

【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30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
トーマス・ポートマン (Thomas Portmann)

【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
クラス(日本円・ヘッジ) 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
15億9,500万米ドル(約1,713億円)
クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券
1,073億9,000万円

(注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2018年2月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている(バランスド(米ドル)クラス P - a c c 投資証券については15.95米ドルに1億口およびクラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券については10,739円に1,000万口を乗じて算出した金額である。)。

(注2) 米ドルの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2018年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=107.37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、また管理事務代行会社の名称が変更されましたので、平成30年4月27日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。) の関係情報を新たな情報により追加、更新および訂正するため、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】

(1) 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 (クラス (日本円・ヘッジ) を含む) 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」というときは、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)

	2016年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2016年10月末日に 終了する 会計年度末	2017年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2017年10月末日に 終了する 会計年度末	2018年4月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	- 1,304,153.23	6,992,798.37	12,952,190.52	25,622,118.77	3,261,075.38
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 1,304,153.23	6,992,798.37	12,952,190.52	25,622,118.77	3,261,075.38
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 1,304,153.23	6,992,798.37	12,952,190.52	25,622,118.77	3,261,075.38
(d) 出資総額 ^(2)	286,771,495.34	267,815,406.45	282,709,651.20	286,719,226.02	288,978,230.73
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	16,494,199.738口	13,519,373.174口	12,148,207.311口	11,475,677.196口	11,027,166.953口
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	329,561.000口	348,761.000口	545,437.279口	563,228.608口	645,297.008口
(f) 純資産額	286,771,495.34	267,815,406.45	282,709,651.20	286,719,226.02	288,978,230.73
(g) 資産総額	315,682,310.74	269,147,562.05	283,046,320.62	289,750,978.98	289,267,594.89
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	13.77	14.19	15.01	15.76	15.85
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	9,496円	9,738円	10,238円	10,675円	10,628円
(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)	- 0.24	0.14	0.83	1.65	0.09
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	6.96	10.46	0.56	2.49	2.69
(j) 分配総額	64,748.92	458,863.39	550,204.49	1,217,334.26	682,004.27
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	90.84%	99.51%	99.88%	98.95%	99.90%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	- 4.97%	0.64%	9.01%	11.06%	5.60%
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	- 5.04%	0.06%	7.81%	9.62%	3.81%

(1) 営業収益には投資収益および実現および未実現利益 (損失) 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) 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

2018年5月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

	出資総額(米ドル)	発行済投資証券総数(口)	
バランスド(米ドル)	288,479,346.75 (約31,358百万円)	クラス P - a c c 投資証券	10,922,943.502
		クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	649,055.699

(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

(本書提出日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	取締役会長	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)	取締役会役員 (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 マネージング・ディレクター	該当なし
トーマス・ポートマン (Thomas Portmann)	取締役会役員 (メンバー・オ ブ・ザ・ボード)	ユービーエス・ファンド・マネジメン ト(スイス)エイ・ジー、パーゼル マネージング・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nst・アンド・ヤング・エス・エイ(Ernst & Young S.A.)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

定足数および多数決の要件に関する法律規定を満たす投資主総会は本投資法人を解散することができる。

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、本投資法人を解散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。本投資法人が清算する場合、一名以上の清算人により終了される。投資主総会が清算人を任命し、清算人の報酬および権限の範囲を決定する。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、当該サブ・ファンドの清算による正味収入を当該サブ・ファンドの投資主に分配する。清算工程の終了時点で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。

同一サブ・ファンド内で各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産総額が当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスを経済的に合理的な管理のため要求される価額より下落するかまたはかかる価額に達しなかった場合、または政治、経済もしくは金融の状況が著しく変化した場合または合理化の一環として、本投資法人は、該当する投資証券クラスのすべての投資証券を決定が効力が生じる評価日または時間における純資産価格にて（投資対象の実際の換金レートおよび換金経費を考慮して）買い戻すことを決定することができる。

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、本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。

投資主総会または本投資法人の取締役会による投資証券の消却の決定は、2018年4月27日提出の有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営 3 投資主・外国投資法人債権者の権利」と題する項の「報告書を受領する権利」に記載される通り関係するサブ・ファンドの投資主に通知される。

買い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をそこなわずに、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2018年4月27日提出の有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営 3 投資主・外国投資法人債権者の権利」と題する項の「報告書を受領する権利」に記載される通り投資主に通知する。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、2018年4月27日提出の有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第2 手続等 2 買い戻し手続等」と題する項に記載するガイドラインに従って、買い戻手数料またはその他の管理料金を支払わずに、その時点の純資産価格で買い戻す権限を有する。買い戻しのために提出されなかった投資証券は、決定が有効となる日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価格に基づいて交換される。契約型投資信託として設立された投資ファンドの投資証券が割当てられる場合、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、本投資法人または関係するサブ・ファンドの投資主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。

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))

(2018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	164,886,427.18	56.81
	アイルランド	6,374,538.42	2.20
	ジャージー	73,950.47	0.03
	アメリカ合衆国	25,666.80	0.01
	シンガポール	9,750.64	0.00
	カナダ	2,105.92	0.00
	イギリス	1,036.54	0.00
	小計	171,373,475.97	59.05
債券	アメリカ合衆国	45,002,925.81	15.51
	国際機関	1,064,102.77	0.37
	大韓民国	723,337.73	0.25
	カナダ	643,541.91	0.22
	ドイツ	390,531.70	0.13
	オーストラリア	282,377.00	0.10
	ルクセンブルグ	256,323.58	0.09
	オランダ	235,937.50	0.08
	イギリス	234,991.08	0.08
	フランス	228,157.58	0.08
	クウェート	194,000.00	0.07
	カタール	192,500.00	0.07
	小計	49,448,726.66	17.04
その他証券	アイルランド	41,517,210.00	14.31
	小計	41,517,210.00	14.31

株式	アメリカ合衆国	12,156,473.76	4.19
	日本	1,824,846.93	0.63
	イギリス	1,158,389.88	0.40
	フランス	768,791.72	0.26
	カナダ	701,481.42	0.24
	ドイツ	691,259.34	0.24
	スイス	647,256.69	0.22
	オーストラリア	505,278.86	0.17
	オランダ	448,429.79	0.15
	香港	278,158.11	0.10
	スペイン	225,224.20	0.08
	スウェーデン	193,809.85	0.07
	アイルランド	177,845.37	0.06
	イタリア	157,511.15	0.05
	デンマーク	129,278.30	0.04
	シンガポール	98,084.95	0.03
	フィンランド	85,560.66	0.03
	ベルギー	75,412.39	0.03
	ノルウェー	54,415.98	0.02
	イスラエル	37,874.77	0.01
	ジャージー	35,680.59	0.01
	バミューダ	31,764.73	0.01
	ルクセンブルグ	20,118.51	0.01
	オーストリア	19,946.86	0.01
	マカオ	18,110.31	0.01
	ニュージーランド	9,617.81	0.00
	ポルトガル	5,497.79	0.00
	南アフリカ	4,308.58	0.00
	パプアニューギニア	3,835.84	0.00
	メキシコ	1,697.06	0.00
	小計	20,565,962.20	7.09
オプション (標準型)	アメリカ合衆国	163,680.00	0.06
	小計	163,680.00	0.06
ポートフォリオ合計		283,069,054.83	97.53
現金・その他資産		7,154,124.80	2.47
資産総額		290,223,179.63	100.00
負債総額		1,743,832.88	0.60
合計(純資産総額)		288,479,346.75 (約31,358百万円)	99.40

(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

2018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。

(バランズド(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
2017年6月末日	284,476	30,923	283,869	30,857	15.19	1,651	10,339
7月末日	285,648	31,050	285,077	30,988	15.37	1,671	10,446
8月末日	282,970	30,759	282,674	30,727	15.45	1,679	10,486
9月末日	280,812	30,524	277,721	30,188	15.58	1,694	10,569
10月末日	289,751	31,496	286,719	31,166	15.76	1,713	10,675
11月末日	290,540	31,582	288,367	31,345	15.83	1,721	10,712
12月末日	284,306	30,904	283,453	30,811	15.93	1,732	10,750
2018年1月末日	290,994	31,631	287,968	31,302	16.22	1,763	10,926
2月末日	288,471	31,357	283,715	30,840	15.95	1,734	10,739
3月末日	288,805	31,393	288,054	31,311	15.80	1,717	10,614
4月末日	289,268	31,443	288,978	31,412	15.85	1,723	10,628
5月末日	290,223	31,547	288,479	31,358	15.87	1,725	10,625

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。

同取引所での実質的な取引実績はない。

分配の推移

バランズド(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

2017年6月1日から2018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。

バランズド(米ドル)	収益率(%) (注)	
	クラスP - a c c 投資証券	4.55
	クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	2.70

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2018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 = 2017年5月末日現在の1口当たり純資産価格(分配額の額)

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2018年4月27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関して重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたって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

2018年5月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ (約16億円)

(注) ユーロの円貨換算は、便宜上、2018年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1ユーロ = 126.73円) による。

ユービーエス・エイ・ジー、UBS 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

2018年5月末日現在の株主資本総額は、385,840,847スイスフラン (約425億円)

(注) スイスフランの円貨換算は、便宜上、2018年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1スイスフラン = 110.05円) による。以下同じ。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー (チューリッヒ) (「投資運用会社」)

資本金 (株主資本) の額

2018年5月末日現在の株主資本総額は、10,000,000スイスフラン (約11億円)

(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

(2018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・アセット・マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,500	100

ユービーエス・エイ・ジー、UBS アセット・マネジメント (バーゼル・チューリッヒ)

(2018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・グループ・エイ・ジー (UBS Group AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、CH-8001 チューリッヒ、スイス	385,840,847	100

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2018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	100,000,000	100

(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

(2018年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ミュラー・ ウェグナー (André Müller-Wegner)	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、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
パスカル・キストラー (Pascal Kistler)	メンバー・オブ・ザ・ボ ード・オブ・ ディレクター ズ	UBS ビジネス・ソリューションズ・エ イ・ジー、チューリッヒ、マネージング・ ディレクター	該当なし
アンドレアス・シュラター (Andreas Schlatter)	メンバー・オブ・ザ・ボ ード・オブ・ ディレクター ズ	スイス、キュッティンゲン、インディペン デント・ディレクター、数学者(博士)	該当なし

ユービーエス・エイ・ジー、UBSアセット・マネジメント(バーゼル・チューリッヒ)

(2018年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユービーエス・グループ・エイ・ジー株式(2017年12月31日現在)
アクセル・ウェーバー (Axel Weber)	チェアマン	2012年5月3日就任	642,100株
ミシェル・デマレ (Michel Demaré)	ヴァイス・チェアマン	2010年4月14日就任	290,694株
イサベル・ロミー (Isabelle Romy)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2012年5月3日就任	94,376株
アン・エフ・ゴッドビーヒアー (Ann F. Godbehere)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2009年4月15日就任	232,263株
レト・フランシオニ (Reto Francioni)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2013年5月2日就任	76,772株
ウィリアム・ジー・パレット (William G. Parrett)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2008年10月2日就任	106,916株
ビートライス・ウェダー・ディ・マウロ (Beatrice Weder di Mauro)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2012年5月3日就任	126,809株
ディエター・ウェマー (Dieter Wemmer)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2016年5月4日就任	14,002株
ジュリー・ジー・リチャードソン (Julie G Richardson)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2017年4月27日就任	未公開
デイビッド・シドウェル (David Sidwell)	シニア・インディペンデント・ディレクター	2010年4月14日就任	154,672株
ロバート・ダブリュ・スカリー (Robert W. Scully)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2016年5月4日就任	29,917株

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2018年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユービーエス・グループ・エイ・ジー株式
ルーカス・ゲーヴィラー (Lukas Gähwiler)	チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ、ユービーエス・スイス・エイ・ジー	2017年ユービーエス・スイス・エイ・ジーへの初選出	非公開
セルジオ・エルモッティ (Sergio Ermotti)	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・スイス・エイ・ジー	2017年ユービーエス・スイス・エイ・ジーへの初選出	2,092,841株
フベルト・エミル・マルクス・アケーマン (Hubert Emil Markus Achermann)	ヴァイス・チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ、ユービーエス・スイス・エイ・ジー	2015年ユービーエス・スイス・エイ・ジーへの初選出	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティン (Daniel J. Crittin)	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・スイス・エイ・ジー	2016年ユービーエス・スイス・エイ・ジーへの初選出	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	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・スイス・エイ・ジー	2015年ユービーエス・スイス・エイ・ジーへの初選出	非公開
クリスチャン・ブルーム (Christian Bluhm)	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・スイス・エイ・ジー	2016年ユービーエス・スイス・エイ・ジーへの初選出	131,520株

(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

管理会社は、本投資法人と管理会社契約を締結し、当該契約に詳述された業務を遂行する。

2018年5月末日現在、管理会社は以下のとおり、313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	313	845,406,269.52 オーストラリア・ドル
			1,550,171,513.40 カナダ・ドル
			12,892,934,526.03 スイス・フラン
			555,508,747.12 中国元
			585,919,372.95 デンマーク・クローネ
			37,329,182,351.42 ユーロ
			2,443,907,011.48 英ポンド
			421,814,605.00 香港ドル
			146,117,287,375.83 日本円
			80,470,789.22 シンガポール・ドル
			101,944,229,566.40 米ドル

ユービーエス・エイ・ジー、UBS アセット・マネジメント (バーゼル・チューリッヒ)

2018年5月末日現在、ユービーエス・エイ・ジー、UBS アセット・マネジメント (バーゼル・チューリッヒ) は136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 (年/月/日)	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS ETF - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2002年9月20日	3,676,635,979
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	3,621,564,484
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31日	3,121,565,408
4	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する投資法人	2005年9月2日	3,100,732,926
5	UBS (Lux) Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月29日	2,544,996,313
6	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield (CHF)	契約型投資信託	1991年9月13日	1,760,580,101
7	UBS (Lux) Equity Sicav - Global Quantitative (USD)	変動資本を有する投資法人	2016年2月24日	1,592,717,143
8	UBS (Lux) Strategy Sicav - Systematic Allocation Portfolio Medium (USD)	変動資本を有する投資法人	2017年5月31日	1,583,398,745
9	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月11日	1,441,299,663
10	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced (USD)	契約型投資信託	1994年7月7日	1,280,920,190

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2018年3月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は以下の45本のサブ・ファンドを運用している。

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)
スイス	オープン・エンド型ファンド	5	57億スイスフラン
ケイマン諸島	ヘッジ・ファンド	12	93億スイスフラン
ルクセンブルグ	オープン・エンド型ファンド	28	247億スイスフラン

(注1) 一部のファンドについては、ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は、管理会社の選定およびアセット・アロケーションについてのみ責任を負っている。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[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سد(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、2018年5月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=108.70円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

U B S (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

	2018年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	246,084,650.16	26,749,401
投資有価証券、未実現評価(損)益	36,034,271.00	3,916,925
投資有価証券合計(注1)	282,118,921.16	30,666,327
現金預金、要求払預金および預託金勘定	2,816,114.84	306,112
その他の流動資産(マージン)	996,254.03	108,293
有価証券売却未収金(注1)	1,517,656.55	164,969
発行未収金	7,657.73	832
有価証券に係る未収利息	248,683.44	27,032
流動資産に係る未収利息	351.88	38
配当金に係る未収金	42,384.52	4,607
その他の未収金	10,744.34	1,168
その他の資産	140,271.27	15,247
金融先物未実現(損)益(注1)	656,090.78	71,317
先渡為替契約未実現(損)益(注1)	712,464.35	77,445
資産合計	289,267,594.89	31,443,388
負 債		
買戻未払金	(27,211.47)	(2,958)
報酬引当金(注2)	(231,800.72)	(25,197)
年次税引当金(注3)	(5,155.02)	(560)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(25,196.95)	(2,739)
引当金合計	(262,152.69)	(28,496)
負債合計	(289,364.16)	(31,454)
期末現在純資産	288,978,230.73	31,411,934

注記は当財務書類と不可分のものである。

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)

運用計算書

	自2017年11月 1 日 至2018年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	16,713.81	1,817
有価証券に係る利息	466,222.85	50,678
配当金	198,634.99	21,592
貸付証券に係る収益(注11)	41,288.60	4,488
その他の収益(注4)	23,614.82	2,567
収益合計	746,475.07	81,142
費 用		
貸付証券に係るコスト(注11)	(16,515.44)	(1,795)
報酬(注2)	(2,772,533.09)	(301,374)
年次税(注3)	(36,427.74)	(3,960)
その他の手数料および報酬(注2)	(32,221.37)	(3,502)
現金および当座借越に係る利息	(10,298.20)	(1,119)
費用合計	(2,867,995.84)	(311,751)
投資純(損)益	(2,121,520.77)	(230,609)
実現利益(注1)		
無オプション市場価格証券	4,056,302.97	440,920
オプション	1,196.44	130
金融先物	724,207.35	78,721
先渡為替契約	7,469,876.80	811,976
為替差益	14,766,485.48	1,605,117
実現利益合計	27,018,069.04	2,936,864
実現損失(注1)		
無オプション市場価格証券	(304,398.46)	(33,088)
オプション	(90.20)	(10)
金融先物	(1,672,252.02)	(181,774)
先渡為替契約	(7,067,251.10)	(768,210)
為替差損	(15,103,620.77)	(1,641,764)
実現損失合計	(24,147,612.55)	(2,624,845)
当期実現純(損)益	748,935.72	81,409
未実現評価益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券	38,536,635.97	4,188,932
オプション	5,505.97	598
金融先物	711,296.25	77,318
先渡為替契約	712,464.35	77,445
未実現評価益の変動合計	39,965,902.54	4,344,294
未実現評価損の変動(注1)		
無オプション市場価格証券	(36,229,033.27)	(3,938,096)
金融先物	(380,060.50)	(41,313)
先渡為替契約	(844,669.11)	(91,816)
未実現評価損の変動合計	(37,453,762.88)	(4,071,224)
運用の結果による純資産の純増(減)	3,261,075.38	354,479

注記は当財務書類と不可分のものである。

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2017年11月1日 至2018年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	286,719,226.02	31,166,380
発行額	27,375,740.99	2,975,743
買戻額	(27,695,807.39)	(3,010,534)
純発行(買戻)合計	(320,066.40)	(34,791)
支払配当金	(682,004.27)	(74,134)
投資純(損)益	(2,121,520.77)	(230,609)
実現利益合計	27,018,069.04	2,936,864
実現損失合計	(24,147,612.55)	(2,624,845)
未実現評価益の変動合計	39,965,902.54	4,344,294
未実現評価損の変動合計	(37,453,762.88)	(4,071,224)
運用の結果による純資産の純増(減)	3,261,075.38	354,479
期末現在純資産	288,978,230.73	31,411,934

発行済投資証券数の変動表

	自2017年11月1日 至2018年4月30日
クラスP - 4% - m d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,461,852.4480
期中発行投資証券数	4,370.1520
期中買戻投資証券数	(127,369.2980)
期末現在発行済投資証券数	2,338,853.3020
クラス(シンガポールドル・ヘッジ)	
P - 4% - m d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	838,077.9610
期中発行投資証券数	72,305.0420
期中買戻投資証券数	(18,214.9370)
期末現在発行済投資証券数	892,168.0660
クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	11,475,677.1960
期中発行投資証券数	803,554.9440
期中買戻投資証券数	(1,252,065.1870)
期末現在発行済投資証券数	11,027,166.9530
クラス(日本円・ヘッジ)P - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	563,228.6080
期中発行投資証券数	130,169.8980
期中買戻投資証券数	(48,101.4980)
期末現在発行済投資証券数	645,297.0080
クラスP - d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	583,215.4230
期中発行投資証券数	57,740.2420

期中買戻投資証券数	(3,694.3980)
期末現在発行済投資証券数	637,261.2670
クラスQ - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	87,279.7520
期中発行投資証券数	3,110.3320
期中買戻投資証券数	(10,679.9200)
期末現在発行済投資証券数	79,710.1640
クラスQ - d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	2,962.7730
期中発行投資証券数	0.0000
期中買戻投資証券数	(1,744.6460)
期末現在発行済投資証券数	1,218.1270

年次分配金

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)	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P - d i s t	2017年12月11日	2017年12月14日	米ドル	0.00
Q - d i s t	2017年12月11日	2017年12月14日	米ドル	0.65

月次分配金

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)	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額
P - 4 % - m d i s t	2017年11月10日	2017年11月15日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2017年12月11日	2017年12月14日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2018年 1 月10日	2018年 1 月16日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2018年 2 月12日	2018年 2 月15日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2018年 3 月12日	2018年 3 月15日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2018年 4 月10日	2018年 4 月13日	米ドル	0.04
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2017年11月10日	2017年11月15日	シンガポール・ドル	0.04
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2017年12月11日	2017年12月14日	シンガポール・ドル	0.04
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2018年 1 月10日	2018年 1 月15日	シンガポール・ドル	0.04
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2018年 2 月12日	2018年 2 月15日	シンガポール・ドル	0.04
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2018年 3 月12日	2018年 3 月15日	シンガポール・ドル	0.04
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2018年 4 月10日	2018年 4 月13日	シンガポール・ドル	0.04

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

最重要数値

	ISIN	2018年4月30日	2017年10月31日	2016年10月31日
純資産額 (米ドル)		288 978 230.73	286 719 226.02	267 815 406.45
クラスP - 4% - m d i s t	LU1336973653			
発行済投資証券数 (口)		2 338 853.3020	2 461 852.4480	2 190 567.3830
1口当たり純資産価格 (米ドル)		10.92	11.08	10.37
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		10.92	11.08	10.37
クラス (シンガポールドル・ヘッジ)				
P - 4% - m d i s t	LU1336973570			
発行済投資証券数 (口)		892 168.0660	838 077.9610	587 192.7080
1口当たり純資産価格				
(シンガポール・ドル)		10.83	11.03	10.38
1口当たり発行・買戻価格				
(シンガポール・ドル) ¹		10.83	11.03	10.38
クラスP - a c c	LU0200191152			
発行済投資証券数 (口)		11 027 166.9530	11 475 677.1960	13 519 373.1740
1口当たり純資産価格 (米ドル)		15.85	15.76	14.19
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		15.85	15.76	14.19
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c	LU1152097959			
発行済投資証券数 (口)		645 297.0080	563 228.6080	348 761.0000
1口当たり純資産価格 (日本円)		10 628.00	10 675.00	9 738.00
1口当たり発行・買戻価格 (日本円) ¹		10 628.00	10 675.00	9 738.00
クラスP - d i s t	LU0234745577			
発行済投資証券数 (口)		637 261.2670	583 215.4230	651 645.5940
1口当たり純資産価格 (米ドル)		14.33	14.25	12.84
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		14.33	14.25	12.84
クラスQ - a c c	LU1240802741			
発行済投資証券数 (口)		79 710.1640	87 279.7520	73 020.5110
1口当たり純資産価格 (米ドル)		118.67	117.48	104.84
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		118.67	117.48	104.84
クラスQ - d i s t	LU1240802824			
発行済投資証券数 (口)		1 218.1270	2 962.7730	4 524.1240
1口当たり純資産価格 (米ドル)		115.55	115.03	103.51
1口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ¹		115.55	115.03	103.51

¹ 注記1を参照

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)

組入証券の構造

通貨別分類表	(純資産に対する百分率 %)	投資商品分類表	(純資産に対する百分率 %)
米ドル	90.90	投資信託、オープン・エンド型	59.00
ユーロ	4.72	投資信託証券	14.37
日本円	0.64	財務省証券(T-note)、固定利付債	9.70
英ポンド	0.47	無記名株式	6.63
カナダ・ドル	0.23	財務省証券(T-note)、変動利付債	4.02
スイス・フラン	0.20	ノート、固定利付債	1.85
オーストラリア・ドル	0.18	債券、固定利付債	1.02
香港ドル	0.10	中期債券、固定利付債	0.47
スウェーデン・クローナ	0.07	記名株式	0.40
デンマーク・クローネ	0.05	指数に係るオプション、標準型	0.08
シンガポール・ドル	0.04	その他の株式	0.05
ノルウェー・クローネ	0.02	優先株式	0.02
イスラエル・シェケル	0.01	預託証券	0.01
合計	97.63	投資信託、クローズド・エンド型	0.01
		合計	97.63

注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2018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呼値スプレッドは、計算上考慮される。ファンドの全投資証券が純増する場合、調整は純資産価額の増加を導く。投資証券が純減する場合、調整は純資産価額の減少となる。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。

証券取引所において通常の取引が行われていない証券、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、定期的に運営され、認知され、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（OTC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。

- 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根）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入額と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 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) 証券の売却に係る実現純（損）益

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

本投資法人の連結財務書類は、ユーロで実証される。本投資法人の2018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、2018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 = 1.195997 スイス・フラン

1 ユーロ = 1.208200 米ドル

i) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「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「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定率報酬を各サブ・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)

上限定率報酬 (年率)

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	1.250%*
名称に「I - A 1」が付く投資証券クラス	1.050%
名称に「I - A 2」が付く投資証券クラス	1.000%
名称に「I - A 3」が付く投資証券クラス	0.940%
名称に「F」が付く投資証券クラス	0.940%
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%

*実効報酬料率1.050%

上記の定率報酬は、以下のとおり用いられるものとする。

1. 本投資法人の運用、管理事務、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、次の規定に従い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定率報酬が支払われる。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（上限定率料率）。関連する上限定率報酬は対応する投資証券クラスが発行されるまで請求されない。上限定率報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよびその特別投資方針」の項にて参照できる。
2. 上限定率報酬は、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UCIs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。

サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬の上限は、あらゆる付随的な報酬を考慮の上、適用されるパフォーマンス報酬を除き、最大3%(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、最高4.5%)とする。

管理会社もしくはその委託先により直接運用されるか、または合同運用もしくは支配または直接的もしくは間接的な実質保有を通じて管理会社と関係する別の会社により、運用されるファンドの受益証券へ投資する場合、対象ファンドの受益証券に関連して投資を行うサブ・ファンドは、発行および買戻しの手数を請求されないことがある。

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 - その他の収益

その他の収益は、主にシングル・スイング・プライシングから生じた収益で構成される。

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 - 金融先物契約

2018年4月30日現在の個々のサブ・ファンドおよび各通貨の金融先物に係る契約債務は、以下のよう
に要約できる。

金融先物

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)	18 861 913.13 米ドル	9 237 228.33 米ドル
---------------	-------------------	------------------

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)	5 627 187.50 米ドル	8 259 904.08 米ドル
---------------	------------------	------------------

注7 - ソフト・コミッション取決め

2017年11月1日から2018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 - 4 % - m d i s t	2.12%
- バランスド (米ドル) (シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2.12%
- バランスド (米ドル) P - a c c	2.10%
- バランスド (米ドル) (日本円・ヘッジ) P - a c c	2.10%
- バランスド (米ドル) P - d i s t	2.11%
- バランスド (米ドル) Q - a c c	1.16%
- バランスド (米ドル) Q - d i s t	1.16%

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 - 取締役会により零と評価される有価証券

UBS 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*

* サブ・ファンド (イールド (スイスフラン)、バランスド (スイスフラン)、イールド (ユーロ) およびバランスド (ユーロ))

注10 - 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11 - 証券貸付

本投資法人は、第三者に本投資法人の組入証券の一部分を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。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 ヨーロッパ SE ルクセンブルグ支店は、証券の貸付機関として行為する。

貸付証券

U B S (Lux) ストラテジー ・エクストラ・シキャブ	2018年 4 月30日現在		2018年 4 月30日現在		
	貸付証券による		担保内訳(比率%)		
	取引相手方エクスポージャー				
	貸付証券 時価	担保(ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- バランスド(米ドル)	46 241 643.72	48 944 972.66	68.23	31.77	0.00
	米ドル	米ドル			

(2) 投資有価証券明細表等

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

2018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 / 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	365.00	5 987.06	0.00
AUD AMCOR LIMITED NPV	553.00	5 731.34	0.00
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	675.00	2 058.48	0.00
AUD APA GROUP NPV	1 582.00	9 971.34	0.01
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	1 478.00	29 944.54	0.01
AUD BHP BILLITON LTD NPV	1 632.00	38 127.78	0.01
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	504.00	3 827.27	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 664.00	12 397.41	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	178.00	4 167.95	0.00
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	408.00	3 326.17	0.00
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	80.00	2 741.01	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	848.00	45 972.90	0.02
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	394.00	2 762.95	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	45.00	6 591.88	0.00
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	382.00	4 902.00	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	255.00	2 494.63	0.00
AUD CSL NPV	230.00	29 577.14	0.01
AUD DEXUS NPV (STAPLED)	1 457.00	10 437.26	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	71.00	2 995.92	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	772.00	2 657.31	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 748.00	11 967.66	0.01
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 093.00	3 135.19	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	2 370.00	14 133.06	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	89.00	1 201.88	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	179.00	14 685.99	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	1 338.00	29 239.19	0.01
AUD NEWCREST MINING NPV	419.00	6 689.37	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	444.00	6 662.85	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	872.00	6 417.73	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	748.00	5 623.69	0.00
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	97.00	4 736.63	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	191.00	11 513.92	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	788.00	3 652.21	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	3 381.00	10 285.16	0.00
AUD SEEK LIMITED NPV	336.00	4 928.02	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	313.00	5 580.65	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	2 437.00	6 843.20	0.00
GBP SOUTH32 LTD NPV	1 554.00	4 319.33	0.00
AUD SUNCORP GROUP	701.00	7 418.68	0.00
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	184.00	990.30	0.00
AUD TELSTRA CORP NPV	2 356.00	5 655.40	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	1 511.00	13 230.71	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	468.00	6 736.86	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	540.00	17 841.48	0.01
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	1 176.00	8 166.87	0.00
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	1 679.00	36 298.14	0.01
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	423.00	10 287.90	0.00
AUD WOOLWORTHS GRP LTD NPV	638.00	13 417.22	0.01
オーストラリア合計		498 331.63	0.17

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	68.00	3 660.94	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	158.00	7 750.36	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	113.00	7 031.12	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	65.00	3 432.68	0.00
オーストリア合計		21 875.10	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV	23.00	1 235.20	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	408.00	40 776.46	0.02
EUR COLRUYT SA NPV	66.00	3 722.32	0.00
EUR PROXIMUS SA NPV	41.00	1 259.71	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	30.00	4 190.04	0.00
EUR TELENET GRP HLDG NPV	62.00	3 637.55	0.00
EUR UCB NPV	65.00	4 928.73	0.00
EUR UMICORE NPV	160.00	8 942.61	0.00
ベルギー合計		68 692.62	0.02
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	77.00	6 170.01	0.00
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	100.00	5 870.00	0.00
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	300.00	6 018.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	54.00	7 346.16	0.01
USD XL GROUP LTD COM USD0.01	125.00	6 948.75	0.00
バミューダ合計		32 352.92	0.01
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	135.00	5 689.81	0.00
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	216.00	9 353.06	0.00
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	100.00	1 930.65	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	149.00	1 664.40	0.00
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	615.00	37 860.92	0.01
CAD BANK OF MONTREAL COM NPV	324.00	24 644.67	0.01
CAD BCE INC COM NEW	41.00	1 742.73	0.00
CAD BLACKBERRY LTD NPV	200.00	2 096.81	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS ' B ' SUB-VTG NPV	900.00	2 787.16	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL ' A '	430.00	17 069.85	0.01
CAD CAE INC COM	277.00	5 244.19	0.00
CAD CAMECO CORP COM	182.00	1 919.45	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	75.00	13 706.46	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	601.00	21 715.61	0.01
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	397.00	30 711.41	0.01
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	109.00	2 780.37	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	190.00	16 574.52	0.01
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	489.00	4 905.45	0.00
CAD CGI GROUP INC ' A ' SUB-VTG NPV	178.00	10 330.51	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	191.00	4 025.76	0.00
CAD CRESCENT POINT EN COM NPV	214.00	1 878.00	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	100.00	11 529.31	0.01
CAD ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	200.00	756.66	0.00
CAD ENBRIDGE INC COM NPV	481.00	14 591.90	0.01
USD ENBRIDGE INC COM NPV	356.00	10 776.12	0.01
CAD ENCANA CORP COM NPV	573.00	7 147.14	0.00
CAD FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	25.00	13 862.28	0.01
CAD FINNING INTL INC COM NEW	203.00	5 129.04	0.00
CAD FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	447.00	6 450.72	0.00
CAD FORTIS INC COM NPV	167.00	5 614.65	0.00
CAD FRANCO NEVADA CORP COM NPV	75.00	5 328.02	0.00
CAD GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	200.00	5 834.86	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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	GOLDCORP INC COM NPV	557.00	7 403.78	0.00
CAD	GREAT WEST LIFECO INC COM	162.00	4 325.64	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	204.00	2 858.02	0.00
CAD	IGM FINANCIAL INC COM	124.00	3 812.04	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	187.00	5 824.65	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	60.00	4 582.08	0.00
CAD	INTER PIPELINE LTD COM NPV	200.00	3 611.69	0.00
SEK	INTERNATIONAL PETROLEUM CORP/SWEDEN	50.00	235.62	0.00
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NPV	500.00	1 938.45	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	154.00	7 844.46	0.00
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK US\$0.01	28.00	2 794.40	0.00
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	223.00	13 190.91	0.01
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	1 059.00	20 016.05	0.01
CAD	METHANEX CORP COM	100.00	6 036.90	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	109.00	3 463.99	0.00
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	157.00	7 468.20	0.00
CAD	NUTRIEN LTD NPV	416.00	18 967.35	0.01
CAD	OPEN TEXT CO COM NPV	200.00	7 072.04	0.00
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	241.00	7 687.11	0.00
CAD	POWER CORP CDA COM	140.00	3 331.96	0.00
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	163.00	4 235.37	0.00
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	88.00	4 788.96	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	163.00	7 706.56	0.00
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	763.00	58 114.06	0.02
CAD	SAPUTO INC COM	200.00	6 494.79	0.00
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	401.00	8 254.92	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	100.00	4 390.97	0.00
CAD	SUN LIFE FINL INC COM	309.00	12 775.07	0.01
CAD	SUNCOR ENERGY INC COM NPV ' NEW '	873.00	33 436.80	0.01
CAD	TECK RESOURCES LTD CLASS ' B ' SUB-VTG COM NPV	495.00	12 444.99	0.01
CAD	THOMSON-REUTERS CO COM NPV	144.00	5 799.54	0.00
CAD	TORONTO-DOMINION COM NPV	947.00	53 268.98	0.02
CAD	TRANSCANADA CORP COM NPV	445.00	18 897.62	0.01
CAD	VERMILION ENERGY I COM NPV	100.00	3 385.47	0.00
CAD	WHEATON PRECIOUS M COM NPV	200.00	4 157.73	0.00
カナダ合計			676 269.66	0.23
デンマーク				
DKK	A.P.MOELLER-MAERSK SER ' B ' DKK1000	5.00	8 072.45	0.00
DKK	A.P.MOLLER-MAERSK ' A ' DKK1000	4.00	6 139.48	0.00
DKK	CARLSBERG SER ' B ' DKK20	60.00	6 727.15	0.00
DKK	CHR.HANSEN HLDG DKK10	30.00	2 730.17	0.00
DKK	COLOPLAST DKK1 B	67.00	5 693.20	0.00
DKK	DANSKE BANK A/S DKK10	335.00	11 701.49	0.01
DKK	DSV DKK1	143.00	11 369.69	0.01
DKK	ISS A/S DKK1	49.00	1 716.33	0.00
DKK	NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER ' B '	985.00	46 609.26	0.02
DKK	NOVOZYMES A/S SER ' B ' DKK2 (POST CONS)	93.00	4 396.15	0.00
DKK	PANDORA A/S DKK1	77.00	8 583.23	0.00
DKK	TDC A/S DKK1	305.00	2 484.85	0.00
DKK	TRYG A/S DKK5	195.00	4 632.58	0.00
DKK	VESTAS WIND SYSTEM DKK1	138.00	8 955.85	0.01
DKK	WILLIAM DEMANT HOL DKK0.20	127.00	4 967.43	0.00
デンマーク合計			134 779.31	0.05
フィンランド				
EUR	ELISA CORPORATION EURO.50	138.00	6 122.38	0.00
EUR	FORTUM OYJ EUR3.40	221.00	5 102.60	0.00
EUR	KONE CORPORATION NPV ORD ' B '	134.00	6 679.94	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 METSO OYJ NPV	83.00	2 967.30	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	67.00	5 658.36	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	3 051.00	18 350.00	0.01
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	88.00	3 535.19	0.00
EUR SAMPO OYJ SER ' A ' NPV	198.00	10 705.26	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER ' R '	505.00	10 027.67	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	307.00	11 008.83	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER ' B ' EUR3.50	330.00	7 037.16	0.00
フィンランド合計		87 194.69	0.03
フランス			
EUR ACCOR EUR3	104.00	5 889.35	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	225.00	29 372.85	0.01
EUR AIRBUS EUR1	297.00	34 950.57	0.01
EUR ALSTOM EUR7.00	143.00	6 515.25	0.00
EUR ARKEMA EUR10	41.00	5 374.68	0.00
EUR ATOS SE EUR1	74.00	10 004.62	0.00
EUR AXA EUR2.29	991.00	28 400.58	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	554.00	42 824.55	0.02
EUR BOUYGUES EUR1	96.00	4 900.46	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	217.00	5 676.18	0.00
EUR CAPGEMINI EUR8	99.00	13 635.75	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	267.00	5 495.32	0.00
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	46.00	2 387.60	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	233.00	12 244.31	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	607.00	9 999.61	0.00
EUR DANONE EURO.25	295.00	23 912.15	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	82.00	10 625.51	0.00
EUR EDENRED EUR2	146.00	5 027.32	0.00
EUR EDF EURO.5	160.00	2 252.08	0.00
EUR ENGIE EUR1	1 121.00	19 706.41	0.01
EUR ESSILOR INTL EURO.18	111.00	15 161.16	0.01
EUR EURAZEO NPV	30.00	2 638.71	0.00
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	91.00	1 972.43	0.00
EUR GETLINK SE EURO.40	333.00	4 703.24	0.00
EUR HERMES INTL NPV	16.00	10 357.66	0.00
EUR ILIAD NPV	21.00	4 210.52	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	13.00	1 137.16	0.00
EUR KERING EUR4	52.00	30 131.54	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	53.00	2 172.05	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	156.00	37 479.09	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	121.00	9 429.40	0.00
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	143.00	49 983.11	0.02
EUR NATIXIS EUR1.6	621.00	5 110.99	0.00
EUR ORANGE EUR4	1 058.00	19 321.14	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	157.00	26 091.50	0.01
EUR PEUGEOT SA EUR1	181.00	4 465.53	0.00
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	72.00	5 393.40	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	114.00	12 374.09	0.01
EUR REXEL EUR5	156.00	2 421.96	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	149.00	17 544.92	0.01
EUR SANOFI EUR2	601.00	47 771.97	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	275.00	25 012.16	0.01
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	91.00	3 699.69	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	399.00	21 912.58	0.01
EUR SODEXO EUR4	57.00	5 654.01	0.00
EUR SUEZ EUR4	204.00	2 947.81	0.00
EUR THALES EUR3	32.00	4 059.55	0.00
EUR TOTAL EUR2.5	1 189.00	75 174.65	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 UNIBAIL-RODAMCO EUR5	44.00	10 573.68	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	112.00	7 502.05	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	228.00	5 414.35	0.00
EUR VINCI EUR2.50	243.00	24 397.55	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	533.00	14 096.52	0.01
EUR WENDEL EUR4	62.00	9 378.53	0.00
フランス合計		798 889.85	0.28
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	146.00	16 311.45	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	60.00	6 808.45	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	629.00	8 139.15	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	43.00	11 491.92	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	193.00	9 126.77	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	97.00	9 877.23	0.00
EUR FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV	196.00	14 999.37	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	89.00	3 485.04	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	62.00	6 087.06	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	107.00	12 766.14	0.01
EUR KION GROUP AG NPV	26.00	2 176.93	0.00
EUR LANXESS AG NPV	56.00	4 165.10	0.00
EUR LINDE AG NPV (ASD 24/10/2017)	93.00	20 680.34	0.01
EUR MAN SE ORD NPV	30.00	3 461.49	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	91.00	8 929.83	0.00
EUR METRO AG (NEW) NPV	89.00	1 291.98	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	240.00	5 763.11	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	507.00	56 612.55	0.02
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	47.00	3 810.30	0.00
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	1 240.00	5 934.24	0.00
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	372.00	9 708.13	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	24.00	4 912.06	0.00
ドイツ合計		226 538.64	0.08
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	6 600.00	59 455.29	0.02
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	2 000.00	10 409.96	0.00
HKD CK ASSET HOLDINGS HKD1	1 368.00	11 861.55	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	1 368.00	16 227.92	0.01
HKD CK INFRASTRUCTURE HKD1	1 000.00	7 912.59	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	1 000.00	10 384.48	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	2 000.00	17 685.47	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	4 000.00	9 500.21	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	500.00	12 716.21	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 339.00	8 539.09	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	567.00	18 581.52	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	100.00	725.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	4 699.00	9 843.16	0.00
HKD I-CABLE COMMUNICAT NPV	1 468.00	31.42	0.00
HKD LI & FUNG HKD0.0125	8 000.00	4 046.76	0.00
HKD MTR CORP HKD1	1 543.00	8 699.74	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	5 380.00	7 951.84	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 000.00	7 447.52	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	2 610.00	4 516.14	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	1 047.00	16 915.82	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	4 969.26	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 500.00	13 302.33	0.01
HKD WHARF REAL ESTATE HKD0.1	1 000.00	7 517.60	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	3 344.69	0.00
HKD WHEELLOCK & COMPANY HKD0.50	1 000.00	7 460.26	0.00
香港合計		280 045.83	0.10

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	325.00	49 140.00	0.02
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	100.00	4 427.00	0.00
EUR CRH ORD EURO.32	486.00	17 327.84	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	227.00	17 031.81	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	583.00	13 385.93	0.01
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST	109.00	11 128.13	0.00
USD MALLINCKRODT PLC USD0.20	100.00	1 300.00	0.00
EUR PADDY POWER BETFAI ORD EURO.09	29.00	2 871.35	0.00
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	147.00	9 890.16	0.00
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	75.00	5 860.50	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	200.00	11 578.00	0.00
GBP SHIRE ORD GBPO.05	464.00	24 707.23	0.01
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	35.00	103.25	0.00
アイルランド合計		168 751.20	0.06
イスラエル			
ILS BANK HAPOALIM B.M.ILS1	720.00	4 934.88	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	833.00	1 051.58	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 477.00	8 744.02	0.01
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	56.00	5 404.56	0.00
ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1	439.00	1 974.21	0.00
イスラエル合計		22 109.25	0.01
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	717.00	14 501.52	0.01
EUR ATLANTIA SPA EUR1	148.00	4 917.37	0.00
EUR ENEL EUR1	3 935.00	25 045.48	0.01
EUR ENI SPA EUR1	1 350.00	26 423.33	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	80.00	9 863.74	0.01
EUR INTESA SANPAOLO EURO.52	6 852.00	26 135.49	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	324.00	3 761.90	0.00
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	108.00	6 753.93	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	449.00	5 460.09	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	102.00	3 004.50	0.00
EUR SAIPEM NPV(POST CONS)	221.00	847.49	0.00
EUR SNAM EUR1	1 683.00	8 103.11	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	7 324.00	6 309.23	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	5 164.00	5 104.86	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	951.00	5 718.57	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	1 534.00	33 312.64	0.01
イタリア合計		185 263.25	0.06
日本			
JPY イオン	300.00	5 997.26	0.00
JPY イオンモール	110.00	2 229.66	0.00
JPY アイシン精機	100.00	5 428.38	0.00
JPY 味の素	200.00	3 666.44	0.00
JPY アルフレッサ ホールディングス	100.00	2 207.90	0.00
JPY アルプス電気	100.00	2 218.87	0.00
JPY A N A ホールディングス	100.00	3 966.19	0.00
JPY 旭硝子	200.00	8 297.92	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	300.00	15 177.52	0.01
JPY 旭化成	1 000.00	13 776.56	0.01
JPY アステラス製薬	1 200.00	17 606.58	0.01
JPY パンダイナムコホールディングス	200.00	6 790.04	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	3 646.33	0.00
JPY プリヂストーン	300.00	12 581.22	0.01
JPY カルビー	100.00	3 372.17	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 キヤノン	500.00	17 317.80	0.01
JPY 東海旅客鉄道	100.00	20 077.68	0.01
JPY 中部電力	400.00	6 263.65	0.00
JPY 中外製薬	200.00	10 564.31	0.01
JPY 中国銀行	100.00	1 161.53	0.00
JPY 中国電力	400.00	5 008.00	0.00
JPY クレディセゾン	100.00	1 793.92	0.00
JPY 大日本印刷	500.00	10 774.50	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	600.00	11 920.49	0.01
JPY 第一三共	300.00	10 281.01	0.00
JPY ダイキン工業	200.00	23 404.16	0.01
JPY 大和ハウス工業	300.00	10 993.83	0.01
JPY 大和証券グループ本社	1 000.00	6 147.59	0.00
JPY デンソー	300.00	15 780.67	0.01
JPY 電通	100.00	4 733.84	0.00
JPY ドンキホーテホールディングス	200.00	10 783.64	0.01
JPY 東日本旅客鉄道	200.00	19 172.95	0.01
JPY エーザイ	100.00	6 712.36	0.00
JPY ユニー・ファミリーマートホールディングス	100.00	9 714.42	0.00
JPY ファナック	100.00	21 530.73	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	200.00	8 051.18	0.00
JPY 富士通	1 000.00	6 085.45	0.00
JPY 博報堂D Yホールディングス	300.00	4 197.40	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	200.00	7 886.68	0.00
JPY 日野自動車	400.00	4 887.37	0.00
JPY 久光製薬	100.00	7 795.29	0.00
JPY 日立化成	100.00	2 198.77	0.00
JPY 日立建機	100.00	3 641.76	0.00
JPY 日立製作所	2 000.00	14 651.13	0.01
JPY 本田技研工業	800.00	27 540.32	0.01
JPY H O Y A	200.00	10 714.19	0.01
JPY ヒューリック	200.00	2 151.25	0.00
JPY 国際石油開発帝石	800.00	10 253.60	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	7 649.07	0.00
JPY 伊藤忠商事	800.00	16 040.21	0.01
JPY 日本取引所グループ	300.00	5 565.46	0.00
JPY ゆうちょ銀行	200.00	2 719.67	0.00
JPY 日本郵政	200.00	2 430.89	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	2.00	3 746.86	0.00
JPY 日本たばこ産業	600.00	16 101.44	0.01
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	200.00	4 120.63	0.00
JPY J S R	200.00	3 774.27	0.00
JPY ジェイテクト	100.00	1 622.12	0.00
JPY J X T Gホールディングス	1 000.00	6 528.67	0.00
JPY カカクコム	200.00	3 821.80	0.00
JPY 関西電力	400.00	5 592.87	0.00
JPY 関西ペイント	100.00	2 251.77	0.00
JPY 花王	300.00	21 535.30	0.01
JPY K D D I	1 000.00	26 840.30	0.01
JPY キリンホールディングス	600.00	16 849.90	0.01
JPY 小糸製作所	200.00	13 433.86	0.01
JPY 小松製作所	600.00	20 562.03	0.01
JPY コナミホールディングス	100.00	4 916.61	0.00
JPY コニカミノルタ	500.00	4 295.18	0.00
JPY クボタ	600.00	10 141.19	0.00
JPY クラレ	300.00	4 995.20	0.00
JPY 栗田工業	200.00	6 488.46	0.00
JPY 京セラ	200.00	12 790.50	0.01
JPY 九州電力	300.00	3 706.65	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 L I X I L グループ	200.00	4 483.44	0.00
JPY マキタ	200.00	8 992.46	0.00
JPY 丸紅	900.00	6 778.89	0.00
JPY マツダ	200.00	2 780.90	0.00
JPY メディカルホールディングス	200.00	4 297.01	0.00
JPY 明治ホールディングス	100.00	8 023.76	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	600.00	5 699.79	0.00
JPY 三菱商事	800.00	22 130.23	0.01
JPY 三菱電機	1 000.00	15 357.55	0.01
JPY 三菱地所	1 000.00	18 300.21	0.01
JPY 三菱重工業	200.00	7 906.79	0.00
JPY 三菱自動車工業	400.00	2 982.86	0.00
JPY 田辺三菱製薬	300.00	5 713.50	0.00
JPY 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6 600.00	44 223.17	0.02
JPY 三井物産	900.00	16 256.34	0.01
JPY 商船三井	100.00	2 965.50	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	12 700.00	23 026.55	0.01
JPY M S & A D インシュアランスグループホールディングス	300.00	10 067.17	0.00
JPY 村田製作所	100.00	12 657.07	0.01
JPY ナブテスコ	100.00	3 614.35	0.00
JPY 日本電気	200.00	5 492.35	0.00
JPY 日本特殊陶業	100.00	2 577.11	0.00
JPY 日本電産	100.00	15 663.70	0.01
JPY ニコン	100.00	1 743.66	0.00
JPY 任天堂	100.00	42 193.28	0.02
JPY 日本ビルファンド投資法人	1.00	5 620.29	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	100.00	4 094.13	0.00
JPY 日本プロロジスリート投資法人	1.00	2 104.64	0.00
JPY 新日鐵住金	447.00	9 742.70	0.00
JPY 日本電信電話	400.00	19 026.73	0.01
JPY 日本郵船	100.00	2 132.97	0.00
JPY 日産自動車	1 300.00	13 680.15	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	150.00	3 280.33	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	100.00	7 356.64	0.00
JPY 日東電工	100.00	7 448.02	0.00
JPY N O K	100.00	2 056.20	0.00
JPY 野村ホールディングス	1 800.00	10 397.81	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	2.00	2 790.95	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	200.00	4 967.79	0.00
JPY 日本精工	300.00	4 030.16	0.00
JPY N T T ドコモ	700.00	18 135.71	0.01
JPY 大林組	400.00	4 613.21	0.00
JPY 小田急電鉄	200.00	4 315.28	0.00
JPY オリンパス	200.00	7 466.30	0.00
JPY オムロン	100.00	5 428.38	0.00
JPY 小野薬品工業	200.00	4 632.40	0.00
JPY オリエンタルランド	200.00	19 949.74	0.01
JPY オリックス	900.00	15 824.54	0.01
JPY 大阪瓦斯	200.00	4 302.49	0.00
JPY 大塚ホールディングス	200.00	10 476.58	0.00
JPY パナソニック	1 100.00	16 405.76	0.01
JPY パーク 2 4	200.00	5 665.98	0.00
JPY 楽天	500.00	3 565.00	0.00
JPY ルネサスエレクトロニクス	200.00	2 098.24	0.00
JPY りそなホールディングス	1 100.00	6 258.72	0.00
JPY リコー	300.00	2 936.26	0.00
JPY ローム	100.00	9 339.73	0.00
JPY S A N K Y O	100.00	3 513.82	0.00
JPY 参天製薬	200.00	3 372.17	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 セコム	100.00	7 495.54	0.00
JPY 西武ホールディングス	100.00	1 689.74	0.00
JPY 積水化学工業	200.00	3 545.81	0.00
JPY 積水ハウス	300.00	5 495.54	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	400.00	17 564.54	0.01
JPY シマノ	100.00	13 287.64	0.01
JPY 信越化学工業	200.00	20 114.23	0.01
JPY 塩野義製薬	200.00	10 297.46	0.01
JPY 資生堂	200.00	12 998.86	0.01
JPY 静岡銀行	1 000.00	10 162.21	0.00
JPY 昭和シェル石油	300.00	4 241.26	0.00
JPY ソフトバンクグループ	500.00	38 843.96	0.01
JPY S O M P Oホールディングス	250.00	10 486.63	0.01
JPY ソニー	600.00	29 609.32	0.01
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 653.64	0.00
JPY スタンレー電気	200.00	7 246.97	0.00
JPY S U B A R U	300.00	10 086.36	0.00
JPY 住友化学	2 000.00	11 496.46	0.01
JPY 住友商事	600.00	10 799.17	0.01
JPY 住友電気工業	400.00	6 139.36	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	700.00	29 106.69	0.01
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	200.00	8 491.66	0.00
JPY 住友ゴム工業	200.00	3 576.88	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	9 851.50	0.00
JPY スルガ銀行	400.00	5 439.34	0.00
JPY スズキ	200.00	10 767.19	0.01
JPY シスメックス	100.00	8 846.24	0.00
JPY T & Dホールディングス	200.00	3 397.76	0.00
JPY 大成建設	200.00	10 801.92	0.01
JPY 武田薬品工業	400.00	16 891.94	0.01
JPY T D K	100.00	8 636.05	0.00
JPY テルモ	200.00	11 331.96	0.01
JPY T H K	200.00	7 000.23	0.00
JPY 東宝	100.00	3 344.76	0.00
JPY 東北電力	300.00	3 868.40	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	400.00	18 906.10	0.01
JPY 東京電力ホールディングス	600.00	2 856.75	0.00
JPY 東京エレクトロン	100.00	19 241.49	0.01
JPY 東京瓦斯	200.00	5 358.92	0.00
JPY 東京建物	100.00	1 523.42	0.00
JPY 東京急行電鉄	500.00	8 412.15	0.00
JPY 東急不動産ホールディングス	300.00	2 363.26	0.00
JPY 東レ	1 000.00	9 339.73	0.00
JPY 東芝	2 000.00	5 355.27	0.00
JPY T O T O	100.00	5 675.12	0.00
JPY 東洋製罐グループホールディングス	200.00	3 149.19	0.00
JPY 豊田合成	200.00	5 070.14	0.00
JPY 豊田自動織機	100.00	5 912.73	0.00
JPY トヨタ自動車	1 378.00	90 431.05	0.03
JPY 豊田通商	200.00	7 192.14	0.00
JPY ユニ・チャーム	300.00	8 430.43	0.00
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	4.00	6 133.88	0.00
JPY ユー・エス・エス	300.00	6 308.43	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	100.00	7 082.48	0.00
JPY ヤフー	700.00	2 878.68	0.00
JPY ヤクルト本社	100.00	7 128.17	0.00
JPY ヤマダ電機	600.00	3 147.36	0.00
JPY ヤマハ	200.00	9 668.72	0.00
JPY ヤマハ発動機	100.00	3 198.54	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 ヤマトホールディングス	200.00	5 149.65	0.00
JPY 安川電機	100.00	4 084.99	0.00
JPY 横河電機	100.00	2 206.08	0.00
日本合計		1 843 444.97	0.64
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	6 341.00	30 629.36	0.01
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	54.00	4 364.44	0.00
ジャージー合計		34 993.80	0.01
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)	359.00	12 186.04	0.00
ルクセンブルグ合計		12 186.04	0.00
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG 'S'	2 000.00	11 658.65	0.01
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	1 600.00	5 983.50	0.00
マカオ合計		17 642.15	0.01
メキシコ			
GBP FRESNILLO PLC ORD USD0.50	96.00	1 685.88	0.00
メキシコ合計		1 685.88	0.00
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	1 397.00	10 282.41	0.00
USD AERCAP HOLDINGS NV	100.00	5 213.00	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	93.00	8 415.96	0.00
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	202.00	1 937.32	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	203.00	38 629.17	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	458.00	5 666.36	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	64.00	4 758.57	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	511.00	11 464.94	0.01
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	64.00	6 510.75	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	113.00	11 918.77	0.01
EUR ING GROEP N.V.EURO.01	2 096.00	35 392.65	0.01
EUR KON KPN NV EURO.04	3 410.00	10 617.14	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	701.00	16 943.20	0.01
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.01	86.00	2 552.95	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	70.00	7 258.14	0.00
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	513.00	21 823.39	0.01
EUR NN GROUP N.V.EURO.12	127.00	6 090.09	0.00
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	108.00	11 329.20	0.01
EUR QIAGEN NV EURO.01	151.00	4 978.74	0.00
EUR RANDSTAD N.V.EURO.10	65.00	4 192.09	0.00
EUR RELX NV EURO.07	491.00	10 449.69	0.00
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	1 982.00	71 018.55	0.03
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	2 503.00	87 256.40	0.03
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	422.00	9 238.67	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	170.00	9 207.81	0.00
オランダ合計		413 145.96	0.14
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	1 033.12	4 644.25	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	1 877.00	4 575.97	0.00
ニュージーランド合計		9 220.22	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	569.00	10 693.03	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	58.00	920.92	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	826.00	5 161.53	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	555.00	5 150.19	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	750.00	19 238.93	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	437.00	9 698.87	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	107.00	4 527.84	0.00
ノルウェー合計		55 391.31	0.02
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	613.00	3 627.75	0.00
パプアニューギニア合計		3 627.75	0.00
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	243.00	4 672.53	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	63.00	1 106.74	0.00
ポルトガル合計		5 779.27	0.00
シンガポール			
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	200.00	1 913.83	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	879.00	20 473.82	0.01
USD FLEX LTD COM USD0.01	500.00	6 500.00	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	1 000.00	6 185.57	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	2 211.00	23 044.30	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	1 000.00	2 318.64	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	200.00	1 643.44	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 000.00	5 830.60	0.00
SGD SINGAPORE PRESS HD SGD0.20	2 300.00	4 724.90	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV(POST RE-ORG)	4 000.00	10 634.04	0.01
SGD SUNTEC REIT NPV (REIT)	5 000.00	7 401.53	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	664.00	15 114.96	0.01
シンガポール合計		105 785.63	0.04
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	155.00	4 325.29	0.00
南アフリカ合計		4 325.29	0.00
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	290.00	6 397.90	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	122.00	5 163.44	0.00
EUR AENA SME S.A. EUR10	36.00	7 442.03	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	205.00	15 034.24	0.01
EUR BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)	512.00	2 256.02	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	5 276.00	10 368.06	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	2 592.00	12 648.75	0.01
EUR ENAGAS SA EUR1.50	167.00	4 870.71	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	167.00	3 908.27	0.00
EUR FERROVIAL SA EURO.2	230.00	4 928.31	0.00
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	252.00	6 366.39	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	174.00	4 908.80	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	2 435.00	18 875.66	0.01
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	505.00	15 729.43	0.01
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	547.00	4 739.87	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	332.00	6 931.40	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	761.00	14 573.13	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	2 250.00	22 924.69	0.01
スペイン合計		168 067.10	0.06

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	237.00	5 901.28	0.00
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	465.00	9 796.75	0.00
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	322.00	12 673.02	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	153.00	5 465.16	0.00
USD AUTOLIV INC COM	47.00	6 300.35	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	136.00	4 741.26	0.00
SEK ELECTROLUX AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	32.00	846.57	0.00
SEK ERICSSON SER ' B ' NPV	1 665.00	12 797.44	0.01
SEK ESSITY AB SER ' B ' NPV	288.00	7 345.76	0.00
SEK GETINGE AB SER ' B ' NPV	188.00	1 755.93	0.00
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV	51.00	2 963.28	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	379.00	3 660.39	0.00
SEK ICA GRUPPEN AB	62.00	1 932.40	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	146.00	3 091.83	0.00
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV	149.00	6 528.87	0.00
SEK KINNEVIK INV AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	90.00	3 264.21	0.00
SEK LUNDIN PETROLEUM A NPV	152.00	4 210.73	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	1 854.00	18 953.51	0.01
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	619.00	10 619.92	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	224.00	3 638.11	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	736.00	6 944.98	0.00
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	150.00	2 938.92	0.00
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	377.00	7 677.55	0.00
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	1 113.00	12 475.58	0.01
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	492.00	10 745.44	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV	95.00	4 281.14	0.00
SEK TELE2 AB SHS	236.00	3 077.20	0.00
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	983.00	16 774.97	0.01
スウェーデン合計		191 402.55	0.07
スイス			
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	33.00	3 105.31	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	3.00	21 911.30	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	12.00	5 800.59	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	154.00	14 726.38	0.01
CHF VIFOR PHARMA AG CHF0.01	60.00	9 531.27	0.00
スイス合計		55 074.85	0.02
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	880.00	11 412.83	0.01
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	120.00	3 294.07	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	730.00	17 187.43	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	137.00	1 834.89	0.00
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	131.00	18 663.57	0.01
USD APTIV PLC COM USD0.01	130.00	10 995.40	0.00
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	173.00	4 844.26	0.00
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	172.00	6 405.89	0.00
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	647.00	45 475.15	0.02
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	484.00	2 353.23	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	2 539.00	18 499.61	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	1 795.00	15 106.02	0.00
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	8 673.00	24 757.58	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	1 077.00	8 277.41	0.00
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	1 089.00	23 158.98	0.01
GBP BP ORD USD0.25	9 659.00	71 574.57	0.03
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	951.00	52 381.30	0.02
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	616.00	5 704.96	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	4 227.00	14 523.12	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 BUNZL ORD GBPO.32142857	182.00	5 291.81	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	166.00	4 169.25	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBPO.02066666	408.00	1 076.43	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	90.00	5 857.18	0.00
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	3 733.00	7 907.85	0.00
GBP COBHAM ORD GBPO.025	2 155.00	3 416.39	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.1105	876.00	18 822.31	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10357143	18.00	1 105.98	0.00
GBP DIAGEO ORD GBPO.28 101/108	1 301.00	46 393.13	0.02
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	1 101.00	5 676.11	0.00
GBP G4S ORD GBPO.25	965.00	3 441.16	0.00
GBP GKN ORD GBPO.50	500.00	3 199.58	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	2 575.00	51 831.13	0.02
GBP HAMMERSON PLC REIT	568.00	4 295.02	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	10 483.00	104 738.76	0.04
USD IHS MARKIT LTD COM	209.00	10 268.17	0.00
GBP IMI ORD GBPO.2857	335.00	5 038.62	0.00
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	470.00	16 860.35	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.1980952380937	85.00	5 372.56	0.00
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	73.00	4 927.79	0.00
GBP INVESTEC ORD GBPO.0002	587.00	4 668.31	0.00
GBP ITV ORD GBPO.10	1 450.00	3 028.70	0.00
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	127.00	5 761.98	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBPO.157142857	633.00	2 648.71	0.00
GBP LAND SECURITIES GP ORD GBPO.106666666	485.00	6 602.66	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	2 960.00	11 007.78	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	112.00	3 375.68	0.00
GBP LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1	32 320.00	28 784.01	0.01
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	147.00	8 706.23	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	1 480.00	5 864.70	0.00
GBP MEGGITT ORD GBPO.05	435.00	2 830.37	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	100.00	6 842.00	0.00
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	1 269.00	4 249.04	0.00
GBP NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289	1 713.00	19 885.02	0.01
GBP NEXT ORD GBPO.10	58.00	4 198.82	0.00
GBP OLD MUTUAL PLC ORD GBPO.114285714(POST CON)	2 181.00	7 558.07	0.00
GBP PEARSON ORD GBPO.25	434.00	4 984.20	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBPO.10	117.00	4 375.22	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBPO.05	1 298.00	33 512.32	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	307.00	24 110.70	0.01
GBP RELX PLC GBPO.1444	753.00	16 122.42	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	624.00	33 914.54	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	795.00	9 197.94	0.00
GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	1 737.00	6 464.41	0.00
GBP ROYAL MAIL PLC ORD GBPO.01 (WI)	699.00	5 595.61	0.00
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	644.00	5 831.23	0.00
GBP SAGE GROUP GBPO.01051948	903.00	7 900.29	0.00
GBP SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	651.00	2 770.66	0.00
GBP SCHRODERS VTG SHS GBP1	138.00	6 274.35	0.00
GBP SEGRO PLC ORD GBPO.10	119.00	1 059.15	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	131.00	3 500.40	0.00
GBP SKY PLC ORD GBPO.50	604.00	11 463.85	0.01
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	736.00	14 151.67	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBPO.375	100.00	2 200.32	0.00
GBP SSE PLC ORD GBPO.50	688.00	13 086.59	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBPO.15	262.00	4 101.24	0.00
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	1 636.00	17 283.15	0.01
GBP STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1222222	830.00	4 176.11	0.00
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	3 354.00	8 858.15	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 TECHNIPFMC PLC COM USD1	158.00	5 207.68	0.00
EUR TECHNIPFMC PLC COM USD1	124.00	4 079.51	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.05	4 170.00	13 549.03	0.01
GBP TRAVIS PERKINS ORD GBP0.10	233.00	4 072.51	0.00
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	665.00	37 347.37	0.01
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	467.00	4 780.42	0.00
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	13 691.00	39 902.05	0.01
GBP WEIR GROUP ORD GBP0.125	108.00	3 177.38	0.00
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	44.00	2 594.43	0.00
USD WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	79.00	11 732.29	0.01
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	684.00	11 752.79	0.01
イギリス合計		1 171 281.91	0.40

アメリカ合衆国

USD 3M CO COM	309.00	60 066.51	0.02
USD ABBOTT LABS COM	871.00	50 631.23	0.02
USD ABBVIE INC COM USD0.01	844.00	81 488.20	0.03
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	291.00	19 307.85	0.01
USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	269.00	59 610.40	0.02
USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM	52.00	5 951.40	0.00
USD AES CORP COM	400.00	4 896.00	0.00
USD AETNA INC COM USD0.01	180.00	32 229.00	0.01
USD AFFILIATED MNGRS COM USD0.01	33.00	5 440.38	0.00
USD AFLAC INC COM USD0.10	370.00	16 860.90	0.01
USD AGCO CORP COM USD0.01	14.00	877.52	0.00
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	162.00	10 649.88	0.00
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	200.00	3 784.00	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	101.00	16 391.29	0.01
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	60.00	4 299.00	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	9 696.00	0.00
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	120.00	14 115.60	0.01
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	206.00	31 651.90	0.01
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	29.00	5 888.45	0.00
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	200.00	8 590.00	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	176.00	17 216.32	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	208.00	5 428.80	0.00
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	163.00	165 824.79	0.06
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	155.00	157 879.90	0.06
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	1 013.00	56 839.43	0.02
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	210.00	328 887.30	0.11
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	248.00	17 355.04	0.01
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	383.00	37 821.25	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	528.00	29 568.00	0.01
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	219.00	29 862.84	0.01
USD AMEREN CORP COM	139.00	8 148.18	0.00
USD AMERICAN AIRLINES COM USD1	100.00	4 293.00	0.00
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	107.00	9 264.06	0.00
USD AMERIPRISE FINL INC COM	100.00	14 021.00	0.01
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	97.00	8 786.26	0.00
USD AMETEK INC COM USD0.01	85.00	5 933.00	0.00
USD AMGEN INC COM USD0.0001	391.00	68 221.68	0.02
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	127.00	10 631.17	0.00
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	287.00	19 320.84	0.01
USD ANALOG DEVICES INC COM	149.00	13 015.15	0.01
USD ANDEAVOR COM USD0.1666	73.00	10 097.36	0.00
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	400.00	4 148.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	140.00	33 038.60	0.01
USD APACHE CORP COM USD0.625	194.00	7 944.30	0.00
USD APPLE INC COM NPV	2 795.00	461 901.70	0.16

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 APPLIED MATLS INC COM	553.00	27 467.51	0.01
USD ARAMARK COM USD0.01	105.00	3 925.95	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	294.00	13 341.72	0.01
USD ARCONIC INC COM USD1.00	306.00	5 449.86	0.00
USD ARROW ELECTRS INC COM	100.00	7 474.00	0.00
USD ASSURANT INC COM	41.00	3 805.62	0.00
USD AT&T INC COM USD1	3 207.00	104 868.90	0.04
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	239.00	28 221.12	0.01
USD AUTODESK INC COM USD0.01	144.00	18 129.60	0.01
USD AUTONATION INC COM	96.00	4 434.24	0.00
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	20.00	12 490.40	0.01
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	77.00	12 551.00	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	115.00	12 053.15	0.01
USD AVNET INC COM	100.00	3 923.00	0.00
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	114.00	3 522.60	0.00
USD BAKER HUGHES A GE COM USD0.0001 CL A	206.00	7 438.66	0.00
USD BALL CORP COM NPV	252.00	10 102.68	0.00
USD BAXTER INTL INC COM USD1	218.00	15 151.00	0.01
USD BB&T CORP COM USD5	391.00	20 644.80	0.01
USD BECTON DICKINSON COM USD1	135.00	31 302.45	0.01
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	7 456.00	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY CLASS ' B ' COM USD0.0033	617.00	119 531.41	0.04
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	131.00	10 025.43	0.00
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	116.00	31 737.60	0.01
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	98.00	8 183.98	0.00
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	5 327.00	159 383.84	0.06
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	522.00	28 454.22	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	72.00	37 548.00	0.01
USD BLOCK(H&R)INC COM NPV	31.00	857.15	0.00
USD BOEING CO COM USD5	305.00	101 735.80	0.04
USD BOOKING HLDGS INC COM USD0.008	26.00	56 628.00	0.02
USD BORG WARNER INC COM	70.00	3 425.80	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	60.00	7 284.60	0.00
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	691.00	19 845.52	0.01
USD BRIGHTHOUSE FINL I COM USD0.01 WI	42.00	2 132.76	0.00
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	870.00	45 353.10	0.02
USD BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	377.00	5 613.53	0.00
USD BROADCOM CORP COM USD1.00	205.00	47 031.10	0.02
USD BROWN FORMAN CORP CL B	207.00	11 600.28	0.01
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	68.00	4 911.64	0.00
USD CA INC COM USD0.10	186.00	6 472.80	0.00
USD CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	253.00	6 049.23	0.00
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	137.00	5 586.86	0.00
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	250.00	22 655.00	0.01
USD CARDINAL HEALTH INC COM	147.00	9 432.99	0.00
USD CARMAX INC COM USD0.50	93.00	5 812.50	0.00
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)	166.00	10 467.96	0.00
USD CATERPILLAR INC DEL COM	294.00	42 441.84	0.02
USD CBRE GROUP INC CLASS ' A ' USD0.01	133.00	6 026.23	0.00
USD CBS CORP NEW CL B	206.00	10 135.20	0.00
USD CDK GLOBAL INC COM USD0.01	91.00	5 936.84	0.00
USD CDW CORP COM USD0.01	78.00	5 560.62	0.00
USD CELANESE CORP COM SERIES ' A ' USD0.0001	100.00	10 867.00	0.00
USD CELGENE CORP COM USD0.01	406.00	35 362.60	0.01
USD CENTENE CORP DEL COM	85.00	9 229.30	0.00
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	256.00	6 484.48	0.00
USD CENTURYLINK INC COM	362.00	6 725.96	0.00
USD CERNER CORP COM	226.00	13 164.50	0.01
USD CF INDS HLDGS INC COM	130.00	5 044.00	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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	CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	73.00	6 718.19	0.00
USD	CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS ' A '	119.00	32 283.51	0.01
USD	CHENIERE ENERGY INC COM NEW	82.00	4 769.12	0.00
USD	CHEVRON CORP COM USD0.75	980.00	122 607.80	0.04
USD	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	16.00	6 773.28	0.00
USD	CHURCH & DWIGHT INC COM	102.00	4 712.40	0.00
USD	CIGNA CORP COM USD0.25	160.00	27 491.20	0.01
USD	CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01	59.00	5 934.81	0.00
USD	CINCINNATI FINL CORP COM	100.00	7 034.00	0.00
USD	CINTAS CORP COM	100.00	17 030.00	0.01
USD	CISCO SYSTEMS COM USD0.001	2 606.00	115 419.74	0.04
USD	CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	97.00	5 136.15	0.00
USD	CITIGROUP INC COM USD0.01	1 490.00	101 722.30	0.04
USD	CITIZENS FINL GP COM USD0.01	253.00	10 496.97	0.00
USD	CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	100.00	10 291.00	0.00
USD	CLOROX CO DEL COM	65.00	7 618.00	0.00
USD	CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS ' A '	176.00	27 751.68	0.01
USD	CMS ENERGY CORP COM	132.00	6 229.08	0.00
USD	COCA-COLA CO COM USD0.25	2 107.00	91 043.47	0.03
USD	COGNIZANT TECHNOLO COM CL ' A ' USD0.01	308.00	25 200.56	0.01
USD	COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	424.00	27 657.52	0.01
USD	COMCAST CORP COM CLS ' A ' USD0.01	2 527.00	79 322.53	0.03
USD	COMERICA INC COM	57.00	5 391.06	0.00
USD	CONAGRA BRANDS IN COM USD5	208.00	7 710.56	0.00
USD	CONCHO RES INC COM STK USD0.001	85.00	13 362.85	0.01
USD	CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	638.00	41 789.00	0.02
USD	CONSOLIDATED EDISON INC COM	146.00	11 698.98	0.01
USD	CONSTELLATION BRDS CLASS ' A ' COM USD0.01	110.00	25 644.30	0.01
USD	CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	149.00	9 842.94	0.00
USD	CORNING INC COM USD0.50	517.00	13 969.34	0.01
USD	COSTCO WHSL CORP NEW COM	229.00	45 149.64	0.02
USD	CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	159.00	16 038.33	0.01
USD	CROWN HOLDINGS INC COM USD5	100.00	4 984.00	0.00
USD	CSX CORP COM USD1	485.00	28 804.15	0.01
USD	CUMMINS INC COM	80.00	12 788.80	0.01
USD	CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	548.00	38 266.84	0.01
USD	D R HORTON INC COM	147.00	6 488.58	0.00
USD	DANAHER CORP COM USD0.01	297.00	29 795.04	0.01
USD	DARDEN RESTAURANTS INC COM	100.00	9 286.00	0.00
USD	DAVITA INC COM USD0.001	78.00	4 897.62	0.00
USD	DEERE & CO COM USD1	138.00	18 675.54	0.01
USD	DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V	116.00	8 325.32	0.00
USD	DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	86.00	4 490.92	0.00
USD	DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	100.00	5 034.00	0.00
USD	DEVON ENERGY CORP NEW COM	240.00	8 719.20	0.00
USD	DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	88.00	9 300.72	0.00
USD	DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	198.00	14 107.50	0.01
USD	DISCOVERY INC COM USD0.01 SER A	100.00	2 365.00	0.00
USD	DISCOVERY INC COM USD0.01 SER C	170.00	3 777.40	0.00
USD	DISH NETWORK CORPO CLASS ' A ' COM USD0.01	200.00	6 710.00	0.00
USD	DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	212.00	20 464.36	0.01
USD	DOLLAR TREE INC	149.00	14 287.61	0.01
USD	DOMINION ENERGY IN COM STK NPV	332.00	22 097.92	0.01
USD	DOVER CORP COM	100.00	9 270.00	0.00
USD	DOWDUPONT INC COM USD0.01	1 132.00	71 587.68	0.03
USD	DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	96.00	11 516.16	0.01
USD	DTE ENERGY CO COM	107.00	11 277.80	0.00
USD	DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	357.00	28 617.12	0.01
USD	DXC TECHNOLOGY CO COM USD0.01	73.00	7 523.38	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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	E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	152.00	9 223.36	0.00
USD	EASTMAN CHEM CO COM	58.00	5 920.64	0.00
USD	EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	5 439.00	0.00
USD	EBAY INC COM USD0.001	578.00	21 894.64	0.01
USD	ECOLAB INC COM	121.00	17 517.17	0.01
USD	EDISON INTL COM	163.00	10 679.76	0.00
USD	EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	109.00	13 882.24	0.01
USD	ELECTRONIC ARTS INC COM	155.00	18 286.90	0.01
USD	ELI LILLY AND CO COM NPV	519.00	42 075.33	0.02
USD	EMERSON ELEC CO COM	314.00	20 852.74	0.01
USD	ENTERGY CORP NEW COM	83.00	6 771.97	0.00
USD	ENVISION HEALTHCAR COM USD0.01	100.00	3 717.00	0.00
USD	EOG RESOURCES INC COM USD0.01	304.00	35 923.68	0.01
USD	EQT CORPORATION	100.00	5 019.00	0.00
USD	EQUIFAX INC COM	100.00	11 205.00	0.00
USD	EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	57.00	23 985.03	0.01
USD	EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	173.00	10 675.83	0.00
USD	ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	40.00	9 587.60	0.00
USD	ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01	103.00	15 253.27	0.01
USD	EVERSOURCE ENERGY COM USD5	132.00	7 953.00	0.00
USD	EXELON CORP COM NPV	486.00	19 284.48	0.01
USD	EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001	60.00	6 908.40	0.00
USD	EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	94.00	6 002.84	0.00
USD	EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	324.00	24 526.80	0.01
USD	EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	74.00	6 629.66	0.00
USD	EXXON MOBIL CORP COM NPV	2 161.00	168 017.75	0.06
USD	F M C CORP COM NEW	43.00	3 428.39	0.00
USD	F5 NETWORK INC COM STK NPV	37.00	6 034.33	0.00
USD	FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL ' A '	1 208.00	207 776.00	0.07
USD	FASTENAL CO COM	134.00	6 698.66	0.00
USD	FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	34.00	3 938.90	0.00
USD	FEDEX CORP COM USD0.10	135.00	33 372.00	0.01
USD	FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	189.00	6 960.87	0.00
USD	FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	147.00	13 960.59	0.01
USD	FIFTH THIRD BANCORP COM	380.00	12 604.60	0.01
USD	FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	100.00	9 287.00	0.00
USD	FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	182.00	6 260.80	0.00
USD	FISERV INC COM USD0.01	218.00	15 447.48	0.01
USD	FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	55.00	11 400.40	0.00
USD	FLIR SYS INC COM	118.00	6 318.90	0.00
USD	FLOWSERVE CORP COM	67.00	2 975.47	0.00
USD	FLUOR CORP NEW COM	100.00	5 895.00	0.00
USD	FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	2 037.00	22 895.88	0.01
USD	FORTIVE CORP COM USD0.01	168.00	11 812.08	0.01
USD	FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	75.00	4 101.75	0.00
USD	FRANKLIN RES INC COM	153.00	5 146.92	0.00
USD	FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	618.00	9 399.78	0.00
USD	GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	94.00	6 579.06	0.00
USD	GAP INC DEL COM	40.00	1 169.60	0.00
USD	GEN DYNAMICS CORP COM USD1	138.00	27 780.78	0.01
USD	GEN ELEC CO COM USD0.06	4 662.00	65 594.34	0.02
USD	GENERAL MLS INC COM	283.00	12 378.42	0.01
USD	GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	703.00	25 828.22	0.01
USD	GENUINE PARTS CO COM STK USD1	100.00	8 832.00	0.00
USD	GGP INC COM USD0.01	230.00	4 597.70	0.00
USD	GILEAD SCIENCES COM USD0.001	677.00	48 899.71	0.02
USD	GLOBAL PAYMENTS COM NPV	80.00	9 044.00	0.00
USD	GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	189.00	45 044.37	0.02
USD	GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	128.00	3 214.08	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 GRAINGER W W INC COM	28.00	7 877.80	0.00
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	434.00	22 997.66	0.01
USD HANESBRANDS INC COM	400.00	7 388.00	0.00
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	88.00	3 619.44	0.00
USD HARRIS CORP COM STK USD1	80.00	12 513.60	0.01
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	173.00	9 314.32	0.00
USD HASBRO INC COM	76.00	6 694.84	0.00
USD HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01	145.00	13 882.30	0.01
USD HCP INC COM USD1	221.00	5 162.56	0.00
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	100.00	6 955.00	0.00
USD HERSHEY CO COM	100.00	9 194.00	0.00
USD HESS CORPORATION COM USD1	145.00	8 263.55	0.00
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	860.00	14 663.00	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	133.00	10 485.72	0.00
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	88.00	5 340.72	0.00
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	162.00	6 283.98	0.00
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	632.00	116 793.60	0.04
USD HONEYWELL INTL INC COM	366.00	52 952.88	0.02
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	226.00	8 192.50	0.00
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	374.00	7 315.44	0.00
USD HP INC COM USD0.01	914.00	19 641.86	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	79.00	23 240.22	0.01
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	11 743.00	0.01
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	757.00	11 286.87	0.00
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	161.00	22 865.22	0.01
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	66.00	15 901.38	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	100.00	6 194.00	0.00
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	113.00	9 479.57	0.00
USD INTEL CORP COM USD0.001	2 421.00	124 972.02	0.04
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	294.00	21 303.24	0.01
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	44.00	6 215.44	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	400.00	9 436.00	0.00
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	473.00	68 566.08	0.02
USD INTL PAPER CO COM	167.00	8 610.52	0.00
USD INTUIT INC COM USD0.01	139.00	25 685.81	0.01
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	78.00	34 380.84	0.01
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	161.00	4 664.17	0.00
USD IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01	93.00	8 905.68	0.00
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	115.00	3 903.10	0.00
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	100.00	5 809.00	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	1 417.00	179 236.33	0.06
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	472.00	15 986.64	0.01
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	1 862.00	202 548.36	0.07
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	161.00	3 958.99	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	104.00	11 089.52	0.00
USD KELLOGG CO COM USD0.25	109.00	6 420.10	0.00
USD KEYCORP NEW COM	521.00	10 378.32	0.00
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	182.00	18 844.28	0.01
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	196.00	2 843.96	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	990.00	15 661.80	0.01
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	124.00	12 615.76	0.01
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	69.00	4 286.28	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	315.00	17 759.70	0.01
USD KROGER CO COM USD1	464.00	11 688.16	0.01
USD L BRANDS INC COM USD0.50	197.00	6 877.27	0.00
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	93.00	15 879.75	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	100.00	18 506.00	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	194.00	14 226.02	0.01
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	4 055.00	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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	LENNAR CORP CL B	1.00	42.69	0.00
USD	LENNAR CORP COM CL ' A ' USD0.10	73.00	3 860.97	0.00
USD	LEUCADIA NATL CORP COM	331.00	7 957.24	0.00
USD	LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	55.00	2 297.35	0.00
USD	LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	225.00	9 373.50	0.00
USD	LINCOLN NATL CORP COM NPV	119.00	8 406.16	0.00
USD	LKQ CORP COM	222.00	6 886.44	0.00
USD	LOCKHEED MARTIN CORP COM	139.00	44 596.76	0.02
USD	LOEWS CORP COM	123.00	6 452.58	0.00
USD	LOWE ' S COS INC COM USD0.50	439.00	36 186.77	0.01
USD	LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	169.00	17 868.37	0.01
USD	M & T BANK CORP COM USD0.50	113.00	20 596.51	0.01
USD	MACERICH CO COM USD0.01	81.00	4 667.22	0.00
USD	MACY ' S INC COM STK USD0.01	135.00	4 194.45	0.00
USD	MANPOWER GROUP COM USD0.01	40.00	3 828.80	0.00
USD	MARATHON OIL CORP COM USD1	631.00	11 515.75	0.01
USD	MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	270.00	20 225.70	0.01
USD	MARKEL CORP COM	10.00	11 300.40	0.00
USD	MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS ' A '	164.00	22 415.52	0.01
USD	MARSH & MCLENNAN COM USD1	240.00	19 560.00	0.01
USD	MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	35.00	6 816.95	0.00
USD	MASCO CORP COM	242.00	9 164.54	0.00
USD	MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS ' A '	507.00	90 382.89	0.03
USD	MATTEL INC COM USD1	200.00	2 960.00	0.00
USD	MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	207.00	11 281.50	0.00
USD	MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	44.00	4 638.04	0.00
USD	MCDONALD ' S CORP COM USD0.01	437.00	73 171.28	0.03
USD	MCKESSON CORP COM USD0.01	117.00	18 276.57	0.01
USD	MEDTRONIC PLC USD0.0001	703.00	56 331.39	0.02
USD	MERCK & CO INC COM USD0.50	1 435.00	84 478.45	0.03
USD	METLIFE INC COM USD0.01	471.00	22 452.57	0.01
USD	MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	594.00	18 663.48	0.01
USD	MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001	105.00	8 784.30	0.00
USD	MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	672.00	30 898.56	0.01
USD	MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	3 853.00	360 332.56	0.13
USD	MOHAWK INDS COM USD0.01	26.00	5 456.88	0.00
USD	MOLSON COORS BREW1 CLASS ' B ' USD0.01	100.00	7 124.00	0.00
USD	MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	798.00	31 521.00	0.01
USD	MONSANTO COM STK USD0.01	222.00	27 832.14	0.01
USD	MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	156.00	8 580.00	0.00
USD	MOODYS CORP COM USD0.01	88.00	14 273.60	0.01
USD	MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	723.00	37 321.26	0.01
USD	MOSAIC CO COM USD0.01	155.00	4 177.25	0.00
USD	MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	65.00	7 138.95	0.00
USD	MYLAN NV EURO.01	236.00	9 147.36	0.00
USD	NASDAQ INC COM STK USD0.01	35.00	3 091.20	0.00
USD	NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	126.00	4 872.42	0.00
USD	NETAPP INC COM USD0.001	126.00	8 389.08	0.00
USD	NETFLIX INC COM USD0.001	221.00	69 053.66	0.02
USD	NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	302.00	3 587.76	0.00
USD	NEWELL BRANDS INC COM USD1	194.00	5 360.22	0.00
USD	NEWMONT MINING CP COM USD1.60	225.00	8 840.25	0.00
USD	NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL ' A '	97.00	1 550.06	0.00
USD	NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	253.00	41 469.23	0.02
USD	NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	243.00	7 642.35	0.00
USD	NIKE INC CLASS ' B ' COM NPV	672.00	45 958.08	0.02
USD	NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	338.00	11 434.54	0.01
USD	NORDSTROM INC COM NPV	100.00	5 056.00	0.00
USD	NORFOLK STHN CORP COM USD1	151.00	21 663.97	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	118.00	12 596.50	0.01
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	91.00	29 305.64	0.01
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	81.00	4 331.07	0.00
USD NUCOR CORP COM	157.00	9 674.34	0.00
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	278.00	62 522.20	0.02
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	385.00	29 745.10	0.01
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	138.00	4 536.06	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	103.00	7 586.98	0.00
USD ONEOK INC	116.00	6 985.52	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	1 614.00	73 711.38	0.03
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	72.00	18 437.04	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	155.00	9 868.85	0.00
USD PACKAGING CORP AMER COM	100.00	11 569.00	0.01
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	48.00	9 240.48	0.00
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	64.00	10 535.68	0.00
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	24.00	558.72	0.00
USD PAYCHEX INC COM	193.00	11 690.01	0.01
USD PEOPLE ' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	225.00	4 115.25	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	728.00	73 484.32	0.03
USD PFIZER INC COM USD0.05	3 168.00	115 980.48	0.04
USD PG&E CORP COM	273.00	12 585.30	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV ' WI '	801.00	65 682.00	0.02
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	229.00	25 489.99	0.01
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	100.00	8 050.00	0.00
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	93.00	18 744.15	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	254.00	36 984.94	0.01
USD POLARIS INDS INC COM	60.00	6 289.20	0.00
USD PPG INDS INC COM	120.00	12 705.60	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	269.00	7 827.90	0.00
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	133.00	20 285.16	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	145.00	8 586.90	0.00
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	1 312.00	94 910.08	0.03
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	266.00	16 037.14	0.01
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	253.00	16 422.23	0.01
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	226.00	24 028.32	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	84.00	16 949.52	0.01
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	239.00	12 463.85	0.01
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	185.00	5 616.60	0.00
USD PVH CORP COM USD1	93.00	14 849.31	0.01
USD QORVO INC COM USD 0.0001	100.00	6 740.00	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	753.00	38 410.53	0.01
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	45.00	4 554.00	0.00
USD QURATE RETAIL GRP COM USD0.01 SER A	220.00	5 150.20	0.00
USD RALPH LAUREN CORP CLASS ' A ' COM USD0.01	38.00	4 174.30	0.00
USD RANGE RES CORP COM USD0.01	100.00	1 385.00	0.00
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	100.00	8 975.00	0.00
USD RAYTHEON CO COM NEW	154.00	31 560.76	0.01
USD REALTY INCOME CORP	127.00	6 414.77	0.00
USD RED HAT INC COM	101.00	16 469.06	0.01
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	105.00	6 179.25	0.00
USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM	67.00	20 346.56	0.01
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	400.00	7 480.00	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	100.00	6 468.00	0.00
USD RESMED INC COM USD0.004	100.00	9 464.00	0.00
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	118.00	7 168.50	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	64.00	10 529.92	0.00
USD ROCKWELL COLLINS INC COM	103.00	13 651.62	0.01
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	57.00	15 058.83	0.01
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	193.00	15 604.05	0.01

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	88.00	9 520.72	0.00
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	170.00	32 062.00	0.01
USD SABRE CORP COM USD0.01	300.00	6 192.00	0.00
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	333.00	40 289.67	0.01
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	123.00	19 708.29	0.01
USD SCANA CORP NEW COM	100.00	3 677.00	0.00
USD SCHEIN HENRY INC COM	88.00	6 688.00	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	711.00	48 746.16	0.02
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	604.00	33 630.72	0.01
USD SEALED AIR CORP NEW COM	149.00	6 533.65	0.00
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	110.00	6 955.30	0.00
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	133.00	14 869.40	0.01
USD SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01	100.00	5 072.00	0.00
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	100.00	16 614.00	0.01
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	54.00	19 853.64	0.01
USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	163.00	25 483.42	0.01
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	94.00	8 155.44	0.00
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	59.00	6 730.72	0.00
USD SOUTHERN CO COM	513.00	23 659.56	0.01
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	81.00	4 279.23	0.00
USD SPLUNK INC COM USD0.001	75.00	7 698.75	0.00
USD SPRINT CORPORATION COM USD0.01	390.00	2 187.90	0.00
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	100.00	14 159.00	0.01
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	743.00	42 774.51	0.02
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	193.00	19 257.54	0.01
USD STERICYCLE INC COM	52.00	3 052.92	0.00
USD STRYKER CORP COM USD0.10	173.00	29 309.66	0.01
USD SUNTRUST BKS INC COM	237.00	15 831.60	0.01
USD SYMANTEC CORP COM	330.00	9 170.70	0.00
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	420.00	13 931.40	0.01
USD SYNOPSYS INC COM USD0.01	94.00	8 037.94	0.00
USD SYSCO CORP COM USD1	259.00	16 197.86	0.01
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	94.00	10 699.08	0.00
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	162.00	9 802.62	0.00
USD TAPESTRY INC COM USD0.01	119.00	6 398.63	0.00
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	267.00	19 384.20	0.01
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	121.00	7 028.89	0.00
USD TESLA INC COM USD0.001	60.00	17 634.00	0.01
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	493.00	50 004.99	0.02
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	210.00	44 173.50	0.02
USD TIFFANY & CO NEW COM	61.00	6 272.63	0.00
USD TIME WARNER INC COM USD0.01	401.00	38 014.80	0.01
USD TJX COS INC COM USD1	309.00	26 218.65	0.01
USD TOLL BROS INC COM USD0.01	142.00	5 986.72	0.00
USD TORCHMARK CORP COM	105.00	9 107.70	0.00
USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	148.00	12 440.88	0.01
USD TRACTOR SUPPLY CO COM	100.00	6 800.00	0.00
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	40.00	12 822.80	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	139.00	18 292.40	0.01
USD TRIMBLE INC COM NPV	127.00	4 394.20	0.00
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	46.00	1 721.32	0.00
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL 'A '	553.00	20 217.68	0.01
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL 'B '	208.00	7 502.56	0.00
USD TWITTER INC COM USD0.000005	269.00	8 153.39	0.00
USD TYSON FOODS INC CL A	147.00	10 304.70	0.00
USD UDR INC	138.00	4 988.70	0.00
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	33.00	8 280.03	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	200.00	3 552.00	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL C	201.00	3 085.35	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄		数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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	UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	432.00	57 728.16	0.02
USD	UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	16.00	1 080.64	0.00
USD	UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	353.00	40 065.50	0.02
USD	UNITED RENTALS INC COM	46.00	6 900.00	0.00
USD	UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	492.00	116 308.80	0.04
USD	UNIVERSAL HEALTH S CLASS ' B ' COM USD0.01	64.00	7 308.80	0.00
USD	UNUM GROUP COM USD0.10	121.00	5 853.98	0.00
USD	US BANCORP COM USD0.01	868.00	43 790.60	0.02
USD	UTD TECHNOLOGIES COM USD1	402.00	48 300.30	0.02
USD	VALERO ENERGY CORP NEW COM	235.00	26 068.55	0.01
USD	VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	100.00	11 559.00	0.01
USD	VEREIT INC COM USD0.001	718.00	4 882.40	0.00
USD	VERISIGN INC COM	100.00	11 742.00	0.01
USD	VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	69.00	7 345.05	0.00
USD	VERIZON COMMUN COM USD0.10	2 124.00	104 819.40	0.04
USD	VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	133.00	20 370.28	0.01
USD	VF CORP COM NPV	143.00	11 564.41	0.01
USD	VIACOM INC NEW CL ' B ' NON-VTG USD0.001	128.00	3 860.48	0.00
USD	VISA INC COM STK USD0.0001	981.00	124 469.28	0.04
USD	VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS ' A '	42.00	5 596.92	0.00
USD	VORNADO REALTY TR COM USD0.04	95.00	6 462.85	0.00
USD	VOYA FINL INC COM USD0.01	69.00	3 612.15	0.00
USD	VULCAN MATERIALS COM STK USD1	61.00	6 813.09	0.00
USD	WABTEC CORP COM	100.00	8 881.00	0.00
USD	WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	472.00	31 364.40	0.01
USD	WALMART INC COM USD0.10	797.00	70 502.62	0.03
USD	WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	779.00	78 157.07	0.03
USD	WASTE MGMT INC DEL COM	209.00	16 989.61	0.01
USD	WATERS CORP COM	57.00	10 739.37	0.00
USD	WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	173.00	11 120.44	0.00
USD	WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	2 478.00	128 756.88	0.05
USD	WELLTOWER INC COM USD1	174.00	9 298.56	0.00
USD	WESTERN DIGITAL CORP COM	143.00	11 266.97	0.01
USD	WESTERN UN CO COM	316.00	6 241.00	0.00
USD	WESTROCK CO COM USD0.01	178.00	10 530.48	0.00
USD	WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	351.00	12 909.78	0.01
USD	WHIRLPOOL CORP COM	41.00	6 352.95	0.00
USD	WILLIAMS COS INC COM USD1	559.00	14 383.07	0.00
USD	WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	12 484.00	0.01
USD	WORLDPAY INC COM USD0.00001 CL A	99.00	8 040.78	0.00
USD	WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	59.00	6 738.39	0.00
USD	WYNN RESORTS LTD COM	51.00	9 495.69	0.00
USD	XCEL ENERGY INC COM	320.00	14 988.80	0.01
USD	XEROX CORP COM USD1(POST REV SPLT)	175.00	5 503.75	0.00
USD	XILINX INC COM USD0.01	117.00	7 516.08	0.00
USD	XYLEM INC COM USD0.01 WI	84.00	6 123.60	0.00
USD	YUM BRANDS INC COM	159.00	13 848.90	0.01
USD	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	112.00	12 899.04	0.01
USD	ZOETIS INC COM USD0.01 CL ' A '	236.00	19 701.28	0.01
アメリカ合衆国合計			11 870 259.67	4.11
無記名株式合計			19 164 408.30	6.63

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
参加証券			
スイス			
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	48.00	9 969.49	0.00
スイス合計		9 969.49	0.00
参加証券合計			
		9 969.49	0.00
その他の株式			
オランダ			
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	855.00	49 016.37	0.02
オランダ合計		49 016.37	0.02
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	360.00	80 317.20	0.03
スイス合計		80 317.20	0.03
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	33.00	2 818.20	0.00
アメリカ合衆国合計		2 818.20	0.00
その他の株式合計			
		132 151.77	0.05
優先株式			
ドイツ			
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	203.00	10 924.09	0.00
EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV	102.00	12 989.12	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	94.00	8 040.81	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	89.00	18 477.92	0.01
ドイツ合計		50 431.94	0.02
優先株式合計			
		50 431.94	0.02
記名株式			
オーストラリア			
AUD BENDIGO & ADELAIDE NPV	558.00	4 473.21	0.00
オーストラリア合計		4 473.21	0.00
ベルギー			
EUR KBC GROUP NV NPV	131.00	11 459.05	0.00
ベルギー合計		11 459.05	0.00
カナダ			
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	666.70	8 986.72	0.00
カナダ合計		8 986.72	0.00
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	104.00	14 644.83	0.01
フランス合計		14 644.83	0.01
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	96.00	23 649.79	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	233.00	55 305.57	0.02
EUR AXEL SPRINGER SE NPV(REGD)	57.00	4 672.65	0.00
EUR BASF SE NPV	447.00	46 618.45	0.02

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 BAYER AG NPV (REGD)	434.00	52 058.34	0.02
EUR BRENNTAG AG	94.00	5 396.88	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	465.00	36 798.75	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	1 057.00	14 515.15	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	99.00	13 354.66	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	179.00	5 227.19	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	569.00	24 817.52	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	1 799.00	31 505.64	0.01
EUR E.ON SE NPV	939.00	10 292.18	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	58.00	8 170.81	0.00
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	31.00	2 913.94	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	511.00	13 138.06	0.01
EUR K&S AG NPV	80.00	2 359.37	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	81.00	18 589.30	0.01
EUR OSRAM LICHT AG NPV	80.00	4 617.26	0.00
EUR PROSIEBENSAT1 MED.NPV	90.00	3 273.01	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	399.00	50 926.06	0.02
GBP TUI AG NPV (REGD)	363.00	8 227.15	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	80.00	5 198.16	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	181.00	9 099.45	0.00
ドイツ合計		450 725.34	0.16
イスラエル			
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	252.00	4 616.39	0.00
イスラエル合計		4 616.39	0.00
ルクセンブルグ			
EUR TENARIS S.A. USD1	118.00	2 219.78	0.00
ルクセンブルグ合計		2 219.78	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	8 149.00	52 900.53	0.02
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	254.00	2 663.74	0.00
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	3 291.00	26 759.73	0.01
EUR MAPFRE SA EURO.10	1 160.00	4 041.96	0.00
スペイン合計		86 365.96	0.03
スウェーデン			
SEK HENNES & MAURITZ SER 'B' NPV	432.00	7 402.75	0.00
スウェーデン合計		7 402.75	0.00
スイス			
CHF ABB LTD CHF0.12 (REGD)	910.00	21 364.18	0.01
CHF ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)	75.00	4 995.96	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	69.00	10 992.32	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	241.00	32 696.47	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	144.00	4 847.39	0.00
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	1 267.00	21 496.39	0.01
GBP FERGUSON PLC ORD GBP0.108030303	130.00	9 991.30	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	5 867.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	11.00	4 718.25	0.00
CHF GIVAUDAN AG CHF10	4.00	8 966.56	0.00
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	89.00	5 326.15	0.00
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	34.00	5 323.77	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	140.00	7 829.48	0.00
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	94.00	5 257.19	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	41.00	10 114.35	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	1 673.00	130 101.57	0.05
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	1 170.00	90 654.61	0.03

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	21.00	15 412.16	0.01
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	268.00	25 600.65	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	2.00	4 883.32	0.00
CHF SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)	38.00	6 303.26	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	41.00	3 671.73	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	7.00	2 464.39	0.00
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	77.00	7 237.95	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	4.00	1 927.47	0.00
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	206.00	18 900.50	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	1 930.00	32 696.33	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	73.00	23 421.36	0.01
スイス合計		523 062.06	0.18
イギリス			
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	282.00	8 206.20	0.00
イギリス合計		8 206.20	0.00
アメリカ合衆国			
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	564.00	42 080.04	0.02
アメリカ合衆国合計		42 080.04	0.02
記名株式合計		1 164 242.33	0.40
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	455.00	8 109.01	0.00
アイルランド合計		8 109.01	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	483.00	8 684.34	0.00
イスラエル合計		8 684.34	0.00
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	49.00	3 273.02	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	192.00	2 969.27	0.00
ルクセンブルグ合計		6 242.29	0.00
イギリス			
USD BRITISH AMERN TOB PLC SPONSORED ADR	230.00	12 571.80	0.01
USD MICRO FOCUS INTL SPON ADR EACH REP 1 ORD SHS	118.00	2 043.76	0.00
イギリス合計		14 615.56	0.01
預託証券合計		37 651.20	0.01
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.03.19	29 890 000.00	41 517 210.00	14.37
アイルランド合計		41 517 210.00	14.37
投資信託証券合計		41 517 210.00	14.37
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	116.00	2 112.87	0.00
カナダ合計		2 112.87	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
シンガポール			
SGD CAPITALAND MALL TRUST	6 300.00	9 992.07	0.00
シンガポール合計		9 992.07	0.00
アメリカ合衆国			
USD DUKE REALTY CORP REIT	235.00	6 368.50	0.00
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	104.00	4 349.28	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	53.00	5 180.22	0.00
USD VENTAS INC REIT	170.00	8 741.40	0.01
アメリカ合衆国合計		24 639.40	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		36 744.34	0.01
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	225 000.00	201 191.85	0.07
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 3.65000% 16-01.02.26	200 000.00	195 539.80	0.07
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	100 000.00	96 084.50	0.03
USD APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	175 000.00	164 679.02	0.06
USD APPLE INC 3.00000% 17-09.02.24	375 000.00	367 016.25	0.13
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	100 000.00	96 535.50	0.03
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	150 000.00	146 283.15	0.05
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	250 000.00	249 768.00	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75000% 16-15.03.23	200 000.00	194 926.00	0.07
USD CHEVRON CORP 2.89500% 17-03.03.24	100 000.00	97 378.30	0.03
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	150 000.00	149 088.45	0.05
USD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22	75 000.00	77 905.50	0.03
USD EXXON MOBIL CORP 2.72600% 16-01.03.23	225 000.00	220 807.58	0.08
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	100 000.00	96 788.00	0.03
USD KOREA RESOURCES CORP-REG-S 3.00000% 17-24.04.22	200 000.00	191 746.28	0.07
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	125 000.00	116 737.75	0.04
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	200 000.00	192 250.00	0.07
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	100 000.00	97 469.80	0.03
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	225 000.00	217 677.38	0.07
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	275 000.00	254 281.23	0.09
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	200 000.00	192 500.00	0.07
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.70000% 13-15.01.24	225 000.00	227 466.22	0.08
USD VISA INC 2.75000% 17-15.09.27	45 000.00	42 023.56	0.01
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	350 000.00	349 780.20	0.12
USD WESTPAC BANKING CORP 2.85000% 16-13.05.26	200 000.00	185 440.00	0.06
米ドル合計		4 421 364.32	1.53
ノート、固定利付債合計		4 421 364.32	1.53
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 15-22.01.25	225 000.00	210 858.75	0.07
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.30000% 16-01.06.21	250 000.00	242 557.50	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	175 000.00	162 976.45	0.06
USD HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 1.50000% 16-13.09.19	80 000.00	78 658.88	0.03
USD MDC-GMTN B.V-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	250 000.00	236 875.00	0.08
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.60000% 17-28.09.22	125 000.00	119 955.25	0.04
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	300 000.00	293 704.50	0.10
米ドル合計		1 345 586.33	0.47
中期債券、固定利付債合計		1 345 586.33	0.47

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	175 000.00	206 392.62	0.07
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	250 000.00	245 267.00	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	275 000.00	255 089.18	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 14-21.02.24	250 000.00	249 089.00	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	325 000.00	313 816.42	0.11
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	550 000.00	526 813.70	0.18
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 14-20.11.24	200 000.00	193 468.00	0.07
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	325 000.00	299 152.75	0.10
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	150 000.00	157 547.25	0.05
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	300 000.00	298 162.80	0.10
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.40000% 17-08.02.22	100 000.00	97 427.00	0.03
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	100 000.00	99 983.50	0.04
米ドル合計		2 942 209.22	1.02
債券、固定利付債合計		2 942 209.22	1.02
財務省証券(T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 15-15.10.18	3 500 000.00	3 481 544.50	1.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 10-15.11.20	6 500 000.00	6 506 097.00	2.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 11-31.08.18	500 000.00	499 238.50	0.17
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	4 800 000.00	4 569 374.40	1.58
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	70 000.00	66 294.90	0.03
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 13-15.08.23	5 000.00	4 922.66	0.00
米ドル合計		15 127 471.96	5.24
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		15 127 471.96	5.24
財務省証券(T-note)、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	610 000.00	659 867.71	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	570 000.00	607 034.78	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	580 000.00	611 117.29	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 14-15.04.19	740 000.00	782 737.86	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 15-15.04.20	1 600 000.00	1 686 911.06	0.58
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	690 000.00	703 695.03	0.24
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	570 000.00	603 492.55	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	940 000.00	966 647.75	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 17-15.01.27	240 000.00	239 664.17	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.500%/CPI LINKED 18-15.01.28	1 250 000.00	1 231 041.52	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	570 000.00	606 837.51	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	930 000.00	966 823.26	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	860 000.00	995 141.86	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	655 000.00	960 645.18	0.33
米ドル合計		11 621 657.53	4.02
財務省証券(T-note)、変動利付債合計		11 621 657.53	4.02
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		97 571 098.73	33.77

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
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			
米ドル			
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	600 000.00	578 964.60	0.20
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	225 000.00	235 416.60	0.08
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	100 000.00	96 568.00	0.04
米ドル合計		910 949.20	0.32
ノート、固定利付債合計		910 949.20	0.32
財務省証券(T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 14-31.08.19	7 100 000.00	7 029 000.00	2.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	6 100 000.00	5 872 439.50	2.03
米ドル合計		12 901 439.50	4.46
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		12 901 439.50	4.46
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		13 812 388.70	4.78
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	86.00	3 107.39	0.00
カナダ合計		3 107.39	0.00
無記名株式合計		3 107.39	0.00
記名株式			
イギリス			
GBP ROLLS ROYCE HLDGS C SHS ENTITLEMENT (JULY 201	56 445.00	77.75	0.00
イギリス合計		77.75	0.00
記名株式合計		77.75	0.00
新株引受権			
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 17.05.18	93.00	217.98	0.00
オランダ合計		217.98	0.00
新株引受権合計		217.98	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		3 403.12	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
UCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
EUR UBS IRL ALT SOL PLC-A&Q DIVER ALT PORTFOL-U-X-(EUR HDG)-CAP	244.00	2 834 291.54	0.98
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	15 535.00	3 712 243.60	1.28
アイルランド合計		6 546 535.14	2.26
ジャージー			
USD UBS WEALTH MANAGEMENT-GLOBAL PROPERTY FUND LTD H-USD	10 785.30	73 950.47	0.03
ジャージー合計		73 950.47	0.03
ルクセンブルグ			
USD MANAGER OPP ACCESS-RISK PARITY STRATEGIES FUND USD Q-ACC	54 506.12	5 719 327.17	1.98
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	55 313.00	5 795 696.14	2.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	493.40	8 792 271.50	3.04
USD UBS (LUX) BOND SICAV USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	2 280.00	23 334 318.00	8.07
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X-ACC	1 169.00	14 426 406.89	4.99
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP(USD)-U-X-ACC	123.00	3 586 686.15	1.24
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	312.00	6 683 046.24	2.31
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA GRWTH (USD)-U-X-ACC	49.00	1 662 950.24	0.58
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	2 740.86	41 800 962.40	14.47
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL.GLOBAL EQUITY FA-USD	1 388.00	31 612 213.56	10.94
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMERG.MARKETS EQUITY PASSIVE XA USD	2 148.00	275 309.16	0.10
USD UBS (LUX) INSTITUTIONAL SICAV - E MARKETS EQUITY PASS FA USD	766.00	10 553 442.44	3.65
EUR UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV-GLOBAL ALPHA OPP (EUR) U-X-ACC	525.00	8 299 684.29	2.87
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	126.00	1 341 530.82	0.46
ルクセンブルグ合計		163 883 845.00	56.71
投資信託、オープン・エンド型合計		170 504 330.61	59.00
UCITS/その他のUCIs合計		170 504 330.61	59.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
指数関連オプション、標準型			
米ドル			
USD S&P 500 INDEX PUT 2450.00000 21.12.18	33.00	227 700.00	0.08
米ドル合計		227 700.00	0.08
指数関連オプション、標準型合計		227 700.00	0.08
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		227 700.00	0.08
投資有価証券合計		282 118 921.16	97.63

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券関連金融先物			
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.06.18	44.00	-18 094.78	-0.01
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (TSE) FUTURE 13.06.18	-6.00	4 934.89	0.01
債券関連金融先物合計		-13 159.89	0.00
指数関連金融先物			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.06.18	223.00	417 162.00	0.15
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.06.18	26.00	27 635.44	0.01
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 15.06.18	51.00	251 637.44	0.09
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 18.05.18	-29.00	-15 092.07	-0.01
JPY NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 07.06.18	3.00	41 124.06	0.01
USD S&P500 EMINI FUTURE 15.06.18	10.00	13 275.00	0.00
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 14.06.18	-20.00	-28 987.09	-0.01
AUD SPI 200 INDEX FUTURE 21.06.18	-45.00	-32 968.07	-0.01
HKD HANG SENG INDEX FUTURE 30.05.18	-4.00	-4 536.04	0.00
指数関連金融先物合計		669 250.67	0.23
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		656 090.78	0.23
派生商品合計		656 090.78	0.23

先渡為替契約

先渡為替契約(購入/売却)

USD	247 580.75	DKK	1 485 000.00	16.5.2018	6 509.58	0.00
USD	562 362.44	AUD	712 609.80	16.5.2018	24 437.78	0.01
USD	404 638.54	SGD	533 000.00	16.5.2018	1 972.98	0.00
CAD	1 641 418.30	USD	1 304 905.39	16.5.2018	-24 123.09	-0.01
USD	4 894 326.31	JPY	521 582 482.00	16.5.2018	123 295.62	0.04
SEK	40 848 077.12	USD	5 089 969.23	16.5.2018	-412 670.26	-0.14
USD	6 051 099.26	NOK	47 275 804.40	16.5.2018	146 852.49	0.05
USD	1 007 480.08	HKD	7 865 000.00	16.5.2018	4 933.19	0.00
USD	1 248 847.30	CHF	1 160 326.50	16.5.2018	75 271.64	0.03
USD	2 754 590.06	GBP	1 965 000.00	16.5.2018	46 327.86	0.02
USD	11 805 906.17	EUR	9 510 085.86	16.5.2018	303 936.53	0.11
GBP	510 000.00	CHF	665 531.13	16.5.2018	29 741.34	0.01
EUR	1 150 000.00	USD	1 422 890.40	16.5.2018	-32 023.35	-0.01
JPY	148 568 832.00	NZD	1 920 000.00	16.5.2018	6 247.25	0.00
JPY	149 128 012.00	NZD	1 930 000.00	16.5.2018	4 316.52	0.00
JPY	40 500 000.00	USD	381 668.24	16.5.2018	-11 205.75	0.00
GBP	310 000.00	CHF	404 624.71	16.5.2018	17 991.01	0.01
GBP	510 000.00	CHF	665 934.54	16.5.2018	29 333.82	0.01
USD	129 132.51	CHF	120 000.00	16.5.2018	7 762.29	0.00
NOK	43 590 000.00	SEK	45 184 391.43	16.5.2018	269 799.61	0.09
USD	147 726.67	SEK	1 200 000.00	16.5.2018	10 320.97	0.00
EUR	1 150 000.00	USD	1 423 249.20	16.5.2018	-32 382.15	-0.01
EUR	1 460 000.00	USD	1 806 755.84	16.5.2018	-40 959.41	-0.01
NOK	2 700 000.00	USD	344 898.20	16.5.2018	-7 696.82	0.00
GBP	510 000.00	CHF	665 710.14	16.5.2018	29 560.51	0.01
GBP	300 000.00	USD	421 506.60	16.5.2018	-8 031.45	0.00
JPY	149 246 321.00	NZD	1 930 000.00	16.5.2018	5 398.79	0.00

注記は当財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 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	469 656.88 JPY 50 000 000.00	16.5.2018 12 295.79	0.01
EUR	360 000.00 USD 445 143.96	16.5.2018 -9 742.10	0.00
EUR	500 000.00 USD 622 647.50	16.5.2018 -17 922.69	-0.01
USD	992 032.80 EUR 800 000.00	16.5.2018 24 473.11	0.01
BRL	6 920 000.00 USD 2 076 924.23	28.6.2018 -103 726.38	-0.04
RUB	122 080 000.00 USD 2 091 978.15	28.6.2018 -165 902.18	-0.06
INR	135 380 000.00 USD 2 048 418.82	28.6.2018 -26 906.76	-0.01
USD	2 179 601.07 TWD 62 960 000.00	28.6.2018 44 011.47	0.02
USD	2 076 664.50 AUD 2 700 000.00	28.6.2018 38 109.03	0.01
TRY	8 100 000.00 USD 2 001 111.73	28.6.2018 -44 475.36	-0.02
USD	2 175 581.29 HUF 548 860 000.00	28.6.2018 52 427.22	0.02
USD	2 216 812.58 NOK 17 080 000.00	28.6.2018 80 298.66	0.03
USD	1 067 597.08 CAD 1 370 000.00	16.5.2018 -1 400.23	0.00
EUR	140 000.00 USD 173 495.56	16.5.2018 -4 172.61	0.00
USD	203 180.32 NZD 280 000.00	16.5.2018 5 904.86	0.00
USD	232 025.40 AUD 300 000.00	16.5.2018 5 565.70	0.00
GBP	150 000.00 USD 213 010.20	16.5.2018 -6 272.63	0.00
EUR	150 000.00 USD 186 585.90	16.5.2018 -5 168.46	0.00
USD	245 958.60 EUR 200 000.00	16.5.2018 4 068.68	0.00
USD	211 750.50 GBP 150 000.00	16.5.2018 5 012.93	0.00
USD	10 438 793.42 EUR 8 409 694.03	13.7.2018 220 937.20	0.08
USD	701 758.13 SEK 5 819 153.13	13.7.2018 32 380.69	0.01
USD	4 427 780.76 NZD 6 030 000.00	13.7.2018 179 398.64	0.06
USD	1 007 271.11 HKD 7 881 000.00	13.7.2018 1 413.59	0.00
USD	125 430.09 NOK 977 313.11	13.7.2018 3 107.93	0.00
USD	876 948.87 GBP 616 535.41	13.7.2018 24 766.49	0.01
USD	1 328 776.03 AUD 1 718 972.47	13.7.2018 30 791.80	0.01
USD	4 302 366.82 CHF 4 080 059.22	13.7.2018 154 284.51	0.05
USD	802 642.39 JPY 85 331 561.00	13.7.2018 18 873.07	0.01
CAD	572 879.08 USD 452 427.85	13.7.2018 -4 807.25	0.00
USD	249 175.60 DKK 1 495 000.00	13.7.2018 5 351.34	0.00
USD	114 699.24 SGD 150 000.00	13.7.2018 1 218.36	0.00
USD	1 963 912.50 TRY 8 100 000.00	28.6.2018 7 276.13	0.00
USD	1 971 748.18 RUB 122 080 000.00	28.6.2018 45 672.21	0.02
HUF	548 860 000.00 USD 2 184 026.54	28.6.2018 -60 872.47	-0.02
AUD	2 700 000.00 USD 2 078 062.02	28.6.2018 -39 506.55	-0.01
NOK	17 080 000.00 USD 2 192 194.35	28.6.2018 -55 680.43	-0.02
CHF	2 522 530.50 GBP 1 850 000.00	13.7.2018 7 476.14	0.00
CHF	2 515 092.32 GBP 1 840 000.00	16.5.2018 7 825.74	0.00
USD	589 498.73 GBP 420 000.00	16.5.2018 10 633.53	0.00
USD	591 121.78 GBP 420 000.00	13.7.2018 10 592.92	0.00
USD	320 987.16 EUR 260 000.00	13.7.2018 5 084.75	0.00
USD	141 420.93 CAD 180 000.00	16.5.2018 968.73	0.00
SGD	210 000.00 USD 159 779.78	13.7.2018 -906.54	0.00
USD	141 612.08 CAD 180 000.00	13.7.2018 968.60	0.00
USD	319 511.92 EUR 260 000.00	16.5.2018 5 055.02	0.00
SGD	210 000.00 USD 159 541.86	16.5.2018 -893.14	0.00
JPY	6 794 928 300.00 USD 62 559 183.73	30.5.2018 -342 789.87	-0.12
SGD	9 680 200.00 USD 7 321 470.98	30.5.2018 -6 149.15	0.00
EUR	470 000.00 USD 574 120.04	16.5.2018 -5 678.72	0.00
EUR	470 000.00 USD 576 778.83	13.7.2018 -5 724.47	0.00
先渡為替契約（購入 / 売却）合計		712 464.35	0.25
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		3 812 368.87	1.32
その他の資産および負債		1 678 385.57	0.57
純資産総額		288 978 230.73	100.00

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2017年6月1日から2018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2018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	1,976,080.112 (1,583,742.772)	3,229,887.510 (1,051,502.466)	10,922,943.502 (4,441,989.306)
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	176,668.596 (140,849.808)	60,854.090 (57,326.501)	649,055.699 (535,697.246)

(注) () 内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡し日を基準として算出している。一方、() の上段の数字は約定日を基準として算出している。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線で示します。

第一部 証券情報

第1 外国投資証券(外国新投資口予約権証券及び外国投資法人債券を除く。)

(5) 発行(売出)価格

<訂正前>

ファンド営業日(「注文日」)の遅くとも中央ヨーロッパ標準時間13時(「締切時間」)までにノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・リミテッド ルクセンブルグ支店(Northern Trust Global Services Ltd, Luxembourg Branch)(「管理事務代行会社」)に登録された場合、その日の締切時間後に計算した純資産価格。

(注1) 発行価格は、下記(10)記載の申込取扱場所に照会することができる。

(注2) 2017年10月1日付で、ルクセンブルグおよびスイスにおけるUBSアセット・マネジメントのファンド事務管理業務部門は、ノーザン・トラスト・コーポレーションに買収された。

管理会社は、本取引について適切に通知を受けており、その結果、管理会社は、自らが運用するファンドについて、UBSファンド・サービスズ(ルクセンブルグ)エス・エイの後任としてノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・リミテッド ルクセンブルグ支店に管理事務代行業務を委任し、2017年10月1日付で、ノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・リミテッド ルクセンブルグ支店がファンドの管理事務代行会社となった。

以下同じ。

<訂正後>

ファンド営業日(「注文日」)の遅くとも中央ヨーロッパ標準時間13時(「締切時間」)までにノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・ピーエルシー ルクセンブルグ支店(Northern Trust Global Services PLC, Luxembourg Branch)(「管理事務代行会社」)に登録された場合、その日の締切時間後に計算した純資産価格。

(注1) 発行価格は、下記(10)記載の申込取扱場所に照会することができる。

(注2) ノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・リミテッド ルクセンブルグ支店(Northern Trust Global Services Ltd, Luxembourg Branch)は、2018年4月3日付で、ノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ・ピーエルシー ルクセンブルグ支店(Northern Trust Global Services PLC, Luxembourg Branch)に商号が変更された。

以下同じ。

第四部 特別情報

第3 その他

<訂正前>

(前略)

交付目論見書の概要

(中略)

お申込価格	注文日の遅くとも中央ヨーロッパ標準時間13時(「締切時間」)までにノーズン・トラスト・グローバル・サービスズ・リミテッド ルクセンブルグ支店(Northern Trust Global Services Ltd, Luxembourg Branch)(「管理事務代行会社」)に登録された場合、その日の締切時間後に計算した純資産価格。
-------	--

(後略)

<訂正後>

(前略)

交付目論見書の概要

(中略)

お申込価格	注文日の遅くとも中央ヨーロッパ標準時間13時(「締切時間」)までにノーズン・トラスト・グローバル・サービスズ・ピーエルシー ルクセンブルグ支店(Northern Trust Global Services PLC, Luxembourg Branch)(「管理事務代行会社」)に登録された場合、その日の締切時間後に計算した純資産価格。
-------	---

(後略)