

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年7月31日
【計算期間】	第4期中(自 平成28年11月1日 至 平成29年4月30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
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

(注1) 米ドルの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2017年5月31日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=110.96円)による。

(注2) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

(注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してまたは切り捨てて記載してある。従って、合計の数字が一致しない場合がある。また円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入して記載してある。従って、本書の中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

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)

	2015年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2015年10月末日に 終了する 会計年度末	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
(a) 営業収益 ^(1)	6,364,768.56	468,060.31	- 1,304,153.23	6,992,798.37	12,952,190.52
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	6,364,768.56	468,060.31	- 1,304,153.23	6,992,798.37	12,952,190.52
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	6,364,768.56	468,060.31	- 1,304,153.23	6,992,798.37	12,952,190.52
(d) 出資総額 ^(2)	220,508,200.57	243,753,477.85	286,771,495.34	267,815,406.45	282,709,651.20
(e) 発行済投資口総数 (クラス P - a c c 投資証券)	14,363,444.090口	15,488,643.480口	16,494,199.738口	13,519,373.174口	12,148,207.311口
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	-	208,919.000口	329,561.000口	348,761.000口	545,437.279口
(f) 純資産額	220,508,200.57	243,753,477.85	286,771,495.34	267,815,406.45	282,709,651.20
(g) 資産総額	221,302,874.28	244,050,708.19	315,682,310.74	269,147,562.05	283,046,320.62
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス P - a c c 投資証券)	14.49	14.10	13.77	14.19	15.01
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	-	9,732円	9,496円	9,738円	10,238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)	0.42	0.01	- 0.24	0.14	0.83
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	-	0.97	6.96	10.46	0.56
(j) 分配総額	なし	なし	64,748.92	458,863.39	550,204.49
(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	99.64%	99.88%	90.84%	99.51%	99.88%
(m) 自己資本利益率 ^(3) (クラス P - a c c 投資証券)	6.15%	0.50%	- 4.97%	0.64%	9.01%
(クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券)	-	- 2.68%	- 5.04%	0.06%	7.81%

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

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

(2) 【外国投資法人の出資総額】

2017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)	284,879,242.45 (約31,610百万円)	クラス P - a c c 投資証券	12,176,750.900
		クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	533,241.193

(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

定足数および過半数に関する法律規定を満たす投資主総会は本投資法人を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、平成29年4月28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。

合併の決定は平成29年4月28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、平成29年4月28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 買戻し手続等」と題する項に記載するガイドラインに従って、買戻手数料またはその他の管理料金を支払わずに、その時点の純資産価格で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、決定が有効となる日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価格に基づいて交換される。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。

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

(バランズド(米ドル))

(2017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	159,717,153.50	55.83
	アイルランド	11,912,369.01	4.16
	ジャージー島	146,141.98	0.05
	アメリカ合衆国	9,627.95	0.00
	シンガポール	9,062.45	0.00
	カナダ	2,172.80	0.00
	小計	171,796,527.69	60.06
債券	アメリカ合衆国	45,740,727.64	15.99
	国際機関	1,441,386.70	0.50
	カナダ	1,066,995.80	0.37
	韓国	554,750.15	0.19
	ドイツ	448,701.38	0.16
	オランダ	247,187.50	0.09
	イギリス	246,176.55	0.09
	オーストラリア	101,470.00	0.04
	イタリア	70,723.20	0.02
	フランス	52,866.90	0.02
	小計	49,970,985.82	17.47
その他証券	アイルランド	36,367,588.00	12.71
	小計	36,367,588.00	12.71

株式	アメリカ合衆国	10,961,663.93	3.83
	日本	1,630,940.24	0.57
	イギリス	1,144,630.56	0.40
	フランス	728,226.00	0.25
	スイス	713,996.89	0.25
	ドイツ	682,734.83	0.24
	カナダ	629,812.95	0.22
	オーストラリア	480,030.45	0.17
	オランダ	392,752.78	0.14
	スペイン	253,805.35	0.09
	香港	247,897.84	0.09
	スウェーデン	209,783.44	0.07
	アイルランド	172,394.09	0.06
	イタリア	155,592.14	0.05
	シンガポール	143,821.05	0.05
	デンマーク	129,379.94	0.05
	ベルギー	81,508.98	0.03
	フィンランド	75,677.43	0.03
	ノルウェー	44,509.13	0.02
	イスラエル	39,552.90	0.01
	ジャージー島	37,048.06	0.01
	バミューダ	33,644.54	0.01
	オーストリア	18,665.44	0.01
	ルクセンブルグ	17,221.74	0.01
	マカオ	12,779.04	0.00
	ニュージーランド	9,960.30	0.00
	ポルトガル	5,007.12	0.00
	南アフリカ	4,049.97	0.00
	パプアニューギニア	3,244.63	0.00
	メキシコ	1,953.16	0.00
	小計	19,062,284.92	6.66
ポートフォリオ合計		277,197,386.43	96.90
現金・その他資産		8,865,374.88	3.10
資産総額		286,062,761.31	100.00
負債総額		1,183,518.86	0.41
合計(純資産総額)		284,879,242.45 (約31,610百万円)	99.59

(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】

2017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
2016年6月末日	266,215.04	29,539	261,826.14	29,052	13.80	1,531	9,504
7月末日	269,700.19	29,926	267,055.70	29,633	14.08	1,562	9,690
8月末日	267,878.68	29,724	266,439.01	29,564	14.19	1,575	9,756
9月末日	269,408.70	29,894	268,253.72	29,765	14.24	1,580	9,772
10月末日	269,147.56	29,865	267,815.41	29,717	14.19	1,575	9,738
11月末日	262,050.29	29,077	260,378.74	28,892	14.18	1,573	9,731
12月末日	255,431.85	28,343	253,711.97	28,152	14.35	1,592	9,831
2017年1月末日	260,287.67	28,882	259,503.47	28,795	14.52	1,611	9,933
2月末日	267,104.61	29,638	266,041.16	29,520	14.75	1,637	10,083
3月末日	297,431.03	33,003	277,773.51	30,822	14.86	1,649	10,147
4月末日	283,046.32	31,407	282,709.65	31,369	15.01	1,666	10,238
5月末日	286,062.76	31,742	284,879.24	31,610	15.18	1,684	10,346

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】

2016年6月1日から2017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	9.68
	クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	8.44

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2017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 = 2016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】

中間計算期間において、平成29年4月28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り営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、本書提出日現在、存在しない。

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

2017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、2017年5月31日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=123.95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

2017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439億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2017年5月31日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=113.67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

2017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

(2017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)

(2017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	3,858,408,466	100

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2017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

(2017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)	ディレク ター / ボー ド・メンバー	2016年11月29日UBS ファンド・マネジメ ント(ルクセンブルグ) エス・エイへの就 任 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)	ディレク ター / ボー ド・メンバー	2010年7月1日UBS ファンド・マネジメ ント(ルクセンブルグ) エス・エイへの就 任 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・マーティン・キス トラー (Pascal Martin Kistler)	ディレク ター / ボー ド・メンバー	2015年7月21日UBS ファンド・マネジメ ント(ルクセンブルグ) エス・エイへの就 任 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
アンドレアス・シュラター (Andreas Schlatter)	チェアマン	2010年7月1日UBS ファンド・マネジメ ント(ルクセンブルグ) エス・エイへの就 任 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)

(2017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
アクセル・アルフレッド・ウェーバー (Axel Alfred Weber)	チェアマン	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2012年5月3日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	635,751株
ミシェル・デマレ (Michel Demaré)	ヴァイス・チェアマン	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2010年4月14日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	254,287株
レト・フランシオニ (Reto Francioni)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2013年5月2日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	51,567株
イサベル・ロミー (Isabelle Romy)	メンバー・オブ・ザ・ボード	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2012年5月3日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	91,038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	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2009年4月15日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	201,457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	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2008年10月2日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	104,385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	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2012年5月3日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	99,737株
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	2014年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2010年4月14日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	205,540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年ユービーエス・グループ・エイ・ジーへの初選出 2016年5月4日ユービーエス・エイ・ジーへの就任	未公開

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
ディエター・ウェマー (Dieter Wemmer)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	2016年ユービーエス・グループ・エ イ・ジーへの初選出 2016年5月4日ユービーエス・エ イ・ジーへの就任	未公開
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年ユービーエス・グループ・エ イ・ジーへの初選出 2017年4月27日ユービーエス・エ イ・ジーへの就任	未公開

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2017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	1,631,052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	非公開

(4) 【事業の内容及び営業の概況】

UBS ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

管理会社は、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。

2017年5月末日現在、管理会社は以下のとおり、243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	243	867,631,423.86オーストラリア・ドル
			550,721,761.49カナダ・ドル
			12,332,855,288.17スイス・フラン
			157,069,147.22中国元
			375,611,375.33デンマーク・クローネ
			31,828,844,964.36ユーロ
			1,471,534,859.67英ポンド
			320,435,549.89香港ドル
			108,438,279,429.81日本円
			37,275,991.14シンガポール・ドル
			59,825,205,867.62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)

2017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	純資産総額 (ユーロ)
1	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	3,867,874,476.39
2	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する投資法人	2006年10月26日	3,859,529,633.61
3	UBS (Lux) Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月29日	3,529,441,568.36
4	UBS ETF - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2002年9月20日	3,426,192,721.91
5	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する投資法人	2005年8月30日	2,741,670,175.56
6	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月11日	2,116,025,373.10
7	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield (CHF)	契約型投資信託	1991年9月13日	1,986,785,544.31
8	UBS (Lux) Institutional Fund - Key Selection Global Equity	契約型投資信託	2002年11月19日	1,567,154,081.77
9	UBS (Lux) Strategy Xtra Sicav - Yield (CHF)	変動資本を有する投資法人	2004年6月30日	1,415,820,131.45
10	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced (CHF)	契約型投資信託	1994年7月7日	1,355,408,389.54

(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)

2017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24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	70億スイスフラン
ケイマン諸島	ヘッジ・ファンド	4	116億スイスフラン
ルクセンブルグ	オープン・エンド型ファンド	15	201億スイスフラン

(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。

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、2017年5月31日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=110.96円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

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

純資産計算書

	2017年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	251,869,840.02	27,947,477
投資有価証券、未実現評価(損)益	23,650,328.13	2,624,240
投資有価証券合計(注1)	275,520,168.15	30,571,718
現金預金、要求払預金および預託金勘定	6,522,879.06	723,779
その他の流動資産(マージン)	961,532.64	106,692
有価証券売却未収金(注1)	118,495.26	13,148
発行未収金	788,530.81	87,495
有価証券に係る未収利息	213,525.62	23,693
流動資産に係る未収利息	917.11	102
配当金に係る未収金	34,585.94	3,838
その他の未収金	7,722.81	857
その他の資産	36,565.11	4,057
金融先物未実現(損)益(注1)	273,895.86	30,391
先渡為替契約未実現(損)益(注1)	(1,629,191.08)	(180,775)
スワップ未実現(損)益(注1)	196,693.33	21,825
資産合計	283,046,320.62	31,406,820
負 債		
当座借越	(29.92)	(3)
有価証券購入未払金(注1)	(39,985.45)	(4,437)
買戻未払金	(83,566.80)	(9,273)
報酬引当金(注2)	(194,520.02)	(21,584)
年次税引当金(注3)	(4,942.59)	(548)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(13,624.64)	(1,512)
引当金合計	(213,087.25)	(23,644)
負債合計	(336,669.42)	(37,357)
期末現在純資産	282,709,651.20	31,369,463

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)

運用計算書

自2016年11月 1 日 至2017年 4 月30日		
	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	7,073.71	785
有価証券に係る利息	746,081.18	82,785
配当金	236,470.93	26,239
スワップに係る受取利息(注1)	73,142.24	8,116
貸付証券に係る収益(注12)	34,840.70	3,866
その他の収益(注4)	39,150.30	4,344
収益合計	1,136,759.06	126,135
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(41,535.21)	(4,609)
貸付証券に係るコスト(注12)	(13,936.28)	(1,546)
報酬(注2)	(2,539,198.18)	(281,749)
年次税(注3)	(37,053.47)	(4,111)
その他の手数料および報酬(注2)	(29,597.86)	(3,284)
現金および当座借越に係る利息	(1,922.16)	(213)
費用合計	(2,663,243.16)	(295,513)
投資純(損)益	(1,526,484.10)	(169,379)
実現利益(注1)		
無オプション市場価格証券	5,721,241.39	634,829
金融先物	1,222,169.21	135,612
先渡為替契約	9,550,151.67	1,059,685
スワップ	397,123.58	44,065
為替差益	13,977,178.36	1,550,908
実現利益合計	30,867,864.21	3,425,098
実現損失(注1)		
無オプション市場価格証券	(3,267,376.83)	(362,548)
金融先物	(108,641.35)	(12,055)
先渡為替契約	(6,927,381.97)	(768,662)
スワップ	(527,267.48)	(58,506)
為替差損	(14,714,477.57)	(1,632,718)
実現損失合計	(25,545,145.20)	(2,834,489)
当期実現純(損)益	3,796,234.91	421,230
未実現評価益の変動(注1)		
無オプション市場価格証券	27,381,501.34	3,038,251
金融先物	273,895.86	30,391
スワップ	196,693.33	21,825
未実現評価益の変動合計	27,852,090.53	3,090,468
未実現評価損の変動(注1)		
無オプション市場価格証券	(15,843,028.62)	(1,757,942)
金融先物	(244,962.36)	(27,181)
先渡為替契約	(2,608,143.94)	(289,400)
未実現評価損の変動合計	(18,696,134.92)	(2,074,523)
運用の結果による純資産の純増(減)	12,952,190.52	1,437,175

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2016年11月1日 至2017年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	267,815,406.45	29,716,797
発行額	40,172,645.58	4,457,557
買戻額	(37,680,386.86)	(4,181,016)
純発行(買戻)合計	2,492,258.72	276,541
支払配当金	(550,204.49)	(61,051)
投資純(損)益	(1,526,484.10)	(169,379)
実現利益合計	30,867,864.21	3,425,098
実現損失合計	(25,545,145.20)	(2,834,489)
未実現評価益の変動合計	27,852,090.53	3,090,468
未実現評価損の変動合計	(18,696,134.92)	(2,074,523)
運用の結果による純資産の純増(減)	12,952,190.52	1,437,175
期末現在純資産	282,709,651.20	31,369,463

発行済投資証券数の変動表

	自2016年11月1日 至2017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	2,190,567.3830
期中発行投資証券数	602,193.3660
期中買戻投資証券数	(377,229.5200)
期末現在発行済投資証券数	2,415,531.2290
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	587,192.7080
期中発行投資証券数	357,678.7960
期中買戻投資証券数	(99,975.8910)
期末現在発行済投資証券数	844,895.6130
クラスP - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	13,519,373.1740
期中発行投資証券数	793,229.9950
期中買戻投資証券数	(2,164,395.8580)
期末現在発行済投資証券数	12,148,207.3110
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	348,761.0000
期中発行投資証券数	200,262.3590
期中買戻投資証券数	(3,586.0800)
期末現在発行済投資証券数	545,437.2790
クラスP - d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	651,645.5940
期中発行投資証券数	62,842.8470
期中買戻投資証券数	(57,289.2130)

期末現在発行済投資証券数	657,199.2280
クラスQ - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	73,020.5110
期中発行投資証券数	8,896.1930
期中買戻投資証券数	(4,808.5760)
期末現在発行済投資証券数	77,108.1280
クラスQ - d i s t	(口)
期首現在発行済投資証券数	4,524.1240
期中発行投資証券数	0.0000
期中買戻投資証券数	(1,367.0170)
期末現在発行済投資証券数	3,157.1070

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1月3日	2017年1月6日	米ドル	0.00
Q - d i s t	2017年1月3日	2017年1月6日	米ドル	0.88

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	2016年11月10日	2016年11月15日	米ドル	0.03
P - 4 % - m d i s t	2016年12月12日	2016年12月15日	米ドル	0.03
P - 4 % - m d i s t	2017年1月10日	2017年1月13日	米ドル	0.03
P - 4 % - m d i s t	2017年2月10日	2017年2月15日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2017年3月10日	2017年3月15日	米ドル	0.04
P - 4 % - m d i s t	2017年4月10日	2017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	2016年11月10日	2016年11月15日	シンガポール・ドル	0.03
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2016年12月12日	2016年12月15日	シンガポール・ドル	0.03
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2017年1月10日	2017年1月13日	シンガポール・ドル	0.03
(シンガポールドル・ヘッジ) P - 4 % - m d i s t	2017年2月10日	2017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	2017年3月10日	2017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	2017年4月10日	2017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。

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

最重要数値

	ISIN	2017年4月30日	2016年10月31日	2015年10月31日
純資産額 (米ドル)		282 709 651.20	267 815 406.45	243 753 477.85
クラス P - 4 % - m d i s t ¹	LU1336973653			
発行済投資証券数 (口)		2 415 531.2290	2 190 567.3830	-
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		10.76	10.37	-
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		10.76	10.37	-
クラス (シンガポールドル・ヘッジ)				
P - 4 % - m d i s t ¹	LU1336973570			
発行済投資証券数 (口)		844 895.6130	587 192.7080	-
1 口当たり純資産価格 (シンガポール・ドル)		10.74	10.38	-
1 口当たり発行・買戻価格 (シンガポール・ドル) ²		10.74	10.38	-
クラス P - a c c	LU0200191152			
発行済投資証券数 (口)		12 148 207.3110	13 519 373.1740	15 488 643.4800
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		15.01	14.19	14.10
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		15.01	14.19	14.10
クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c	LU1152097959			
発行済投資証券数 (口)		545 437.2790	348 761.0000	208 919.0000
1 口当たり純資産価格 (日本円)		10 238.00	9 738.00	9 732.00
1 口当たり発行・買戻価格 (日本円) ²		10 238.00	9 738.00	9 732.00
クラス P - d i s t	LU0234745577			
発行済投資証券数 (口)		657 199.2280	651 645.5940	669 818.0370
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		13.57	12.84	12.79
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		13.57	12.84	12.79
クラス Q - a c c	LU1240802741			
発行済投資証券数 (口)		77 108.1280	73 020.5110	100.0000
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		111.33	104.84	103.14
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		111.33	104.84	103.14
クラス Q - d i s t	LU1240802824			
発行済投資証券数 (口)		3 157.1070	4 524.1240	100.0000
1 口当たり純資産価格 (米ドル)		109.00	103.51	103.14
1 口当たり発行・買戻価格 (米ドル) ²		109.00	103.51	103.14

¹ 初回純資産価格計算日：2016年1月29日² 注記1を参照

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)

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	89.76	投資信託、オープン・エンド型	58.81
ユーロ	5.82	投資信託証券	14.33
日本円	0.56	財務省証券(T-note)、固定利付債	9.86
英ポンド	0.44	無記名株式	6.18
カナダドル	0.22	財務省証券(T-note)、変動利付債	3.95
スイスフラン	0.22	ノート、固定利付債	2.08
豪ドル	0.18	債券、固定利付債	1.18
香港ドル	0.09	中期債券、固定利付債	0.61
スウェーデン・クローナ	0.07	記名株式	0.37
デンマーク・クローネ	0.04	その他の株式	0.05
シンガポール・ドル	0.03	優先株式	0.02
ノルウェー・クローネ	0.02	預託証券	0.01
イスラエル・シェケル	0.01	投資信託、クローズド・エンド型	0.01
合計	97.46	合計	97.46

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

2017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2017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、2017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 = 1.083995 スイスフラン

1 ユーロ = 1.088950 米ドル

償還または合併したサブ・ファンドに関する連結財務書類の換算に使用された為替レートは、償還日または合併日現在のものである。

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

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・リアルエスレート・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。

その他のUCIsおよびUCITSに関しては、サブ・ファンドまたは投資証券クラスおよび本投資法人の段階で支払う報酬合計(ターゲット・ファンドで発生した実績報酬を除く。)は、投資証券クラスのそれぞれの定率報酬よりも最大で3%(3.000%)多い額とし、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・リアルエスレート・ファンズに関しては、投資証券クラスのそれぞれの定率報酬よりも最大で4.5%(4.500%)多い額とする。

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

注3 - 年次税

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

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

注4 - 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 - 金融先物およびスワップ契約

2017年4月30日現在の個々のサブ・ファンドおよび各通貨の金融先物およびスワップに係る契約債務は、以下のように要約できる。

a) 金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ	指数関連金融先物	
	(購入)	(売却)
- バランスド (米ドル)	17 699 457.73 米ドル	4 806 094.54 米ドル

b) スワップ

UBS (Lux) ストラテジー・エクストラ・シキャブ	クレジット・デフォルト・スワップ	
	(購入)	(売却)
- バランスド (米ドル)	- 米ドル	2 583 693.33 米ドル

注7 - ソフト・コミッション取決め

2016年11月1日から2017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	2.13%

- 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	2.13%
- バランスド(米ドル) P - a c c	2.11%
- バランスド(米ドル)(日本円・ヘッジ) P - a c c	2.12%
- 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	1.19%
- バランスド(米ドル) Q - d i s t	1.19%

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
PTBESOAM0007	BCO ESPIRITO SANTO EUR

注10 - 合併

以下の合併が生じた。

サブ・ファンド	合併先	日付
UBS (Lux) ストラテジー ・エクストラ・シキャブ - フィクスト・インカム(スイスフラン)	UBS (Lux) ストラテジー ・エクストラ・シキャブ - イールド(スイスフラン)	2017年4月10日
UBS (Lux) ストラテジー ・エクストラ・シキャブ - グロース(ユーロ)	UBS (Lux) ストラテジー ・エクストラ・シキャブ - バランスド(ユーロ)	2017年1月11日

注11 - 適用法、業務地および公認言語

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

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

注12 - 証券貸付

本投資法人は、第三者に本投資法人の組入証券の一部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。

UBS (Lux) ストラテジー ・エクストラ・シキャブ	2017年4月30日現在		2017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)	44 228 364.45	47 440 027.51	21.89	78.11	0.00
	米ドル	米ドル			

(2) 【投資有価証券明細表等】

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

2017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	7 304.55	0.00
AUD AMCOR LIMITED NPV	553.00	6 497.04	0.00
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	675.00	2 705.72	0.00
AUD APA GROUP NPV	1 494.00	10 234.35	0.01
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	1 478.00	36 210.36	0.01
AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	558.00	5 141.14	0.00
AUD BHP BILLITON LTD NPV	1 632.00	28 950.05	0.01
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	504.00	4 511.69	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 664.00	12 867.33	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	178.00	3 976.21	0.00
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	408.00	4 033.72	0.00
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	80.00	2 215.43	0.00
AUD CMNWLT BK OF AUST NPV	848.00	55 427.05	0.02
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	394.00	2 760.90	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	45.00	4 707.42	0.00
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	382.00	4 210.90	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	255.00	2 383.77	0.00
AUD CSL NPV	230.00	22 799.33	0.01
AUD DEXUS PROPERTY GP NPV (STAPLED)	1 386.00	10 572.51	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	71.00	1 669.91	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	772.00	3 065.68	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 748.00	10 601.73	0.01
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 093.00	3 097.95	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	2 370.00	11 006.63	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	89.00	1 066.94	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	179.00	12 449.46	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	1 338.00	34 021.19	0.01
AUD NEWCREST MINING NPV	419.00	6 630.47	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	444.00	6 152.80	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	872.00	4 682.26	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	1 114.00	3 532.36	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	748.00	7 199.37	0.00
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	97.00	5 201.22	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	191.00	8 633.21	0.00
AUD SANTOS LIMITED NPV	788.00	2 050.78	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	3 381.00	10 897.75	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	336.00	4 281.77	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	313.00	5 170.76	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	2 437.00	5 066.58	0.00
GBP SOUTH32 LTD NPV	1 554.00	3 241.92	0.00
AUD SUNCORP GROUP	701.00	7 234.55	0.00
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	184.00	948.09	0.00
AUD TELSTRA CORP NPV	2 356.00	7 435.36	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	1 398.00	12 755.03	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 (%)
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	468.00	4 199.93	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	540.00	17 365.08	0.01
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	1 176.00	7 985.60	0.00
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	1 679.00	44 022.74	0.02
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	381.00	9 169.07	0.00
AUD WOOLWORTHS LTD NPV	638.00	12 825.21	0.01
オーストラリア合計		501 170.87	0.18
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	68.00	3 759.45	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	158.00	5 646.82	0.00
EUR OMV AG NPV(VAR)	113.00	5 202.00	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	65.00	2 714.84	0.01
オーストリア合計		17 323.11	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	23.00	941.72	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	408.00	45 939.75	0.03
EUR COLRUYT SA NPV	66.00	3 388.34	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	131.00	9 455.00	0.00
EUR PROXIMUS SA NPV	41.00	1 253.92	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	30.00	3 814.05	0.00
EUR TELENET GRP HLDG NPV	62.00	3 764.63	0.00
EUR UCB NPV	65.00	5 065.14	0.00
EUR UMICORE NPV	80.00	4 682.49	0.00
ベルギー合計		78 305.04	0.03
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	77.00	7 466.69	0.00
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	100.00	6 590.00	0.00
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	300.00	4 506.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	54.00	7 677.18	0.00
USD SIGNET JEWELERS LT ORD USD0.18	26.00	1 711.84	0.00
USD XL GROUP LTD COM USD0.01	125.00	5 231.25	0.01
バミューダ合計		33 182.96	0.01
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	135.00	6 442.44	0.00
CAD AGRUM INC COM NPV	76.00	7 121.42	0.00
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	216.00	9 917.71	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	100.00	2 237.26	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	149.00	1 952.81	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	324.00	22 904.88	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 （％）
CAD	BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	615.00	34 130.18	0.01
CAD	BARRICK GOLD CORP COM NPV	662.00	11 048.67	0.01
CAD	BCE INC COM NEW	41.00	1 863.64	0.00
CAD	BLACKBERRY LTD NPV	200.00	1 864.99	0.00
CAD	BOMBARDIER INC CLASS ' B ' SUB-VTG NPV	900.00	1 388.87	0.00
CAD	BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL ' A '	430.00	15 869.09	0.01
CAD	CAE INC COM	277.00	4 223.98	0.00
CAD	CAMECO CORP COM	182.00	1 742.40	0.00
CAD	CAN PACIFIC RYS COM NPV	75.00	11 472.98	0.01
CAD	CANADIAN NAT RES LTD COM	601.00	19 111.74	0.01
CAD	CANADIAN NATL RY CO COM	397.00	28 649.16	0.01
CAD	CANADIAN UTILS LTD CL A	109.00	3 136.95	0.00
CAD	CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	190.00	15 320.34	0.01
CAD	CENOVUS ENERGY INC COM NPV	489.00	4 867.47	0.00
CAD	CGI GROUP INC ' A ' SUB-VTG NPV	178.00	8 576.49	0.00
CAD	CI FINANCIAL CORP COM NPV	191.00	3 729.76	0.00
CAD	CRESCENT POINT EN COM NPV	214.00	2 114.49	0.00
CAD	DOLLARAMA INC COM NPV	100.00	8 739.85	0.00
CAD	ELDORADO GOLD CORP NEW COM	300.00	1 094.86	0.00
CAD	ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	200.00	1 753.82	0.00
CAD	ENBRIDGE INC COM	481.00	19 904.18	0.01
USD	ENBRIDGE INC COM NPV	356.00	14 756.20	0.01
CAD	ENCANA CORP COM NPV	573.00	6 122.67	0.00
CAD	FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	25.00	11 409.35	0.01
CAD	FINNING INTL INC COM NEW	203.00	3 854.22	0.00
CAD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	447.00	4 253.25	0.00
CAD	FORTIS INC COM NPV	167.00	5 425.39	0.00
CAD	FRANCO NEVADA CORP COM NPV	75.00	5 092.52	0.00
CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	200.00	5 597.89	0.00
CAD	GOLDCORP INC COM NPV	557.00	7 748.22	0.00
CAD	GREAT WEST LIFECO INC COM	162.00	4 350.65	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	204.00	2 351.38	0.00
CAD	IGM FINANCIAL INC COM	124.00	3 719.18	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	187.00	5 430.97	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	60.00	4 103.42	0.00
CAD	INTER PIPELINE LTD COM NPV	200.00	4 067.87	0.00
SEK	INTERNATIONAL PETROLEUM CORP/SWEDEN	50.67	184.24	0.00
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NPV	500.00	1 737.00	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	154.00	8 628.64	0.00
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	28.00	1 456.00	0.00
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	223.00	9 299.69	0.00
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	1 059.00	18 541.99	0.01
CAD	METHANEX CORP COM	100.00	4 587.87	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	109.00	3 729.26	0.00
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	157.00	6 091.46	0.00
CAD	OPEN TEXT CORP COM	200.00	6 923.13	0.00
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	241.00	7 667.30	0.00
CAD	POTASH CORP SASK INC COM	617.00	10 387.87	0.01
CAD	POWER CORP CDA COM	140.00	3 238.65	0.00
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	163.00	4 135.50	0.00
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	88.00	4 942.96	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS ' B ' COM CAD1.62478	163.00	7 461.54	0.00
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	763.00	52 159.45	0.02
CAD	SAPUTO INC COM	200.00	6 564.76	0.00
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	401.00	8 487.49	0.00
CAD	SILVER WHEATON COR COM NPV	200.00	3 984.49	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	100.00	4 015.21	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 SUN LIFE FINL INC COM	309.00	10 895.11	0.01
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	873.00	27 314.37	0.01
CAD TECK RESOURCES LTD CLASS 'B' SUB-VTG COM NPV	495.00	10 252.61	0.01
CAD TORONTO-DOMINION COM NPV	947.00	44 486.07	0.02
CAD TRANSCANADA CORP COM NPV	445.00	20 627.59	0.01
CAD VERMILION ENERGY I COM NPV	100.00	3 514.96	0.00
CAD YAMANA GOLD INC COM	400.00	1 073.65	0.00
カナダ合計		631 852.47	0.22
デンマーク			
DKK A.P.MOELLER-MAERSK SER 'B' DKK1000	5.00	8 645.93	0.00
DKK A.P.MOLLER-MAERSK 'A' DKK1000	4.00	6 635.63	0.00
DKK CARLSBERG SER 'B' DKK20	60.00	5 987.00	0.00
DKK CHR.HANSEN HLDG DKK10	30.00	2 021.44	0.00
DKK COLOPLAST DKK1 B	67.00	5 733.92	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	335.00	12 164.34	0.01
DKK DSV DKK1	143.00	7 964.68	0.00
DKK ISS A/S DKK1	49.00	2 031.80	0.00
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER 'B'	985.00	38 319.50	0.02
DKK NOVOZYMES A/S SER 'B' DKK2 (POST CONS)	93.00	4 016.96	0.00
DKK PANDORA A/S DKK1	77.00	8 320.30	0.00
DKK TDC A/S DKK1	305.00	1 636.69	0.00
DKK TRYG A/S DKK5	195.00	3 740.23	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK1	138.00	11 880.87	0.01
DKK WILLIAM DEMANT HOL DKK0.20	127.00	2 906.40	0.00
デンマーク合計		122 005.69	0.04
フィンランド			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	138.00	4 699.10	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	221.00	3 215.19	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	134.00	6 137.37	0.00
EUR METSO OYJ NPV	83.00	2 976.31	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	67.00	2 735.26	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	3 051.00	17 442.53	0.01
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	88.00	3 785.19	0.00
EUR SAMPO OYJ SER 'A' NPV	198.00	9 484.78	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER 'R'	505.00	6 005.12	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	307.00	8 100.27	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER 'B' EUR3.50	110.00	6 695.95	0.00
フィンランド合計		71 277.07	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 (%)
フランス			
EUR ACCOR EUR3	102.00	4 647.85	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L ') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	205.00	24 689.76	0.01
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	297.00	24 007.33	0.01
EUR ALSTOM EUR7.00	143.00	4 539.23	0.00
EUR ARKEMA EUR10	41.00	4 340.13	0.00
EUR ATOS SE EUR1	74.00	9 694.05	0.00
EUR AXA EUR2.29	991.00	26 449.95	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	554.00	39 080.37	0.02
EUR BOUYGUES EUR1	96.00	4 034.69	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	217.00	5 024.97	0.00
EUR CAP GEMINI EUR8	99.00	9 907.38	0.00
EUR CARREFOUR EUR2.50	259.00	6 099.08	0.00
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	46.00	2 770.07	0.00
EUR CHRISTIAN DIOR EUR2	20.00	5 487.22	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	233.00	12 572.09	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	607.00	9 022.55	0.00
EUR DANONE EURO.25	287.00	20 058.09	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	82.00	7 315.85	0.00
EUR EDENRED EUR2	144.00	3 685.79	0.00
EUR EDF EURO.5	152.00	1 268.88	0.00
EUR ENGIE EUR1	1 121.00	15 808.23	0.01
EUR ESSILOR INTL EURO.18	111.00	14 377.90	0.01
EUR EURAZEO NPV	29.00	1 965.51	0.00
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	91.00	2 153.32	0.00
EUR GPE EUROTUNNEL SE EURO.40	333.00	3 657.03	0.00
EUR HERMES INTL NPV	13.00	6 217.47	0.00
EUR ILIAD NPV	21.00	5 097.27	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	13.00	1 177.53	0.00
EUR KERING EUR4	52.00	16 112.76	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	53.00	2 080.03	0.00
EUR L ' OREAL EURO.20	156.00	31 061.86	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	121.00	7 830.67	0.00
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	143.00	35 270.55	0.01
EUR NATIXIS EUR1.6	621.00	4 319.14	0.00
EUR ORANGE EUR4	1 058.00	16 359.95	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	157.00	19 635.35	0.01
EUR PEUGEOT SA EUR1	181.00	3 791.22	0.00
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	70.00	5 051.53	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	114.00	10 627.65	0.01
EUR REXEL EUR5	156.00	2 785.97	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	149.00	12 334.51	0.01
EUR SANOFI EUR2	601.00	56 682.69	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	275.00	21 710.94	0.01
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	91.00	3 599.11	0.00
EUR SOC GENERALE EUR1.25	399.00	21 815.80	0.01
EUR SODEXO EUR4	57.00	7 243.59	0.00
EUR SUEZ EUR4	204.00	3 351.07	0.00
EUR THALES EUR3	32.00	3 363.37	0.00
EUR TOTAL EUR2.5	1 157.00	59 430.20	0.02
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	44.00	10 802.17	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	112.00	8 049.52	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	228.00	4 330.01	0.00
EUR VINCI EUR2.50	243.00	20 666.42	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	533.00	10 572.18	0.00
EUR WENDEL EUR4	62.00	8 685.79	0.00
EUR ZODIAC AEROSPACE	185.00	4 490.45	0.00
フランス合計		687 204.09	0.24

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 (%)
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	146.00	13 935.18	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	60.00	5 967.88	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	629.00	6 161.13	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	43.00	9 622.51	0.00
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	193.00	6 597.15	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	97.00	8 603.41	0.00
EUR FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV	196.00	15 881.64	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	89.00	3 783.62	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	62.00	5 738.77	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	107.00	12 484.87	0.01
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	31.00	2 357.28	0.00
EUR LANXESS AG NPV	56.00	4 043.05	0.00
EUR LINDE AG NPV	93.00	16 704.87	0.01
EUR MAN SE ORD NPV	30.00	3 150.55	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	91.00	10 682.38	0.01
EUR METRO AG ORD NPV	89.00	2 927.85	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	240.00	3 973.80	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	507.00	50 831.63	0.02
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	47.00	3 289.38	0.00
EUR TELEFONICA DEUTSCH NPV	1 240.00	6 008.83	0.00
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	372.00	8 853.23	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	24.00	3 866.64	0.00
ドイツ合計		205 465.65	0.07
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	6 600.00	45 696.91	0.02
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	2 000.00	8 228.81	0.00
HKD CHEUNG KONG INFSTR HKD1	1 000.00	8 762.40	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	1 368.00	17 087.80	0.01
HKD CK PROPERTY LTD HKD1	1 368.00	9 814.71	0.00
HKD CLP HOLDINGS HKD5	1 000.00	10 549.59	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	2 000.00	11 134.61	0.01
HKD HANG LUNG PROP HKD1	4 000.00	10 491.74	0.01
HKD HANG SENG BANK HKD5	500.00	10 138.15	0.00
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 218.00	7 720.61	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	555.00	13 672.43	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	100.00	771.00	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 (%)
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	4 272.00	8 535.71	0.00
HKD LI & FUNG HKD0.0125	8 000.00	3 353.24	0.00
HKD MTR CORP HKD1	1 543.00	8 887.94	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	5 147.00	6 412.61	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 000.00	9 000.26	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	2 535.00	4 295.86	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	1 047.00	15 709.95	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	4 815.14	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1 500.00	10 790.67	0.01
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	8 543.82	0.00
HKD WHEELLOCK & COMPANY HKD0.50	1 000.00	7 798.09	0.00
香港合計		242 212.05	0.09
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	325.00	39 422.50	0.02
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	100.00	5 825.00	0.00
EUR CRH ORD EURO.32	484.00	17 643.06	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	227.00	17 170.28	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	583.00	12 513.11	0.01
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	113.00	10 028.75	0.00
EUR KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST	109.00	8 904.54	0.00
USD MALLINCKRODT PLC USD0.20	100.00	4 692.00	0.00
EUR PADDY POWER BETFAI ORD EURO.09	29.00	3 230.59	0.00
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	147.00	9 482.97	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	200.00	8 426.00	0.00
GBP SHIRE ORD GBPO.05	464.00	27 235.61	0.01
アイルランド合計		164 574.41	0.06
イスラエル			
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	720.00	4 497.33	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	833.00	1 402.62	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 477.00	6 916.26	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	56.00	5 824.56	0.00
ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1	439.00	1 898.02	0.00
イスラエル合計		20 538.79	0.00
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	717.00	11 344.69	0.00
EUR ATLANTIA SPA EUR1	148.00	3 751.91	0.00
EUR ENEL EUR1	3 935.00	18 699.82	0.01
EUR ENI SPA EUR1	1 350.00	20 978.07	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	80.00	6 015.36	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	6 852.00	19 952.01	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	324.00	5 091.19	0.00
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	108.00	6 256.67	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	449.00	4 314.89	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	102.00	2 944.54	0.00
EUR SAIPEM EUR1	3 243.00	1 397.05	0.00
EUR SNAM EUR1	1 683.00	7 437.10	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55	7 324.00	5 227.92	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	5 164.00	4 583.02	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	951.00	4 794.79	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	1 534.00	24 956.51	0.02
イタリア合計		147 745.54	0.05

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 (%)
日本			
JPY イオン	300.00	4 450.08	0.00
JPY イオンモール	110.00	1 868.04	0.00
JPY アイシン精機	100.00	4 889.21	0.00
JPY 味の素	200.00	3 891.63	0.00
JPY アルフレッサ ホールディングス	100.00	1 804.07	0.00
JPY アルプス電気	100.00	2 938.01	0.00
JPY A N A ホールディングス	1 000.00	3 009.78	0.00
JPY 旭硝子	1 000.00	8 666.01	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	300.00	11 316.95	0.01
JPY 旭化成	1 000.00	9 531.71	0.01
JPY アステラス製薬	1 200.00	15 803.36	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	200.00	6 270.75	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	3 018.75	0.00
JPY ブリヂストン	300.00	12 509.20	0.01
JPY カルビー	100.00	3 489.73	0.00
JPY キヤノン	500.00	16 578.45	0.01
JPY 東海旅客鉄道	100.00	16 762.36	0.01
JPY 中部電力	400.00	5 373.64	0.00
JPY 中外製薬	200.00	7 087.11	0.00
JPY 中国銀行	100.00	1 483.81	0.00
JPY 中国電力	400.00	4 359.92	0.00
JPY クレディセゾン	100.00	1 820.22	0.00
JPY 大日本印刷	1 000.00	11 124.07	0.01
JPY 第一生命ホールディングス	600.00	10 205.44	0.00
JPY 第一三共	300.00	6 655.60	0.00
JPY ダイキン工業	200.00	19 422.27	0.01
JPY 大和ハウス工業	300.00	8 910.92	0.00
JPY 大和証券グループ本社	1 000.00	6 076.07	0.00
JPY デンソー	300.00	12 915.58	0.01
JPY 電通	100.00	5 633.80	0.00
JPY ドンキホーテホールディングス	200.00	7 293.44	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	200.00	17 859.51	0.01
JPY エーザイ	100.00	5 249.84	0.00
JPY ユニー・ファミリーマートホールディングス	100.00	5 651.74	0.00
JPY ファナック	100.00	20 323.85	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	200.00	7 417.24	0.00
JPY 富士通	1 000.00	6 233.07	0.00
JPY 博報堂D Yホールディングス	300.00	3 652.10	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 阪急阪神ホールディングス	200.00	6 602.67	0.00
JPY 日野自動車	400.00	5 013.01	0.00
JPY 久光製薬	100.00	5 113.48	0.00
JPY 日立化成	100.00	2 861.76	0.00
JPY 日立建機	100.00	2 575.58	0.00
JPY 日立製作所	2 000.00	11 036.15	0.01
JPY 北陸電力	100.00	924.02	0.00
JPY 本田技研工業	800.00	23 195.48	0.01
JPY H O Y A	200.00	9 552.35	0.01
JPY ヒューリック	200.00	1 883.91	0.00
JPY 国際石油開発帝石	800.00	7 668.43	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	6 782.09	0.00
JPY 伊藤忠商事	800.00	11 310.67	0.01
JPY 日本取引所グループ	300.00	4 201.13	0.00
JPY ゆうちょ銀行	200.00	2 488.56	0.00
JPY 日本郵政	200.00	2 477.80	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	2.00	3 907.78	0.00
JPY 日本たばこ産業	600.00	19 947.97	0.01
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	200.00	3 409.89	0.00
JPY J S R	200.00	3 653.00	0.00
JPY ジェイテクト	100.00	1 573.52	0.00
JPY J X T Gホールディングス	1 000.00	4 513.32	0.00
JPY カカクコム	200.00	2 883.29	0.00
JPY 関西電力	400.00	5 407.73	0.00
JPY 関西ペイント	100.00	2 214.05	0.00
JPY 花王	300.00	16 546.16	0.01
JPY K D D I	1 000.00	26 513.86	0.01
JPY キリンホールディングス	600.00	11 658.74	0.01
JPY 小糸製作所	200.00	10 316.68	0.00
JPY 小松製作所	600.00	15 997.13	0.01
JPY コナミホールディングス	100.00	4 158.07	0.00
JPY コニカミノルタ	500.00	4 418.23	0.00
JPY クボタ	600.00	9 435.72	0.00
JPY クラレ	300.00	4 838.97	0.00
JPY 栗田工業	200.00	5 160.13	0.00
JPY 京セラ	200.00	11 321.43	0.01
JPY 九州電力	300.00	3 234.95	0.00
JPY LIXILグループ	200.00	4 993.27	0.00
JPY マキタ	200.00	7 131.96	0.00
JPY 丸紅	900.00	5 541.94	0.00
JPY マツダ	200.00	2 931.73	0.00
JPY メディバルホールディングス	200.00	3 308.51	0.00
JPY 明治ホールディングス	100.00	8 486.59	0.00
JPY 三菱ケミカルホールディングス	600.00	4 695.25	0.00
JPY 三菱商事	800.00	17 249.48	0.01
JPY 三菱電機	1 000.00	13 940.97	0.01
JPY 三菱地所	1 000.00	19 108.28	0.01
JPY 三菱重工業	2 000.00	8 002.15	0.00
JPY 三菱自動車工業	400.00	2 558.53	0.00
JPY 田辺三菱製薬	300.00	6 087.74	0.00
JPY 三菱U F J フィナンシャル・グループ	6 600.00	41 990.85	0.02
JPY 三井物産	900.00	12 700.28	0.01
JPY 商船三井	1 000.00	3 059.12	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	12 700.00	23 196.56	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	9 774.83	0.01
JPY 村田製作所	100.00	13 407.19	0.01
JPY ナブテスコ	100.00	2 834.84	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 日本電気	2 000.00	4 969.95	0.00
JPY 日本特殊陶業	100.00	2 162.91	0.00
JPY 日本電産	100.00	9 168.39	0.00
JPY ニコン	100.00	1 426.39	0.00
JPY 任天堂	100.00	25 159.24	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	1.00	5 319.82	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	100.00	3 835.11	0.00
JPY 日本プロロジスリート投資法人	1.00	2 114.47	0.00
JPY 新日鐵住金	447.00	10 067.23	0.01
JPY 日本電信電話	400.00	17 113.12	0.01
JPY 日本郵船	1 000.00	2 009.51	0.00
JPY 日産自動車	1 300.00	12 344.58	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	150.00	2 299.72	0.00
JPY 日清食品ホールディングス	100.00	5 723.51	0.00
JPY 日東電工	100.00	7 525.79	0.00
JPY N O K	100.00	2 378.22	0.00
JPY 野村ホールディングス	1 800.00	10 802.91	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	2.00	2 883.29	0.00
JPY 野村不動産ホールディングス	200.00	3 378.49	0.00
JPY 日本精工	300.00	4 090.79	0.00
JPY N T T ドコモ	700.00	16 879.88	0.01
JPY 大林組	400.00	3 879.07	0.00
JPY 小田急電鉄	200.00	3 879.07	0.00
JPY オリンパス	200.00	7 697.14	0.00
JPY オムロン	100.00	4 184.98	0.00
JPY 小野薬品工業	200.00	4 121.29	0.00
JPY オリエンタルランド	200.00	11 482.91	0.01
JPY オリックス	900.00	13 733.74	0.01
JPY 大阪瓦斯	1 000.00	3 743.61	0.00
JPY 大塚ホールディングス	200.00	9 198.89	0.01
JPY パナソニック	1 100.00	13 129.54	0.01
JPY バーク24	200.00	5 158.34	0.00
JPY 楽天	500.00	5 117.97	0.00
JPY りそなホールディングス	1 100.00	6 116.26	0.00
JPY リコー	300.00	2 497.53	0.00
JPY ローム	100.00	7 015.34	0.00
JPY S A N K Y O	100.00	3 485.24	0.00
JPY 参天製薬	200.00	2 811.52	0.00
JPY セコム	100.00	7 253.97	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 西武ホールディングス	100.00	1 745.76	0.00
JPY 積水化学工業	200.00	3 355.16	0.00
JPY 積水ハウス	300.00	4 977.57	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	400.00	16 901.41	0.01
JPY シマノ	100.00	15 277.65	0.01
JPY 信越化学工業	200.00	17 375.08	0.01
JPY 塩野義製薬	200.00	10 286.18	0.01
JPY 資生堂	200.00	5 411.32	0.00
JPY 静岡銀行	1 000.00	8 432.76	0.00
JPY 昭和シェル石油	300.00	2 898.54	0.00
JPY ソフトバンクグループ	500.00	37 866.69	0.01
JPY S O M P Oホールディングス	250.00	9 433.03	0.01
JPY ソニー	600.00	20 233.25	0.01
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 322.87	0.00
JPY スタンレー電気	200.00	5 849.11	0.00
JPY S U B A R U	300.00	11 335.79	0.01
JPY 住友化学	2 000.00	11 285.55	0.01
JPY 住友商事	600.00	8 012.02	0.00
JPY 住友電気工業	400.00	6 518.35	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	700.00	25 897.55	0.01
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	200.00	6 848.48	0.00
JPY 住友ゴム工業	200.00	3 595.59	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	8 944.11	0.00
JPY スルガ銀行	400.00	8 357.41	0.00
JPY スズキ	200.00	8 346.64	0.00
JPY シスメックス	100.00	6 082.35	0.00
JPY T & Dホールディングス	200.00	2 966.72	0.00
JPY 大成建設	1 000.00	7 625.37	0.00
JPY 武田薬品工業	400.00	19 169.28	0.01
JPY T D K	100.00	6 190.01	0.00
JPY テルモ	200.00	7 293.44	0.00
JPY T H K	200.00	5 151.16	0.00
JPY 東宝	100.00	2 866.24	0.00
JPY 東北電力	300.00	3 999.28	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	400.00	16 836.82	0.01
JPY 東京電力ホールディングス	600.00	2 330.67	0.00
JPY 東京エレクトロン	100.00	11 630.93	0.01
JPY 東京瓦斯	1 000.00	4 642.50	0.00
JPY 東京建物	100.00	1 364.49	0.00
JPY 東京急行電鉄	1 000.00	7 158.88	0.00
JPY 東急不動産ホールディングス	300.00	1 636.31	0.00
JPY 東レ	1 000.00	8 846.33	0.00
JPY 東芝	2 000.00	4 044.14	0.00
JPY T O T O	100.00	3 817.17	0.00
JPY 東洋製罐グループホールディングス	200.00	3 346.20	0.00
JPY 豊田合成	200.00	5 305.46	0.00
JPY 豊田自動織機	100.00	4 969.95	0.00
JPY トヨタ自動車	1 378.00	74 605.10	0.03
JPY 豊田通商	200.00	6 306.63	0.00
JPY ユニ・チャーム	300.00	7 289.41	0.00
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	4.00	6 046.47	0.00
JPY ユー・エス・エス	300.00	5 301.87	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	100.00	6 678.03	0.00
JPY ヤフー	700.00	2 995.43	0.00
JPY ヤクルト本社	100.00	5 687.63	0.00
JPY ヤマダ電機	600.00	3 148.83	0.00
JPY ヤマハ	200.00	5 544.09	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 ヤマハ発動機	100.00	2 369.25	0.00
JPY ヤマトホールディングス	200.00	4 321.34	0.00
JPY 安川電機	100.00	1 909.93	0.00
JPY 横河電機	100.00	1 543.91	0.00
日本合計		1 587 034.33	0.56
ジャージー			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	6 341.00	24 910.44	0.01
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	54.00	4 754.14	0.00
GBP WOLSELEY ORD GBP0.108030303(POST CON)	130.00	8 247.92	0.00
ジャージー合計		37 912.50	0.01
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG 'S'	2 000.00	9 077.41	0.00
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	1 600.00	3 517.82	0.00
マカオ合計		12 595.23	0.00
メキシコ			
GBP FRESNILLO PLC ORD USD0.50	96.00	1 803.38	0.00
メキシコ合計		1 803.38	0.00
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	1 323.00	6 740.95	0.00
USD AERCAP HOLDINGS NV	100.00	4 601.00	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	92.00	8 042.72	0.00
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	202.00	5 016.37	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	203.00	26 825.25	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	458.00	5 052.23	0.00
USD CORE LABORATORIES ORD EURO.01	49.00	5 430.18	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	64.00	3 592.66	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	511.00	5 781.55	0.00
EUR GEMALTO EUR1	49.00	2 743.70	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	64.00	5 360.07	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	113.00	10 071.75	0.01
EUR ING GROEP N.V.EURO.01	2 096.00	34 111.05	0.01
EUR KON KPN NV EURO.24	3 410.00	9 858.86	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	701.00	14 518.99	0.01
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.01	84.00	3 088.55	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	69.00	4 934.28	0.00
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	501.00	17 359.84	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 (%)
EUR NN GROUP N.V.EURO.12	122.00	4 044.01	0.00
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	108.00	11 421.00	0.01
EUR QIAGEN NV EURO.01	151.00	4 513.64	0.00
EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	65.00	3 872.47	0.00
EUR RELX NV EURO.07	491.00	9 493.15	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	1 982.00	52 630.46	0.02
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	2 355.00	61 011.80	0.02
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	100.00	4 118.00	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	170.00	7 217.89	0.00
オランダ合計		331 452.42	0.12
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	998.00	4 727.72	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	1 877.00	4 761.58	0.00
ニュージーランド合計		9 489.30	0.00
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	569.00	8 907.13	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	58.00	893.04	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	826.00	4 724.68	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	555.00	5 037.21	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	725.00	11 992.35	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	437.00	7 080.56	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	107.00	3 986.97	0.00
ノルウェー合計		42 621.94	0.02
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	613.00	3 309.88	0.00
パプアニューギニア合計		3 309.88	0.00
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	243.00	3 776.05	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	63.00	1 155.97	0.00
ポルトガル合計		4 932.02	0.00
シンガポール			
USD BROADCOM LIMITED COM NPV	205.00	45 266.05	0.02
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	200.00	1 543.97	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	879.00	12 169.03	0.01
USD FLEX LTD COM USD0.01	500.00	7 730.00	0.00
SGD GLOBAL LOGISTIC PR NPV	3 600.00	7 417.90	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	1 000.00	4 657.65	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	2 211.00	15 502.47	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	1 000.00	2 167.85	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	200.00	1 466.70	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 000.00	5 294.41	0.00
SGD SINGAPORE PRESS HD SGD0.20	2 300.00	5 710.10	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV(POST RE-ORG)	4 000.00	10 703.30	0.01
SGD SUNTEC REIT NPV (REIT)	5 000.00	6 331.83	0.00
SGD UTD O/S BANK SGD1	652.00	10 169.28	0.00
シンガポール合計		136 130.54	0.05
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	155.00	4 012.63	0.00
南アフリカ合計		4 012.63	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 (%)
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	290.38	5 106.73	0.00
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	119.00	4 409.78	0.00
EUR AENA SA EUR10	36.00	6 350.76	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	205.00	11 050.12	0.01
EUR BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)	3 033.00	2 126.99	0.00
EUR BANKIA S.A. EUR1	2 050.00	2 486.84	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	5 276.00	10 146.20	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	2 592.00	11 767.25	0.01
EUR DISTRIBUIDORA INTL EURO.01	276.00	1 642.51	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	167.00	4 391.79	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	167.00	3 934.43	0.00
EUR FERROVIAL SA EURO.2	222.00	4 722.53	0.00
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	252.00	5 696.86	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	174.00	4 671.57	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	2 384.00	17 139.17	0.01
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	505.00	19 362.67	0.01
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	547.00	3 965.88	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	332.00	6 471.41	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	721.00	11 411.91	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	2 250.00	24 881.15	0.01
スペイン合計		161 736.55	0.06
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	237.00	4 863.23	0.00
SEK ASSA ABLOY SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	465.00	10 077.42	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' A ' NPV (POST SPLIT)	322.00	12 043.91	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	153.00	5 090.32	0.00
USD AUTOLIV INC COM	47.00	4 708.93	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	136.00	3 888.87	0.00
SEK ELECTROLUX AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	32.00	950.81	0.00
SEK ERICSSON SER ' B ' NPV	1 665.00	10 736.72	0.00
SEK GETINGE AB SER ' B ' NPV	165.00	3 225.54	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER ' B ' NPV	432.00	10 703.89	0.00
SEK HEXAGON AB SER ' B ' NPV	51.00	2 221.47	0.00
SEK HUSQVARNA AB SER ' B ' NPV	379.00	3 768.68	0.00
SEK ICA GRUPPEN AB	62.00	2 117.36	0.00
SEK INDUSTRIVARDEN AB SER ' C ' NPV	146.00	3 396.58	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 (%)
SEK INVESTOR AB SER ' B ' NPV	149.00	6 813.27	0.00
SEK KINNEVIK INV AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	90.00	2 402.76	0.00
SEK LUNDIN PETROLEUM A NPV	152.00	2 902.74	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	1 854.00	22 822.20	0.01
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	619.00	9 940.57	0.01
SEK SECURITAS SER ' B ' NPV	224.00	3 703.48	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER ' A ' NPV	736.00	8 478.11	0.00
SEK SKANSKA AB SER ' B ' NPV	150.00	3 589.58	0.00
SEK SKF AB SER ' B ' NPV	377.00	8 285.25	0.00
SEK SVENSKA CELLULOSA SER ' B ' NPV	288.00	9 542.76	0.00
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER ' A ' NPV (P/S)	1 113.00	15 799.80	0.01
SEK SWEDBANK AB SER ' A ' NPV	492.00	11 662.69	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV	95.00	3 134.91	0.00
SEK TELE2 AB SHS	236.00	2 377.38	0.00
SEK VOLVO AB SER ' B ' NPV (POST SPLIT)	983.00	16 085.82	0.01
スウェーデン合計		205 335.05	0.07
スイス			
CHF ACTELION LTD CHF0.50 N 2ND LINE	50.00	14 151.89	0.01
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)(POST SUBD)	33.00	2 464.76	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	3.00	19 137.07	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	422.00	6 824.12	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	12.00	4 801.45	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	154.00	13 397.36	0.00
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	335.00	1 932.95	0.00
スイス合計		62 709.60	0.02
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	880.00	9 034.00	0.00
GBP ABERDEEN ASSET MGT ORD GBPO.10	572.00	2 064.67	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	120.00	3 122.08	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	730.00	10 450.20	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	137.00	1 485.30	0.00
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	131.00	15 699.04	0.01
GBP ASHTAD GROUP ORD GBPO.10	173.00	3 650.48	0.00
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	172.00	6 252.95	0.00
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	647.00	38 818.49	0.02
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01	484.00	2 511.58	0.00
GBP AVIVA ORD GBPO.25	2 539.00	17 228.95	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	1 795.00	14 560.70	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	8 673.00	23 815.92	0.01
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	1 077.00	8 074.58	0.00
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	1 089.00	16 554.50	0.01
GBP BP ORD USD0.25	9 659.00	55 296.27	0.02
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	951.00	64 163.08	0.02
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	616.00	5 231.98	0.00
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	4 227.00	16 665.80	0.01
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	182.00	5 669.94	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	166.00	3 466.27	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBPO.02066666	408.00	2 934.85	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	90.00	5 549.41	0.00
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	3 577.00	9 158.30	0.00
GBP COBHAM ORD GBPO.025	1 539.00	2 638.19	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.10625	912.00	18 382.84	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10357143	18.00	876.54	0.00
USD DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01	130.00	10 452.00	0.01
GBP DIAGEO ORD GBX28.935185	1 301.00	37 812.39	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 (%)
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	1 101.00	4 974.07	0.00
GBP DIXONS CARPHONE ORD GBP0.001	1 071.00	4 648.72	0.00
GBP G4S ORD GBP0.25	965.00	3 809.08	0.00
GBP GKN ORD GBP0.50	500.00	2 321.63	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	2 575.00	51 636.80	0.02
GBP HAMMERSON PLC REIT	568.00	4 317.24	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	10 483.00	86 324.56	0.03
USD IHS MARKIT LTD COM	209.00	9 070.60	0.00
GBP IMI ORD GBP0.2857	335.00	5 543.27	0.00
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	470.00	22 996.92	0.01
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.1896656535	89.00	4 716.29	0.00
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	73.00	3 840.08	0.00
GBP INVESTEC ORD GBP0.0002	587.00	4 340.16	0.00
GBP ITV ORD GBP0.10	1 450.00	3 939.47	0.00
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	127.00	4 894.68	0.00
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	633.00	2 795.06	0.00
GBP LAND SECURITIES GROUP PLC REIT	518.00	7 412.00	0.00
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	2 960.00	9 424.40	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	282.00	9 760.02	0.01
USD LIBERTY GLOBAL PLC LILAC SHS CL C USD	94.00	2 052.96	0.00
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBP0.25	32 320.00	28 935.29	0.01
GBP LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	147.00	6 433.83	0.00
GBP MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25	1 480.00	7 019.47	0.00
GBP MEGGITT ORD GBP0.05	435.00	2 602.87	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	100.00	3 733.00	0.00
GBP MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBP0.10	1 269.00	3 938.60	0.00
GBP NATIONAL GRID ORD GBP0.11395	1 869.00	24 180.19	0.01
GBP NEXT ORD GBP0.10	58.00	3 230.36	0.00
GBP OLD MUTUAL PLC ORD GBP0.114285714(POST CON)	2 181.00	5 474.04	0.00
GBP PEARSON ORD GBP0.25	434.00	3 587.91	0.00
GBP PERSIMMON ORD GBP0.10	117.00	3 526.89	0.00
GBP PROVIDENT FINL ORD GBX20.727272	176.00	7 295.51	0.00
GBP PRUDENTIAL ORD GBP0.05	1 298.00	28 816.57	0.01
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	307.00	28 243.56	0.01
GBP RELX PLC GBP0.1444	753.00	15 255.87	0.01
GBP RIO TINTO ORD GBP0.10	624.00	24 719.53	0.01
GBP ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	795.00	8 351.67	0.00
GBP ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	1 737.00	5 964.19	0.00
GBP ROYAL MAIL PLC ORD GBP0.01 (WI)	699.00	3 639.94	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 (%)
GBP RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	644.00	4 965.72	0.00
GBP SAGE GROUP GBP0.01051948	903.00	7 827.32	0.00
GBP SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	651.00	2 319.50	0.00
GBP SCHRODERS VTG SHS GBP1	138.00	5 689.99	0.00
GBP SEGRO PLC ORD GBP0.10	119.00	747.76	0.00
GBP SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	131.00	3 940.44	0.00
GBP SKY PLC ORD GBP0.50	604.00	7 751.74	0.00
GBP SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	736.00	12 092.94	0.01
GBP SMITHS GROUP ORD GBP0.375	100.00	2 121.75	0.00
GBP SSE PLC ORD GBP0.50	658.00	11 841.41	0.01
GBP ST JAMES ' S PLACE ORD GBP0.15	262.00	3 891.29	0.00
GBP STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	1 636.00	15 264.74	0.01
GBP STANDARD LIFE ORD GBP0.1222222	397.00	1 869.05	0.00
GBP TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	3 354.00	8 678.48	0.00
USD TECHNIPFMC LIMITED COM USD1	158.00	4 760.54	0.00
EUR TECHNIPFMC PLC COM USD1	124.00	3 726.82	0.00
GBP TESCO ORD GBP0.05	4 170.00	9 886.23	0.01
GBP TRAVIS PERKINS ORD GBP0.10	233.00	4 856.26	0.00
GBP UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	665.00	34 172.85	0.01
GBP UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	467.00	5 881.71	0.00
GBP VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	13 691.00	35 257.20	0.01
GBP WEIR GROUP ORD GBP0.125	107.00	2 756.17	0.00
GBP WHITBREAD ORD GBP0.76797385	44.00	2 296.92	0.00
GBP WILLIAM HILL ORD GBP0.10	675.00	2 563.09	0.00
USD WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	79.00	10 476.98	0.01
GBP WPP PLC ORD GBP0.10	684.00	14 627.81	0.01
イギリス合計		1 095 653.31	0.39

アメリカ合衆国

USD 3M CO COM	309.00	60 511.47	0.02
USD ABBOTT LABS COM	871.00	38 010.44	0.01
USD ABBVIE INC COM USD0.01	844.00	55 653.36	0.02
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	291.00	15 204.75	0.01
USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	269.00	35 976.06	0.01
USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM	52.00	7 391.28	0.00
USD AES CORP COM	400.00	4 524.00	0.00
USD AETNA INC COM USD0.01	180.00	24 312.60	0.01
USD AFFILIATED MNGRS COM USD0.01	33.00	5 464.47	0.00
USD AFLAC INC COM USD0.10	185.00	13 852.80	0.01
USD AGCO CORP COM USD0.01	14.00	895.86	0.00
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	162.00	8 918.10	0.00
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	200.00	4 214.00	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	101.00	14 190.50	0.02
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	60.00	3 656.40	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	10 891.00	0.01
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	120.00	15 333.60	0.01
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	206.00	50 235.16	0.02
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	29.00	7 239.27	0.00
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	200.00	7 864.00	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	176.00	14 307.04	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	208.00	4 118.40	0.00
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	163.00	147 671.48	0.05
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	155.00	143 300.60	0.05
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	1 013.00	72 713.14	0.03
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	210.00	194 247.90	0.07
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	248.00	16 821.84	0.01
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	383.00	30 352.75	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	AMER INTL GRP COM USD2.50	528.00	32 160.48	0.01
USD	AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	219.00	27 580.86	0.01
USD	AMEREN CORP COM	139.00	7 601.91	0.00
USD	AMERICAN AIRLINES COM USD1	100.00	4 262.00	0.00
USD	AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	107.00	8 534.32	0.00
USD	AMERIPRISE FINL INC COM	100.00	12 785.00	0.01
USD	AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	97.00	7 958.85	0.00
USD	AMETEK INC COM USD0.01	85.00	4 862.00	0.00
USD	AMGEN INC COM USD0.0001	391.00	63 858.12	0.02
USD	AMPHENOL CORP NEW CL A	127.00	9 183.37	0.00
USD	ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	287.00	16 364.74	0.01
USD	ANALOG DEVICES INC COM	149.00	11 353.80	0.01
USD	ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	400.00	4 724.00	0.00
USD	ANTHEM INC COM USD0.01	140.00	24 904.60	0.01
USD	APACHE CORP COM USD0.625	194.00	9 436.16	0.00
USD	APPLE INC COM NPV	2 795.00	401 501.75	0.14
USD	APPLIED MATLS INC COM	553.00	22 457.33	0.01
USD	ARAMARK COM USD0.01	105.00	3 834.60	0.00
USD	ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	294.00	13 450.50	0.01
USD	ARCONIC INC COM USD1.00	306.00	8 362.98	0.00
USD	ARROW ELECTRS INC COM	100.00	7 050.00	0.00
USD	ASHLAND GLOBAL HLD COM USD0.01	54.00	6 669.00	0.00
USD	ASSURANT INC COM	41.00	3 945.84	0.00
USD	AT&T INC COM USD1	3 207.00	127 093.41	0.05
USD	AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	239.00	24 973.11	0.01
USD	AUTODESK INC COM USD0.01	144.00	12 970.08	0.01
USD	AUTONATION INC COM	96.00	4 032.00	0.00
USD	AUTOZONE INC COM USD0.01	20.00	13 843.80	0.01
USD	AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	77.00	14 617.68	0.01
USD	AVERY DENNISON CORP COM	115.00	9 569.15	0.00
USD	AVNET INC COM	100.00	3 869.00	0.00
USD	AXALTA COATING SYS COM USD1.00	114.00	3 576.18	0.00
USD	BAKER HUGHES INC COM USD1	206.00	12 230.22	0.00
USD	BALL CORP COM	126.00	9 688.14	0.00
USD	BARD(CR)INC COM USD0.25	40.00	12 299.20	0.01
USD	BAXTER INTL INC COM USD1	218.00	12 138.24	0.01
USD	BB&T CORP COM USD5	391.00	16 883.38	0.01
USD	BECTON DICKINSON COM USD1	115.00	21 501.55	0.01
USD	BED BATH & BEYOND INC COM	49.00	1 898.75	0.00
USD	BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	6 798.00	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	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	617.00	101 934.57	0.04
USD	BEST BUY CO INC COM USD0.10	131.00	6 787.11	0.00
USD	BIOGEN INC COM STK USD0.0005	116.00	31 460.36	0.01
USD	BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	98.00	9 392.32	0.00
USD	BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	5 327.00	124 332.18	0.05
USD	BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	522.00	24 565.32	0.01
USD	BLACKROCK INC COM STK USD0.01	72.00	27 689.04	0.01
USD	BLOCK(H&R)INC COM NPV	31.00	768.49	0.00
USD	BOEING CO COM USD5	305.00	56 373.15	0.02
USD	BORG WARNER INC COM	70.00	2 959.60	0.00
USD	BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	60.00	7 596.00	0.00
USD	BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	691.00	18 228.58	0.01
USD	BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	870.00	48 763.50	0.02
USD	BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	377.00	7 445.75	0.00
USD	BROWN FORMAN CORP CL B	166.00	7 855.12	0.00
USD	BUNGE LIMITED COM USD0.01	68.00	5 374.04	0.00
USD	CA INC COM USD0.10	186.00	6 106.38	0.00
USD	CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	253.00	5 879.72	0.00
USD	CALPINE CORP COM STK USD0.001	196.00	1 999.20	0.00
USD	CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	137.00	7 882.98	0.00
USD	CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	250.00	20 095.00	0.01
USD	CARDINAL HEALTH INC COM	147.00	10 670.73	0.00
USD	CARMAX INC COM USD0.50	93.00	5 440.50	0.00
USD	CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	166.00	10 253.82	0.00
USD	CATERPILLAR INC DEL COM	294.00	30 064.44	0.01
USD	CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	133.00	4 762.73	0.00
USD	CBS CORP NEW CL B	206.00	13 711.36	0.01
USD	CDK GLOBAL INC COM USD0.01	91.00	5 915.91	0.00
USD	CDW CORP COM USD0.01	78.00	4 609.02	0.00
USD	CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	100.00	8 704.00	0.00
USD	CELGENE CORP COM USD0.01	406.00	50 364.30	0.02
USD	CENTENE CORP DEL COM	85.00	6 324.00	0.00
USD	CENTERPOINT ENERGY INC COM	256.00	7 303.68	0.00
USD	CENTURYLINK INC COM	362.00	9 292.54	0.00
USD	CERNER CORP COM	226.00	14 633.50	0.01
USD	CF INDS HLDGS INC COM	130.00	3 476.20	0.00
USD	CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	73.00	5 307.10	0.00
USD	CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	119.00	41 074.04	0.02
USD	CHENIERE ENERGY INC COM NEW	82.00	3 718.70	0.00
USD	CHEVRON CORP COM USD0.75	980.00	104 566.00	0.04
USD	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	16.00	7 591.52	0.00
USD	CHURCH & DWIGHT INC COM	102.00	5 052.06	0.00
USD	CIGNA CORP COM USD0.25	160.00	25 019.20	0.01
USD	CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01	59.00	6 884.12	0.00
USD	CINCINNATI FINL CORP COM	100.00	7 209.00	0.00
USD	CINTAS CORP COM	100.00	12 247.00	0.01
USD	CISCO SYSTEMS COM USD0.001	2 606.00	88 786.42	0.03
USD	CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	97.00	4 492.07	0.00
USD	CITIGROUP INC COM USD0.01	1 490.00	88 088.80	0.03
USD	CITIZENS FINL GP COM USD0.01	253.00	9 287.63	0.00
USD	CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	100.00	8 094.00	0.00
USD	CLOROX CO DEL COM	65.00	8 689.85	0.00
USD	CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	176.00	20 449.44	0.01
USD	CMS ENERGY CORP COM	132.00	5 992.80	0.00
USD	COACH INC COM USD0.01	119.00	4 687.41	0.00
USD	COCA-COLA CO COM USD0.25	2 107.00	90 917.05	0.03
USD	COGNIZANT TECHNOLO COM CL 'A' USD0.01	308.00	18 550.84	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 COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	424.00	30 544.96	0.01
USD COMCAST CORP COM CLS ' A ' USD0.01	2 527.00	99 033.13	0.05
USD COMERICA INC COM	57.00	4 029.90	0.00
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	208.00	8 066.24	0.00
USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001	85.00	10 766.10	0.00
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	638.00	30 566.58	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	146.00	11 574.88	0.01
USD CONSTELLATION BRDS CLASS ' A ' COM USD0.01	110.00	18 979.40	0.01
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	149.00	6 319.09	0.00
USD CORNING INC COM USD0.50	517.00	14 915.45	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	229.00	40 652.08	0.02
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	159.00	15 041.40	0.01
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	100.00	5 609.00	0.00
USD CSX CORP COM USD1	485.00	24 657.40	0.01
USD CUMMINS INC COM	80.00	12 075.20	0.01
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	548.00	45 177.12	0.02
USD D R HORTON INC COM	147.00	4 834.83	0.00
USD DANAHER CORP COM USD0.01	297.00	24 749.01	0.01
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	100.00	8 519.00	0.00
USD DAVITA INC COM USD0.001	78.00	5 382.78	0.00
USD DEERE & CO COM USD1	138.00	15 402.18	0.01
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V	116.00	7 784.76	0.00
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	86.00	3 907.84	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	100.00	6 324.00	0.00
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	240.00	9 477.60	0.00
USD DICKS SPORTING GOO COM USD0.01	100.00	5 055.00	0.00
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	88.00	10 105.92	0.00
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	198.00	12 392.82	0.01
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	100.00	2 878.00	0.00
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	104.00	2 909.92	0.00
USD DISH NETWORK CORPO CLASS ' A ' COM USD0.01	200.00	12 888.00	0.01
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	212.00	15 414.52	0.01
USD DOLLAR TREE INC	149.00	12 332.73	0.01
USD DOMINION RES(VIR) COM STK NPV	332.00	25 706.76	0.01
USD DOVER CORP COM	100.00	7 888.00	0.00
USD DOW CHEMICAL CO COM USD2.50	563.00	35 356.40	0.01
USD DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	96.00	8 798.40	0.00
USD DTE ENERGY CO COM	107.00	11 191.13	0.01
USD DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30	444.00	35 409.00	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 DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	357.00	29 452.50	0.01
USD DUKE REALTY CORP COM USD0.01	235.00	6 516.55	0.00
USD DXC TECHNOLOGY CO COM USD0.01	73.00	5 499.82	0.00
USD E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	152.00	5 251.60	0.00
USD EASTMAN CHEM CO COM	58.00	4 625.50	0.00
USD EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	4 293.00	0.00
USD EBAY INC COM USD0.001	578.00	19 310.98	0.01
USD ECOLAB INC COM	121.00	15 619.89	0.01
USD EDGEWELL PERSONAL COM USD0.01	59.00	4 217.91	0.00
USD EDISON INTL COM	163.00	13 035.11	0.01
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	109.00	11 954.03	0.01
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	155.00	14 697.10	0.01
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	519.00	42 589.14	0.02
USD EMERSON ELEC CO COM	314.00	18 927.92	0.01
USD ENTERGY CORP NEW COM	83.00	6 329.58	0.00
USD ENVISION HEALTHCAR COM USD0.01	100.00	5 603.00	0.00
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	304.00	28 120.00	0.01
USD EQT CORPORATION	100.00	5 814.00	0.00
USD EQUIFAX INC COM	100.00	13 531.00	0.01
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	57.00	23 808.90	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	173.00	11 172.34	0.01
USD ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001	40.00	9 778.80	0.00
USD ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01	103.00	8 975.42	0.00
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	132.00	7 840.80	0.00
USD EXELON CORP COM NPV	486.00	16 830.18	0.01
USD EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)	60.00	8 023.20	0.00
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	94.00	5 272.46	0.00
USD EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	324.00	19 874.16	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	74.00	5 589.22	0.00
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	2 161.00	176 445.65	0.06
USD F M C CORP COM NEW	43.00	3 148.89	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	37.00	4 777.81	0.00
USD FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL ' A '	1 208.00	181 502.00	0.07
USD FASTENAL CO COM	134.00	5 987.12	0.00
USD FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	34.00	4 450.26	0.00
USD FEDEX CORP COM USD0.10	135.00	25 609.50	0.01
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	189.00	7 739.55	0.00
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	147.00	12 375.93	0.01
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	380.00	9 283.40	0.00
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	100.00	9 246.00	0.00
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	182.00	5 449.08	0.00
USD FISERV INC COM USD0.01	109.00	12 986.26	0.01
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	55.00	7 762.70	0.00
USD FLIR SYS INC COM	118.00	4 334.14	0.00
USD FLOWSERVE CORP COM	67.00	3 408.29	0.00
USD FLUOR CORP NEW COM	100.00	5 132.00	0.00
USD FOOT LOCKER INC COM USD0.01	66.00	5 104.44	0.00
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	2 037.00	23 364.39	0.01
USD FORTIVE CORP COM USD0.01	168.00	10 627.68	0.01
USD FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	75.00	4 780.50	0.00
USD FRANKLIN RES INC COM	153.00	6 595.83	0.00
USD FREEPORT-MCMORAN COM STK USD0.10	618.00	7 879.50	0.00
USD FRONTIER COMMUNICA COM USD0.25	324.00	609.12	0.00
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	94.00	5 246.14	0.00
USD GAP INC DEL COM	40.00	1 048.00	0.00
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	138.00	26 743.02	0.01
USD GEN ELEC CO COM USD0.06	4 662.00	135 151.38	0.05

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 GENERAL MLS INC COM	283.00	16 275.33	0.01
USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	703.00	24 351.92	0.01
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	100.00	9 202.00	0.00
USD GGP INC COM USD0.01	230.00	4 970.30	0.00
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	677.00	46 408.35	0.02
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	80.00	6 540.80	0.00
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	189.00	42 298.20	0.02
USD GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	128.00	4 637.44	0.00
USD GRAINGER W W INC COM	28.00	5 395.60	0.00
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	434.00	19 911.92	0.01
USD HANESBRANDS INC COM	400.00	8 724.00	0.00
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	88.00	4 999.28	0.00
USD HARRIS CORP COM STK USD1	80.00	8 951.20	0.00
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	173.00	8 366.28	0.00
USD HASBRO INC COM	76.00	7 532.36	0.00
USD HCA HLDGS INC COM USD0.01	145.00	12 210.45	0.01
USD HCP INC COM USD1	221.00	6 928.35	0.00
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	100.00	6 064.00	0.00
USD HERSHEY CO COM	100.00	10 820.00	0.01
USD HESS CORPORATION COM USD1	145.00	7 080.35	0.00
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	860.00	16 021.80	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01	133.00	7 843.01	0.00
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	88.00	2 476.32	0.00
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	162.00	7 314.30	0.00
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	632.00	98 655.20	0.04
USD HONEYWELL INTL INC COM	366.00	47 997.24	0.02
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	226.00	7 928.08	0.00
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	374.00	6 713.30	0.00
USD HP INC COM USD0.01	914.00	17 201.48	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	79.00	17 536.42	0.01
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	8 966.00	0.00
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	757.00	9 735.02	0.00
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	161.00	22 232.49	0.01
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	66.00	12 200.76	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	100.00	12 428.00	0.01
USD INTEL CORP COM USD0.001	2 421.00	87 519.15	0.03
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	294.00	17 698.80	0.01
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	44.00	6 097.96	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	400.00	9 428.00	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 INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	473.00	75 817.17	0.03
USD INTL PAPER CO COM	167.00	9 012.99	0.00
USD INTUIT INC COM USD0.01	139.00	17 404.19	0.01
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	26.00	21 732.62	0.01
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	161.00	5 303.34	0.00
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	115.00	3 997.40	0.00
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	100.00	5 492.00	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	1 417.00	174 956.99	0.06
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	472.00	19 621.04	0.01
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	1 862.00	161 994.00	0.06
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	161.00	4 841.27	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	104.00	9 367.28	0.00
USD KELLOGG CO COM USD0.25	109.00	7 739.00	0.00
USD KEYCORP NEW COM	521.00	9 503.04	0.00
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	182.00	23 614.50	0.01
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	196.00	3 976.84	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	990.00	20 423.70	0.01
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	124.00	12 179.28	0.01
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	69.00	2 693.07	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	315.00	28 472.85	0.01
USD KROGER CO COM USD1	464.00	13 757.60	0.01
USD L BRANDS INC COM USD0.50	197.00	10 403.57	0.00
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	93.00	13 033.95	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	100.00	14 485.00	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	194.00	11 444.06	0.01
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	5 254.00	0.00
USD LENNAR CORP COM CL 'A' USD0.10	73.00	3 686.50	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	331.00	8 404.09	0.00
USD LEVEL 3 COMMUNICAT COM USD0.01(POST REV SPLIT)	200.00	12 152.00	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	112.00	3 967.04	0.00
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	220.00	4 659.60	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	55.00	2 095.50	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	225.00	8 547.75	0.00
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	119.00	7 845.67	0.00
USD LKQ CORP COM	222.00	6 935.28	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	139.00	37 453.55	0.01
USD LOEWS CORP COM	123.00	5 734.26	0.00
USD LOWE 'S COS INC COM USD0.50	439.00	37 262.32	0.01
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	169.00	14 324.44	0.01
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	113.00	17 561.33	0.01
USD MACERICH CO COM USD0.01	81.00	5 056.83	0.00
USD MACY 'S INC COM STK USD0.01	135.00	3 944.70	0.00
USD MANPOWER GROUP COM USD0.01	40.00	4 039.20	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	631.00	9 382.97	0.00
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	270.00	13 753.80	0.01
USD MARKEL CORP COM	10.00	9 696.00	0.00
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	164.00	15 484.88	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	240.00	17 791.20	0.01
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	35.00	7 706.65	0.00
USD MASCO CORP COM	242.00	8 958.84	0.00
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	507.00	58 974.24	0.02
USD MATTEL INC COM USD1	200.00	4 484.00	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	207.00	9 139.05	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	44.00	4 395.60	0.00
USD MCDONALD 'S CORP COM USD0.01	437.00	61 149.41	0.02
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	117.00	16 179.93	0.01
USD MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01	85.00	7 541.20	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 MEDNAX INC COM USD0.01	100.00	6 036.00	0.00
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	703.00	58 412.27	0.02
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	1 435.00	89 443.55	0.03
USD METLIFE INC COM USD0.01	471.00	24 402.51	0.01
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	594.00	18 241.74	0.01
USD MICROCHIP TECHNOLOGY COM USD0.001	105.00	7 935.90	0.00
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	672.00	18 594.24	0.01
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	3 853.00	263 776.38	0.09
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	26.00	6 104.54	0.00
USD MOLSON COORS BREW CO CLS 'B' COM NON-V USD0.01	100.00	9 589.00	0.00
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	798.00	35 933.94	0.01
USD MONSANTO COM STK USD0.01	222.00	25 887.42	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	156.00	7 079.28	0.00
USD MOODYS CORP COM USD0.01	88.00	10 412.16	0.00
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	723.00	31 356.51	0.01
USD MOSAIC CO COM USD0.01	155.00	4 174.15	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	65.00	5 588.05	0.00
USD MURPHY OIL CORP COM USD1	137.00	3 586.66	0.00
USD MYLAN NV EURO.01	236.00	8 814.60	0.00
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	35.00	2 410.45	0.00
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	126.00	4 406.22	0.00
USD NAVIENT CORP COM USD0.01	300.00	4 560.00	0.00
USD NETAPP INC COM USD0.001	126.00	5 021.10	0.00
USD NETFLIX INC COM USD0.001	221.00	33 636.20	0.01
USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	302.00	4 013.58	0.00
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	194.00	9 261.56	0.00
USD NEWMONT MINING CP COM USD1.60	225.00	7 607.25	0.00
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL 'A'	97.00	1 233.84	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	253.00	33 790.68	0.01
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	243.00	9 994.59	0.00
USD NIKE INC CLASS 'B' COM NPV	672.00	37 235.52	0.01
USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	338.00	10 927.54	0.00
USD NORDSTROM INC COM NPV	100.00	4 827.00	0.00
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	151.00	17 740.99	0.01
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	118.00	10 620.00	0.01
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	91.00	22 382.36	0.01
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	81.00	4 368.33	0.00
USD NUANCE COMMUNICAT COM USD0.001	325.00	5 814.25	0.00
USD NUCOR CORP COM	157.00	9 628.81	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 NVIDIA CORP COM USD0.001	278.00	28 995.40	0.01
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	385.00	23 692.90	0.01
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	138.00	4 799.64	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	103.00	8 458.36	0.00
USD ONEOK INC	116.00	6 102.76	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	1 614.00	72 565.44	0.03
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	72.00	17 866.80	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	155.00	10 343.15	0.00
USD PACKAGING CORP AMER COM	100.00	9 878.00	0.00
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	48.00	5 203.68	0.00
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	64.00	10 291.20	0.00
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	24.00	1 067.76	0.00
USD PAYCHEX INC COM	193.00	11 441.04	0.01
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	564.00	26 914.08	0.01
USD PEOPLE ' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	225.00	3 930.75	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	728.00	82 467.84	0.03
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	75.00	5 545.50	0.00
USD PFIZER INC COM USD0.05	3 168.00	107 458.56	0.04
USD PG&E CORP COM	273.00	18 304.65	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV ' WI '	801.00	88 782.84	0.03
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	229.00	18 219.24	0.01
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	100.00	8 509.00	0.00
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	93.00	16 088.07	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	254.00	30 416.50	0.01
USD POLARIS INDS INC COM	60.00	5 115.60	0.00
USD PPG INDS INC COM	120.00	13 180.80	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	269.00	10 251.59	0.00
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	133.00	16 622.34	0.01
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	26.00	48 017.32	0.02
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	145.00	9 443.85	0.00
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	1 312.00	114 576.96	0.04
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	266.00	10 565.52	0.00
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	253.00	13 765.73	0.01
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	226.00	24 188.78	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	84.00	17 587.92	0.01
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	239.00	10 527.95	0.00
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	185.00	4 193.95	0.00
USD PVH CORP COM USD1	93.00	9 395.79	0.00
USD QORVO INC COM USD 0.0001	100.00	6 803.00	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	753.00	40 466.22	0.02
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	45.00	4 747.95	0.00
USD QUINTILES IMS HOLD COM USD0.01	93.00	7 838.04	0.00
USD RALPH LAUREN CORP CLASS ' A ' COM USD0.01	38.00	3 067.36	0.00
USD RANGE RES CORP COM USD0.01	100.00	2 649.00	0.00
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	100.00	7 452.00	0.00
USD RAYTHEON CO COM NEW	154.00	23 902.34	0.01
USD REALTY INCOME CORP	127.00	7 410.45	0.00
USD RED HAT INC COM	101.00	8 896.08	0.00
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	105.00	6 633.90	0.00
USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM	67.00	26 028.83	0.01
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	400.00	5 500.00	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	100.00	6 299.00	0.00
USD RESMED INC COM USD0.004	100.00	6 799.00	0.00
USD REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001	439.00	28 315.50	0.01
USD RITE AID CORP COM	1 200.00	4 800.00	0.00
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	118.00	5 433.90	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	64.00	10 070.40	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	ROCKWELL COLLINS INC COM	103.00	10 721.27	0.01
USD	ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	57.00	12 465.90	0.01
USD	ROSS STORES INC COM USD0.01	193.00	12 545.00	0.01
USD	ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	88.00	9 380.80	0.00
USD	S&P GLOBAL INC COM USD1	170.00	22 812.30	0.01
USD	SABRE CORP COM USD0.01	300.00	7 023.00	0.00
USD	SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	333.00	28 677.96	0.01
USD	SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	123.00	15 558.27	0.01
USD	SCANA CORP NEW COM	100.00	6 631.00	0.00
USD	SCHEIN HENRY INC COM	44.00	7 647.20	0.00
USD	SCHLUMBERGER COM USD0.01	711.00	51 611.49	0.02
USD	SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	604.00	23 465.40	0.01
USD	SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	63.00	4 707.36	0.00
USD	SEALED AIR CORP NEW COM	149.00	6 558.98	0.00
USD	SEI INVESTMENT COM USD0.01	110.00	5 578.10	0.00
USD	SEMPRA ENERGY COM NPV	133.00	15 031.66	0.01
USD	SERVICENOW INC COM USD0.001	100.00	9 448.00	0.00
USD	SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	54.00	18 072.72	0.01
USD	SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	163.00	26 937.38	0.01
USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	94.00	9 375.56	0.00
USD	SMUCKER(JM)CO COM NPV	59.00	7 476.48	0.00
USD	SOUTHERN CO COM	513.00	25 547.40	0.01
USD	SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	81.00	4 553.82	0.00
USD	SPLUNK INC COM USD0.001	75.00	4 823.25	0.00
USD	SPRINT CORPORATION COM USD0.01	390.00	3 521.70	0.00
USD	STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	100.00	13 615.00	0.01
USD	STAPLES INC COM STK USD0.0006	565.00	5 520.05	0.00
USD	STARBUCKS CORP COM USD0.001	743.00	44 624.58	0.02
USD	STATE STREET CORP COM STK USD1	193.00	16 192.70	0.01
USD	STERICYCLE INC COM	52.00	4 437.68	0.00
USD	STHWESTN ENERGY CO COM USD0.01	188.00	1 411.88	0.00
USD	STRYKER CORP COM USD0.10	173.00	23 592.01	0.01
USD	SUNTRUST BKS INC COM	237.00	13 463.97	0.01
USD	SYMANTEC CORP COM	330.00	10 437.90	0.00
USD	SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	420.00	11 676.00	0.01
USD	SYNOPSIS INC COM USD0.01	94.00	6 927.80	0.00
USD	SYSCO CORP COM USD1	259.00	13 693.33	0.01
USD	T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	94.00	6 663.66	0.00
USD	T-MOBILE US INC COM USD0.0001	162.00	10 897.74	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	TARGET CORP COM STK USD0.0833	267.00	14 911.95	0.01
USD	TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	121.00	4 630.67	0.00
USD	TESLA MOTORS INC COM USD0.001	60.00	18 844.20	0.01
USD	TESORO CORP COM	73.00	5 818.83	0.00
USD	TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	493.00	39 035.74	0.01
USD	THERMO FISHER SCIE COM USD1	210.00	34 719.30	0.01
CAD	THOMSON-REUTERS CO COM NPV	144.00	6 532.82	0.00
USD	TIFFANY & CO NEW COM	61.00	5 590.65	0.00
USD	TIME WARNER INC COM USD0.01	401.00	39 807.27	0.02
USD	TJX COS INC COM USD1	309.00	24 299.76	0.01
USD	TOLL BROS INC COM USD0.01	142.00	5 110.58	0.00
USD	TORCHMARK CORP COM	105.00	8 054.55	0.00
USD	TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	148.00	8 481.88	0.00
USD	TRACTOR SUPPLY CO COM	100.00	6 191.00	0.00
USD	TRANSDIGM GROUP INC COM	40.00	9 869.20	0.00
USD	TRAVELERS CO INC COM NPV	139.00	16 910.74	0.01
USD	TRIMBLE INC COM NPV	127.00	4 499.61	0.00
USD	TRIPADVISOR INC COM USD0.001	46.00	2 070.46	0.00
USD	TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL ' A '	553.00	16 888.62	0.01
USD	TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL ' B '	208.00	6 210.88	0.00
USD	TWITTER INC COM USD0.000005	269.00	4 433.12	0.00
USD	TYSON FOODS INC CL A	147.00	9 446.22	0.00
USD	UDR INC	138.00	5 152.92	0.00
USD	ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	33.00	9 287.52	0.00
USD	UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	200.00	4 298.00	0.00
USD	UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.0003333 CL C	201.00	3 901.41	0.00
USD	UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	432.00	48 366.72	0.02
USD	UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	16.00	1 123.36	0.00
USD	UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	353.00	37 933.38	0.01
USD	UNITED RENTALS INC COM	46.00	5 044.36	0.00
USD	UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	492.00	86 040.96	0.03
USD	UNIVERSAL HEALTH S CLASS ' B ' COM USD0.01	64.00	7 728.64	0.00
USD	UNUM GROUP COM USD0.10	121.00	5 605.93	0.00
USD	US BANCORP COM USD0.01	868.00	44 511.04	0.02
USD	UTD TECHNOLOGIES COM USD1	402.00	47 833.98	0.02
USD	VALERO ENERGY CORP NEW COM	235.00	15 183.35	0.01
USD	VANTIV INC COM USD0.00001 A	99.00	6 141.96	0.00
USD	VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	100.00	9 074.00	0.00
USD	VENTAS INC COM USD0.25	170.00	10 881.70	0.01
USD	VEREIT INC COM USD0.001	718.00	6 009.66	0.00
USD	VERISIGN INC COM	100.00	8 892.00	0.00
USD	VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	69.00	5 713.89	0.00
USD	VERIZON COMMUN COM USD0.10	2 124.00	97 512.84	0.04
USD	VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	133.00	15 733.90	0.01
USD	VF CORP COM NPV	143.00	7 812.09	0.00
USD	VIACOM INC NEW CL ' B ' NON-VTG USD0.001	128.00	5 447.68	0.00
USD	VISA INC COM STK USD0.0001	981.00	89 486.82	0.03
USD	VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS ' A '	42.00	3 953.04	0.00
USD	VORNADO REALTY TR COM USD0.04	95.00	9 142.80	0.00
USD	VOYA FINL INC COM USD0.01	69.00	2 579.22	0.00
USD	VULCAN MATERIALS COM STK USD1	61.00	7 373.68	0.00
USD	WABTEC CORP COM	100.00	8 389.00	0.00
USD	WAL-MART STORES IN COM USD0.10	797.00	59 918.46	0.02
USD	WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	472.00	40 846.88	0.02
USD	WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	779.00	90 052.40	0.03
USD	WASTE MGMT INC DEL COM	209.00	15 211.02	0.01
USD	WATERS CORP COM	57.00	9 683.73	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 WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	173.00	10 469.96	0.00
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	2 478.00	133 415.52	0.05
USD WELLTOWER INC COM USD1	174.00	12 430.56	0.01
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	143.00	12 737.01	0.01
USD WESTERN UN CO COM	316.00	6 275.76	0.00
USD WESTROCK CO COM USD0.01	178.00	9 533.68	0.00
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	351.00	11 888.37	0.01
USD WHIRLPOOL CORP COM	41.00	7 612.88	0.00
USD WHOLE FOODS MKT INC COM	119.00	4 328.03	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	559.00	17 122.17	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	8 740.00	0.00
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	59.00	5 623.29	0.00
USD WYNN RESORTS LTD COM	51.00	6 273.51	0.00
USD XCEL ENERGY INC COM	320.00	14 416.00	0.01
USD XEROX CORP COM	700.00	5 033.00	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	117.00	7 383.87	0.00
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	84.00	4 318.44	0.00
USD YAHOO INC COM STK USD0.001	466.00	22 465.86	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	159.00	10 454.25	0.01
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	112.00	13 400.80	0.01
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	236.00	13 241.96	0.01
アメリカ合衆国合計		10 846 422.83	3.84
無記名株式合計		17 466 009.25	6.17
参加証券			
スイス			
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	48.00	9 803.00	0.00
スイス合計		9 803.00	0.00
参加証券合計		9 803.00	0.00
その他の株式			
オランダ			
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	855.00	44 825.52	0.02
オランダ合計		44 825.52	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 (%)
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	360.00	94 136.32	0.03
スイス合計		94 136.32	0.03
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	33.00	2 716.89	0.00
アメリカ合衆国合計		2 716.89	0.00
その他の株式合計		141 678.73	0.05
優先株式			
ドイツ			
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	203.00	10 468.15	0.00
EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV	102.00	13 884.11	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	94.00	5 497.83	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	89.00	14 106.20	0.01
ドイツ合計		43 956.29	0.02
優先株式合計		43 956.29	0.02
記名株式			
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	104.00	13 584.43	0.01
フランス合計		13 584.43	0.01
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	96.00	19 224.76	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)	233.00	44 351.19	0.02
EUR AXEL SPRINGER SE NPV(REGD)	57.00	3 197.23	0.00
EUR BASF SE NPV	447.00	43 545.61	0.02
EUR BAYER AG NPV (REGD)	434.00	53 687.85	0.02
EUR BRENNTAG AG	94.00	5 572.55	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	465.00	34 635.14	0.01
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)	1 057.00	19 026.36	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)	99.00	9 686.37	0.00
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)	176.00	3 035.82	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)	569.00	20 447.21	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	1 735.00	30 418.18	0.01
EUR E.ON SE NPV	921.00	7 177.92	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)	58.00	6 953.82	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	511.00	10 572.62	0.00
EUR K&S AG NPV	80.00	1 908.28	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)	81.00	15 519.66	0.01
EUR OSRAM LICHT AG NPV	80.00	5 356.76	0.00
EUR PROSIEBENSAT1 MED.NPV	90.00	3 821.23	0.00
EUR SIEMENS AG NPV(REGD)	399.00	57 179.02	0.03
GBP TUI AG NPV (REGD)	363.00	5 273.96	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV(REGD)	80.00	3 681.09	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	176.00	6 369.66	0.00
ドイツ合計		410 642.29	0.15
イスラエル			
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	252.00	4 072.66	0.00
イスラエル合計		4 072.66	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 (%)
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV	1 079.00	8 510.36	0.00
EUR TENARIS S.A. USD1	118.00	1 847.77	0.00
ルクセンブルグ合計		10 358.13	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	7 358.00	47 970.81	0.02
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	254.00	2 235.70	0.00
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	3 291.00	26 336.87	0.01
EUR MAPFRE SA EURO.10	1 160.00	4 047.24	0.00
スペイン合計		80 590.62	0.03
スイス			
CHF ABB LTD CHF1.03(REGD)	910.00	22 268.92	0.01
CHF ADECCO SA CHF1(REGD)	75.00	5 567.83	0.00
CHF ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)	60.00	1 947.46	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	69.00	10 113.11	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	241.00	33 077.25	0.01
GBP COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70	144.00	3 990.55	0.00
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	1 020.00	15 503.14	0.01
CHF GALENICA AG CHF0.10 (REGD)	6.00	6 515.65	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	5 084.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	11.00	5 007.99	0.00
CHF GIVAUDAN AG CHF10	4.00	7 703.05	0.00
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	89.00	4 635.74	0.00
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	34.00	5 136.97	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	140.00	7 932.09	0.00
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	94.00	5 335.07	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	33.00	6 746.20	0.00
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	1 673.00	128 821.59	0.05
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	1 170.00	89 972.88	0.03
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	21.00	12 689.24	0.01
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	268.00	22 386.06	0.01
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	2.00	4 498.47	0.00
CHF SONOVA HOLDING AG	38.00	5 615.35	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	41.00	3 179.67	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	7.00	2 276.96	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 (%)
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	77.00	6 671.61	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	4.00	1 743.93	0.00
CHF SYNGENTA CHF0.1(REGD)	44.00	20 438.60	0.01
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	206.00	15 938.22	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	1 930.00	32 959.97	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	73.00	20 196.09	0.01
スイス合計		513 953.66	0.18
記名株式合計		1 033 201.79	0.37
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUFS EURO.5	455.00	7 713.96	0.00
アイルランド合計		7 713.96	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	483.00	15 253.14	0.01
イスラエル合計		15 253.14	0.01
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	49.00	2 689.39	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	192.00	4 197.25	0.00
ルクセンブルグ合計		6 886.64	0.00
預託証券合計		29 853.74	0.01
投資信託証券			
アイルランド			
USD STAR COMPASS PLC/UBS DYNMC DIVERSIFIED LTD NOTE DUE 30.03.18	30 810 000.00	40 527 474.00	14.33
アイルランド合計		40 527 474.00	14.33
投資信託証券合計		40 527 474.00	14.33
投資信託、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	116.00	2 199.87	0.00
カナダ合計		2 199.87	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND MALL TRUST	6 300.00	8 879.59	0.00
シンガポール合計		8 879.59	0.00
アメリカ合衆国			
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	104.00	4 219.28	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	53.00	5 561.29	0.01
アメリカ合衆国合計		9 780.57	0.01
投資信託、クローズド・エンド型合計		20 860.03	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 (%)
新株引受権			
イギリス			
GBP COBHAM PLC (NIL PAID) RIGHTS 04.05.17	616.00	454.26	0.00
イギリス合計		454.26	0.00
新株引受権合計			
		454.26	0.00
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	225 000.00	210 240.90	0.07
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 3.65000% 16-01.02.26	175 000.00	178 330.42	0.06
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	100 000.00	99 396.80	0.04
USD APPLE INC 3.00000% 17-09.02.24	225 000.00	229 431.15	0.08
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	250 000.00	261 793.50	0.09
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22	300 000.00	298 009.50	0.11
USD CHEVRON CORP 3.19100% 13-24.06.23	75 000.00	77 456.03	0.03
USD CISCO SYSTEMS INC 2.20000% 16-28.02.21	300 000.00	301 586.40	0.11
USD CONOCOPHILLIPS CO 3.35000% 14-15.11.24	150 000.00	152 207.10	0.05
USD EXXON MOBIL CORP 2.72600% 16-01.03.23	150 000.00	151 509.75	0.05
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	50 000.00	70 516.05	0.03
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.25000% 16-19.02.21	375 000.00	378 737.62	0.13
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	225 000.00	239 580.00	0.09
USD KOREA RESOURCES CORP-REG-S 3.00000% 17-24.04.22	200 000.00	199 571.00	0.07
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.12500% 13-17.01.23	250 000.00	249 611.26	0.09
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	120 000.00	116 877.00	0.04
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	300 000.00	304 468.20	0.11
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	225 000.00	225 762.75	0.08
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 17-17.05.22	265 000.00	265 393.79	0.09
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	275 000.00	265 453.10	0.09
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	200 000.00	199 004.00	0.07
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 1.85000% 16-15.05.22	175 000.00	170 593.15	0.06
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	350 000.00	365 116.85	0.13
米ドル合計		5 010 646.32	1.77
ノート、固定利付債合計			
		5 010 646.32	1.77

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 (%)
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.30000% 16-01.06.21	250 000.00	248 007.50	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	175 000.00	167 777.40	0.06
USD HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 1.50000% 16-13.09.19	200 000.00	198 870.00	0.07
USD MDC-GMTN B.V-REG-S 3.00000% 17-19.04.24	250 000.00	247 265.00	0.09
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	300 000.00	302 145.00	0.11
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.60000% 17-11.01.22	300 000.00	302 574.90	0.10
米ドル合計		1 466 639.80	0.52
中期債券、固定利付債合計		1 466 639.80	0.52
債券、固定利付債			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	175 000.00	220 935.75	0.08
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	250 000.00	248 370.00	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24	250 000.00	264 264.50	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 15-10.02.25	275 000.00	265 003.20	0.09
USD FANNIE MAE 1.62500% 15-21.01.20	75 000.00	75 249.52	0.03
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 14-21.02.24	95 000.00	99 194.82	0.03
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 7.62500% 93-19.01.23	200 000.00	257 696.00	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	325 000.00	326 565.85	0.12
USD ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	200 000.00	234 900.00	0.08
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.25000% 14-10.07.24	350 000.00	353 590.30	0.12
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	225 000.00	215 561.25	0.08
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	150 000.00	163 873.65	0.06
USD ONTARIO, PROVINCE OF 3.20000% 14-16.05.24	300 000.00	313 681.50	0.11
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.40000% 17-08.02.22	200 000.00	202 110.40	0.07
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	100 000.00	105 173.90	0.04
米ドル合計		3 346 170.64	1.18
債券、固定利付債合計		3 346 170.64	1.18
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	4 700 000.00	4 677 416.50	1.65
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 10-15.11.20	6 125 000.00	6 340 569.38	2.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 11-31.08.18	4 000 000.00	4 015 780.00	1.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.07.21	4 350 000.00	4 241 589.30	1.50
米ドル合計		19 275 355.18	6.82
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		19 275 355.18	6.82

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 (%)
財務省証券(T-note)、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI INDEX 13-15.04.18	470 000.00	496 340.23	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	510 000.00	553 694.58	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	520 000.00	556 048.30	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	530 000.00	560 591.76	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 15-15.04.20	2 110 000.00	2 220 729.47	0.79
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 14-15.04.19	740 000.00	776 442.69	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	545 000.00	557 962.64	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	520 000.00	554 441.49	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	600 000.00	621 590.93	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	520 000.00	558 016.32	0.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	2 030 000.00	2 132 125.56	0.75
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	860 000.00	1 006 440.81	0.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	375 000.00	559 860.56	0.20
米ドル合計		11 154 285.34	3.96
財務省証券(T-note)、変動利付債合計			11 154 285.34 3.96
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			99 526 388.37 35.21
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 CHEVRON CORP 1.71800% 13-24.06.18	100 000.00	100 335.20	0.04
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	425 000.00	432 300.65	0.14
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	225 000.00	245 060.10	0.09
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27	100 000.00	100 961.00	0.04
米ドル合計		878 656.95	0.31
ノート、固定利付債合計			878 656.95 0.31
中期債券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 2.00000% 13-11.01.18	100 000.00	100 252.40	0.04
USD FREDDIE MAC 2.37500% 12-13.01.22	150 000.00	153 000.45	0.05
米ドル合計		253 252.85	0.09
中期債券、固定利付債合計			253 252.85 0.09

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 (%)
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	7 147 704.90	2.53
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 12-15.05.22	1 450 000.00	1 444 110.10	0.51
米ドル合計		8 591 815.00	3.04
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		8 591 815.00	3.04
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		9 723 724.80	3.44
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	2 848.01	0.00
カナダ合計		2 848.01	0.00
イギリス			
GBP ROLLS ROYCE HLDGS C SHS ENTITLEMENT (JUL 2017	56 445.00	73.03	0.00
イギリス合計		73.03	0.00
無記名株式合計		2 921.04	0.00
新株引受権			
オランダ			
EUR AKZO NOBEL NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 17.05.17	92.00	129.99	0.00
EUR WOLTERS KLUWER NV DRIP RIGHTS 09.05.17	170.00	111.63	0.00
オランダ合計		241.62	0.00
イギリス			
EUR RELX NV STOCK DIVIDEND RIGHTS 15.05.17	491.00	160.08	0.00
イギリス合計		160.08	0.00
新株引受権合計		401.70	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		3 322.74	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	337.00	3 614 931.59	1.28
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	43 388.00	8 303 161.56	2.94
アイルランド合計		11 918 093.15	4.22
ジャージー			
USD UBS WEALTH MANAGEMENT-GLOBAL PROPERTY FUND LTD H-USD	26 558.23	146 141.98	0.05
ジャージー合計		146 141.98	0.05
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	677.40	11 581 043.62	4.10
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	52 766.00	5 666 540.74	2.00
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD INVEST GRADE CORP USD U X ACC	2 229.00	22 649 247.93	8.01
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND - GLOBAL BONDS (USD)-U-X-ACC	474.00	5 703 499.80	2.02
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA GRWTH (USD)-U-X-ACC	61.00	1 694 310.99	0.60
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLB EM OPP(USD)-U-X-ACC	254.00	5 830 818.92	2.06
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	359.00	6 821 969.30	2.41
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	3 342.83	43 027 508.96	15.21
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL.GLOBAL EQUITY FA-USD	1 624.00	32 272 745.12	11.42
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMERG.MARKETS EQUITY PASSIVE XA USD	5 847.00	619 138.83	0.22
EUR UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV - GLOBAL ALPHA OPP (EUR) U-X-ACC	777.00	10 632 041.96	3.76
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	734.00	7 703 630.94	2.73
ルクセンブルグ合計		154 202 497.11	54.54
投資信託、オープン・エンド型合計		166 266 732.24	58.81
UCITS/その他のUCIS合計		166 266 732.24	58.81
投資有価証券合計		275 520 168.15	97.46

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			
指数関連金融先物			
USD S&P500 EMINI FUTURE 16.06.17	7.00	13 187.50	0.00
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.17	53.00	-78 158.70	-0.03
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 15.06.17	-21.00	-7 696.04	0.00
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.17	260.00	314 747.54	0.12
AUD SPI 200 INDEX FUTURE 15.06.17	-18.00	-16 826.74	-0.01
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.17	23.00	48 642.30	0.02
指数関連金融先物合計		273 895.86	0.10
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			273 895.86 0.10
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派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD CME/CDX.NA.HY.28 JUN22 CDI REC 5.00000% 17-20.06.22 2 400 000.00		196 693.33	0.07
クレジット・デフォルト・スワップ合計		196 693.33	0.07
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派生商品合計			196 693.33 0.07
派生商品合計			470 589.19 0.17

先渡為替契約

先渡為替契約(購入/売却)

USD	4 536 889.15	JPY	509 582 482.00	11.5.2017	-36 473.96	-0.01
USD	4 011 918.13	GBP	3 215 000.00	11.5.2017	-148 794.80	-0.05
USD	427 158.49	DKK	2 935 000.00	11.5.2017	-2 819.40	0.00
USD	705 859.33	HKD	5 475 000.00	11.5.2017	1 739.98	0.00
USD	546 234.88	SGD	763 000.00	11.5.2017	269.01	0.00
SEK	7 768 077.12	USD	886 428.51	11.5.2017	-8 648.09	0.00
USD	1 877 249.20	AUD	2 429 498.51	11.5.2017	60 716.91	0.02
USD	3 677 672.06	CAD	4 879 958.22	11.5.2017	108 057.33	0.04
USD	15 597 505.78	EUR	14 387 542.25	11.5.2017	-78 481.26	-0.03
USD	871 364.23	CHF	863 000.00	11.5.2017	3 818.29	0.00
USD	886 054.18	CAD	1 180 000.00	9.6.2017	22 532.84	0.01
BRL	2 180 000.00	USD	694 690.08	9.6.2017	-20 185.30	-0.01
USD	893 508.56	AUD	1 160 000.00	9.6.2017	26 625.84	0.01
USD	873 086.19	SGD	1 220 000.00	9.6.2017	-157.58	0.00
ZAR	9 060 000.00	USD	707 895.07	9.6.2017	-35 888.81	-0.01
RUB	38 500 000.00	USD	658 581.66	9.6.2017	10 664.84	0.00
INR	44 480 000.00	USD	676 236.55	9.6.2017	12 124.91	0.00
CAD	730 000.00	USD	546 334.40	11.5.2017	-12 350.58	0.00
AUD	140 000.00	USD	106 790.46	11.5.2017	-2 112.68	0.00
USD	283 016.76	EUR	260 000.00	11.5.2017	-266.97	0.00
USD	262 704.12	GBP	210 000.00	11.5.2017	-9 068.73	0.00
EUR	1 270 000.00	USD	1 355 168.74	11.5.2017	28 563.32	0.01
CAD	350 000.00	USD	261 525.43	11.5.2017	-5 505.79	0.00
GBP	800 000.00	USD	997 591.20	11.5.2017	37 733.94	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 （％）
EUR	2 900 000.00	USD	3 090 356.00	11.5.2017	69 347.14	0.02
AUD	850 000.00	USD	639 493.25	11.5.2017	-3 949.56	0.00
USD	270 437.61	SGD	380 000.00	22.6.2017	-1 591.83	0.00
USD	707 483.67	HKD	5 489 000.00	22.6.2017	949.41	0.00
USD	4 600 023.34	JPY	510 297 609.00	22.6.2017	12 307.68	0.00
SEK	7 587 223.28	USD	839 300.00	22.6.2017	20 008.71	0.01
USD	1 557 637.21	AUD	2 082 851.00	22.6.2017	1 413.74	0.00
USD	420 378.46	DKK	2 945 000.00	22.6.2017	-12 026.92	0.00
USD	4 317 811.78	GBP	3 476 535.41	22.6.2017	-186 939.32	-0.07
USD	1 272 661.46	CHF	1 280 297.43	22.6.2017	-17 890.99	-0.01
USD	13 969 953.50	EUR	13 166 060.20	22.6.2017	-406 686.34	-0.14
USD	2 659 092.96	CAD	3 548 636.67	22.6.2017	61 671.91	0.02
SGD	1 220 000.00	USD	869 473.50	9.6.2017	3 770.27	0.00
USD	685 455.04	INR	44 480 000.00	9.6.2017	-2 906.42	0.00
USD	666 666.03	RUB	38 500 000.00	9.6.2017	-2 580.47	0.00
AUD	1 160 000.00	USD	870 288.84	9.6.2017	-3 406.12	0.00
USD	647 987.56	ZAR	9 060 000.00	9.6.2017	-24 018.70	-0.01
USD	685 346.23	BRL	2 180 000.00	9.6.2017	10 841.45	0.00
CAD	1 180 000.00	USD	886 599.43	9.6.2017	-23 078.09	-0.01
GBP	350 000.00	USD	437 516.80	11.5.2017	15 437.95	0.01
GBP	350 000.00	USD	437 956.75	22.6.2017	15 558.80	0.01
AUD	400 000.00	USD	299 505.20	22.6.2017	-641.10	0.00
AUD	400 000.00	USD	299 733.60	11.5.2017	-654.22	0.00
JPY	5 494 947 500.00	USD	50 452 307.65	24.5.2017	-1 112 219.34	-0.40
SGD	8 966 200.00	USD	6 420 203.93	24.5.2017	-3 503.92	0.00
EUR	1 620 000.00	USD	1 767 019.86	22.6.2017	1 934.27	0.00
EUR	1 630 000.00	USD	1 774 435.93	11.5.2017	1 535.14	0.00
USD	734 567.23	EUR	670 000.00	22.6.2017	2 962.74	0.00
USD	722 174.64	EUR	660 000.00	11.5.2017	3 069.79	0.00
先渡為替契約（購入 / 売却）合計					-1 629 191.08	-0.58
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					7 484 411.70	2.65
当座借越およびその他の短期負債					-29.92	0.00
その他の資産および負債					863 703.16	0.30
純資産総額					282 709 651.20	100.00

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

注記は当財務書類と不可分のものである。

5【販売及び買戻しの実績】

2016年6月1日から2017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2017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	1,959,266.304 (641,197.571)	4,024,151.657 (1,595,370.571)	12,176,750.900 (3,909,749.000)
クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 投資証券	250,516.273 (169,833.964)	43,936.080 (44,321.025)	533,241.193 (452,173.939)

(注)()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数である。