK1		305.00	2	321.85	0.00
DKK	TRYG A/S DKK25		39.00	4	230.85	0.00
DKK	VESTAS WIND SYSTEM DKK1		142.00	6	462.49	0.00

デンマーク合計 **162** **206.86** **0.07**

フィンランド

EUR	ELISA CORPORATION EURO.50		138.00	4	220.01	0.00
EUR	FORTUM OYJ EUR3.40		221.00	4	383.26	0.00
EUR	KONE CORPORATION NPV ORD ' B '		265.00	11	423.50	0.01
EUR	METSO OYJ EUR1.70		83.00	2	365.13	0.00
EUR	NESTE OIL OYJ NPV		243.00	6	605.84	0.00
EUR	NOKIA OYJ EURO.06	2	243.00	15	193.47	0.01

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 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 (%)
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	88.00	2 870.49	0.00
EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV	285.00	13 847.31	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	505.00	5 336.23	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	307.00	5 576.38	0.00
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	110.00	5 053.68	0.00
フィンランド合計		76 875.30	0.03
フランス			
EUR ACCOR EUR3	100.00	5 489.57	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	211.00	27 615.73	0.01
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	481.00	33 417.04	0.02
EUR ALCATEL-LUCENT EURO.05	1 600.00	5 649.36	0.00
EUR ALSTOM EUR7.00	209.00	6 565.66	0.00
EUR ARKEMA EUR10	40.00	3 223.60	0.00
EUR ATOS EUR1	73.00	5 713.74	0.00
EUR AXA EUR2.29	1 025.00	25 974.77	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	776.00	49 077.22	0.02
EUR BOUYGUES EUR1	88.00	3 641.61	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	217.00	5 112.43	0.00
EUR CAP GEMINI EUR8	97.00	8 641.12	0.00
EUR CARREFOUR EUR2.50	523.00	18 044.41	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	46.00	4 072.08	0.00
EUR CHRISTIAN DIOR EUR2	20.00	3 921.93	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	315.00	14 366.01	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	549.00	8 554.11	0.00
EUR DANONE EURO.25	444.00	32 095.29	0.02
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	62.00	4 779.82	0.00
EUR EDENRED EUR2	139.00	3 723.36	0.00
EUR EDF EURO.5	109.00	2 776.24	0.00
EUR ESSILOR INTL EURO.18	107.00	13 039.00	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	91.00	3 169.23	0.00
EUR GDF SUEZ EUR1	1 121.00	22 867.97	0.01
EUR GPE EUROTUNNEL SE EURO.40	333.00	5 334.09	0.00
EUR HERMES INTL NPV	27.00	10 197.40	0.01
EUR ILIAD NPV	21.00	4 949.86	0.00
EUR KERING EUR4	52.00	9 617.23	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	75.00	3 638.99	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	165.00	31 514.63	0.02
EUR LAFARGE EUR4	107.00	7 832.99	0.00
EUR LEGRAND SA EUR4	170.00	9 837.09	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	157.00	27 550.07	0.01
EUR NATIXIS EUR1.6	621.00	5 139.64	0.00
EUR ORANGE EUR4	1 044.00	17 243.65	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	157.00	19 527.82	0.01
EUR PEUGEOT SA EUR1	464.00	8 786.90	0.00
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	139.00	11 659.93	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	106.00	11 177.04	0.01
EUR REXEL EUR5	149.00	2 809.97	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	214.00	15 646.80	0.01
EUR SANOFI EUR2	845.00	86 354.07	0.04
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	381.00	28 535.97	0.01
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	251.00	9 036.82	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	441.00	22 091.54	0.01
EUR SODEXO EUR4	107.00	10 829.27	0.01
EUR SUEZ ENVIRONNEMENT EUR4	204.00	4 160.38	0.00
EUR TECHNIP NPV	58.00	3 956.06	0.00
EUR THALES EUR3	89.00	5 409.30	0.00
EUR TOTAL EUR2.5	1 508.00	81 929.44	0.04
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	73.00	20 163.74	0.01
EUR VALEO EUR3	81.00	13 006.56	0.01
EUR VALLOUREC USIN A T EUR2 (POST SUBDIVISION)	63.00	1 482.49	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	294.00	6 233.04	0.00
EUR VINCI EUR2.50	419.00	25 738.56	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	706.00	17 732.69	0.01
EUR WENDEL EUR4	62.00	7 614.36	0.00
EUR ZODIAC AEROSPACE	184.00	6 756.56	0.00

フランス合計		865 026.25	0.39
---------------	--	-------------------	-------------

ドイツ

EUR	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	211.00	25 085.86	0.01
EUR	BEIERSDORF AG NPV	60.00	5 241.48	0.00
EUR	COMMERZBANK AG NPV	692.00	9 417.49	0.01
EUR	CONTINENTAL AG ORD NPV	74.00	17 467.25	0.01
EUR	DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	310.00	8 145.84	0.00
EUR	FRESENIUS MED CARE NPV	206.00	17 365.59	0.01
EUR	FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV	279.00	16 704.01	0.01
EUR	GEA GROUP AG NPV	89.00	4 305.80	0.00
EUR	HEIDELBERGCEMENT NPV	72.00	5 554.79	0.00
EUR	HENKEL AG & CO KGAA	107.00	10 861.63	0.01
EUR	LANXESS AG NPV	56.00	3 004.19	0.00
EUR	LINDE AG NPV	147.00	28 793.20	0.01
EUR	MAN SE ORD NPV	30.00	3 254.41	0.00
EUR	MERCK KGAA NPV	62.00	6 724.40	0.00
EUR	METRO AG ORD NPV	89.00	3 226.74	0.00
EUR	RWE AG (NEU) NPV	240.00	5 994.49	0.00
EUR	SAP AG ORD NPV	703.00	53 511.63	0.03
EUR	SYMRISE AG	137.00	8 360.45	0.01
EUR	TELEFONICA DEUTSCH NPV	1 240.00	7 724.13	0.00
EUR	THYSSENKRUPP AG NPV	372.00	9 945.91	0.01
EUR	VOLKSWAGEN AG ORD NPV	24.00	6 112.83	0.00

ドイツ合計		256 802.12	0.12
--------------	--	-------------------	-------------

香港

HKD	AIA GROUP LTD USD1.00	7 000.00	46 780.16	0.02
HKD	BOC HONG KONG HLDG HKD5	2 000.00	7 779.49	0.00
HKD	CHEUNG KONG INFSTR HKD1	1 000.00	8 489.06	0.01
HKD	CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	1 000.00	21 738.71	0.01

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 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 (%)
HKD CLP HOLDINGS HKD5	2 000.00	17 532.88	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	2 000.00	9 675.98	0.01
HKD HANG SENG BANK HKD5	800.00	15 615.75	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 000.00	8 037.52	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	807.00	30 880.09	0.02
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	3 531.00	8 427.59	0.00
HKD HUTCHISON WHAMPOA HKD0.25	2 000.00	29 466.60	0.01
HKD LI & FUNG HKD0.0125	8 000.00	8 163.95	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	100.00	6 186.00	0.00
HKD MTR CORP HKD1	1 500.00	7 392.45	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	4 625.00	6 145.86	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 000.00	10 121.08	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	2 484.00	4 390.42	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP HKD0.50	1 047.00	17 438.41	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	6 766.74	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 500.00	9 317.97	0.01
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	7 231.19	0.00
HKD WHEELLOCK & COMPANY HKD0.50	1 000.00	5 650.77	0.00
香港合計		293 228.67	0.13
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	470.00	43 545.50	0.02
USD ACTAVIS PLC EUR1	258.00	72 977.88	0.03
EUR CRH ORD EURO.32(DUBLIN LISTING)	382.00	10 750.48	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	371.00	25 498.83	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	583.00	10 464.41	0.00
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	214.00	14 089.76	0.01
USD MALLINCKRODT PLC USD0.20	100.00	11 318.00	0.01
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	147.00	9 136.05	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	200.00	11 744.00	0.01
GBP SHIRE ORD GBPO.05	365.00	29 924.75	0.01
USD XL GROUP PLC USD0.01	200.00	7 416.00	0.00
アイルランド合計		246 865.66	0.11
イスラエル			
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	720.00	3 605.78	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	3 914.00	7 417.13	0.01
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 477.00	5 745.46	0.00
ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1	439.00	3 073.39	0.00
ILS TEVA PHARMA IND ILS0.1 (POST CONS)	230.00	14 048.35	0.01
イスラエル合計		33 890.11	0.02
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	717.00	14 044.03	0.01
EUR ATLANTIA SPA EUR1	203.00	5 718.64	0.00
EUR BCA MPS NPV (POST REVERSE SPLIT)	3 218.00	1 994.08	0.00
EUR ENEL EUR1	3 686.00	17 496.16	0.01
EUR ENI SPA EUR1	1 511.00	29 088.34	0.01
EUR FINMECCANICA SPA EUR4.40	324.00	4 157.02	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	6 874.00	23 231.22	0.01
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	108.00	7 140.15	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	449.00	4 387.27	0.00
EUR PIRELLI & CO (AZ ORD POST RAGRR)	484.00	8 379.25	0.01
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	357.00	7 320.67	0.01
EUR SAIPEM EUR1	141.00	1 873.85	0.00
EUR SNAM EUR1	1 683.00	8 780.69	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	7 324.00	7 057.94	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	5 084.00	6 033.00	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	951.00	4 490.62	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV	3 743.00	27 052.71	0.01
EUR UNIONE DI BANCHE I EUR2.50	615.00	4 913.55	0.00
イタリア合計		183 159.19	0.08
日本			
JPY イオン	400.00	4 983.71	0.00
JPY イオンフィナンシャルサービス	300.00	7 683.63	0.00
JPY イオンモール	110.00	2 059.00	0.00
JPY アイシン精機	100.00	4 587.62	0.00

JPY	味の素	1 000.00	22 236.15	0.01
JPY	旭硝子	1 000.00	6 735.19	0.00
JPY	アサヒグループホールディングス	300.00	9 665.33	0.01
JPY	旭化成	1 000.00	9 459.35	0.01
JPY	アシックス	300.00	7 696.16	0.00
JPY	アステラス製薬	1 400.00	21 870.98	0.01
JPY	バンダイナムコホールディングス	200.00	4 114.65	0.00
JPY	ベネッセホールディングス	100.00	3 133.62	0.00
JPY	横浜銀行	1 000.00	6 380.88	0.00
JPY	ブリヂストン	500.00	20 978.52	0.01
JPY	ブラザー工業	300.00	4 810.73	0.00
JPY	カルビー	100.00	4 077.88	0.00
JPY	キヤノン	900.00	32 211.08	0.02
JPY	カシオ計算機	300.00	6 104.29	0.00
JPY	東海旅客鉄道	100.00	17 928.47	0.01
JPY	中部電力	300.00	3 977.19	0.00
JPY	中外製薬	200.00	6 108.46	0.00
JPY	中国銀行	400.00	6 444.39	0.00
JPY	中国電力	400.00	5 856.10	0.00
JPY	クレディセゾン	100.00	1 901.06	0.00
JPY	大日本印刷	1 000.00	10 382.72	0.01
JPY	第一生命保険	1 100.00	18 144.90	0.01
JPY	ダイハツ工業	300.00	4 351.97	0.00
JPY	第一三共	400.00	6 970.84	0.00
JPY	ダイキン工業	200.00	13 543.91	0.01
JPY	大東建託	100.00	11 677.95	0.01
JPY	大和ハウス工業	700.00	15 664.74	0.01
JPY	大和証券グループ本社	1 000.00	8 356.31	0.01

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 先物/オプション/ 先渡し為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
JPY デンソー	200.00	9 967.41	0.01
JPY 電通	100.00	4 662.82	0.00
JPY ドンキホーテホールディングス	100.00	7 620.96	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	300.00	26 560.54	0.01
JPY エーザイ	200.00	13 423.58	0.01
JPY ファミリーマート	100.00	4 311.86	0.00
JPY ファナック	200.00	44 330.24	0.02
JPY 富士フイルムホールディングス	400.00	15 158.35	0.01
JPY 富士重工業	500.00	16 814.99	0.01
JPY 富士通	1 000.00	6 628.23	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	1 000.00	6 049.97	0.00
JPY 日野自動車	400.00	5 247.76	0.00
JPY 久光製薬	100.00	4 320.21	0.00
JPY 日立化成工業	100.00	1 942.84	0.00
JPY 日立建機	100.00	1 782.40	0.00
JPY 日立製作所	4 000.00	27 385.31	0.01
JPY 北陸電力	100.00	1 482.41	0.00
JPY 本田技研工業	1 100.00	37 149.24	0.02
JPY HOYA	300.00	11 634.49	0.01
JPY ヒューリック	200.00	2 154.26	0.00
JPY イビデン	100.00	1 754.83	0.00
JPY 国際石油開発帝石	800.00	10 094.43	0.01
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	400.00	6 497.87	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	6 657.89	0.00
JPY 伊藤忠商事	1 500.00	18 551.02	0.01
JPY 日本取引所グループ	100.00	2 916.35	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	2.00	4 261.72	0.00
JPY 日本たばこ産業	700.00	24 631.90	0.01
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	500.00	11 322.81	0.01
JPY JSR	200.00	3 427.76	0.00
JPY ジェイテクト	100.00	1 713.04	0.00
JPY JXホールディングス	2 800.00	12 229.97	0.01
JPY カカクコムINC NPV	200.00	3 106.88	0.00
JPY 関西電力	400.00	4 034.43	0.00
JPY 花王	500.00	24 020.22	0.01
JPY KDDI	1 200.00	28 478.32	0.01
JPY キリンホールディングス	600.00	7 951.87	0.01
JPY 小糸製作所	200.00	7 052.73	0.00
JPY 小松製作所	700.00	14 161.44	0.01
JPY コナミ	100.00	1 845.91	0.00
JPY コニカミノルタ	500.00	5 552.77	0.00
JPY クボタ	1 000.00	15 680.62	0.01
JPY クラレ	300.00	4 076.21	0.00
JPY 栗田工業	200.00	5 214.34	0.00
JPY 京セラ	200.00	10 480.49	0.01
JPY 九州電力	300.00	3 201.30	0.00
JPY LIXILグループ	200.00	4 183.17	0.00
JPY エムスリー	400.00	7 574.16	0.00
JPY マキタ	100.00	5 038.86	0.00
JPY 丸紅	1 000.00	6 215.42	0.00
JPY マツダ	600.00	11 799.95	0.01
JPY メディカルホールディングス	200.00	2 742.54	0.00
JPY 明治ホールディングス	100.00	11 464.86	0.01
JPY 三菱ケミカルホールディングス	1 800.00	11 240.41	0.01
JPY 三菱商事	700.00	15 152.92	0.01
JPY 三菱電機	2 000.00	26 138.55	0.01
JPY 三菱地所	1 000.00	23 589.87	0.01
JPY 三菱重工業	2 000.00	11 159.02	0.01
JPY 三菱自動車工業	400.00	3 700.18	0.00
JPY 田辺三菱製薬	300.00	5 101.53	0.00
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	8 100.00	57 932.56	0.03
JPY 三井物産	1 000.00	14 042.78	0.01
JPY 三井不動産	1 000.00	29 761.01	0.01
JPY 商船三井	1 000.00	3 534.72	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	16 200.00	30 959.64	0.02
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	8 629.98	0.01

JPY	村田製作所	200.00	28 361.33	0.01
JPY	ナブテスコ	300.00	8 285.28	0.01
JPY	日本電気	2 000.00	6 718.48	0.00
JPY	日本電産	200.00	14 974.51	0.01
JPY	ニコン	500.00	7 111.22	0.00
JPY	任天堂	100.00	16 980.03	0.01
JPY	新日鐵住金	4 470.00	11 691.40	0.01
JPY	日本電信電話	300.00	20 265.73	0.01
JPY	日本郵船	1 000.00	3 158.69	0.00
JPY	日産自動車	2 300.00	24 043.62	0.01
JPY	日清製粉グループ本社	550.00	6 452.75	0.00
JPY	日清食品ホールディングス	100.00	4 796.52	0.00
JPY	ニトリホールディングス	100.00	7 704.52	0.00
JPY	日東電工	100.00	6 431.85	0.00
JPY	NOK	100.00	3 171.22	0.00
JPY	野村ホールディングス	1 700.00	10 986.71	0.01
JPY	野村不動産ホールディングス	200.00	4 081.22	0.00
JPY	日本精工	1 000.00	15 760.01	0.01
JPY	NTTドコモ	1 100.00	19 532.88	0.01
JPY	NTT都市開発	200.00	2 100.78	0.00
JPY	小田急電鉄	1 000.00	10 086.07	0.01
JPY	オリンパス	200.00	7 253.28	0.00
JPY	オムロン	100.00	4 612.68	0.00
JPY	小野薬品工業	100.00	10 838.14	0.01
JPY	オリエンタルランド	400.00	27 101.20	0.01
JPY	オリックス	1 000.00	15 496.78	0.01
JPY	大阪ガス	1 000.00	4 255.03	0.00
JPY	大塚ホールディングス	200.00	6 339.93	0.00
JPY	パナソニック	1 500.00	21 609.43	0.01
JPY	パーク 2 4	200.00	3 999.33	0.00
JPY	楽天	500.00	8 759.51	0.01
JPY	りそなホールディングス	2 500.00	13 405.62	0.01

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 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 (%)
JPY リコー	300.00	3 133.62	0.00
JPY ローム	100.00	6 969.17	0.00
JPY SANKYO	100.00	3 789.59	0.00
JPY SBIホールディングス	330.00	4 414.89	0.00
JPY セコム	200.00	14 192.36	0.01
JPY セガサミーホールディングス	200.00	2 802.71	0.00
JPY 積水ハウス	300.00	4 679.12	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	500.00	21 621.96	0.01
JPY シャープ	1 000.00	2 172.65	0.00
JPY シマノ	100.00	14 297.65	0.01
JPY 信越化学工業	300.00	18 438.21	0.01
JPY 塩野義製薬	200.00	6 593.13	0.00
JPY 資生堂	200.00	3 614.11	0.00
JPY 静岡銀行	1 000.00	11 063.76	0.01
JPY 昭和シェル石油	300.00	2 902.98	0.00
JPY ソフトバンク	700.00	43 899.89	0.02
JPY 損保ジャパン日本興亜ホールディングス	250.00	8 210.08	0.01
JPY ソニー	800.00	24 363.67	0.01
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 609.93	0.00
JPY スタンレー電気	200.00	4 517.42	0.00
JPY 住友商事	600.00	7 112.06	0.00
JPY 住友電気工業	400.00	5 675.61	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	900.00	39 423.41	0.02
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	3 000.00	13 294.06	0.01
JPY 住友ゴム工業	200.00	3 711.87	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	8 540.15	0.01
JPY スルガ銀行	400.00	8 871.06	0.01
JPY スズキ	200.00	6 488.68	0.00
JPY T&Dホールディングス	500.00	7 247.01	0.00
JPY 武田薬品工業	600.00	30 869.89	0.02
JPY TDK	100.00	7 228.21	0.00
JPY テルモ	200.00	5 164.20	0.00
JPY THK	200.00	5 080.64	0.00
JPY トーホー	100.00	2 491.02	0.00
JPY 東北電力	300.00	3 777.89	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	500.00	20 477.15	0.01
JPY 東京電力	600.00	2 456.76	0.00
JPY 東京エレクトロン	100.00	5 515.17	0.00
JPY 東京瓦斯	2 000.00	11 573.49	0.01
JPY 東京急行電鉄	1 000.00	6 676.69	0.00
JPY 東急不動産ホールディングス	300.00	2 236.15	0.00
JPY 東レ	1 000.00	8 703.10	0.01
JPY 東芝	2 000.00	8 042.12	0.01
JPY 東洋製罐グループホールディングス	200.00	3 178.74	0.00
JPY 豊田合成	200.00	4 647.78	0.00
JPY 豊田自動織機	100.00	5 699.01	0.00
JPY トヨタ自動車	1 900.00	132 699.92	0.06
JPY 豊田通商	200.00	5 164.20	0.00
JPY ユニ・チャーム	300.00	7 560.79	0.00
JPY ユー・エス・エス	300.00	5 304.59	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	100.00	5 549.43	0.00
JPY ヤフー	700.00	2 872.06	0.00
JPY ヤクルト本社	100.00	6 292.30	0.00
JPY ヤマダ電機	600.00	2 461.77	0.00
JPY ヤマハ	200.00	3 641.68	0.00
JPY ヤマハ発動機	100.00	2 365.67	0.00
JPY ヤマトホールディングス	200.00	4 494.03	0.00
JPY 横河電機	500.00	5 857.78	0.00
日本合計		2 067 703.69	0.94
ジャージー			
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	54.00	4 119.35	0.00
ジャージー合計		4 119.35	0.00
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG ' S '	2 000.00	8 192.33	0.01

HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10

1 600.00

3 257.32

0.00

マカオ合計**11 449.65****0.01****オランダ**

EUR	AEGON NV	1 190.00	9 420.86	0.01
EUR	AHOLD(KON)NV EURO.01	628.00	12 174.10	0.01
EUR	AKZO NOBEL NV EUR2	234.00	17 940.32	0.01
EUR	ASML HOLDING NV EURO.09	231.00	25 033.10	0.01
EUR	CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	458.00	4 036.41	0.00
USD	CORE LABORATORIES ORD EURO.01	100.00	13 128.00	0.01
EUR	DELTA LLOYD NV EURO.20	246.00	4 648.93	0.00
EUR	FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	511.00	7 644.22	0.00
EUR	GEMALTO EUR1	32.00	2 979.76	0.00
EUR	HEINEKEN HOLDING EUR1.6	64.00	4 463.55	0.00
EUR	HEINEKEN NV EUR1.60	139.00	10 959.02	0.01
EUR	KON KPN NV EURO.24	3 410.00	12 643.94	0.01
EUR	KONINKLIJKE BOSKAL EURO.80	79.00	4 116.34	0.00
EUR	KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	146.00	8 335.43	0.00
EUR	KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	653.00	18 772.26	0.01
EUR	RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	61.00	3 643.24	0.00
EUR	REED ELSEVIER ORD EURO.07	524.00	12 644.67	0.01
GBP	ROYAL DUTCH SHELL ' B ' SHS EURO.07 (UK LIST)	1 627.00	52 368.63	0.02
GBP	ROYAL DUTCH SHELL PLC ' A ' SHS EURO.07	2 753.00	87 130.71	0.04
USD	SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	100.00	5 521.00	0.00
EUR	TNT EXPRESS NV EURO.08	285.00	2 433.50	0.00
EUR	VOPAK(KON) EURO.50	129.00	6 770.77	0.00
EUR	WOLTERS KLUWER EURO.12	142.00	4 601.70	0.00

オランダ合計**331 410.46****0.15**

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 先物/オプション/ 先渡し為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ニュージーランド			
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	1 877.00	4 244.29	0.00
ニュージーランド合計		4 244.29	0.00
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	543.00	9 655.90	0.00
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	406.00	7 063.45	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	826.00	3 901.18	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	388.00	3 043.03	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	705.00	14 875.59	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	437.00	9 876.07	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	107.00	5 486.67	0.00
ノルウェー合計		53 901.89	0.02
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	243.00	3 319.26	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	379.00	5 531.57	0.00
ポルトガル合計		8 850.83	0.00
シンガポール			
USD AV TECH CORP NPV	177.00	20 687.76	0.01
SGD CITY DEVELOPMENTS SGDO.50	1 000.00	8 055.57	0.01
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	1 140.00	18 151.52	0.01
USD FLEXTRONICS INTL USD0.01	500.00	5 762.50	0.00
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	200.00	6 101.69	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	1 000.00	6 583.37	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	1 801.00	14 521.67	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)	1 000.00	3 412.48	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES SGDO.50	1 000.00	9 210.68	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	1 000.00	6 432.37	0.00
SGD SINGAPORE PRESS HD SGDO.20	2 300.00	7 275.68	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV(POST RE-ORG)	4 000.00	13 378.13	0.01
SGD SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5 000.00	6 681.51	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 127.00	20 837.44	0.01
シンガポール合計		147 092.37	0.07
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	174.00	3 210.27	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	111.00	3 921.12	0.00
EUR AMADEUS IT HLDGS EURO.01	322.00	14 732.16	0.01
EUR BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)	1 540.00	8 055.32	0.01
EUR BANKIA S.A. EUR1	2 050.00	2 864.52	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	4 962.00	13 327.72	0.01
EUR CAIXABANK SA EUR1	2 492.00	12 526.75	0.01
EUR DISTRIBUIDORA INTL EURO.01	276.00	2 219.34	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	167.00	5 148.94	0.00
EUR FERROVIAL SA EURO.2	287.00	6 528.44	0.00
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	252.00	6 199.62	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.5	75.00	3 197.35	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	3 419.00	22 898.84	0.01
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	913.00	29 336.31	0.01
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	547.00	4 584.80	0.00
EUR RED ELECTRICA CORPORACION EUR2	83.00	6 976.35	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	639.00	13 185.72	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	3 407.00	52 073.61	0.03
スペイン合計		210 987.18	0.10
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	237.00	4 421.92	0.00
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV	248.00	14 401.22	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV	511.00	15 941.31	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV	153.00	4 258.17	0.00
USD AUTOLIV INC COM	104.00	12 346.88	0.01
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	470.00	10 238.25	0.01
SEK ELECTROLUX AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	239.00	7 163.98	0.00
SEK ELEKTA SER ' B ' NPV	256.00	2 391.28	0.00

SEK	ERICSSON SER ' B ' NPV	1 838.00	20 129.11	0.01
SEK	GETINGE AB SER ' B ' NPV	165.00	4 015.16	0.00
SEK	HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV	710.00	28 254.26	0.01
SEK	HEXAGON AB SER ' B ' NPV	186.00	6 900.64	0.00
SEK	HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	379.00	2 818.55	0.00
SEK	INVESTOR AB SER ' B ' NPV	262.00	10 674.09	0.01
SEK	KINNEVIK INV AB SER ' B ' NPV	90.00	3 104.06	0.00
SEK	LUNDIN PETROLEUM A NPV	152.00	2 457.38	0.00
SEK	NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	2 382.00	30 294.35	0.01
SEK	SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	1 170.00	14 711.95	0.01
SEK	SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	1 207.00	15 292.84	0.01
SEK	SKANSKA AB SER ' B ' NPV	468.00	10 424.48	0.01
SEK	SKF AB SER ' B ' NPV	377.00	9 210.16	0.01
SEK	SVENSKA CELLULOSEA SER ' B ' NPV	338.00	8 556.91	0.00
SEK	SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV	371.00	17 123.05	0.01
SEK	SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	386.00	8 986.26	0.00
SEK	SWEDISH MATCH NPV	126.00	3 874.90	0.00
SEK	TELE2 AB SHS	210.00	2 801.56	0.00
SEK	TELIASONERA AB NPV	1 105.00	6 881.15	0.00
SEK	VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	1 434.00	19 714.53	0.01
スウェーデン合計			297 388.40	0.14

スイス

GBP	GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	8 543.00	40 731.04	0.02
CHF	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)(POST SUBD)	33.00	2 403.94	0.00
CHF	SIKA AG CHF0.60 (BR)	1.00	3 443.27	0.00
EUR	STMICROELECTRONICS EUR1.04	422.00	3 366.85	0.00
CHF	SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	16.00	7 179.42	0.00
CHF	SWISS RE AG CHF0.10	238.00	21 109.83	0.01

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 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 (%)
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	400.00	5 820.00	0.00
GBP WOLSELEY ORD GBPO.108030303(POST CON	218.00	12 971.65	0.01
スイス合計		97 026.00	0.04

イギリス

GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	880.00	6 849.60	0.00
GBP ABERDEEN ASSET MGT ORD GBPO.10	572.00	4 176.23	0.00
GBP AGGREKO ORD GBPO.048329113924	204.00	5 175.84	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	1 096.00	18 611.27	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	651.00	7 818.32	0.00
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	165.00	15 877.95	0.01
GBP ARM HLDGS ORD GBPO.0005	1 030.00	17 632.98	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	432.00	7 475.24	0.00
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBPO.0568	242.00	10 625.00	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	896.00	61 913.57	0.03
GBP AVIVA ORD GBPO.25	2 825.00	22 878.75	0.01
GBP BABCOCK INTL GROUP ORD GBPO.60	444.00	6 884.58	0.00
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	1 673.00	13 060.59	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	11 800.00	46 295.21	0.02
GBP BG GROUP ORD GBPO.10	2 480.00	45 066.73	0.02
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	1 554.00	37 278.39	0.02
GBP BP ORD USD0.25	13 018.00	94 045.44	0.04
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	1 295.00	71 494.04	0.03
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	611.00	7 816.80	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	6 001.00	42 029.44	0.02
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	210.00	5 934.77	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	166.00	4 448.95	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBPO.02066666	408.00	7 172.81	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	91.00	4 179.94	0.00
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	3 464.00	13 595.72	0.01
GBP COBHAM ORD GBPO.025	1 026.00	4 682.82	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.10625	887.00	15 771.04	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10	154.00	6 709.30	0.00
USD DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01	204.00	16 932.00	0.01
GBP DIAGEO ORD GBX28.935185	1 755.00	48 856.09	0.02
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBPO.10	1 202.00	5 894.33	0.00
GBP DIXONS CARPHONE ORD GBPO.001	1 071.00	6 983.38	0.00
GBP EASYJET ORD GBPO.27285714(POST CONS	265.00	7 383.24	0.00
USD ENSCO PLC COM USD0.10 'A'	112.00	3 055.36	0.00
GBP G4S ORD GBPO.25	965.00	4 345.08	0.00
GBP GKN ORD GBPO.50	754.00	4 070.54	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	3 379.00	78 643.12	0.04
GBP HAMMERSON PLC REIT	556.00	5 716.16	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	13 207.00	131 537.46	0.06
GBP ICAP ORD GBPO.10	440.00	3 762.89	0.00
GBP IMI ORD GBPO.2857	335.00	6 445.44	0.00
GBP IMPERIAL TOBACCO ORD GBPO.10	708.00	34 729.57	0.02
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.1580547	107.00	4 610.68	0.00
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	80.00	3 211.19	0.00
GBP INTU PROPERTIES PLC GBPO.50	1 113.00	5 866.68	0.00
GBP INVESTEC ORD GBPO.0002	587.00	5 637.95	0.00
GBP ITV ORD GBPO.10	3 622.00	14 115.65	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.047619 (POST CONS)	135.00	6 939.58	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	1 984.00	10 710.82	0.01
GBP LAND SECURITIES GROUP PLC REIT	518.00	9 942.50	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	3 480.00	13 904.51	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	495.00	24 972.75	0.01
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBPO.25	41 110.00	48 885.43	0.02
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	222.00	8 696.13	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	1 480.00	12 588.75	0.01
GBP MEGGITT ORD GBPO.05	435.00	3 542.98	0.00
GBP MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.0012727273	1 748.00	7 131.96	0.00
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	1 269.00	3 642.85	0.00
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.11395	2 696.00	36 417.66	0.02
GBP NEXT ORD GBPO.10	93.00	10 504.45	0.01
USD NOBLE CORP PLC USD0.01	200.00	3 462.00	0.00

GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBP0.114285714(POST CON	4	218.00	15	226.24	0.01
GBP	PEARSON ORD GBP0.25		434.00	8	803.73	0.01
GBP	PRUDENTIAL ORD GBP0.05	1	494.00	37	400.28	0.02
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10		437.00	39	125.07	0.02
GBP	REED ELSEVIER ORD GBP0.14		753.00	12	520.61	0.01
GBP	REXAM NEW ORD GBP0.8035714		403.00	3	588.91	0.00
GBP	RIO TINTO ORD GBP0.10		752.00	33	340.10	0.02
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	1	418.00	22	793.51	0.01
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	2	194.00	11	412.97	0.01
GBP	ROYAL MAIL PLC ORD GBP0.01 (WI)		699.00	5	023.97	0.00
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00		644.00	4	231.81	0.00
GBP	SABMILLER ORD USD0.10		701.00	37	305.57	0.02
GBP	SAGE GROUP GBP0.01051948		903.00	6	744.15	0.00
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428		651.00	2	722.15	0.00
GBP	SCHRODERS VTG SHS GBP1		138.00	6	885.96	0.00
GBP	SEGRO PLC ORD GBP0.10		984.00	6	487.17	0.00
GBP	SEVERN TRENT ORD GBP0.9789		131.00	4	277.93	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBP0.50		604.00	9	996.68	0.01
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0.20		736.00	12	633.81	0.01
GBP	SMITHS GROUP ORD GBP0.375		391.00	6	879.95	0.00
GBP	SSE PLC ORD GBP0.50		488.00	11	601.48	0.01
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	1	368.00	22	494.33	0.01
GBP	STANDARD LIFE ORD GBP0.1222222	1	572.00	11	303.40	0.01
NOK	SUBSEA 7 S.A. COM USD2		333.00	3	696.56	0.00
GBP	TESCO ORD GBP0.05	6	903.00	23	444.09	0.01
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBP0.10		233.00	7	440.54	0.00
GBP	TULLOW OIL ORD GBP0.10		436.00	2	773.22	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBP0.031111		752.00	33	120.53	0.02
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05		467.00	6	968.50	0.00
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	18	626.00	65	991.49	0.03
GBP	WEIR GROUP ORD GBP0.125		106.00	3	062.44	0.00

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 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 (%)
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	157.00	12 678.73	0.01
GBP WILLIAM HILL ORD GBP0.10	675.00	3 746.75	0.00
USD WILLIS GROUP HOLDI ORD SHS USD0.000115	103.00	5 008.89	0.00
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	638.00	14 961.61	0.01
イギリス合計		1 714 333.63	0.78

アメリカ合衆国

USD 3M CO COM	410.00	64 119.90	0.03
USD ABBOTT LABS COM	1 044.00	48 462.48	0.02
USD ABBVIE INC COM USD0.01	1 107.00	71 578.62	0.03
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	400.00	9 126.00	0.00
USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	378.00	28 750.68	0.01
USD ADT CORP COM USD0.01	100.00	3 760.00	0.00
USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM	52.00	7 436.00	0.00
USD AES CORP COM	400.00	5 300.00	0.00
USD AETNA INC COM USD0.01	234.00	25 007.58	0.01
USD AFFILIATED MNGRS COM USD0.01	33.00	7 462.29	0.00
USD AFLAC INC COM USD0.10	292.00	18 407.68	0.01
USD AGCO CORP COM USD0.01	100.00	5 151.00	0.00
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	336.00	13 900.32	0.01
USD AIR PRODS & CHEMS INC COM	150.00	21 514.50	0.01
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	100.00	7 378.00	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	200.00	11 940.00	0.01
USD ALCOA INC COM USD1	918.00	12 319.56	0.01
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	116.00	19 630.68	0.01
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	52.00	15 460.12	0.01
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	100.00	6 047.00	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	308.00	21 455.28	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	500.00	10 945.00	0.01
USD ALTERA COM USD0.001	268.00	11 170.24	0.01
USD ALTRIA GROUP INC COM	1 364.00	68 268.20	0.03
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	271.00	114 302.38	0.05
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	312.00	17 743.44	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 033.00	58 147.57	0.03
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	259.00	24 483.27	0.01
USD AMEREN CORP COM	129.00	5 281.26	0.00
USD AMERICAN AIRLINES COM USD1	100.00	4 828.50	0.00
USD AMERICAN EXPRESS CO COM	638.00	49 413.10	0.02
USD AMERICAN RLTY CAP COM USD0.001	718.00	6 483.54	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	88.00	4 797.76	0.00
USD AMERIPRISE FINL INC COM	100.00	12 528.00	0.01
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	199.00	22 745.70	0.01
USD AMETEK INC COM USD0.01	208.00	10 903.36	0.01
USD AMGEN INC COM USD0.0001	540.00	85 271.40	0.04
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	200.00	11 074.00	0.01
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	377.00	35 475.70	0.02
USD ANALOG DEVICES INC COM	209.00	12 924.56	0.01
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	400.00	4 028.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	162.00	24 450.66	0.01
USD APACHE CORP COM USD0.625	334.00	22 845.60	0.01
USD APPLE INC COM NPV	4 165.00	521 249.75	0.24
USD APPLIED MATLS INC COM	901.00	17 830.79	0.01
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	417.00	20 382.96	0.01
USD ARROW ELECTRS INC COM	100.00	5 971.00	0.00
USD ASHLAND INC COM USD1.00	54.00	6 823.44	0.00
USD ASSURANT INC COM	100.00	6 146.00	0.00
USD AT&T INC COM USD1	3 585.00	124 184.40	0.06
USD AUTODESK INC COM USD0.01	100.00	5 683.00	0.00
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC COM	342.00	28 912.68	0.01
USD AUTONATION INC COM	96.00	5 908.80	0.00
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	14.00	9 417.24	0.00
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	109.00	17 913.06	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	115.00	6 392.85	0.00
USD AVNET INC COM	100.00	4 263.00	0.00
USD AVON PRODUCTS INC COM USD0.25	100.00	817.00	0.00
USD BAKER HUGHES INC COM USD1	374.00	25 604.04	0.01

USD	BALL CORP COM	108.00	7 928.28	0.00
USD	BARD(CR)INC COM USD0.25	40.00	6 663.20	0.00
USD	BAXTER INTL INC COM USD1	416.00	28 595.84	0.01
USD	BB&T CORP COM USD5	458.00	17 536.82	0.01
USD	BE AEROSPACE COM USD0.01	100.00	5 979.00	0.00
USD	BECTON DICKINSON COM USD1	166.00	23 384.42	0.01
USD	BED BATH & BEYOND INC COM	100.00	7 046.00	0.00
USD	BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	4 899.00	0.00
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	787.00	111 132.27	0.05
USD	BEST BUY CO INC COM USD0.10	293.00	10 152.45	0.01
USD	BIOGEN INC COM STK USD0.0005	164.00	61 324.52	0.03
USD	BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	100.00	11 205.00	0.01
USD	BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	7 143.00	113 787.99	0.05
USD	BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	864.00	36 581.76	0.02
USD	BLACKROCK INC COM STK USD0.01	66.00	24 020.04	0.01
USD	BLOCK(H&R)INC COM NPV	299.00	9 041.76	0.00
USD	BOEING CO COM USD5	475.00	68 086.50	0.03
USD	BORG WARNER INC COM	200.00	11 840.00	0.01
USD	BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	100.00	13 231.00	0.01
USD	BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	800.00	14 256.00	0.01
USD	BRISTOL MYERS SQUIBB CO COM	1 157.00	73 735.61	0.03
USD	BROADCOM CORP CL A COM USD0.0001	282.00	12 465.81	0.01
USD	BROWN FORMAN CORP CL B	83.00	7 489.09	0.00
USD	BUNGE LIMITED COM USD0.01	139.00	12 005.43	0.01
USD	CA INC COM USD0.10	200.00	6 354.00	0.00
USD	CABLEVISION SYS CORP CL A NY CABLVS	200.00	3 996.00	0.00
USD	CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	191.00	6 459.62	0.00
USD	CALPINE CORP COM STK USD0.001	196.00	4 274.76	0.00
USD	CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	100.00	4 471.00	0.00
USD	CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	435.00	35 169.75	0.02
USD	CARDINAL HEALTH INC COM	286.00	24 121.24	0.01

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 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 (%)
USD CARMAX INC COM USD0.50	212.00	14 439.32	0.01
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)	359.00	15 785.23	0.01
USD CATERPILLAR INC DEL COM	455.00	39 530.40	0.02
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	128.00	4 907.52	0.00
USD CBS CORP NEW CL B	320.00	19 881.60	0.01
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	100.00	6 636.00	0.00
USD CELGENE CORP COM USD0.01	573.00	61 918.38	0.03
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	464.00	9 730.08	0.01
USD CENTURYLINK INC COM	362.00	13 017.52	0.01
USD CERNER CORP COM	226.00	16 229.06	0.01
USD CF INDS HLDGS INC COM	16.00	4 599.52	0.00
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	149.00	9 594.11	0.00
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	45.00	8 417.70	0.00
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	200.00	15 298.00	0.01
USD CHESAPEAKE ENERGY CORP COM	375.00	5 913.75	0.00
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	1 328.00	147 487.68	0.07
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	17.00	10 562.78	0.01
USD CHUBB CORP COM	162.00	15 932.70	0.01
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	144.00	11 688.48	0.01
USD CIGNA CORP COM USD0.25	162.00	20 191.68	0.01
USD CIMAREX ENERGY CO COM	59.00	7 339.60	0.00
USD CINCINNATI FINL CORP COM	100.00	5 064.00	0.00
USD CINTAS CORP COM	100.00	7 995.00	0.00
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	3 581.00	103 240.23	0.05
USD CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	100.00	4 503.00	0.00
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	2 118.00	112 931.76	0.05
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	100.00	6 716.00	0.00
USD CLOROX CO DEL COM	114.00	12 095.40	0.01
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	217.00	19 727.47	0.01
USD CMS ENERGY CORP COM	135.00	4 580.55	0.00
USD COACH INC COM USD0.01	279.00	10 660.59	0.01
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	2 735.00	110 931.60	0.05
USD COCA-COLA ENTERPR COM USD1.00	200.00	8 882.00	0.00
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL 'A' USD0.01	394.00	23 064.76	0.01
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	651.00	43 799.28	0.02
USD COMCAST CORP 'A' SPL COM USD0.01	319.00	18 371.21	0.01
USD COMCAST CORP COM CLS 'A' USD0.01	1 519.00	87 737.44	0.04
USD COMERICA INC COM	85.00	4 029.85	0.00
USD COMMUNICATIONS SAL COM USD0.0001	60.00	1 804.80	0.00
USD COMPUTER SCIENCES COM USD1	176.00	11 343.20	0.01
USD CONAGRA FOODS INC COM	393.00	14 206.95	0.01
USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001	37.00	4 686.42	0.00
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	861.00	58 479.12	0.03
USD CONSOL ENERGY INC COM	100.00	3 248.00	0.00
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	204.00	12 556.20	0.01
USD CONSTELLATION BRDS CLASS 'A' COM USD0.01	110.00	12 753.40	0.01
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	149.00	7 841.87	0.00
USD CORNING INC COM USD0.50	782.00	16 367.26	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	303.00	43 344.15	0.02
USD CREE INC COM	54.00	1 710.72	0.00
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	232.00	19 378.96	0.01
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	100.00	5 426.00	0.00
USD CSX CORP COM	828.00	29 882.52	0.01
USD CUMMINS INC COM	132.00	18 250.32	0.01
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	801.00	79 531.29	0.04
USD D R HORTON INC COM	373.00	9 474.20	0.00
USD DANAHER CORP COM USD0.01	458.00	37 501.04	0.02
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	100.00	6 377.00	0.00
USD DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	116.00	9 407.60	0.00
USD DEERE & CO COM USD1	236.00	21 362.72	0.01
USD DELTA AIR LINES INC	112.00	4 999.68	0.00
USD DENTSPLY INTL INC NEW COM	100.00	5 100.00	0.00
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	249.00	16 984.29	0.01
USD DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC COM	53.00	1 773.91	0.00
USD DICKS SPORTING GOODS INC COM	100.00	5 426.00	0.00
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	71.00	4 502.11	0.00

USD	DIRECTV COM USD0.01	376.00	34 105.08	0.02
USD	DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	373.00	21 622.81	0.01
USD	DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	100.00	3 236.00	0.00
USD	DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	300.00	9 069.00	0.00
USD	DISH NETWORK CORPO CLASS ' A ' COM USD0.01	200.00	13 532.00	0.01
USD	DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	233.00	16 941.43	0.01
USD	DOLLAR TREE INC	136.00	10 391.76	0.01
USD	DOMINION RES(VIR) COM STK NPV	424.00	30 392.32	0.01
USD	DOVER CORP COM	100.00	7 572.00	0.00
USD	DOW CHEMICAL CO COM USD2.50	857.00	43 707.00	0.02
USD	DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	189.00	14 095.62	0.01
USD	DTE ENERGY CO COM	137.00	10 909.31	0.01
USD	DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30	641.00	46 921.20	0.02
USD	DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT	522.00	40 491.54	0.02
USD	DUKE REALTY CORP COM USD0.01	235.00	4 655.35	0.00
USD	EASTMAN CHEM CO COM	164.00	12 500.08	0.01
USD	EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	4 108.00	0.00
USD	EBAY INC COM USD0.001	738.00	42 995.88	0.02
USD	ECOLAB INC COM	221.00	24 747.58	0.01
USD	EDISON INTL COM	203.00	12 370.82	0.01
USD	EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	48.00	6 079.20	0.00
USD	ELECTRONIC ARTS INC COM	262.00	15 219.58	0.01
USD	ELI LILLY AND CO COM NPV	696.00	50 021.52	0.02
USD	EMC CORP(MASS) COM USD0.01	1 423.00	38 292.93	0.02
USD	EMERSON ELEC CO COM	521.00	30 650.43	0.01
USD	ENDO INTERNATIONAL COM USD0.0001	100.00	8 406.50	0.00
USD	ENERGIZER HLDGS INC COM	59.00	8 060.58	0.00
USD	ENTERGY CORP NEW COM	168.00	12 966.24	0.01
USD	EOG RESOURCES INC COM USD0.01	393.00	38 887.35	0.02
USD	EQT CORPORATION	100.00	8 994.00	0.00

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 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 （％）	
USD	EQUIFAX INC COM	100.00	9 693.00	0.00
USD	EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	29.00	7 421.97	0.00
USD	EQUITY RESIDENTIAL-SBI	257.00	18 982.02	0.01
USD	ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	40.00	8 878.00	0.00
USD	ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01	215.00	17 477.35	0.01
USD	EVERSOURCE ENERGY COM USD5	230.00	11 214.80	0.01
USD	EXELON CORP COM NPV	525.00	17 860.50	0.01
USD	EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)	50.00	4 711.50	0.00
USD	EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	100.00	4 583.00	0.00
USD	EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	542.00	46 828.80	0.02
USD	EXXON MOBIL CORP COM NPV	2 966.00	259 139.42	0.12
USD	F M C CORP COM NEW	56.00	3 321.36	0.00
USD	F5 NETWORK INC COM STK NPV	37.00	4 514.74	0.00
USD	FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL ' A '	1 391.00	109 569.07	0.05
USD	FAMILY DOLLAR STRS COM USD0.10	53.00	4 141.42	0.00
USD	FASTENAL CO COM	200.00	8 524.00	0.00
USD	FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	34.00	4 544.78	0.00
USD	FEDEX CORP COM USD0.10	176.00	29 844.32	0.01
USD	FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	189.00	6 802.11	0.00
USD	FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	200.00	12 498.00	0.01
USD	FIFTH THIRD BANCORP COM	469.00	9 380.00	0.00
USD	FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	100.00	5 829.00	0.00
USD	FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	359.00	12 891.69	0.01
USD	FISERV INC COM USD0.01	200.00	15 520.00	0.01
USD	FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	100.00	16 089.00	0.01
USD	FLIR SYS INC COM	118.00	3 645.02	0.00
USD	FLOWSERVE CORP COM	62.00	3 628.86	0.00
USD	FLUOR CORP NEW COM	100.00	6 014.00	0.00
USD	FMC TECHNOLOGIES INC COM	126.00	5 556.60	0.00
USD	FOOT LOCKER INC COM USD0.01	173.00	10 284.85	0.01
USD	FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	2 493.00	39 389.40	0.02
USD	FOSSIL GROUP INC USD0.01	67.00	5 626.66	0.00
USD	FRANKLIN RES INC COM	347.00	17 891.32	0.01
USD	FREEPORT-MCMOR C&G COM STK USD0.10	618.00	14 380.86	0.01
USD	FRONTIER COMMUNICA COM USD0.25	324.00	2 222.64	0.00
USD	GAMESTOP CORP COM USD0.001 CLASS ' A '	127.00	4 894.58	0.00
USD	GAP INC DEL COM	265.00	10 504.60	0.01
USD	GEN DYNAMICS CORP COM USD1	175.00	24 031.00	0.01
USD	GEN ELEC CO COM USD0.06	6 844.00	185 335.52	0.08
USD	GEN GROWTH PPTYS COM USD0.01 NEW	450.00	12 330.00	0.01
USD	GENERAL MLS INC COM	394.00	21 803.96	0.01
USD	GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	636.00	22 298.16	0.01
USD	GENUINE PARTS CO COM STK USD1	100.00	8 985.00	0.00
USD	GENWORTH FINL INC COM CL A	350.00	3 076.50	0.00
USD	GILEAD SCIENCES COM USD0.001	1 072.00	107 746.72	0.05
USD	GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	249.00	48 908.58	0.02
USD	GOOGLE INC COM USD0.001 CL ' A '	199.00	109 205.23	0.05
USD	GOOGLE INC COM USD0.001 CL ' C '	202.55	108 840.37	0.05
USD	GRAINGER W W INC COM	28.00	6 956.04	0.00
USD	HALLIBURTON COM STK USD2.50	662.00	32 404.90	0.02
USD	HANESBRANDS INC COM	400.00	12 432.00	0.01
USD	HARLEY DAVIDSON INC COM	189.00	10 623.69	0.01
USD	HARRIS CORP COM STK USD1	80.00	6 419.20	0.00
USD	HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	373.00	15 207.21	0.01
USD	HASBRO INC COM	76.00	5 380.04	0.00
USD	HCA HLDGS INC COM USD0.01	236.00	17 466.36	0.01
USD	HCP INC COM USD1	341.00	13 738.89	0.01
USD	HELMERICH & PAYNE INC COM	100.00	7 797.00	0.00
USD	HERSHEY CO COM	100.00	9 192.00	0.00
USD	HERTZ GLOBAL HOLDI COM STK USD0.01	510.00	10 628.40	0.01
USD	HESS CORPORATION COM USD1	171.00	13 149.90	0.01
USD	HEWLETT PACKARD CO COM USD0.01	1 302.00	42 926.94	0.02
USD	HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	400.00	11 584.00	0.01
USD	HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	83.00	3 218.74	0.00
USD	HOLOGIC INC COM USD0.01	100.00	3 374.00	0.00
USD	HOME DEPOT INC COM USD0.05	921.00	98 528.58	0.05

USD	HONEYWELL INTL INC COM	498.00	50 258.16	0.02
USD	HORMEL FOODS CORP COM	113.00	6 141.55	0.00
USD	HOSPIRA INC COM	100.00	8 729.00	0.00
USD	HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	693.00	13 957.02	0.01
USD	HUMANA INC COM USD0.166	116.00	19 209.60	0.01
USD	HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	8 720.00	0.00
USD	HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	757.00	8 221.02	0.00
USD	IHS INC COM USD0.01 CLASS ' A '	59.00	7 402.73	0.00
USD	ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	202.00	18 903.16	0.01
USD	ILLUMINA INC COM USD0.01	100.00	18 425.00	0.01
USD	INCYTE CORPORATION COM USD0.001	100.00	9 716.00	0.00
USD	INTEGRYS ENERGY GR COM USD1	100.00	7 310.00	0.00
USD	INTEL CORP COM USD0.001	3 427.00	111 548.85	0.05
USD	INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	77.00	17 288.81	0.01
USD	INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	99.00	11 360.25	0.01
USD	INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	400.00	8 336.00	0.00
USD	INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	666.00	114 079.14	0.05
USD	INTL PAPER CO COM	333.00	17 888.76	0.01
USD	INTUIT COM	171.00	17 156.43	0.01
USD	INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	26.00	12 895.48	0.01
USD	INVESCO LTD COM STK USD0.20	380.00	15 739.60	0.01
USD	IRON MTN INC NEW COM NPV	115.00	3 966.35	0.00
USD	JACOBS ENG GROUP COM USD1	100.00	4 286.00	0.00
USD	JARDEN CORP COM	200.00	10 236.00	0.01
USD	JOHNSON & JOHNSON COM USD1	1 934.00	191 852.80	0.09
USD	JOHNSON CONTROLS COM STK USD0.01388	415.00	20 907.70	0.01
USD	JOY GLOBAL INC COM	60.00	2 558.40	0.00
USD	JP MORGAN CHASE & COM USD1	2 615.00	165 424.90	0.08
USD	JUNIPER NETWORKS INC COM	200.00	5 286.00	0.00
USD	KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	104.00	10 658.96	0.01

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 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 (%)
USD KELLOGG CO COM USD0.25	189.00	11 969.37	0.01
USD KEURIG GREEN MTN I COM USD0.1	46.00	5 353.02	0.00
USD KEYCORP NEW COM	811.00	11 718.95	0.01
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	222.00	24 351.18	0.01
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	300.00	7 230.00	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	1 231.00	52 871.45	0.02
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	100.00	5 880.00	0.00
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	200.00	14 330.00	0.01
USD KRAFT FOODS GROUP COM NPV	362.00	30 679.50	0.01
USD KROGER CO COM USD1	319.00	21 982.29	0.01
USD L BRANDS INC COM USD0.50	197.00	17 603.92	0.01
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	93.00	11 119.08	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	100.00	7 558.00	0.00
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	255.00	13 484.40	0.01
USD LEGG MASON INC COM	100.00	5 265.00	0.00
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	4 247.00	0.00
USD LENNAR CORP COM CL 'A' USD0.10	100.00	4 580.00	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	331.00	7 867.87	0.00
USD LEVEL 3 COMMUNICAT COM USD0.01(POST REV SPLIT)	200.00	11 188.00	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	262.00	13 660.68	0.01
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	300.00	8 628.00	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01	55.00	2 110.90	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C WHEN ISSU	110.00	4 174.50	0.00
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	211.00	11 919.39	0.01
USD LINEAR TECHNOLOGY COM USD0.001	251.00	11 578.63	0.01
USD LINKEDIN CORP COM USD0.0001	75.00	18 909.75	0.01
USD LKQ CORP COM	200.00	5 414.00	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	151.00	28 176.60	0.01
USD LOEWS CORP COM	279.00	11 617.56	0.01
USD LORILLARD INC COM USD0.01	247.00	17 255.42	0.01
USD LOWE 'S COS INC COM USD0.50	608.00	41 866.88	0.02
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	266.00	27 536.32	0.01
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	37.00	4 427.79	0.00
USD MACERICH CO COM USD0.01	81.00	6 622.56	0.00
USD MACY 'S INC COM STK USD0.01	305.00	19 712.15	0.01
USD MANPOWER GROUP COM USD0.01	40.00	3 413.20	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	631.00	19 624.10	0.01
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	176.00	17 348.32	0.01
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	209.00	16 730.45	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	464.00	26 058.24	0.01
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	100.00	14 265.00	0.01
USD MASCO CORP COM	200.00	5 298.00	0.00
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	707.00	63 778.47	0.03
USD MATTEL INC COM USD1	200.00	5 632.00	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	329.00	10 801.07	0.01
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	100.00	7 530.00	0.00
USD MCDONALD 'S CORP COM USD0.01	664.00	64 109.20	0.03
USD MCGRAW HILL FINANCIAL INC COM	170.00	17 731.00	0.01
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	131.00	29 265.40	0.01
USD MDU RES GROUP INC COM USD1	100.00	2 229.00	0.00
USD MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01	125.00	11 990.00	0.01
USD MEADWESTVACO CORP COM	100.00	4 880.00	0.00
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	1 023.00	76 162.35	0.04
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	2 014.00	119 953.84	0.05
USD METLIFE INC COM USD0.01	722.00	37 031.38	0.02
USD MGM RESORTS INTL COM	176.00	3 722.40	0.00
USD MICROCHIP TECHNLOGY COM USD0.001	100.00	4 765.50	0.00
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	672.00	18 903.36	0.01
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	5 379.00	261 634.56	0.12
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	26.00	4 511.00	0.00
USD MOLSON COORS BREWI COM CLS 'B' COM NON-V USD0.01	100.00	7 351.00	0.00
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	1 200.00	46 044.00	0.02
USD MONSANTO COM STK USD0.01	369.00	42 051.24	0.02
USD MONSTER BEV CORP COM USD0.005	94.00	12 888.34	0.01
USD MOODYS CORP COM USD0.01	175.00	18 816.00	0.01
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	1 083.00	40 406.73	0.02

		訂正有価証券届出書（外国投資証券）		
USD	MOSAIC CO COM USD0.01	223.00	9 812.00	0.01
USD	MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	198.00	11 830.50	0.01
USD	MURPHY OIL CORP COM	137.00	6 522.57	0.00
USD	MYLAN NV EURO.01	271.00	19 582.46	0.01
USD	NASDAQ OMX GROUP INC COM USD0.01 ' 144A '	112.00	5 446.56	0.00
USD	NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	266.00	14 473.06	0.01
USD	NAVIENT CORP COM USD0.01	300.00	5 862.00	0.00
USD	NETAPP INC COM USD0.001	263.00	9 533.75	0.00
USD	NETFLIX INC COM USD0.001	32.00	17 808.00	0.01
USD	NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	100.00	1 719.00	0.00
USD	NEWELL RUBBERMAID INC COM	200.00	7 626.00	0.00
USD	NEWMONT MINING CORP COM	374.00	9 907.26	0.01
USD	NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL ' A '	150.00	2 367.00	0.00
USD	NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	307.00	30 985.51	0.01
USD	NIELSEN HLDGS NV EURO.07	243.00	10 920.42	0.01
USD	NIKE INC CLASS ' B ' COM NPV	407.00	40 227.88	0.02
USD	NISOURCE INC COM NPV	200.00	8 684.00	0.00
USD	NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	338.00	17 143.36	0.01
USD	NORDSTROM INC COM NPV	100.00	7 556.00	0.00
USD	NORFOLK SOUTHERN CORP COM	196.00	19 766.60	0.01
USD	NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	100.00	7 315.00	0.00
USD	NORTHROP GRUMMAN COM USD1	100.00	15 404.00	0.01
USD	NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	200.00	9 702.00	0.00
USD	NRG ENERGY INC COM NEW	276.00	6 966.24	0.00
USD	NUANCE COMMUNICATI COM USD0.001	325.00	4 982.25	0.00
USD	NUCOR CORP COM	230.00	11 237.80	0.01
USD	NVIDIA CORP COM USD0.001	502.00	11 141.89	0.01
USD	OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	557.00	44 615.70	0.02
USD	OCEANEERING INTL INC COM	100.00	5 511.00	0.00
USD	OGE ENERGY CORP COM USD0.01	100.00	3 268.00	0.00

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 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 (%)
USD OMNICARE COM USD1	61.00	5 366.78	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	182.00	13 788.32	0.01
USD ONEOK INC	116.00	5 579.60	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	2 501.00	109 093.62	0.05
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	72.00	15 683.76	0.01
USD OWENS ILL INC COM NEW	100.00	2 391.00	0.00
USD PACCAR INC COM STK USD1	225.00	14 703.75	0.01
USD PALL CORP COM USD0.10	100.00	9 732.00	0.01
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	100.00	14 772.00	0.01
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	100.00	11 936.00	0.01
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	149.00	6 996.30	0.00
USD PAYCHEX INC COM	190.00	9 194.10	0.00
USD PEOPLE ' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	512.00	7 736.32	0.00
USD PEPCO HOLDINGS COM USD0.01	200.00	5 196.00	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	1 037.00	98 639.44	0.05
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	104.00	19 061.12	0.01
USD PFIZER INC COM USD0.05	4 386.00	148 816.98	0.07
USD PG&E CORP COM	311.00	16 458.12	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV ' WI '	1 086.00	90 648.42	0.04
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	434.00	34 420.54	0.02
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	100.00	6 120.00	0.00
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	86.00	14 859.08	0.01
USD PLUM CREEK TIMBER COMPANY INC REIT	100.00	4 220.00	0.00
USD PNC FINL SVCS GROUP INC COM	318.00	29 170.14	0.01
USD POLARIS INDS INC COM	60.00	8 217.60	0.00
USD PPG INDS INC COM	100.00	22 156.00	0.01
USD PPL CORP COM	416.00	14 156.48	0.01
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	154.00	18 777.22	0.01
USD PRECISION CASTPART COM NPV	106.00	21 909.14	0.01
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	28.00	34 658.68	0.02
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	213.00	10 888.56	0.01
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	1 866.00	148 365.66	0.07
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	466.00	12 423.56	0.01
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	374.00	15 034.80	0.01
USD PRUDENTIAL FINL INC COM	355.00	28 968.00	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	68.00	12 777.88	0.01
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	453.00	18 817.62	0.01
USD PULTE GROUP INC USD0.01	185.00	3 570.50	0.00
USD PVH CORP COM USD1	93.00	9 611.55	0.00
USD QEP RESOURCES INC COM USD0.01	100.00	2 250.00	0.00
USD QORVO INC COM USD 0.0001	100.00	6 591.00	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	1 197.00	81 396.00	0.04
USD QUANTA SVCS INC COM	120.00	3 469.20	0.00
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	100.00	7 142.00	0.00
USD QUINTILES TRANSNTL COM USD0.01	100.00	6 588.00	0.00
USD RALPH LAUREN CORP CLASS ' A ' COM USD0.01	38.00	5 069.58	0.00
USD RANGE RES CORP COM USD0.01	100.00	6 356.00	0.00
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	100.00	5 653.00	0.00
USD RAYTHEON CO COM NEW	195.00	20 280.00	0.01
USD REALOGY HLDGS CORP COM USD0.01	100.00	4 741.00	0.00
USD REALTY INCOME CORP	125.00	5 871.25	0.00
USD RED HAT INC COM	100.00	7 526.00	0.00
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	105.00	6 591.90	0.00
USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM	49.00	22 415.54	0.01
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	400.00	3 932.00	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	200.00	8 126.00	0.00
USD RESMED INC COM USD0.004	100.00	6 394.00	0.00
USD REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001	200.00	14 660.00	0.01
USD ROBERT HALF INTL INC COM	118.00	6 543.10	0.00
USD ROCK-TENN CO CL A	100.00	6 298.00	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATION INC COM	63.00	7 471.80	0.00
USD ROCKWELL COLLINS INC COM	100.00	9 733.00	0.01
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	57.00	9 585.69	0.00
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	126.00	12 458.88	0.01
USD ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	100.00	6 806.00	0.00
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	473.00	34 443.86	0.02

USD	SANDISK CORP COM USD0.001	100.00	6 694.00	0.00
USD	SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01	123.00	14 245.86	0.01
USD	SCANA CORP NEW COM	100.00	5 298.00	0.00
USD	SCHEIN HENRY INC COM	100.00	13 710.00	0.01
USD	SCHLUMBERGER COM USD0.01	900.00	85 149.00	0.04
USD	SCHWAB CHARLES CORP NEW COM	713.00	21 746.50	0.01
USD	SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	63.00	4 401.18	0.00
USD	SEALED AIR CORP NEW COM	149.00	6 794.40	0.00
USD	SEI INVESTMENT COM USD0.01	110.00	5 022.60	0.00
USD	SEMPRA ENERGY COM	100.00	10 617.00	0.01
USD	SERVICENOW INC COM USD0.001	100.00	7 486.00	0.00
USD	SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	54.00	15 012.00	0.01
USD	SIGMA ALDRICH CORP COM	100.00	13 892.00	0.01
USD	SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	207.00	37 568.43	0.02
USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	100.00	9 225.00	0.00
USD	SMUCKER(JM)CO COM NPV	105.00	12 171.60	0.01
USD	SOUTHERN CO COM	672.00	29 769.60	0.01
USD	SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	178.00	7 219.68	0.00
USD	SPECTRA ENERGY COR COM USD0.001	438.00	16 315.50	0.01
USD	SPRINT CORPORATION COM USD0.01	390.00	2 000.70	0.00
USD	ST JUDE MED INC COM	186.00	13 029.30	0.01
USD	STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	100.00	9 870.00	0.01
USD	STAPLES INC COM STK USD0.0006	565.00	9 220.80	0.00
USD	STARBUCKS CORP COM	1 070.00	53 050.60	0.02
USD	STARWOOD HTLS WRLD COM STK USD0.01	100.00	8 595.00	0.00
USD	STATE STREET CORP COM STK USD1	318.00	24 524.16	0.01
USD	STERICYCLE INC COM	52.00	6 938.36	0.00
USD	STHWESTN ENERGY CO COM USD0.01	188.00	5 269.64	0.00
USD	STRYKER CORP COM USD0.10	267.00	24 628.08	0.01
USD	SUNTRUST BKS INC COM	390.00	16 185.00	0.01

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 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 (%)
USD SUPERIOR ENERGY SVCS INC COM	158.00	4 029.00	0.00
USD SYMANTEC CORP COM	649.00	16 176.33	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	200.00	6 230.00	0.00
USD SYNOPSIS INC COM USD0.01	100.00	4 688.00	0.00
USD SYSCO CORP COM	359.00	13 293.77	0.01
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	171.00	13 881.78	0.01
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	100.00	3 404.00	0.00
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	364.00	28 694.12	0.01
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	311.00	11 273.75	0.01
USD TERADATA CORP COM STK USD0.01 'WI'	100.00	4 399.00	0.00
USD TESLA MOTORS INC COM USD0.001	60.00	13 563.00	0.01
USD TESORO CORP COM	73.00	6 265.59	0.00
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	771.00	41 795.91	0.02
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	285.00	35 818.80	0.02
CAD THOMSON-REUTERS CO COM NPV	194.00	7 939.39	0.00
USD TIFFANY & CO NEW COM	50.00	4 374.00	0.00
USD TIME WARNER CABLE USD0.01	169.00	26 282.88	0.01
USD TIME WARNER INC COM USD0.01	619.00	52 249.79	0.02
USD TJX COS INC COM USD1	425.00	27 429.50	0.01
USD TOLL BROS INC COM USD0.01	142.00	5 046.68	0.00
USD TORCHMARK CORP COM	105.00	5 891.55	0.00
USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	148.00	5 854.88	0.00
USD TOWERS WATSON & CO COM USD0.01 CLASS A	100.00	12 690.50	0.01
USD TRACTOR SUPPLY CO COM	100.00	8 606.00	0.00
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	223.00	22 547.53	0.01
USD TRIMBLE NAVIGATION LTD COM	100.00	2 543.00	0.00
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	48.00	3 863.52	0.00
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL 'A'	967.00	32 955.36	0.02
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL 'B'	392.00	13 073.20	0.01
USD TWITTER INC COM USD0.000005	200.00	7 792.00	0.00
USD TYCO INTL PLC EUR1.00	329.00	12 956.02	0.01
USD TYSON FOODS INC CL A	303.00	11 968.50	0.01
USD UDR INC	152.00	4 981.04	0.00
USD ULTA SALON COM STK USD0.0158	70.00	10 576.30	0.01
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	100.00	7 755.00	0.00
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	614.00	65 225.22	0.03
USD UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	129.00	7 706.46	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	480.00	48 254.40	0.02
USD UNITED RENTALS INC COM	100.00	9 658.00	0.00
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	675.00	75 195.00	0.03
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS 'B' COM USD0.01	64.00	7 484.80	0.00
USD UNUM GROUP COM USD0.10	318.00	10 862.88	0.01
USD URBAN OUTFITTERS INC COM	112.00	4 484.48	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	1 035.00	44 370.45	0.02
USD UTD TECHNOLOGIES COM USD1	597.00	67 908.75	0.03
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	446.00	25 377.40	0.01
USD VANTIV INC COM USD0.00001 A	200.00	7 820.00	0.00
USD VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	100.00	8 885.00	0.00
USD VENTAS INC COM USD0.25	277.00	19 085.30	0.01
USD VERISIGN INC COM	100.00	6 351.00	0.00
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	165.00	12 381.60	0.01
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	2 874.00	144 964.56	0.07
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	161.00	19 848.08	0.01
USD VF CORP COM NPV	297.00	21 511.71	0.01
USD VIACOM INC NEW CL 'B' NON-VTG USD0.001	253.00	17 570.85	0.01
USD VISA INC COM STK USD0.0001	1 344.00	88 771.20	0.04
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	42.00	3 700.20	0.00
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	200.00	8 468.00	0.00
USD VULCAN MATLS CO COM	61.00	5 216.72	0.00
USD WABTEC CORP COM	100.00	9 405.00	0.00
USD WAL-MART STORES IN COM USD0.10	1 118.00	87 259.90	0.04
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	626.00	51 914.18	0.02
USD WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	1 154.00	125 462.88	0.06
USD WASTE MGMT INC DEL COM	331.00	16 394.43	0.01
USD WATERS CORP COM	57.00	7 135.83	0.00
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	3 429.00	188 937.90	0.09

USD	WESTERN DIGITAL CORP COM	172.00	16 811.28	0.01
USD	WESTERN UN CO COM	300.00	6 084.00	0.00
USD	WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	331.00	10 429.81	0.01
USD	WHIRLPOOL CORP COM	28.00	4 916.80	0.00
USD	WHITING PETROLEUM COM USD0.001	64.00	2 426.24	0.00
USD	WHOLE FOODS MKT INC COM	297.00	14 184.72	0.01
USD	WILLIAMS COS INC COM USD1	559.00	28 615.21	0.01
USD	WISCONSIN ENERGY COM USD0.01	200.00	9 824.00	0.01
USD	WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	9 121.00	0.00
USD	WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	132.00	11 272.80	0.01
USD	WYNN RESORTS LTD COM	51.00	5 664.57	0.00
USD	XCEL ENERGY INC COM	300.00	10 173.00	0.01
USD	XEROX CORP COM	700.00	8 050.00	0.00
USD	XILINX INC COM USD0.01	221.00	9 582.56	0.00
USD	XYLEM INC COM USD0.01 WI	100.00	3 702.00	0.00
USD	YAHOO INC COM STK USD0.001	697.00	29 667.81	0.01
USD	YUM BRANDS INC COM	355.00	30 515.80	0.01
USD	ZIMMER HLDGS INC COM USD0.01	112.00	12 302.08	0.01
USD	ZOETIS INC COM USD0.01 CL ' A '	405.00	17 990.10	0.01
アメリカ合衆国合計			13 157 027.23	5.97

無記名株式合計	22 009 356.43	9.98
----------------	----------------------	-------------

参加証券

スイス

CHF	SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	48.00	8 156.26	0.00
-----	---	-------	----------	------

スイス合計	8 156.26	0.00
--------------	-----------------	-------------

参加証券合計	8 156.26	0.00
---------------	-----------------	-------------

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 先物/オプション/ 先渡し為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
その他の株式			
オランダ			
EUR ING GROEP NV CVA EURO.24	2 986.00	46 157.55	0.02
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	1 244.00	54 455.23	0.03
オランダ合計		100 612.78	0.05
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	507.00	145 784.82	0.07
スイス合計		145 784.82	0.07
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	100.00	7 508.00	0.00
アメリカ合衆国合計		7 508.00	0.00
その他の株式合計		253 905.60	0.12
優先株式			
ドイツ			
EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV	100.00	11 676.13	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	94.00	8 984.79	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	130.00	33 715.67	0.01
ドイツ合計		54 376.59	0.02
優先株式合計		54 376.59	0.02
記名株式			
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2(REGD)	173.00	19 321.54	0.01
フランス合計		19 321.54	0.01
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	206.00	16 947.78	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	327.00	55 915.66	0.03
EUR BASF SE NPV	658.00	65 975.57	0.03
EUR BAYER AG NPV (REGD)	573.00	83 405.56	0.04
EUR BRENNTAG AG	189.00	11 404.57	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	693.00	67 038.80	0.03
EUR DEUTSCHE ANNINGTON NPV	259.00	8 725.54	0.00
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	1 078.00	34 698.45	0.02
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	160.00	13 322.90	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	171.00	2 376.01	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	641.00	21 228.55	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	2 235.00	41 260.48	0.02
EUR E.ON SE NPV	1 646.00	25 748.18	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	58.00	5 916.86	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	997.00	11 819.85	0.01
EUR K&S AG NPV	80.00	2 628.36	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	112.00	21 950.23	0.01
EUR OSRAM LICHT AG NPV	80.00	4 227.61	0.00
EUR PROSIEBENSAT1 MEDI NPV	223.00	11 467.11	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	561.00	61 297.57	0.03
GBP TUI AG NPV (REGD)	363.00	6 822.39	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	80.00	3 601.45	0.00
ドイツ合計		577 779.48	0.26
イスラエル			
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	252.00	2 820.15	0.00
イスラエル合計		2 820.15	0.00
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV	638.00	6 803.81	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	448.00	6 897.57	0.01
ルクセンブルグ合計		13 701.38	0.01

オランダ

USD	CHICAGO BRIDGE & I EURO.01 (REG)	100.00	4 765.00	0.00
-----	----------------------------------	--------	----------	------

オランダ合計			4 765.00	0.00
---------------	--	--	-----------------	-------------

ポルトガル

EUR	EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)	1 296.00	5 187.37	0.00
-----	-------------------------------	----------	----------	------

ポルトガル合計			5 187.37	0.00
----------------	--	--	-----------------	-------------

スペイン

EUR	BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	10 473.00	79 285.18	0.04
-----	----------------------------------	-----------	-----------	------

EUR	BANKINTER SA EURO.3(REGD)	966.00	7 332.52	0.00
-----	---------------------------	--------	----------	------

EUR	BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	4 760.00	48 004.36	0.02
-----	----------------------------	----------	-----------	------

スペイン合計			134 622.06	0.06
---------------	--	--	-------------------	-------------

スイス

CHF	ABB LTD CHF1.03(REGD)	1 768.00	38 835.99	0.02
-----	-----------------------	----------	-----------	------

USD	ACE LIMITED ORD CHF30.27	186.00	19 900.14	0.01
-----	--------------------------	--------	-----------	------

CHF	ACTELION CHF0.50(REGD)	50.00	6 617.57	0.00
-----	------------------------	-------	----------	------

CHF	ADECCO SA CHF1(REGD)	152.00	12 443.59	0.01
-----	----------------------	--------	-----------	------

CHF	ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)	60.00	4 053.79	0.00
-----	--------------------------	-------	----------	------

GBP	COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	417.00	8 836.97	0.01
-----	------------------------------	--------	----------	------

CHF	CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	1 270.00	33 617.25	0.02
-----	---------------------------------	----------	-----------	------

USD	GARMIN LTD COM CHF0.005	100.00	4 519.00	0.00
-----	-------------------------	--------	----------	------

CHF	GEBERIT CHF0.10(REGD)	23.00	8 182.20	0.00
-----	-----------------------	-------	----------	------

CHF	GIVAUDAN AG CHF10	9.00	16 926.03	0.01
-----	-------------------	------	-----------	------

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 先物 / オプション / 先渡し為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
CHF HOLCIM CHF2(REGD)	214.00	17 268.01	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	133.00	7 009.86	0.00
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	34.00	5 102.36	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	16.00	2 273.03	0.00
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	2 293.00	178 417.87	0.08
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	1 645.00	169 697.14	0.08
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	21.00	6 601.02	0.00
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	295.00	26 338.72	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	3.00	5 827.73	0.00
CHF SONOVA HOLDING AG	38.00	5 264.60	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	41.00	3 616.87	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	25.00	5 942.47	0.00
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	71.00	6 229.27	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	24.00	14 268.33	0.01
CHF SYNGENTA CHF0.1(REGD)	62.00	20 805.64	0.01
USD TE CONNECTIVITY LTD CHF0.77	323.00	21 495.65	0.01
CHF TRANSOCEAN LTD COM CHF15	136.00	2 428.52	0.00
USD TRANSOCEAN LTD COM CHF15	149.00	2 804.18	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	2 644.00	53 224.29	0.03
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	118.00	36 474.33	0.02
スイス合計		745 022.42	0.34
アメリカ合衆国			
USD CAMERON INTL CORP COM USD0.01	100.00	5 482.00	0.00
アメリカ合衆国合計		5 482.00	0.00
記名株式合計		1 508 701.40	0.68
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	455.00	5 243.26	0.00
アイルランド合計		5 243.26	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	402.00	24 288.84	0.01
イスラエル合計		24 288.84	0.01
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	49.00	3 820.08	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	192.00	6 723.30	0.01
ルクセンブルグ合計		10 543.38	0.01
預託証券合計		40 075.48	0.02
投資信託証書			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.12.16	22 490 000.00	29 875 716.00	13.55
アイルランド合計		29 875 716.00	13.55
投資信託証書合計		29 875 716.00	13.55
投資証書、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	116.00	2 859.66	0.00
カナダ合計		2 859.66	0.00
日本			
JPY 日本ビルファンド投資法人	1.00	4 972.01	0.00
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	4.00	6 360.83	0.01
日本合計		11 332.84	0.01
アメリカ合衆国			
USD AMERICAN CAPITAL A COM STK USD0.01	200.00	4 127.00	0.00

USD	HEALTH CARE REIT INC	236.00	16 996.72	0.01
USD	LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	104.00	3 623.36	0.00
USD	RAYONIER INC COM NPV	88.00	2 251.92	0.00
USD	SL GREEN REALTY CORPORATION	53.00	6 485.08	0.00
USD	VORNADO REALTY TRUST-SBI	116.00	12 004.84	0.01
アメリカ合衆国合計			45 488.92	0.02

投資証券、クローズド・エンド型合計	59 681.42	0.03
--------------------------	------------------	-------------

新株引受権

スペイン

EUR	BANCO POPULAR ESPANOL(STOCK DIVIDEND)OPTION RIGHTS 30.04.15	1 540.00	29.34	0.00
EUR	BANCO SANTANDER SA (STOCK DIVIDEND) OPTION RIGHTS 28.04.15	10 442.00	1 731.72	0.00

スペイン合計	1 761.06	0.00
---------------	-----------------	-------------

新株引受権合計	1 761.06	0.00
----------------	-----------------	-------------

ノート、固定利付債

豪ドル

AUD	NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 4.00000% 13-20.04.23	250 000.00	214 078.59	0.09
AUD	QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 10-21.04.16	160 000.00	130 888.33	0.06
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.50000% 13-17.11.17	80 000.00	65 212.59	0.03
AUD	TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 09-15.06.20	50 000.00	46 228.25	0.02

豪ドル合計	456 407.76	0.20
--------------	-------------------	-------------

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 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 (%)
英ポンド			
GBP EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.00000% 98-07.12.28	60 000.00	131 986.85	0.06
英ポンド合計		131 986.85	0.06
米ドル			
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22	100 000.00	99 416.40	0.04
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 10-14.07.20	100 000.00	110 875.00	0.05
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 13-15.03.18	100 000.00	99 647.00	0.05
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 14-15.10.19	500 000.00	507 206.00	0.23
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 2.87500% 10-09.11.15	1 000 000.00	1 010 740.00	0.46
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 12-12.09.17	250 000.00	250 021.50	0.11
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	50 000.00	49 711.60	0.02
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 2.50000% 15-28.04.20	700 000.00	695 009.00	0.32
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	500 000.00	523 944.00	0.24
米ドル合計		3 346 570.50	1.52
ノート、固定利付債合計		3 934 965.11	1.78
中期債券、固定利付債			
豪ドル			
AUD HYPOTHEKENBANK FRANKFURT AG 6.00000% 06-30.11.16	50 000.00	41 121.08	0.02
豪ドル合計		41 121.08	0.02
カナダドル			
CAD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 4.45000% 06-26.10.18	40 000.00	36 442.68	0.01
カナダドル合計		36 442.68	0.01
英ポンド			
GBP GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 6.25000% 02-15.12.17	10 000.00	17 274.14	0.01
GBP KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.00000% 00-07.12.28	50 000.00	111 099.34	0.05
英ポンド合計		128 373.48	0.06
米ドル			
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.50000% 11-16.05.16	2 500 000.00	2 552 642.50	1.16
USD GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 1.60000% 12-20.11.17	1 000 000.00	1 011 917.00	0.46
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 1.00000% 12-24.10.17	800 000.00	799 984.00	0.36
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 2.00000% 10-09.09.15	1 000 000.00	1 005 900.00	0.45
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.37500% 12-21.06.17	500 000.00	503 995.00	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.00000% 14-30.09.19	450 000.00	455 679.00	0.21
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 1.12500% 12-06.07.15	750 000.00	751 155.00	0.34
USD SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 0.37500% 13-29.03.16	500 000.00	500 070.00	0.23
米ドル合計		7 581 342.50	3.44
中期債券、固定利付債合計		7 787 279.74	3.53
債券、固定利付債			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17	230 000.00	190 416.00	0.09
AUD AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27	260 000.00	246 313.53	0.11
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 11-21.07.22	50 000.00	47 466.97	0.02
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23	110 000.00	94 420.16	0.04
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.750000% 04-15.11.16	25 000.00	20 813.54	0.01
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 03-17.10.22	110 000.00	106 002.08	0.05
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 7.000000% 01-15.10.19	50 000.00	46 904.21	0.02
豪ドル合計		752 336.49	0.34
カナダドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 08-01.06.19	260 000.00	239 877.40	0.11
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21	500 000.00	465 074.47	0.21
CAD CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 01-01.06.33	370 000.00	476 131.45	0.21
CAD EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.12500% 14-04.02.19	70 000.00	59 616.59	0.03
カナダドル合計		1 240 699.91	0.56
ユーロ			

EUR	AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.20000% 10-20.02.17	200 000.00	237 567.80	0.11
EUR	BELGIUM, KINGDOM OF 2.75000% 10-28.03.16	200 000.00	230 004.09	0.11
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.00000% 00-25.10.16	500 000.00	602 990.36	0.27
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 98-04.07.28	500 000.00	863 551.86	0.39
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37	250 000.00	460 994.27	0.21
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 05-04.01.16	300 000.00	344 602.75	0.16
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 07-04.01.18	500 000.00	622 801.69	0.28
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 08-04.07.40	100 000.00	212 310.61	0.10
EUR	KOREA, REPUBLIC OF 3.62500% 05-02.11.15	100 000.00	113 855.72	0.05
ユーロ合計			3 688 679.15	1.68

英ポンド

GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.75000% 03-07.09.15	80 000.00	124 820.98	0.06
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.75000% 07-07.12.30	200 000.00	410 404.45	0.18
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19	40 000.00	69 454.95	0.03
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.75000% 11-07.09.21	150 000.00	262 161.87	0.12
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 10-07.12.40	150 000.00	306 351.12	0.14
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 2.75000% 14-07.09.24	50 000.00	82 669.47	0.04
英ポンド合計			1 255 862.84	0.57

米ドル

USD	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 12-04.10.17	500 000.00	507 205.00	0.23
USD	BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	500 000.00	498 008.50	0.23
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	450 000.00	499 107.15	0.23
USD	INTERNATIONAL FINANCE CORP 1.75000% 13-04.09.18	50 000.00	50 596.25	0.02
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 7.62500% 93-19.01.23	800 000.00	1 116 478.40	0.51
USD	ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	600 000.00	765 597.60	0.35
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 5.12500% 06-14.03.16	2 000 000.00	2 081 100.00	0.94
USD	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.37500% 11-04.08.15	450 000.00	451 314.00	0.20

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 先物 / オプション / 先渡し為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.10000% 12-25.10.17	50 000.00	50 071.50	0.02
USD TEMASEK FINANCIAL LTD-REG-S 4.50000% 05-21.09.15	150 000.00	152 211.00	0.07
米ドル合計		6 171 689.40	2.80
債券、固定利付債合計		13 109 267.79	5.95
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	2 900 000.00	4 044 595.20	1.83
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38	3 300 000.00	4 291 547.70	1.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.12500% 06-15.05.16	2 000 000.00	2 099 688.00	0.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 08-15.02.18	4 000 000.00	4 290 936.00	1.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 08-15.05.18	500 000.00	544 140.50	0.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 09-15.02.19	3 300 000.00	3 490 007.40	1.58
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 09-31.03.16	1 360 000.00	1 386 243.92	0.63
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20	2 500 000.00	2 756 445.00	1.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.11.18	3 500 000.00	3 530 898.00	1.60
米ドル合計		26 434 501.72	11.99
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		26 434 501.72	11.99
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		105 077 744.60	47.65
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			
ノート、固定利付債			
豪ドル			
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 6.00000% 11-01.02.18	90 000.00	78 228.93	0.04
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25	80 000.00	72 673.53	0.03
豪ドル合計		150 902.46	0.07
米ドル			
USD BANK OF NEW YORK MELLON CO 1.30000% 12-25.01.18	750 000.00	749 121.75	0.34
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	250 000.00	253 608.25	0.11
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.25000% 12-05.10.17	150 000.00	150 577.65	0.07
米ドル合計		1 153 307.65	0.52
ノート、固定利付債合計		1 304 210.11	0.59
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK OF MONTREAL 0.80000% 12-06.11.15	100 000.00	100 210.80	0.04
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.50000% 13-16.01.18	500 000.00	502 126.00	0.23
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.37500% 13-10.01.18	950 000.00	954 901.05	0.43
米ドル合計		1 557 237.85	0.70
中期債券、固定利付債合計		1 557 237.85	0.70
債券、固定利付債			
カナダドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.09.17	100 000.00	84 140.09	0.04
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.06.23	500 000.00	415 721.24	0.19
カナダドル合計		499 861.33	0.23
米ドル			
USD BANK OF MONTREAL-REG-S 2.62500% 11-25.01.16	500 000.00	507 827.00	0.23
米ドル合計		507 827.00	0.23
債券、固定利付債合計		1 007 688.33	0.46
財務省証券(T-note)、固定利付債			

米ドル			
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 12-15.12.15	500 000.00	500 273.50 0.23
米ドル合計			500 273.50 0.23
財務省証券（T-note）、固定利付債合計			500 273.50 0.23
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合計			4 369 409.79 1.98
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			
無記名株式			
カナダ			
CAD	TELUS CORPORATION COM NPV	108.00	3 731.52 0.00
カナダ合計			3 731.52 0.00
イギリス			
GBP	ROLLS ROYCE HLDGS C SHS ENTITLEMENT (JULY 201	199 938.00	307.26 0.00
イギリス合計			307.26 0.00
アメリカ合衆国			
USD	WINDSTREAM HLDGS I COM USD0.0001(POST REV SPLT	50.00	584.00 0.00
アメリカ合衆国合計			584.00 0.00
無記名株式合計			4 622.78 0.00

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 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 (%)
株式ストリップ			
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV STRIP	880.00	0.99	0.00
ベルギー合計		0.99	0.00
株式ストリップ合計		0.99	0.00
新株引受権			
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 13.05.15	234.00	284.33	0.00
EUR RANDSTAD HOLDING NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 24.04.15	61.00	83.93	0.00
EUR REED ELSEVIER DRIP (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 14.05.15	524.00	257.18	0.00
EUR TNT EXPRESS NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 06.05.15	285.00	9.88	0.00
EUR UNILEVER NV DRIP RIGHTS 03.06.15 TECHNICAL FOR SETTLEMENT	1 244.00	400.97	0.00
EUR WOLTERS NV DRIP RIGHT 15 TECHNICAL FOR SETTLEMENT EURONEXT	142.00	109.07	0.00
オランダ合計		1 145.36	0.00
新株引受権合計		1 145.36	0.00
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合計		5 769.13	0.00
UCITS/その他のUCIs			
投資証書、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-B USD	38 979.00	6 711 794.01	3.04
アイルランド合計		6 711 794.01	3.04
ジャージー			
USD UBS WEALTH MANAGEMENT-GLOBAL PROPERTY FUND LTD H-USD	75 137.52	376 085.83	0.17
ジャージー合計		376 085.83	0.17
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	35 500.00	4 308 520.35	1.95
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	720.40	11 079 527.70	5.03
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	581.00	6 533 763.32	2.96
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD)-U-X-ACC	208.00	4 434 807.52	2.01
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL.GLOBAL EQUITY FA-USD	1 366.00	25 125 616.62	11.40
EUR UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV-GLOBAL ALPHA OPP (EUR) U-X-ACC	666.28	9 396 183.17	4.27
USD UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV 2 - GLOBAL QUANTITATIVE I-X-ACC	15.36	24 954 264.27	11.32
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1 227.00	12 682 394.70	5.75
ルクセンブルグ合計		98 515 077.65	44.69
投資証書、オープン・エンド型合計		105 602 957.49	47.90
UCITS/その他のUCIs合計		105 602 957.49	47.90
投資有価証券合計		215 055 881.01	97.53
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.06.15	39.00	33 414.29	0.01
債券関連金融先物合計		33 414.29	0.01
指数関連金融先物			
JPY NIKKEI 225 (SGX) INDEX FUTURE 11.06.15	2.00	-459.60	0.00

GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 19.06.15	-26.00	42 880.09	0.02
USD	S&P500 EMINI FUTURE 19.06.15	70.00	35 262.50	0.02
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 19.06.15	209.00	-84 289.65	-0.04
指数関連金融先物合計			-6 606.66	0.00

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計			26 807.63	0.01
---------------------------------	--	--	------------------	-------------

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

クレジット・デフォルト・スワップ*

USD	CME/CDX.NA.IG.23DEC19 CDI REC 1.00000% 14-20.12.19	2 200 000.00	38 871.36	0.02
USD	CME/CDX.NA.HY.23 DEC19 CDI REC 5.00000% 14-20.12.19	3 528 000.00	311 571.44	0.14
クレジット・デフォルト・スワップ合計			350 442.80	0.16

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			350 442.80	0.16
---	--	--	-------------------	-------------

金融派生商品合計			377 250.43	0.17
-----------------	--	--	-------------------	-------------

* 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。

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 （％）
先渡為替契約						
先渡為替契約（購入 / 売却）						
USD	474	531.32	HKD	3 685 000.00	21.5.2015	-883.49 0.00
USD	1 216	398.04	AUD	1 595 000.00	21.5.2015	-40 314.06 -0.02
USD	106	927.92	NOK	890 000.00	21.5.2015	-11 112.60 0.00
USD	193	934.87	SGD	270 000.00	21.5.2015	-9 826.48 0.00
USD	2 836	243.69	JPY	343 930 000.00	21.5.2015	-38 226.33 -0.02
USD	1 867	067.31	CAD	2 386 000.00	21.5.2015	-102 276.84 -0.05
USD	3 052	103.04	GBP	2 065 000.00	21.5.2015	-120 851.15 -0.05
USD	417	317.53	SEK	3 605 000.00	21.5.2015	-14 561.63 -0.01
USD	97	981.31	ZAR	1 225 000.00	21.5.2015	-4 148.85 0.00
USD	205	570.40	DKK	1 445 000.00	21.5.2015	-11 560.40 -0.01
USD	12 364	408.75	EUR	11 675 000.00	21.5.2015	-721 189.84 -0.33
USD	698	349.73	CHF	700 297.43	21.5.2015	-49 597.81 -0.02
USD	175	735.85	MXN	2 720 000.00	21.5.2015	-1 089.64 0.00
USD	1 168	350.70	EUR	1 100 000.00	21.5.2015	-64 553.66 -0.03
USD	250	346.73	JPY	30 000 000.00	21.5.2015	-384.82 0.00
USD	280	763.00	GBP	190 000.00	21.5.2015	-11 179.52 0.00
USD	698	634.30	EUR	650 000.00	21.5.2015	-29 900.10 -0.01
USD	219	914.25	AUD	290 000.00	21.5.2015	-8 578.86 0.00
USD	99	990.25	ZAR	1 225 000.00	18.6.2015	-1 658.83 0.00
USD	1 518	818.95	AUD	2 009 150.00	18.6.2015	-61 745.36 -0.03
USD	14 504	778.08	EUR	13 735 000.00	18.6.2015	-895 554.61 -0.41
USD	410	139.62	SEK	3 613 700.00	18.6.2015	-23 027.49 -0.01
USD	3 124	172.34	JPY	373 930 000.00	18.6.2015	-2 113.94 0.00
USD	3 497	595.35	GBP	2 385 000.00	18.6.2015	-166 354.14 -0.08
USD	474	100.44	HKD	3 675 000.00	18.6.2015	-23.95 0.00
USD	2 294	102.41	CAD	2 887 940.00	18.6.2015	-88 579.05 -0.04
USD	271	127.82	SGD	370 000.00	18.6.2015	-7 960.42 0.00
USD	321	845.86	CHF	313 689.64	18.6.2015	-13 560.17 -0.01
USD	202	914.62	DKK	1 435 000.00	18.6.2015	-12 924.82 -0.01
USD	108	980.04	NOK	883 660.00	18.6.2015	-8 129.66 0.00
USD	176	344.89	MXN	2 720 000.00	18.6.2015	-127.40 0.00
USD	532	354.14	JPY	63 500 000.00	21.5.2015	1 639.03 0.00
USD	257	608.38	CAD	310 000.00	21.5.2015	1 742.21 0.00
USD	532	504.14	JPY	63 500 000.00	18.6.2015	1 604.83 0.00
USD	265	816.06	CAD	320 000.00	18.6.2015	1 801.55 0.00
先渡為替契約（購入 / 売却）合計						-2 515 208.30 -1.14
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						7 741 411.11 3.51
その他の資産および負債						-151 133.68 -0.07
純資産総額						220 508 200.57 100.00

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

2014年6月1日から2015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2015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	7,175,253.117 (2,731,383.000)	2,447,901.298 (177,920.000)	14,533,681.364 (2,809,113.000)
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	- (-)	- (-)	- (-)

(注1) () 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。

(注2) クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券は2015年6月2日に設定された。