

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成29年2月28日

【発行者名】 パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー
(Barclays Multi-Manager Fund public limited company)

【代表者の役職氏名】 取締役 デイビッド・トーマス・キングストン
(David Thomas Kingston, Director)

【本店の所在の場所】 アイルランド、ダブリン2、グランド・カナル・スクエア2、6階
(6th Floor, 2 Grand Canal Square, Dublin 2, Ireland)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健

【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 中 条 咲 耶 子

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】

バークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

- グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド
- グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド
- グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド
- グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド
- グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド
- グローバル・アクセス ジャパン・ファンド
- グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド
- グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド
- グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド
- グローバル・アクセス グローバル株式ファンド
- グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド
- グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド
- グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド
- グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド
- グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド
- グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド
- グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

(Barclays Multi-Manager Fund public limited company

- GlobalAccess UK Alpha Fund
- GlobalAccess UK Opportunities Fund
- GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund
- GlobalAccess US Value Fund
- GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund
- GlobalAccess Japan Fund
- GlobalAccess Pacific Rim (ex-Japan) Fund
- GlobalAccess Emerging Market Equity Fund
- GlobalAccess Global Property Securities Fund
- GlobalAccess Global Equity Income Fund
- GlobalAccess Global Government Bond Fund
- GlobalAccess Global Corporate Bond Fund
- GlobalAccess Global High Yield Bond Fund
- GlobalAccess Global Inflation Linked Bond Fund
- GlobalAccess Emerging Market Debt Fund
- GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund
- GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】

グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド クラスB(無分配型)英ポンド建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000英ポンド(約71,500百万円)

グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド クラスB(無分配型)英ポンド建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000英ポンド(約71,500百万円)

グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド クラスB(無分配型)ユーロ建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000ユーロ(約61,350百万円)

グローバル・アクセス ジャパン・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボン

ド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレン

シー・デット・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボン

ド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

無額面投資証券

上限見込額:500,000,000米ドル(約58,245百万円)

(注1)英ポンド、米ドル、およびユーロの円貨換算は、便宜上、以下による。

1英ポンド=143.00円(平成28年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値)

1米ドル=116.49円(平成28年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値)

1ユーロ=122.70円(平成28年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値)

(注2)上限見込額は、便宜上、各クラスの当初発行価格に基づいて算出されている。ただし、グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建は、2015年1月16日に10株を1株とする投資証券の併合があったため、その影響を反映している。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、平成28年11月30日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」という。)につきまして、関係情報を下表のとおり新たな情報により訂正するため、また、平成28年11月30日付で、本投資法人の定款が変更されたため、これに関する記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円貨換算については、直近の為替レート(平成28年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1英ポンド=143.00円、1米ドル=116.49円、1ユーロ=122.70円))を用いており、訂正前の為替レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

(1) 主要な経営指標等の推移

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | 736,654 英ポンド 105,342 千円 | 6,950,950 英ポンド 993,986 千円 | -6,610,757 英ポンド -945,338 千円 | -5,742,765 英ポンド -821,215 千円 | 8,993,196 英ポンド 1,286,027 千円 |
| (b) 経常利益(損失) (ファンド) | 271,197 英ポンド 38,781 千円 | 6,023,952 英ポンド 861,425 千円 | -7,079,700 英ポンド -1,012,397 千円 | -6,626,610 英ポンド -947,605 千円 | 8,577,881 英ポンド 1,226,637 千円 |
| (c) 当期純利益(損失)金額 ファンド | -740,284 英ポンド -105,861 千円 | 4,725,695 英ポンド 675,774 千円 | -8,419,265 英ポンド -1,203,955 千円 | -8,577,030 英ポンド -1,226,515 千円 | 7,615,702 英ポンド 1,089,045 千円 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | -1,496 英ポンド -214 千円 | 39,220 英ポンド 5,608 千円 | -306,271 英ポンド -43,797 千円 | -276,828 英ポンド -39,586 千円 | 106,243 英ポンド 15,193 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 87,229,158 英ポンド 12,473,770 千円 | 92,559,479 英ポンド 13,236,005 千円 | 82,585,898 英ポンド 11,809,783 千円 | 74,375,564 英ポンド 10,635,706 千円 | 72,378,773 英ポンド 10,350,165 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラスB(無分配型)英ポンド建 | 株 88,445 | 株 360,648 | 株 1,528,017 | 株 1,210,058 | 株 465,028 |
| 合計(ファンド) | 45,474,999 | 45,355,224 | 44,367,147 | 39,846,327 | 35,058,351 |
| (f) 純資産総額(ファンド) | 87,229,158 英ポンド 12,473,770 千円 | 92,559,479 英ポンド 13,236,005 千円 | 82,585,898 英ポンド 11,809,783 千円 | 74,375,564 英ポンド 10,635,706 千円 | 72,378,773 英ポンド 10,350,165 千円 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 176,271 英ポンド 25,207 千円 | 769,169 英ポンド 109,991 千円 | 3,004,262 英ポンド 429,609 千円 | 2,376,439 英ポンド 339,831 千円 | 1,009,718 英ポンド 144,390 千円 |
| (g) 資産総額(ファンド) | 89,023,546 英ポンド 12,730,367 千円 | 93,255,601 英ポンド 13,335,551 千円 | 84,030,391 英ポンド 12,016,346 千円 | 75,259,586 英ポンド 10,762,121 千円 | 73,336,668 英ポンド 10,487,144 千円 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 179,897 英ポンド 25,725 千円 | 774,954 英ポンド 110,818 千円 | 3,056,809 英ポンド 437,124 千円 | 2,404,685 英ポンド 343,870 千円 | 1,023,081 英ポンド 146,301 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラスB(無分配型)英ポンド建 | 1.9930 英ポンド 285.00 円 | 2.1327 英ポンド 304.98 円 | 1.9661 英ポンド 281.15 円 | 1.9639 英ポンド 280.84 円 | 2.1713 英ポンド 310.50 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0163 英ポンド -2.33 円 | 0.1042 英ポンド 14.90 円 | -0.1898 英ポンド -27.14 円 | -0.2153 英ポンド -30.79 円 | 0.2172 英ポンド 31.06 円 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | -0.0169 英ポンド -2.42 円 | 0.1087 英ポンド 15.54 円 | -0.2004 英ポンド -28.66 円 | -0.2288 英ポンド -32.72 円 | 0.2285 英ポンド 32.68 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 853,953 英ポンド | 992,139 英ポンド | 1,200,550 英ポンド | 1,758,314 英ポンド | 957,287 英ポンド |

| | | | | | |
|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 122,115 千円 - | 141,876 千円 - | 171,679 千円 - | 251,439 千円 - | 136,892 千円 - |
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド | 0.0208 英ポンド 2.97 円 | 0.0248 英ポンド 3.55 円 | 0.0326 英ポンド 4.66 円 | 0.0532 英ポンド 7.61 円 | 0.0328 英ポンド 4.69 円 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (l) 自己資本比率 ファンド | 97.98% | 99.25% | 98.28% | 98.83% | 98.69% |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 97.98% | 99.25% | 98.28% | 98.83% | 98.69% |
| (m) 自己資本利益率 ファンド | -0.85% | 5.11% | -10.19% | -11.53% | 10.52% |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | -0.85% | 5.10% | -10.19% | -11.65% | 10.52% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2004年10月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は英ポンドである。

(4) クラスB(無分配型)英ポンド建は、2012年8月21日に運用を開始した。

(5) 各ファンド証券について運用が終了、停止または休止の状態となったことがある場合は、直近で運用を開始または再開した日を運用を開始した日として記載している。以下同じ。

(6) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

2. グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|---------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -1,688,373 英ポンド -241,437 千円 | 14,645,069 英ポンド 2,094,245 千円 | -9,197,509 英ポンド -1,315,244 千円 | -7,079,450 英ポンド -1,012,361 千円 | 14,603,380 英ポンド 2,088,283 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -2,513,231 英ポンド -359,392 千円 | 13,021,719 英ポンド 1,862,106 千円 | -9,974,492 英ポンド -1,426,352 千円 | -8,580,815 英ポンド -1,227,057 千円 | 13,849,442 英ポンド 1,980,470 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -4,119,654 英ポンド -589,111 千円 | 10,662,888 英ポンド 1,524,793 千円 | -12,304,714 英ポンド -1,759,574 千円 | -12,103,806 英ポンド -1,730,844 千円 | 11,785,571 英ポンド 1,685,337 千円 |
| クラス B (無分配型) 英ポンド建 | -17,124 英ポンド -2,449 千円 | 57,433 英ポンド 8,213 千円 | -180,703 英ポンド -25,841 千円 | -168,301 英ポンド -24,067 千円 | 172,304 英ポンド 24,639 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 156,772,153 英ポンド 22,418,418 千円 | 158,993,400 英ポンド 22,736,056 千円 | 145,324,404 英ポンド 20,781,390 千円 | 133,912,783 英ポンド 19,149,528 千円 | 127,269,557 英ポンド 18,199,547 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 英ポンド建 | 株 242,555 | 株 287,055 | 株 766,206 | 株 660,030 | 株 610,000 |
| 合計 (ファンド) | 68,807,680 | 63,356,801 | 62,509,477 | 57,409,867 | 49,720,386 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 156,772,153 英ポンド 22,418,418 千円 | 158,993,400 英ポンド 22,736,056 千円 | 145,324,404 英ポンド 20,781,390 千円 | 133,912,783 英ポンド 19,149,528 千円 | 127,269,557 英ポンド 18,199,547 千円 |
| クラス B (無分配型) 英ポンド建 | 651,648 英ポンド 93,186 千円 | 857,064 英ポンド 122,560 千円 | 2,134,913 英ポンド 305,293 千円 | 1,841,733 英ポンド 263,368 千円 | 1,849,383 英ポンド 264,462 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 160,955,044 英ポンド 23,016,571 千円 | 160,089,559 英ポンド 22,892,807 千円 | 146,492,081 英ポンド 20,948,368 千円 | 135,079,473 英ポンド 19,316,365 千円 | 128,869,916 英ポンド 18,428,398 千円 |
| クラス B (無分配型) 英ポンド建 | 669,035 英ポンド 95,672 千円 | 862,973 英ポンド 123,405 千円 | 2,152,067 英ポンド 307,746 千円 | 1,857,779 英ポンド 265,662 千円 | 1,872,638 英ポンド 267,787 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 英ポンド建 | 2.6866 英ポンド 384.18 円 | 2.9857 英ポンド 426.96 円 | 2.7863 英ポンド 398.44 円 | 2.7904 英ポンド 399.03 円 | 3.0318 英ポンド 433.55 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0599 英ポンド -8.57 円 | 0.1683 英ポンド 24.07 円 | -0.1968 英ポンド -28.14 円 | -0.2108 英ポンド -30.14 円 | 0.2370 英ポンド 33.89 円 |
| クラス B (無分配型) 英ポンド建 | -0.0706 英ポンド -10.10 円 | 0.2001 英ポンド 28.61 円 | -0.2358 英ポンド -33.72 円 | -0.2550 英ポンド -36.47 円 | 0.2825 英ポンド 40.40 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 1,342,781 英ポンド 192,018 千円 | 1,772,394 英ポンド 253,452 千円 | 2,073,890 英ポンド 296,566 千円 | 3,165,233 英ポンド 452,628 千円 | 2,053,082 英ポンド 293,591 千円 |
| クラス B (無分配型) 英ポンド建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| ファンド | 0.0230 英ポンド 3.29 円 | 0.0343 英ポンド 4.90 円 | 0.0398 英ポンド 5.69 円 | 0.0675 英ポンド 9.65 円 | 0.0524 英ポンド 7.49 円 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (l) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 97.40% | 99.32% | 99.20% | 99.14% | 98.76% |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 97.40% | 99.32% | 99.20% | 99.14% | 98.76% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -2.63% | 6.71% | -8.47% | -9.04% | 9.26% |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | -2.63% | 6.70% | -8.46% | -9.14% | 9.32% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2004年10月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は英ポンドである。

(4) クラスB(無分配型)英ポンド建は、2004年10月14日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | 6,105,409 米ドル 711,219 千円 | 23,174,454 米ドル 2,699,592 千円 | -10,672,522 米ドル -1,243,242 千円 | -10,939,723 米ドル -1,274,368 千円 | -286,166 米ドル -33,335 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | 4,097,332 米ドル 477,298 千円 | 19,206,899 米ドル 2,237,412 千円 | -12,550,947 米ドル -1,462,060 千円 | -14,398,277 米ドル -1,677,255 千円 | -1,817,236 米ドル -211,690 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | 3,535,663 米ドル 411,869 千円 | 17,962,434 米ドル 2,092,444 千円 | -12,886,363 米ドル -1,501,132 千円 | -15,546,270 米ドル -1,810,985 千円 | -2,367,174 米ドル -275,752 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 12,924 米ドル 1,506 千円 | 111,950 米ドル 13,041 千円 | -281,990 米ドル -32,849 千円 | -321,526 米ドル -37,455 千円 | -58,523 米ドル -6,817 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 348,909,386 米ドル 40,644,454 千円 | 357,448,803 米ドル 41,639,211 千円 | 304,919,653 米ドル 35,520,090 千円 | 284,851,242 米ドル 33,182,321 千円 | 275,888,178 米ドル 32,138,214 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 879,007 | 株 1,438,874 | 株 4,479,938 | 株 4,464,835 | 株 4,118,957 |
| 合計 (ファンド) | 247,217,207 | 242,972,949 | 217,656,009 | 203,620,128 | 198,320,113 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 348,909,386 米ドル 40,644,454 千円 | 357,448,803 米ドル 41,639,211 千円 | 304,919,653 米ドル 35,520,090 千円 | 284,851,242 米ドル 33,182,321 千円 | 275,888,178 米ドル 32,138,214 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1,275,351 米ドル 148,566 千円 | 2,230,680 米ドル 259,852 千円 | 6,674,431 米ドル 777,504 千円 | 6,740,046 米ドル 785,148 千円 | 6,815,573 米ドル 793,946 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 353,388,168 米ドル 41,166,188 千円 | 369,382,279 米ドル 43,029,342 千円 | 309,892,871 米ドル 36,099,421 千円 | 288,579,461 米ドル 33,616,621 千円 | 282,781,241 米ドル 32,941,187 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1,291,722 米ドル 150,473 千円 | 2,305,152 米ドル 268,527 千円 | 6,783,290 米ドル 790,185 千円 | 6,828,262 米ドル 795,424 千円 | 6,985,860 米ドル 813,783 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1.4509 米ドル 169.02 円 | 1.5503 米ドル 180.59 円 | 1.4898 米ドル 173.55 円 | 1.5096 米ドル 175.85 円 | 1.6547 米ドル 192.76 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | 0.0143 米ドル 1.67 円 | 0.0739 米ドル 8.61 円 | -0.0592 米ドル -6.90 円 | -0.0763 米ドル -8.89 円 | -0.0119 米ドル -1.39 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 0.0147 米ドル 1.71 円 | 0.0778 米ドル 9.06 円 | -0.0629 米ドル -7.33 円 | -0.0720 米ドル -8.39 円 | -0.0142 米ドル -1.65 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | - | - | -115 米ドル -13 千円 | 843 米ドル 98 千円 | 25,741 米ドル 2,999 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|--------|--------|-------------|-----------|-----------|
| ファンド | - | - | -0.0000 米ドル | 0.000 米ドル | 0.000 米ドル |
| | - | - | 0.00 円 | 0.00 円 | 0.02 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |
| | - | - | - | - | - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 98.73% | 96.77% | 98.40% | 98.71% | 97.56% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 98.73% | 96.77% | 98.40% | 98.71% | 97.56% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | 1.01% | 5.03% | -4.23% | -5.46% | -0.86% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 1.01% | 5.02% | -4.22% | -4.77% | -0.86% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2011年6月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2013年7月9日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

4. グローバル・アクセス 米国バリューストックファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|-------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -16,502,617 米ドル -1,922,390 千円 | -20,980,756 米ドル -2,444,048 千円 | -39,964,444 米ドル -4,655,458 千円 | -50,783,640 米ドル -5,915,786 千円 | -14,003,498 米ドル -1,631,267 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -20,369,420 米ドル -2,372,834 千円 | -28,402,193 米ドル -3,308,571 千円 | -43,043,272 米ドル -5,014,111 千円 | -56,292,205 米ドル -6,557,479 千円 | -16,130,760 米ドル -1,879,072 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -24,343,111 米ドル -2,835,729 千円 | -35,443,608 米ドル -4,128,826 千円 | -46,180,699 米ドル -5,379,590 千円 | -64,808,331 米ドル -7,549,522 千円 | -20,452,618 米ドル -2,382,525 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | -51,798 米ドル -6,034 千円 | -615,228 米ドル -71,668 千円 | -991,049 米ドル -115,447 千円 | -176,801 米ドル -20,596 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 788,673,862 米ドル 91,872,618 千円 | 745,040,083 米ドル 86,789,719 千円 | 568,152,344 米ドル 66,184,067 千円 | 518,272,355 米ドル 60,373,547 千円 | 419,521,461 米ドル 48,870,055 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラスB (無分配型) 米ドル建 | 株 - | 株 40,000 | 株 291,500 | 株 308,000 | 株 130,500 |
| 合計 (ファンド) | 32,427,362 | 31,019,420 | 25,190,062 | 23,585,136 | 19,608,363 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 788,673,862 米ドル 91,872,618 千円 | 745,040,083 米ドル 86,789,719 千円 | 568,152,344 米ドル 66,184,067 千円 | 518,272,355 米ドル 60,373,547 千円 | 419,521,461 米ドル 48,870,055 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | 1,091,489 米ドル 127,148 千円 | 7,568,967 米ドル 881,709 千円 | 7,931,579 米ドル 923,950 千円 | 3,627,893 米ドル 422,613 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 801,885,382 米ドル 93,411,628 千円 | 771,536,016 米ドル 89,876,231 千円 | 582,071,922 米ドル 67,805,558 千円 | 526,722,349 米ドル 61,357,886 千円 | 433,592,974 米ドル 50,509,246 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | 1,130,306 米ドル 131,669 千円 | 7,754,405 米ドル 903,311 千円 | 8,060,897 米ドル 939,014 千円 | 3,749,579 米ドル 436,788 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | 27.2872 米ドル 3,178.69 円 | 25.9656 米ドル 3,024.73 円 | 25.7519 米ドル 2,999.84 円 | 27.7999 米ドル 3,238.41 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.7507 米ドル -87.45 円 | -1.1426 米ドル -133.10 円 | -1.8333 米ドル -213.56 円 | -2.7478 米ドル -320.09 円 | -1.0431 米ドル -121.51 円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | -1.2950 米ドル -150.85 円 | -2.1106 米ドル -245.86 円 | -3.2177 米ドル -374.83 円 | -1.3548 米ドル -157.82 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 1,892,587 米ドル 220,467 千円 | 2,885,336 米ドル 336,113 千円 | 2,124,823 米ドル 247,521 千円 | 4,876,775 米ドル 568,096 千円 | 2,747,703 米ドル 320,080 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| ファンド | 0.0785 米ドル 9.14 円 | 0.1260 米ドル 14.68 円 | 0.1197 米ドル 13.94 円 | 0.3048 米ドル 35.51 円 | 0.2095 米ドル 24.40 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 98.35% | 96.57% | 97.61% | 98.40% | 96.75% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | 96.57% | 97.61% | 98.40% | 96.75% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -3.09% | -4.76% | -8.13% | -12.50% | -4.88% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | -4.75% | -8.13% | -12.49% | -4.87% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2011年11月3日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2015年5月20日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

5. グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・アルファ・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | 8,734,900 ユーロ 1,071,772 千円 | 112,518,707 ユーロ 13,806,045 千円 | 26,716,127 ユーロ 3,278,069 千円 | -31,990,135 ユーロ -3,925,190 千円 | -43,276,094 ユーロ -5,309,977 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | 6,064,019 ユーロ 744,055 千円 | 106,860,254 ユーロ 13,111,753 千円 | 23,625,684 ユーロ 2,898,871 千円 | -37,878,821 ユーロ -4,647,731 千円 | -45,594,181 ユーロ -5,594,406 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | 5,656,633 ユーロ 694,069 千円 | 104,987,050 ユーロ 12,881,911 千円 | 19,134,676 ユーロ 2,347,825 千円 | -44,018,747 ユーロ -5,401,100 千円 | -51,461,396 ユーロ -6,314,313 千円 |
| クラス B (無分配型) ユーロ建 | 18,022 ユーロ 2,211 千円 | 152,698 ユーロ 18,736 千円 | 65,885 ユーロ 8,084 千円 | -76,433 ユーロ -9,378 千円 | -90,822 ユーロ -11,144 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 470,728,104 ユーロ 57,758,338 千円 | 550,479,166 ユーロ 67,543,794 千円 | 588,783,833 ユーロ 72,243,776 千円 | 515,798,099 ユーロ 63,288,427 千円 | 342,272,199 ユーロ 41,996,799 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) ユーロ建 | 株 763,802 | 株 348,684 | 株 862,195 | 株 412,195 | 株 297,739 |
| 合計 (ファンド) | 261,660,603 | 254,340,591 | 266,312,926 | 262,524,583 | 194,240,133 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 470,728,104 ユーロ 57,758,338 千円 | 550,479,166 ユーロ 67,543,794 千円 | 588,783,833 ユーロ 72,243,776 千円 | 515,798,099 ユーロ 63,288,427 千円 | 342,272,199 ユーロ 41,996,799 千円 |
| クラス B (無分配型) ユーロ建 | 1,499,725 ユーロ 184,016 千円 | 802,033 ユーロ 98,409 千円 | 2,029,216 ユーロ 248,985 千円 | 895,702 ユーロ 109,903 千円 | 608,891 ユーロ 74,711 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 479,086,213 ユーロ 58,783,878 千円 | 556,059,813 ユーロ 68,228,539 千円 | 594,581,570 ユーロ 72,955,159 千円 | 523,127,029 ユーロ 64,187,686 千円 | 353,463,479 ユーロ 43,369,969 千円 |
| クラス B (無分配型) ユーロ建 | 1,526,354 ユーロ 187,284 千円 | 810,164 ユーロ 99,407 千円 | 2,049,198 ユーロ 251,437 千円 | 908,429 ユーロ 111,464 千円 | 628,800 ユーロ 77,154 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) ユーロ建 | 1.9635 ユーロ 240.92 円 | 2.3002 ユーロ 282.23 円 | 2.3535 ユーロ 288.77 円 | 2.1730 ユーロ 266.63 円 | 2.0450 ユーロ 250.92 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | 0.0216 ユーロ 2.65 円 | 0.4128 ユーロ 50.65 円 | 0.0719 ユーロ 8.82 円 | -0.1677 ユーロ -20.58 円 | -0.2649 ユーロ -32.50 円 |
| クラス B (無分配型) ユーロ建 | 0.0236 ユーロ 2.90 円 | 0.4379 ユーロ 53.73 円 | 0.0764 ユーロ 9.37 円 | -0.1854 ユーロ -22.75 円 | -0.3050 ユーロ -37.42 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 354,372 ユーロ 43,481 千円 | 296,935 ユーロ 36,434 千円 | 4,355,812 ユーロ 534,458 千円 | 4,452,599 ユーロ 546,334 千円 | 6,362,712 ユーロ 780,705 千円 |
| クラス B (無分配型) ユーロ建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド | 0.0024 ユーロ | 0.0022 ユーロ | 0.0264 ユーロ | 0.0270 ユーロ | 0.0555 ユーロ |

| | 0.29 円 | 0.27 円 | 3.24 円 | 3.31 円 | 6.81 円 |
|----------------|--------|--------|--------|--------|---------|
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | - | - | - | - | - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 98.26% | 99.00% | 99.02% | 98.60% | 96.83% |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 98.26% | 99.00% | 99.02% | 98.60% | 96.83% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | 1.20% | 19.07% | 3.25% | -8.53% | -15.04% |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 1.20% | 19.04% | 3.25% | -8.53% | -14.92% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2004年10月1日に設定された。当ファンドの基準通貨はユーロである。

(4) クラスB(無分配型)ユーロ建は、2004年10月14日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|---|----------------------------|---|---|---|---|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | 6,397,214,131 円 | 14,017,612,940 円 | -2,463,903,216 円 | -8,636,899,371 円 | 9,517,814 円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | 6,235,346,857 円 | 13,666,628,090 円 | -2,647,390,547 円 | -8,956,217,670 円 | -77,285,812 円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド クラス B (無分配型) 米ドル建 | 6,110,921,525 円 - - | 13,492,199,529 円 436,726 米ドル 50,874 千円 | -2,805,433,769 円 -828,874 米ドル -96,556 千円 | -9,205,806,138 円 -3,245,544 米ドル -378,073 千円 | -197,172,171 円 -89,514 米ドル -10,427 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 34,856,366,934 円 | 41,915,639,665 円 | 31,195,751,228 円 | 21,999,358,502 円 | 15,762,695,077 円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 合計 (ファンド) | 株 - 216,018,313 | 株 950,000 212,503,174 | 株 6,920,000 171,875,927 | 株 6,990,000 153,635,296 | 株 5,820,000 105,057,042 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) クラス B (無分配型) 米ドル建 | 34,856,366,934 円 - - | 41,915,639,665 円 1,325,607 米ドル 154,420 千円 | 31,195,751,228 円 9,216,580 米ドル 1,073,639 千円 | 21,999,358,502 円 7,746,102 米ドル 902,343 千円 | 15,762,695,077 円 6,998,798 米ドル 815,290 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) クラス B (無分配型) 米ドル建 | 35,150,442,970 円 - - | 42,126,050,850 円 1,332,261 米ドル 155,195 千円 | 31,532,168,940 円 9,315,973 米ドル 1,085,218 千円 | 22,209,366,268 円 7,820,047 米ドル 910,957 千円 | 16,076,713,238 円 7,138,226 米ドル 831,532 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | - - | 1.3954 米ドル 162.55 円 | 1.3007 米ドル 151.52 円 | 1.1082 米ドル 129.09 円 | 1.2289 米ドル 143.15 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド クラス B (無分配型) 米ドル建 | 28.2889 円 - - | 63.4918 円 0.4597 米ドル 53.55 円 | -16.3224 円 -0.1198 米ドル -13.96 円 | -59.9199 円 -0.4643 米ドル -54.09 円 | -1.8768 円 -0.0154 米ドル -1.79 円 |
| (j) 分配総額 ファンド クラス B (無分配型) 米ドル建 | 78,516,706 円 - - | 75,900,530 円 - - | 118,799,070 円 - - | 165,337,981 円 - - | 94,358,482 円 - - |
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド クラス B (無分配型) 米ドル建 | 0.4188 円 - - | 0.4233 円 - - | 0.8776 円 - - | 1.4169 円 - - | 1.1585 円 - - |
| (l) 自己資本比率 ファンド クラス B (無分配型) 米ドル建 | 99.16% - | 99.50% 99.50% | 98.93% 98.93% | 99.05% 99.05% | 98.05% 98.05% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|--------|--------|--------|---------|--------|
| ファンド | 17.53% | 32.19% | -8.99% | -41.85% | -1.25% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | 32.95% | -8.99% | -41.90% | -1.28% |

- (1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2004年10月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は日本円である。
- (4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2015年5月20日に運用を開始した。
- (5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム（除く日本）・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|-------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | 1,864,785 米ドル 217,229 千円 | 9,381,788 米ドル 1,092,884 千円 | -10,862,268 米ドル -1,265,346 千円 | -5,547,286 米ドル -646,203 千円 | 171,008 米ドル 19,921 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | 1,101,166 米ドル 128,275 千円 | 7,969,380 米ドル 928,353 千円 | -11,512,514 米ドル -1,341,093 千円 | -6,896,070 米ドル -803,323 千円 | -492,909 米ドル -57,419 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | 323,022 米ドル 37,629 千円 | 6,874,214 米ドル 800,777 千円 | -12,658,137 米ドル -1,474,546 千円 | -8,622,602 米ドル -1,004,447 千円 | -2,074,493 米ドル -241,658 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | 615 米ドル 72 千円 | 81,058 米ドル 9,442 千円 | -66,919 米ドル -7,795 千円 | -31,737 米ドル -3,697 千円 | -3,199 米ドル -373 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 120,102,060 米ドル 13,990,689 千円 | 124,170,414 米ドル 14,464,612 千円 | 106,202,432 米ドル 12,371,521 千円 | 152,352,515 米ドル 17,747,544 千円 | 108,970,806 米ドル 12,694,009 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラスB (無分配型) 米ドル建 | 株 76,830 | 株 461,262 | 株 195,000 | 株 195,000 | 株 55,000 |
| 合計 (ファンド) | 48,278,846 | 48,183,363 | 42,265,685 | 67,904,811 | 49,606,081 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 120,102,060 米ドル 13,990,689 千円 | 124,170,414 米ドル 14,464,612 千円 | 106,202,432 米ドル 12,371,521 千円 | 152,352,515 米ドル 17,747,544 千円 | 108,970,806 米ドル 12,694,009 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | 228,754 米ドル 26,648 千円 | 1,464,110 米ドル 170,554 千円 | 561,453 米ドル 65,404 千円 | 561,145 米ドル 65,368 千円 | 168,008 米ドル 19,571 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 122,631,319 米ドル 14,285,322 千円 | 126,836,386 米ドル 14,775,171 千円 | 107,760,235 米ドル 12,552,990 千円 | 153,850,247 米ドル 17,922,015 千円 | 112,097,470 米ドル 13,058,234 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | 233,571 米ドル 27,209 千円 | 1,495,545 米ドル 174,216 千円 | 569,689 米ドル 66,363 千円 | 566,661 米ドル 66,010 千円 | 172,829 米ドル 20,133 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラスB (無分配型) 米ドル建 | 2.9774 米ドル 346.84 円 | 3.1741 米ドル 369.75 円 | 2.8792 米ドル 335.40 円 | 2.8777 米ドル 335.22 円 | 3.0547 米ドル 355.84 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | 0.0067 米ドル 0.78 円 | 0.1427 米ドル 16.62 円 | -0.2995 米ドル -34.89 円 | -0.1270 米ドル -14.79 円 | -0.0418 米ドル -4.87 円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | 0.0080 米ドル 0.93 円 | 0.1757 米ドル 20.47 円 | -0.3432 米ドル -39.98 円 | -0.1628 米ドル -18.96 円 | -0.0582 米ドル -6.78 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 479,577 米ドル 55,866 千円 | 582,297 米ドル 67,832 千円 | 929,449 米ドル 108,272 千円 | 1,243,680 米ドル 144,876 千円 | 1,296,451 米ドル 151,024 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0106 米ドル 1.23 円 | 0.0135 米ドル 1.57 円 | 0.0226 米ドル 2.63 円 | 0.0206 米ドル 2.40 円 | 0.0304 米ドル 3.54 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 97.94% | 97.90% | 98.55% | 99.03% | 97.21% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 97.94% | 97.90% | 98.55% | 99.03% | 97.21% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | 0.27% | 5.54% | -11.92% | -5.66% | -1.90% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 0.27% | 5.54% | -11.92% | -5.66% | -1.90% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2004年10月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2004年10月14日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -38,518,586 米ドル -4,487,030 千円 | -66,758,673 米ドル -7,776,718 千円 | -88,591,403 米ドル -10,320,013 千円 | -82,430,581 米ドル -9,602,338 千円 | 23,648,878 米ドル 2,754,858 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -44,183,190 米ドル -5,146,900 千円 | -76,987,511 米ドル -8,968,275 千円 | -92,112,785 米ドル -10,730,218 千円 | -89,245,067 米ドル -10,396,158 千円 | 20,228,571 米ドル 2,356,426 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -48,051,575 米ドル -5,597,528 千円 | -82,592,787 米ドル -9,621,234 千円 | -97,235,838 米ドル -11,327,003 千円 | -95,823,014 米ドル -11,162,423 千円 | 14,770,330 米ドル 1,720,596 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -266,985 米ドル -31,101 千円 | -547,049 米ドル -63,726 千円 | -677,021 米ドル -78,866 千円 | -508,559 米ドル -59,242 千円 | 98,075 米ドル 11,425 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 807,500,534 米ドル 94,065,737 千円 | 617,561,443 米ドル 71,939,732 千円 | 515,624,069 米ドル 60,065,048 千円 | 568,822,739 米ドル 66,262,161 千円 | 568,625,032 米ドル 66,239,130 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 4,802,260 | 株 4,413,090 | 株 4,032,360 | 株 3,835,171 | 株 4,422,509 |
| 合計 (ファンド) | 828,164,908 | 660,405,468 | 647,795,602 | 717,679,545 | 696,203,836 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 807,500,534 米ドル 94,065,737 千円 | 617,561,443 米ドル 71,939,732 千円 | 515,624,069 米ドル 60,065,048 千円 | 568,822,739 米ドル 66,262,161 千円 | 568,625,032 米ドル 66,239,130 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 4,486,752 米ドル 522,662 千円 | 4,094,321 米ドル 476,947 千円 | 3,187,456 米ドル 371,307 千円 | 3,015,841 米ドル 351,315 千円 | 3,772,095 米ドル 439,411 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 823,089,438 米ドル 95,881,689 千円 | 634,129,642 米ドル 73,869,762 千円 | 527,314,599 米ドル 61,426,878 千円 | 577,228,908 米ドル 67,241,395 千円 | 579,295,448 米ドル 67,482,127 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 4,573,369 米ドル 532,752 千円 | 4,204,165 米ドル 489,743 千円 | 3,259,724 米ドル 379,725 千円 | 3,060,410 米ドル 356,507 千円 | 3,842,879 米ドル 447,657 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 0.9343 米ドル 108.84 円 | 0.9278 米ドル 108.08 円 | 0.7905 米ドル 92.09 円 | 0.7864 米ドル 91.61 円 | 0.8529 米ドル 99.35 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0580 米ドル -6.76 円 | -0.1251 米ドル -14.57 円 | -0.1501 米ドル -17.49 円 | -0.1335 米ドル -15.55 円 | 0.0212 米ドル 2.47 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -0.0556 米ドル -6.48 円 | -0.1240 米ドル -14.44 円 | -0.1679 米ドル -19.56 円 | -0.1326 米ドル -15.45 円 | 0.0222 米ドル 2.59 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 2,681,814 米ドル 312,405 千円 | 3,078,524 米ドル 358,617 千円 | 4,237,102 米ドル 493,580 千円 | 4,881,889 米ドル 568,691 千円 | 4,610,210 米ドル 537,043 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド | 0.0048 米ドル | 0.0071 米ドル | 0.0089 米ドル | 0.0091 米ドル | 0.0089 米ドル |

| | 0.56 円 | 0.83 円 | 1.04 円 | 1.06 円 | 1.04 円 |
|--------------------|--------|---------|---------|---------|--------|
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (1)自己資本比率 ファンド | 98.11% | 97.39% | 97.78% | 98.54% | 98.16% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 98.11% | 97.39% | 97.78% | 98.54% | 98.16% |
| (m)自己資本利益率 ファンド | -5.95% | -13.37% | -18.86% | -16.85% | 2.60% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -5.95% | -13.36% | -21.24% | -16.86% | 2.60% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2007年8月29日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2007年9月6日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | 5,467,631 米ドル 636,924 千円 | 10,590,748 米ドル 1,233,716 千円 | -1,742,906 米ドル -203,031 千円 | 3,443,095 米ドル 401,086 千円 | -5,903,723 米ドル -687,725 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | 4,477,735 米ドル 521,611 千円 | 8,645,377 米ドル 1,007,100 千円 | -2,579,790 米ドル -300,520 千円 | 1,806,261 米ドル 210,411 千円 | -6,640,080 米ドル -773,503 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | 2,286,183 米ドル 266,317 千円 | 4,970,819 米ドル 579,051 千円 | -4,673,407 米ドル -544,405 千円 | -2,604,450 米ドル -303,392 千円 | -9,038,270 米ドル -1,052,868 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | 12,191 米ドル 1,420 千円 | -21,866 米ドル -2,547 千円 | -12,762 米ドル -1,487 千円 | -15,174 米ドル -1,768 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 165,924,815 米ドル 19,328,582 千円 | 148,609,122 米ドル 17,311,477 千円 | 137,623,269 米ドル 16,031,735 千円 | 134,862,268 米ドル 15,710,106 千円 | 132,647,561 米ドル 15,452,114 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 - | 株 250,000 | 株 450,000 | 株 450,000 | 株 160,000 |
| 合計 (ファンド) | 115,880,960 | 102,649,030 | 98,444,145 | 95,474,996 | 102,320,429 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 165,924,815 米ドル 19,328,582 千円 | 148,609,122 米ドル 17,311,477 千円 | 137,623,269 米ドル 16,031,735 千円 | 134,862,268 米ドル 15,710,106 千円 | 132,647,561 米ドル 15,452,114 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | 364,455 米ドル 42,455 千円 | 643,997 米ドル 75,019 千円 | 660,433 米ドル 76,934 千円 | 222,920 米ドル 25,968 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 168,384,456 米ドル 19,615,105 千円 | 149,603,754 米ドル 17,427,341 千円 | 139,008,702 米ドル 16,193,124 千円 | 136,593,675 米ドル 15,911,797 千円 | 134,324,011 米ドル 15,647,404 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | 366,894 米ドル 42,739 千円 | 650,480 米ドル 75,774 千円 | 668,912 米ドル 77,922 千円 | 225,737 米ドル 26,296 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | 1.4578 米ドル 169.82 円 | 1.4311 米ドル 166.71 円 | 1.4676 米ドル 170.96 円 | 1.3933 米ドル 162.31 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | 0.0197 米ドル 2.29 円 | 0.0484 米ドル 5.64 円 | -0.0475 米ドル -5.53 円 | -0.0273 米ドル -3.18 円 | -0.0883 米ドル -10.29 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | 0.0488 米ドル 5.68 円 | -0.0486 米ドル -5.66 円 | -0.0284 米ドル -3.31 円 | -0.0948 米ドル -11.04 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 1,711,864 米ドル 199,415 千円 | 2,646,734 米ドル 308,318 千円 | 1,855,729 米ドル 216,174 千円 | 3,438,136 米ドル 400,508 千円 | 2,040,619 米ドル 237,712 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド | 0.0150 米ドル 1.75 円 | 0.0268 米ドル 3.12 円 | 0.0202 米ドル 2.35 円 | 0.0397 米ドル 4.62 円 | 0.0227 米ドル 2.64 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (l) 自己資本比率 ファンド | 98.54% | 99.34% | 99.00% | 98.73% | 98.75% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | 99.34% | 99.00% | 98.73% | 98.75% |
| (m) 自己資本利益率 ファンド | 1.38% | 3.34% | -3.40% | -1.93% | -6.81% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | 3.34% | -3.40% | -1.93% | -6.81% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2009年12月14日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2015年5月21日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -36,374,277 米ドル -4,237,240 千円 | -33,763,575 米ドル -3,933,119 千円 | -25,273,456 米ドル -2,944,105 千円 | -31,522,387 米ドル -3,672,043 千円 | -27,321,648 米ドル -3,182,699 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -39,252,510 米ドル -4,572,525 千円 | -39,117,001 米ドル -4,556,739 千円 | -27,594,448 米ドル -3,214,477 千円 | -35,632,415 米ドル -4,150,820 千円 | -28,912,989 米ドル -3,368,074 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -46,984,080 米ドル -5,473,175 千円 | -49,903,611 米ドル -5,813,272 千円 | -35,507,187 米ドル -4,136,232 千円 | -48,248,181 米ドル -5,620,431 千円 | -34,230,763 米ドル -3,987,542 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -1,080,866 米ドル -125,910 千円 | -835,701 米ドル -97,351 千円 | -840,800 米ドル -97,945 千円 | -1,152,304 米ドル -134,232 千円 | -625,437 米ドル -72,857 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 435,472,856 米ドル 50,728,233 千円 | 473,141,608 米ドル 55,116,266 千円 | 349,098,724 米ドル 40,666,510 千円 | 313,205,198 米ドル 36,485,274 千円 | 303,682,945 米ドル 35,376,026 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 4,517,796 | 株 3,478,651 | 株 3,791,726 | 株 3,460,485 | 株 2,533,630 |
| 合計 (ファンド) | 213,614,536 | 235,412,862 | 186,904,813 | 174,027,152 | 192,369,920 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 435,472,856 米ドル 50,728,233 千円 | 473,141,608 米ドル 55,116,266 千円 | 349,098,724 米ドル 40,666,510 千円 | 313,205,198 米ドル 36,485,274 千円 | 303,682,945 米ドル 35,376,026 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 10,018,213 米ドル 1,167,022 千円 | 7,933,052 米ドル 924,121 千円 | 8,275,670 米ドル 964,033 千円 | 7,482,073 米ドル 871,587 千円 | 5,548,905 米ドル 646,392 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 445,064,371 米ドル 51,845,549 千円 | 490,408,694 米ドル 57,127,709 千円 | 355,563,451 米ドル 41,419,586 千円 | 319,103,252 米ドル 37,172,338 千円 | 311,303,252 米ドル 36,263,716 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 10,238,869 米ドル 1,192,726 千円 | 8,222,565 米ドル 957,847 千円 | 8,428,922 米ドル 981,885 千円 | 7,622,970 米ドル 888,000 千円 | 5,688,144 米ドル 662,612 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 2.2175 米ドル 258.32 円 | 2.2805 米ドル 265.66 円 | 2.1826 米ドル 254.25 円 | 2.1621 米ドル 251.86 円 | 2.1901 米ドル 255.12 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.2199 米ドル -25.62 円 | -0.2120 米ドル -24.70 円 | -0.1900 米ドル -22.13 円 | -0.2772 米ドル -32.29 円 | -0.1779 米ドル -20.72 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -0.2392 米ドル -27.86 円 | -0.2402 米ドル -27.98 円 | -0.2217 米ドル -25.83 円 | -0.3330 米ドル -38.79 円 | -0.2469 米ドル -28.76 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 5,993,782 米ドル 698,216 千円 | 7,469,966 米ドル 870,176 千円 | 7,139,308 米ドル 831,658 千円 | 10,327,064 米ドル 1,203,000 千円 | 4,551,139 米ドル 530,162 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0368 米ドル 4.29 円 | 0.0389 米ドル 4.53 円 | 0.0493 米ドル 5.74 円 | 0.0774 米ドル 9.02 円 | 0.0287 米ドル 3.34 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 97.84% | 96.48% | 98.18% | 98.15% | 97.55% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 97.84% | 96.48% | 98.18% | 98.15% | 97.55% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -10.79% | -10.55% | -10.17% | -15.40% | -11.27% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -10.79% | -10.53% | -10.16% | -15.40% | -11.27% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2011年12月13日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2011年12月13日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -2,095,800 米ドル -244,140 千円 | -4,823,941 米ドル -561,941 千円 | -906,937 米ドル -105,649 千円 | 2,577,018 米ドル 300,197 千円 | -19,811,897 米ドル -2,307,888 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -3,224,057 米ドル -375,570 千円 | -7,091,383 米ドル -826,075 千円 | -2,000,356 米ドル -233,021 千円 | 492,897 米ドル 57,418 千円 | -20,723,948 米ドル -2,414,133 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -4,481,914 米ドル -522,098 千円 | -8,629,355 米ドル -1,005,234 千円 | -2,600,954 米ドル -302,985 千円 | -598,052 米ドル -69,667 千円 | -21,219,098 米ドル -2,471,813 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 340,236,363 米ドル 39,634,134 千円 | 323,413,345 米ドル 37,674,421 千円 | 311,158,242 米ドル 36,246,824 千円 | 278,551,122 米ドル 32,448,420 千円 | 209,058,203 米ドル 24,353,190 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 ⁽³⁾ | 株 | 株 | 株 | 株 | 株 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| クラスB (無分配型) 英ポンド建 | 70 | 70 | - | - | - |
| クラスB (無分配型) ユーロ建 | 402,600 | 507,093 | 463,041 | 432,843 | 432,843 |
| 合計 (ファンド) | 291,322,293 | 283,054,684 | 275,315,903 | 246,318,869 | 202,737,877 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 340,236,363 米ドル 39,634,134 千円 | 323,413,345 米ドル 37,674,421 千円 | 311,158,242 米ドル 36,246,824 千円 | 278,551,122 米ドル 32,448,420 千円 | 209,058,203 米ドル 24,353,190 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 348,097,290 米ドル 40,549,853 千円 | 365,469,180 米ドル 42,573,505 千円 | 328,888,300 米ドル 38,312,198 千円 | 290,200,838 米ドル 33,805,496 千円 | 230,697,937 米ドル 26,874,003 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (h) 1株当たり純資産価格 ⁽³⁾ | | | | | |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| クラスB (無分配型) 英ポンド建 | 0.7575 英ポンド 108.32 円 | 0.7566 英ポンド 108.19 円 | - | - | - |
| クラスB (無分配型) ユーロ建 | 0.9401 ユーロ 115.35 円 | 0.9437 ユーロ 115.79 円 | 0.9448 ユーロ 115.93 円 | 0.9517 ユーロ 116.77 円 | 0.9386 ユーロ 115.17 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0154 米ドル -1.79 円 | -0.0305 米ドル -3.55 円 | -0.0094 米ドル -1.10 円 | -0.0024 米ドル -0.28 円 | -0.1047 米ドル -12.20 円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------------------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|--------------------------|
| (j) 分配総額 ファンド | 1,254,530 米ドル 146,140 千円 | 1,526,832 米ドル 177,861 千円 | 576,792 米ドル 67,191 千円 | 1,060,243 米ドル 123,508 千円 | 472,546 米ドル 55,047 千円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド | 0.0048 米ドル 0.56 円 | 0.0064 米ドル 0.75 円 | 0.0025 米ドル 0.29 円 | 0.0044 米ドル 0.51 円 | 0.0029 米ドル 0.34 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (l) 自己資本比率 ファンド | 97.74% | 88.49% | 94.61% | 95.99% | 90.62% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (m) 自己資本利益率 ファンド | -1.32% | -2.67% | -0.84% | -0.21% | -10.15% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) クラスB(無分配型)米ドル建は、2016年11月末日現在、運用の実績がない。そのため、参考値として、クラスB(無分配型)英ポンド建およびクラスB(無分配型)ユーロ建の値を記載している。

(4) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2004年10月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(5) クラスB(無分配型)英ポンド建は、2010年8月3日に運用を開始した。

(6) クラスB(無分配型)ユーロ建は、2010年7月7日に運用を開始した。

(7) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -5,986,193 米ドル -697,332 千円 | -4,671,130 米ドル -544,140 千円 | -4,702,719 米ドル -547,820 千円 | 3,708,976 米ドル 432,059 千円 | -24,189,675 米ドル -2,817,855 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -7,487,422 米ドル -872,210 千円 | -7,610,045 米ドル -886,494 千円 | -6,137,153 米ドル -714,917 千円 | 1,007,313 米ドル 117,342 千円 | -25,570,910 米ドル -2,978,755 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -12,568,390 米ドル -1,464,092 千円 | -15,136,950 米ドル -1,763,303 千円 | -11,267,518 米ドル -1,312,553 千円 | -9,231,867 米ドル -1,075,420 千円 | -29,874,344 米ドル -3,480,062 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -15,648 米ドル -1,823 千円 | -38,459 米ドル -4,480 千円 | -61,328 米ドル -7,144 千円 | -45,583 米ドル -5,310 千円 | -149,670 米ドル -17,435 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 399,177,367 米ドル 46,500,171 千円 | 396,293,165 米ドル 46,164,191 千円 | 370,853,181 米ドル 43,200,687 千円 | 345,354,998 米ドル 40,230,404 千円 | 346,575,845 米ドル 40,372,620 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 452,640 | 株 901,092 | 株 1,821,092 | 株 1,481,088 | 株 1,501,088 |
| 合計 (ファンド) | 351,429,856 | 348,494,219 | 335,461,373 | 309,456,183 | 344,039,965 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 399,177,367 米ドル 46,500,171 千円 | 396,293,165 米ドル 46,164,191 千円 | 370,853,181 米ドル 43,200,687 千円 | 345,354,998 米ドル 40,230,404 千円 | 346,575,845 米ドル 40,372,620 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 496,999 米ドル 57,895 千円 | 1,007,781 米ドル 117,396 千円 | 2,018,696 米ドル 235,158 千円 | 1,701,131 米ドル 198,165 千円 | 1,739,487 米ドル 202,633 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 418,744,742 米ドル 48,779,575 千円 | 431,197,893 米ドル 50,230,243 千円 | 389,839,173 米ドル 45,412,365 千円 | 380,027,498 米ドル 44,269,403 千円 | 388,749,764 米ドル 45,285,460 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 521,361 米ドル 60,733 千円 | 1,096,544 米ドル 127,736 千円 | 2,122,044 米ドル 247,197 千円 | 1,871,919 米ドル 218,060 千円 | 1,951,161 米ドル 227,291 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1.0980 米ドル 127.91 円 | 1.1184 米ドル 130.28 円 | 1.1085 米ドル 129.13 円 | 1.1486 米ドル 133.80 円 | 1.1588 米ドル 134.99 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0358 米ドル -4.17 円 | -0.0434 米ドル -5.06 円 | -0.0336 米ドル -3.91 円 | -0.0298 米ドル -3.47 円 | -0.0868 米ドル -10.11 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -0.0346 米ドル -4.03 円 | -0.0427 米ドル -4.97 円 | -0.0337 米ドル -3.93 円 | -0.0308 米ドル -3.59 円 | -0.0997 米ドル -11.61 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 5,078,252 米ドル 591,566 千円 | 7,518,706 米ドル 875,854 千円 | 5,125,110 米ドル 597,024 千円 | 10,229,747 米ドル 1,191,663 千円 | 4,285,962 米ドル 499,272 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0163 米ドル 1.90 円 | 0.0244 米ドル 2.84 円 | 0.0174 米ドル 2.03 円 | 0.0379 米ドル 4.41 円 | 0.0141 米ドル 1.64 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 95.33% | 91.91% | 95.13% | 90.88% | 89.15% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 95.33% | 91.91% | 95.13% | 90.88% | 89.15% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -3.15% | -3.82% | -3.04% | -2.67% | -8.62% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -3.15% | -3.82% | -3.04% | -2.68% | -8.60% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2007年12月4日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2014年9月29日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -72,865,936 米ドル -8,488,153 千円 | -96,939,747 米ドル -11,292,511 千円 | -61,601,667 米ドル -7,175,978 千円 | -22,516,798 米ドル -2,622,982 千円 | -28,665,532 米ドル -3,339,248 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -78,501,221 米ドル -9,144,607 千円 | -106,914,403 米ドル -12,454,459 千円 | -65,785,666 米ドル -7,663,372 千円 | -30,657,738 米ドル -3,571,320 千円 | -32,775,628 米ドル -3,818,033 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -97,068,573 米ドル -11,307,518 千円 | -133,616,679 米ドル -15,565,007 千円 | -80,729,912 米ドル -9,404,227 千円 | -65,168,296 米ドル -7,591,455 千円 | -52,185,154 米ドル -6,079,049 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -1,370,434 米ドル -159,642 千円 | -1,667,149 米ドル -194,206 千円 | -845,191 米ドル -98,456 千円 | -676,722 米ドル -78,831 千円 | -346,509 米ドル -40,365 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 978,189,427 米ドル 113,949,286 千円 | 882,257,663 米ドル 102,774,195 千円 | 930,492,745 米ドル 108,393,100 千円 | 934,629,300 米ドル 108,874,967 千円 | 940,978,497 米ドル 109,614,585 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 8,655,030 | 株 6,757,742 | 株 6,329,853 | 株 5,989,317 | 株 3,637,543 |
| 合計 (ファンド) | 790,914,109 | 738,043,708 | 856,314,584 | 846,969,685 | 909,591,721 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 978,189,427 米ドル 113,949,286 千円 | 882,257,663 米ドル 102,774,195 千円 | 930,492,745 米ドル 108,393,100 千円 | 934,629,300 米ドル 108,874,967 千円 | 940,978,497 米ドル 109,614,585 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 13,809,966 米ドル 1,608,723 千円 | 11,013,449 米ドル 1,282,957 千円 | 9,748,159 米ドル 1,135,563 千円 | 9,696,800 米ドル 1,129,580 千円 | 6,247,607 米ドル 727,784 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 1,008,544,249 米ドル 117,485,320 千円 | 916,514,654 米ドル 106,764,792 千円 | 989,504,755 米ドル 115,267,409 千円 | 960,839,075 米ドル 111,928,144 千円 | 965,144,841 米ドル 112,429,723 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 14,238,512 米ドル 1,658,644 千円 | 11,441,088 米ドル 1,332,772 千円 | 10,366,389 米ドル 1,207,581 千円 | 9,968,727 米ドル 1,161,257 千円 | 6,408,059 米ドル 746,475 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1.5956 米ドル 185.87 円 | 1.6298 米ドル 189.86 円 | 1.5400 米ドル 179.39 円 | 1.6190 米ドル 188.60 円 | 1.7175 米ドル 200.07 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.1227 米ドル -14.29 円 | -0.1810 米ドル -21.08 円 | -0.0943 米ドル -10.99 円 | -0.0769 米ドル -8.96 円 | -0.0574 米ドル -6.69 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -0.1583 米ドル -18.44 円 | -0.2467 米ドル -28.74 円 | -0.1335 米ドル -15.55 円 | -0.1130 米ドル -13.16 円 | -0.0953 米ドル -11.10 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 18,511,379 米ドル 2,156,391 千円 | 26,603,400 米ドル 3,099,030 千円 | 14,924,848 米ドル 1,738,596 千円 | 34,390,450 米ドル 4,006,144 千円 | 19,368,001 米ドル 2,256,178 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0341 米ドル 3.97 円 | 0.0514 米ドル 5.99 円 | 0.0213 米ドル 2.48 円 | 0.0492 米ドル 5.73 円 | 0.0253 米ドル 2.95 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 96.99% | 96.26% | 94.04% | 97.27% | 97.50% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 96.99% | 96.26% | 94.04% | 97.27% | 97.50% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -9.92% | -15.14% | -8.68% | -6.97% | -5.55% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -9.92% | -15.14% | -8.67% | -6.98% | -5.55% |

- (1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2007年11月27日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。
- (4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2010年2月24日に運用を開始した。
- (5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -7,166,683 米ドル -834,847 千円 | -13,686,568 米ドル -1,594,348 千円 | -6,542,017 米ドル -762,080 千円 | -6,938,008 米ドル -808,209 千円 | -12,357,178 米ドル -1,439,488 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -8,539,702 米ドル -994,790 千円 | -16,182,305 米ドル -1,885,077 千円 | -7,562,303 米ドル -880,933 千円 | -8,824,728 米ドル -1,027,993 千円 | -13,116,487 米ドル -1,527,940 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -9,509,977 米ドル -1,107,817 千円 | -17,564,480 米ドル -2,046,086 千円 | -8,004,039 米ドル -932,391 千円 | -10,507,384 米ドル -1,224,005 千円 | -14,930,630 米ドル -1,739,269 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -41,568 米ドル -4,842 千円 | -71,132 米ドル -8,286 千円 | -90,201 米ドル -10,508 千円 | -96,858 米ドル -11,283 千円 | -254,172 米ドル -29,608 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 351,204,770 米ドル 40,911,844 千円 | 280,046,527 米ドル 32,622,620 千円 | 276,317,895 米ドル 32,188,272 千円 | 248,007,698 米ドル 28,890,417 千円 | 150,851,156 米ドル 17,572,651 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 1,096,107 | 株 804,112 | 株 2,244,112 | 株 1,544,112 | 株 1,737,912 |
| 合計 (ファンド) | 248,969,509 | 202,412,249 | 204,996,459 | 185,031,377 | 119,828,746 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 351,204,770 米ドル 40,911,844 千円 | 280,046,527 米ドル 32,622,620 千円 | 276,317,895 米ドル 32,188,272 千円 | 248,007,698 米ドル 28,890,417 千円 | 150,851,156 米ドル 17,572,651 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1,535,098 米ドル 178,824 千円 | 1,134,531 米ドル 132,162 千円 | 3,118,658 米ドル 363,292 千円 | 2,180,880 米ドル 254,051 千円 | 2,567,212 米ドル 299,055 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 488,472,324 米ドル 56,902,141 千円 | 407,336,783 米ドル 47,450,662 千円 | 399,074,157 米ドル 46,488,149 千円 | 348,590,595 米ドル 40,607,318 千円 | 291,278,465 米ドル 33,931,028 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 2,135,087 米ドル 248,716 千円 | 1,650,212 米ドル 192,233 千円 | 4,504,145 米ドル 524,688 千円 | 3,065,366 米ドル 357,084 千円 | 4,957,029 米ドル 577,444 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1.4005 米ドル 163.14 円 | 1.4109 米ドル 164.36 円 | 1.3897 米ドル 161.89 円 | 1.4124 米ドル 164.53 円 | 1.4772 米ドル 172.08 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0382 米ドル -4.45 円 | -0.0868 米ドル -10.11 円 | -0.0390 米ドル -4.54 円 | -0.0568 米ドル -6.62 円 | -0.1246 米ドル -14.51 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -0.0379 米ドル -4.41 円 | -0.0885 米ドル -10.31 円 | -0.0402 米ドル -4.68 円 | -0.0627 米ドル -7.30 円 | -0.1463 米ドル -17.04 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 966,822 米ドル 112,625 千円 | 1,375,146 米ドル 160,191 千円 | 438,763 米ドル 51,112 千円 | 1,673,266 米ドル 194,919 千円 | 1,800,578 米ドル 209,749 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0049 米ドル 0.57 円 | 0.0082 米ドル 0.96 円 | 0.0026 米ドル 0.30 円 | 0.0113 米ドル 1.32 円 | 0.0186 米ドル 2.17 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (l) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 71.90% | 68.75% | 69.24% | 71.15% | 51.79% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 71.90% | 68.75% | 69.24% | 71.15% | 51.79% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -2.71% | -6.27% | -2.90% | -4.24% | -9.90% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -2.71% | -6.27% | -2.89% | -4.44% | -9.90% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2007年12月1日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2010年3月10日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -12,604,543 米ドル -1,468,303 千円 | -19,036,864 米ドル -2,217,604 千円 | -6,318,946 米ドル -736,094 千円 | 1,194,707 米ドル 139,171 千円 | -23,655,096 米ドル -2,755,582 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -14,254,266 米ドル -1,660,479 千円 | -21,989,191 米ドル -2,561,521 千円 | -7,569,580 米ドル -881,780 千円 | -1,128,334 米ドル -131,440 千円 | -24,885,583 米ドル -2,898,922 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -19,927,703 米ドル -2,321,378 千円 | -29,487,707 米ドル -3,435,023 千円 | -11,634,969 米ドル -1,355,358 千円 | -8,767,835 米ドル -1,021,365 千円 | -28,884,338 米ドル -3,364,737 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -308,483 米ドル -35,935 千円 | -461,218 米ドル -53,727 千円 | -207,082 米ドル -24,123 千円 | -150,871 米ドル -17,575 千円 | -132,868 米ドル -15,478 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 254,663,041 米ドル 29,665,698 千円 | 263,656,189 米ドル 30,713,309 千円 | 224,670,168 米ドル 26,171,828 千円 | 229,772,328 米ドル 26,766,178 千円 | 284,830,411 米ドル 33,179,895 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 株 2,287,735 | 株 2,383,876 | 株 2,358,198 | 株 2,222,663 | 株 724,680 |
| 合計 (ファンド) | 202,145,170 | 217,342,165 | 192,695,188 | 193,941,434 | 271,006,086 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 254,663,041 米ドル 29,665,698 千円 | 263,656,189 米ドル 30,713,309 千円 | 224,670,168 米ドル 26,171,828 千円 | 229,772,328 米ドル 26,766,178 千円 | 284,830,411 米ドル 33,179,895 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 3,942,225 米ドル 459,230 千円 | 4,124,683 米ドル 480,484 千円 | 4,006,008 米ドル 466,660 千円 | 3,947,017 米ドル 459,788 千円 | 1,310,798 米ドル 152,695 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 264,043,893 米ドル 30,758,473 千円 | 273,094,435 米ドル 31,812,771 千円 | 231,938,857 米ドル 27,018,557 千円 | 235,621,686 米ドル 27,447,570 千円 | 293,423,459 米ドル 34,180,899 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | 4,087,442 米ドル 476,146 千円 | 4,272,337 米ドル 497,685 千円 | 4,135,613 米ドル 481,758 千円 | 4,047,497 米ドル 471,493 千円 | 1,350,343 米ドル 157,301 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラス B (無分配型) 米ドル建 | 1.7232 米ドル 200.74 円 | 1.7302 米ドル 201.55 円 | 1.6988 米ドル 197.89 円 | 1.7758 米ドル 206.86 円 | 1.8088 米ドル 210.71 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0986 米ドル -11.49 円 | -0.1357 米ドル -15.81 円 | -0.0604 米ドル -7.04 円 | -0.0452 米ドル -5.27 円 | -0.1066 米ドル -12.42 円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | -0.1348 米ドル -15.70 円 | -0.1935 米ドル -22.54 円 | -0.0878 米ドル -10.23 円 | -0.0679 米ドル -7.91 円 | -0.1833 米ドル -21.35 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 5,671,326 米ドル 660,653 千円 | 7,489,842 米ドル 872,492 千円 | 4,058,116 米ドル 472,730 千円 | 7,625,297 米ドル 888,271 千円 | 3,988,482 米ドル 464,618 千円 |
| クラス B (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0353 米ドル 4.11 円 | 0.0451 米ドル 5.25 円 | 0.0277 米ドル 3.23 円 | 0.0524 米ドル 6.10 円 | 0.0174 米ドル 2.03 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 96.45% | 96.54% | 96.87% | 97.52% | 97.07% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 96.45% | 96.54% | 96.87% | 97.52% | 97.07% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -7.83% | -11.18% | -5.18% | -3.82% | -10.14% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -7.83% | -11.18% | -5.17% | -3.82% | -10.14% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2007年12月4日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2008年1月11日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -4,431,882 米ドル -516,270 千円 | -15,046,548 米ドル -1,752,772 千円 | -11,828,500 米ドル -1,377,902 千円 | -7,729,016 米ドル -900,353 千円 | -100,297 米ドル -11,684 千円 |
| (b) 経常利益(損失) (ファンド) | -5,161,633 米ドル -601,279 千円 | -16,320,812 米ドル -1,901,211 千円 | -12,342,881 米ドル -1,437,822 千円 | -8,673,513 米ドル -1,010,378 千円 | -547,183 米ドル -63,741 千円 |
| (c) 当期純利益(損失)金額 ファンド | -7,950,554 米ドル -926,160 千円 | -20,352,537 米ドル -2,370,867 千円 | -14,527,069 米ドル -1,692,258 千円 | -13,014,194 米ドル -1,516,023 千円 | -3,199,363 米ドル -372,694 千円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -98,307 米ドル -11,452 千円 | -259,981 米ドル -30,285 千円 | -362,630 米ドル -42,243 千円 | -346,683 米ドル -40,385 千円 | -60,212 米ドル -7,014 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 114,694,716 米ドル 13,360,787 千円 | 99,938,986 米ドル 11,641,892 千円 | 77,466,255 米ドル 9,024,044 千円 | 76,857,222 米ドル 8,953,098 千円 | 109,078,989 米ドル 12,706,611 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラスB(無分配型)米ドル建 | 株 1,572,719 | 株 1,572,719 | 株 2,732,719 | 株 2,732,719 | 株 2,732,719 |
| 合計(ファンド) | 135,540,972 | 132,547,463 | 120,158,297 | 115,776,406 | 170,070,722 |
| (f) 純資産総額(ファンド) | 114,694,716 米ドル 13,360,787 千円 | 99,938,986 米ドル 11,641,892 千円 | 77,466,255 米ドル 9,024,044 千円 | 76,857,222 米ドル 8,953,098 千円 | 109,078,989 米ドル 12,706,611 千円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 1,418,121 米ドル 165,197 千円 | 1,279,705 米ドル 149,073 千円 | 1,933,739 米ドル 225,261 千円 | 2,046,887 米ドル 238,442 千円 | 2,053,295 米ドル 239,188 千円 |
| (g) 資産総額(ファンド) | 118,670,161 米ドル 13,823,887 千円 | 101,515,939 米ドル 11,825,592 千円 | 78,394,058 米ドル 9,132,124 千円 | 77,592,763 米ドル 9,038,781 千円 | 110,781,534 米ドル 12,904,941 千円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 1,467,274 米ドル 170,923 千円 | 1,299,898 米ドル 151,425 千円 | 1,956,899 米ドル 227,959 千円 | 2,066,476 米ドル 240,724 千円 | 2,085,344 米ドル 242,922 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラスB(無分配型)米ドル建 | 0.9017 米ドル 105.04 円 | 0.8137 米ドル 94.79 円 | 0.7076 米ドル 82.43 円 | 0.7490 米ドル 87.25 円 | 0.7514 米ドル 87.53 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0587 米ドル -6.84 円 | -0.1535 米ドル -17.88 円 | -0.1209 米ドル -14.08 円 | -0.1124 米ドル -13.09 円 | -0.0188 米ドル -2.19 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -0.0625 米ドル -7.28 円 | -0.1653 米ドル -19.26 円 | -0.1327 米ドル -15.46 円 | -0.1269 米ドル -14.78 円 | -0.0220 米ドル -2.56 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 2,784,890 米ドル 324,412 千円 | 3,949,839 米ドル 460,117 千円 | 2,075,289 米ドル 241,750 千円 | 4,184,957 米ドル 487,506 千円 | 2,549,628 米ドル 297,006 千円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 ファンド | 0.0212 米ドル | 0.0313 米ドル | 0.0178 米ドル | 0.0373 米ドル | 0.0153 米ドル |

| | 2.47 円 | 3.65 円 | 2.07 円 | 4.35 円 | 1.78 円 |
|----------------|--------|---------|---------|---------|--------|
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (1) 自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 96.65% | 98.45% | 98.82% | 99.05% | 98.46% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 96.65% | 98.45% | 98.82% | 99.05% | 98.46% |
| (m) 自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -6.93% | -20.36% | -18.75% | -16.93% | -2.93% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | -6.93% | -20.32% | -18.75% | -16.94% | -2.93% |

(1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2012年11月13日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。

(4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2013年4月11日に運用を開始した。

(5) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

| | 2014年11月末日 | 第11会計年度 (2015年5月末日) | 2015年11月末日 | 第12会計年度 (2016年5月末日) | 2016年11月末日 |
|-------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| (a) 営業収益 ⁽¹⁾ (ファンド) | -16,530,146 米ドル -1,925,597 千円 | -20,293,151 米ドル -2,363,949 千円 | -7,960,333 米ドル -927,299 千円 | -13,455,791 米ドル -1,567,465 千円 | -31,299,998 米ドル -3,646,137 千円 |
| (b) 経常利益 (損失) (ファンド) | -17,328,400 米ドル -2,018,585 千円 | -22,058,697 米ドル -2,569,618 千円 | -9,214,529 米ドル -1,073,400 千円 | -15,847,227 米ドル -1,846,043 千円 | -32,238,211 米ドル -3,755,429 千円 |
| (c) 当期純利益 (損失) 金額 ファンド | -17,341,637 米ドル -2,020,127 千円 | -22,034,434 米ドル -2,566,791 千円 | -13,056,269 米ドル -1,520,925 千円 | -23,917,186 米ドル -2,786,113 千円 | -35,446,701 米ドル -4,129,186 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | -19,942 米ドル -2,323 千円 | -57,217 米ドル -6,665 千円 | -81,651 米ドル -9,512 千円 | -165,280 米ドル -19,253 千円 |
| (d) 出資総額 ⁽²⁾ (ファンド) | 321,335,227 米ドル 37,432,341 千円 | 365,292,848 米ドル 42,552,964 千円 | 411,246,150 米ドル 47,906,064 千円 | 289,270,483 米ドル 33,697,119 千円 | 260,037,847 米ドル 30,291,809 千円 |
| (e) 発行済ファンド証券総数 クラスB (無分配型) 米ドル建 | 株 - | 株 196,380 | 株 1,076,380 | 株 576,380 | 株 696,380 |
| 合計 (ファンド) | 1,966,136,332 | 227,666,091 | 262,375,620 | 188,022,500 | 191,280,878 |
| (f) 純資産総額 (ファンド) | 321,335,227 米ドル 37,432,341 千円 | 365,292,848 米ドル 42,552,964 千円 | 411,246,150 米ドル 47,906,064 千円 | 289,270,483 米ドル 33,697,119 千円 | 260,037,847 米ドル 30,291,809 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | 330,757 米ドル 38,530 千円 | 1,802,225 米ドル 209,941 千円 | 986,184 米ドル 114,881 千円 | 1,212,566 米ドル 141,252 千円 |
| (g) 資産総額 (ファンド) | 331,234,679 米ドル 38,585,528 千円 | 401,730,776 米ドル 46,797,618 千円 | 434,957,955 米ドル 50,668,252 千円 | 321,305,593 米ドル 37,428,889 千円 | 290,883,256 米ドル 33,884,990 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | 363,750 米ドル 42,373 千円 | 1,906,138 米ドル 222,046 千円 | 1,095,398 米ドル 127,603 千円 | 1,356,399 米ドル 158,007 千円 |
| (h) 1株当たり純資産価格 クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | 1.6843 米ドル 196.20 円 | 1.6743 米ドル 195.04 円 | 1.7110 米ドル 199.31 円 | 1.7412 米ドル 202.83 円 |
| (i) 1株当たり当期純利益金額 ファンド | -0.0088 米ドル -1.03 円 | -0.0968 米ドル -11.28 円 | -0.0498 米ドル -5.80 円 | -0.1272 米ドル -14.82 円 | -0.1853 米ドル -21.59 円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | -0.1015 米ドル -11.82 円 | -0.0532 米ドル -6.20 円 | -0.1417 米ドル -16.51 円 | -0.2373 米ドル -27.64 円 |
| (j) 分配総額 ファンド | 12,154 米ドル 1,416 千円 | -29,588 米ドル -3,447 千円 | 3,833,598 米ドル 446,576 千円 | 8,052,853 米ドル 938,077 千円 | 3,186,230 米ドル 371,164 千円 |
| クラスB (無分配型) 米ドル建 | - - | - - | - - | - - | - - |
| (k) 1株当たり分配金額 | | | | | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンド | 0.0000 米ドル 0.00 円 | -0.0002 米ドル -0.02 円 | 0.0167 米ドル 1.95 円 | 0.0489 米ドル 5.70 円 | 0.0200 米ドル 2.33 円 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | - | - | - | - |
| (1)自己資本比率 | | | | | |
| ファンド | 97.01% | 90.93% | 94.55% | 90.03% | 89.40% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | 90.93% | 94.55% | 90.03% | 89.40% |
| (m)自己資本利益率 | | | | | |
| ファンド | -5.40% | -6.03% | -3.17% | -8.27% | -13.63% |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | - | -6.03% | -3.17% | -8.28% | -13.63% |

- (1) 営業収益には投資収益ならびに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) 本投資法人は、2004年8月26日に運用を開始した。当ファンドは、2010年11月30日に設定された。当ファンドの基準通貨は米ドルである。
- (4) クラスB(無分配型)米ドル建は、2015年5月22日に運用を開始した。
- (5) グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドは、2015年1月16日にその投資証券について10株を1株とする投資証券の併合があった。
- (6) 上記表中、各年度11月末日とは、当該各月末に終了する6か月間の期間およびその末日を示す。以下同じ。

[次へ](#)

(2) 外国投資法人の出資総額

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

| | |
|-----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 390,028株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 74,135,837英ポンド 10,601,425千円 |

発行可能ファンド証券総数は、該当なし。以下、各ファンドにおいて同様。

2. グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

| | |
|-----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 610,000株 |

| | |
|------------|---------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 135,131,937英ポンド 19,323,867千円 |

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 4,008,957株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 284,240,770米ドル 33,111,207千円 |

4. グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 125,000株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 410,491,746米ドル 47,818,183千円 |

5. グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 247,739株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 348,232,487ユーロ 42,728,126千円 |

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 4,900,000株 |

| | |
|------------|-----------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 15,637,999,916円 |

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 55,000株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 103,511,470米ドル 12,058,051千円 |

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 4,422,509株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 563,653,567米ドル 65,660,004千円 |

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 160,000株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 133,761,161米ドル 15,581,838千円 |

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 2,533,630株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 302,060,573米ドル 35,187,036千円 |

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

| | |
|-----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数(注) | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 0株 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 0株 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 432,843株 |

(注)クラスB(無分配型)米ドル建は、2016年12月末日現在、運用の実績がない。そのため、参考値として、クラスB(無分配型)英ポンド建およびクラスB(無分配型)ユーロ建の発行済ファンド証券総数を記載している。

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 201,719,626米ドル 23,498,319千円 |

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 1,501,088株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 345,786,627米ドル 40,280,684千円 |

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 3,392,380株 |

| | |
|------------|---------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 939,561,216米ドル 109,449,486千円 |

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 1,737,912株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 148,889,059米ドル 17,344,086千円 |

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 724,679株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 278,968,196米ドル 32,497,005千円 |

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 2,732,719株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 112,760,819米ドル 13,135,508千円 |

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

| | |
|----------------|------------|
| 発行済ファンド証券総数 | 2016年12月末日 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 646,380株 |

| | |
|------------|--------------------------------|
| | 純資産総額 |
| 2016年12月末日 | 249,473,484米ドル 29,061,166千円 |

(3) 主要な投資主の状況

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|---|--------------|------------------|
| ノーザン・トラスト AVFC LE001 (NORTHERN TRUST AVFC LE001) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 6,813,852.00 | 19.44% |
| ノーザン・トラスト AVFC LE101 (NORTHERN TRUST AVFC LE101) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 6,034,302.66 | 17.21% |
| ノーザン・トラスト AVFC BPC01 (NORTHERN TRUST AVFC BPC01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 5,578,545.11 | 15.91% |
| ノートラスト・ノミネー ズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 2,752,841.52 | 7.85% |
| ノートラスト・ノミネー ズ・リミテッドA/C BAQ01 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BAQ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 2,700,274.92 | 7.70% |

2. グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|---|---------------|------------------|
| パークレイトラスト・チャンネル諸島・リミテッド (BARCLAYTRUST CHANNEL ISLANDS LTD) | ジャージー島、JE4 8PU、ブロード・ストリート39/41 (39/41 BROAD STREET, JE4 8PU, JERSEY) | 12,395,830.18 | 24.93% |
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワーフ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 7,521,726.34 | 15.13% |
| ノーザン・トラス AVFC BPC01 (NORTHERN TRUST AVFC BPC01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 4,337,458.62 | 8.72% |
| CACEIS バンク・フランス/ユーロクリア・フランス・アフィリエイツ (CACEIS BNK FR/EUROCLEAR FR AFFILIATES) | F-75013、パリ、プラス・ヴァルベール1-3 (1-3 PLACE VALHUBERT, PARIS, F-75013) | 3,481,536.02 | 7.00% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 3,473,599.41 | 6.99% |

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|---|---------------|------------------|
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワーフ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 53,224,484.54 | 26.84% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 27,759,587.48 | 14.00% |
| ファンドセトルEOC ノミニーズ・リミテッド (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッセージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 14,703,853.21 | 7.41% |
| BNPマドリードノパクティオ (BNP MADRID / PACTIO) | マドリード28042、リベラ・デル・ロイラ通り28、BNPパリバ・セキュリティーズ・サービス、スペイン支店 (BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, SPANISH BRANCH, C/RIBERA DEL LOIRA 28, MADRID 28042) | 9,221,716.02 | 4.65% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG05 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG05) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 8,779,638.43 | 4.43% |

4. グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|--|--------------|------------------|
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 3,726,060.00 | 19.00% |
| CACEIS バンク・フランス/ユーロクリア・フランス・アフィリエイツ (CACEIS BNK FR/EUROCLEAR FR AFFILIATES) | F-75013、パリ、プラス・ヴァルベール1-3 (1-3 PLACE VALHUBERT, PARIS, F-75013) | 2,021,928.52 | 10.31% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 1,256,581.00 | 6.41% |
| ファンドセトルEOC ノミニーズ・リミテッド (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッセージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 1,243,264.14 | 6.34% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG05 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG05) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 1,227,578.00 | 6.26% |

5. グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|---|---------------|------------------|
| CACEISバンク・フランス/ ユーロクリア・フラン ス・アフィリエイツ (CACEIS BNK FR/EUROCLEAR FR AFFILIATES) | F-75013、パリ、プラス・ヴァルベ ール1-3 (1-3 PLACE VALHUBERT, PARIS, F- 75013) | 36,625,913.69 | 18.86% |
| ノートラスト・ノミニ ーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 32,673,695.52 | 16.82% |
| ファンドセトルEOC ノミ ニーズ・リミテッド (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッ セージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 16,329,008.51 | 8.41% |
| ノートラスト・ノミニ ーズ・リミテッドA/C BPG05 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG05) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 10,250,058.11 | 5.28% |
| ファンドセトルEOC ノミ ニーズ・リミテッド・モ ナコ・キャッシュ (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD MONACO CASH) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッ セージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 9,646,685.28 | 4.97% |

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|--|---------------|------------------|
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 23,878,534.11 | 22.73% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG05 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG05) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 7,264,104.93 | 6.91% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 6,391,063.00 | 6.08% |
| S M B C 日興証券株式会社 (SMBC NIKKO SECURITIES INC) | 〒100-8325 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号 (3-1 MARUNOUCHI 3-CHOME, CHIYODA-KU, TOKYO 100-8325, JAPAN) | 5,820,000.00 | 5.54% |
| ノーザン・トラストAVFC BPC01 (NORTHERN TRUST AVFC BPC01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 5,709,139.57 | 5.43% |

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|--|---------------|------------------|
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 11,001,223.19 | 22.18% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG05 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG05) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 5,707,039.40 | 11.50% |
| ノーザン・トラストAVFC BPC01 (NORTHERN TRUST AVFC BPC01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 4,513,538.00 | 9.10% |
| ノーザン・トラストAVFC LEI01 (NORTHERN TRUST AVFC LEI01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 3,712,196.00 | 7.48% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BAQ01 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BAQ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 3,409,213.50 | 6.87% |

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|---|----------------|------------------|
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワーフ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 123,292,148.37 | 17.71% |
| R Cグレイグ・ノミニーズ・リミテッド (R C GREIG NOMINEES LIMITED) | グラスゴー、G2 5NN、セント・ヴィンセント・ストリート155 (155 ST. VINCENT STREET, G2 5NN, GLASGOW) | 75,163,428.22 | 10.80% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 69,222,430.01 | 9.94% |
| CACEIS バンク・フランス/ユーロクリア・フランス・アフィリエイツ (CACEIS BNK FR/EUROCLEAR FR AFFILIATES) | F-75013、パリ、プラス・ヴァルベール1-3 (1-3 PLACE VALHUBERT, PARIS, F-75013) | 52,008,094.82 | 7.47% |
| ノーザン・トラストAVFC LE001 (NORTHERN TRUST AVFC LE001) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 43,771,569.60 | 6.29% |

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|---|---------------|------------------|
| ノーザン・トラストAVFC LE001 (NORTHERN TRUST AVFC LE001) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 18,485,920.01 | 18.07% |
| ファンドセトルEOC ノミ ニーズ・リミテッド・モ ナコ・キャッシュ (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD MONACO CASH) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッ セージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 12,404,809.22 | 12.12% |
| ノーザン・トラストAVFC BPC01 (NORTHERN TRUST AVFC BPC01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 10,984,668.82 | 10.74% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 10,907,649.40 | 10.66% |
| ノーザン・トラストAVFC LEI01 (NORTHERN TRUST AVFC LEI01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 10,161,955.76 | 9.93% |

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|--|---------------|------------------|
| ノーザン・トラストAVFC LEO01 (NORTHERN TRUST AVFC LEO01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 39,669,846.00 | 20.62% |
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワー フ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 34,090,568.14 | 17.72% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 28,187,114.00 | 14.65% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BPG03 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG03) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 15,456,570.00 | 8.03% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BWZ01 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BWZ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 13,776,641.00 | 7.16% |

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|--|---------------|------------------|
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 38,204,178.94 | 18.84% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG03 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG03) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 28,307,126.36 | 13.96% |
| ファンドセトルEOC ノミニーズ・リミテッド (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッセージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 18,897,134.06 | 9.32% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 17,638,629.87 | 8.70% |
| ファンドセトルEOC ノミニーズ・リミテッド・モナコ・キャッシュ (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD MONACO CASH) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッセージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 13,701,267.33 | 6.76% |

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|--|---------------|------------------|
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 80,329,315.48 | 23.35% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG03 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG03) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 55,055,501.56 | 16.00% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 21,766,166.00 | 6.33% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BWZ01 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BWZ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 21,600,860.80 | 6.28% |
| ノーザン・トラストAVFC BPC01 (NORTHERN TRUST AVFC BPC01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 17,097,489.35 | 4.97% |

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|--|----------------|------------------|
| R Cグレイグ・ノミニー ズ・リミテッド (R C GREIG NOMINEES LIMITED) | グラスゴー、G2 5NN、セント・ヴィ ンセント・ストリート155、ジェラー ド・ノミニーズ (GERRARD NOMINEES, 155 ST. VINCENT STREET, G2 5NN, GLASGOW) | 169,743,108.13 | 18.66% |
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワー フ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 141,285,413.81 | 15.53% |
| ファンドセトルEOC ノミ ニーズ・リミテッド (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッ セージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 75,407,584.74 | 8.29% |
| R Cグレイグ・ノミニー ズ・リミテッド A/C SA1 (R C GREIG NOMINEES LIMITED A/C SA1) | グラスゴー、G2 5NN、セント・ヴィ ンセント・ストリート155、ジェラー ド・ノミニーズ (GERRARD NOMINEES, 155 ST. VINCENT STREET, G2 5NN, GLASGOW) | 58,789,270.77 | 6.46% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 51,942,245.18 | 5.71% |

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|---|---------------|------------------|
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワーフ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 54,111,551.45 | 44.81% |
| パークレイトラスト・チャンネル諸島・リミテッド (BARCLAYTRUST CHANNEL ISLANDS LTD) | ジャージー島、JE4 8PU、ブロード・ストリート39/41 (39/41 BROAD STREET, JE4 8PU, JERSEY) | 24,412,981.95 | 20.21% |
| R Cグレイグ・ノミニーズ・リミテッド (R C GREIG NOMINEES LIMITED) | グラスゴー、G2 5NN、セント・ヴィンセント・ストリート155、ジェラード・ノミニーズ (GERRARD NOMINEES, 155 ST. VINCENT STREET, G2 5NN, GLASGOW) | 20,588,077.62 | 17.05% |
| ファンドセトルEOC ノミニーズ・リミテッド・モナコ・キャッシュ (FUNDSETTLE EOC NOMINEES LTD MONACO CASH) | ロンドン、EC1Y 8BB、ラムズ・パッセージ2 (2 LAMBS PASSAGE, EC1Y 8BB, LONDON) | 4,263,622.71 | 3.53% |
| CACEISバンク・フランス/ユーロクリア・フランス・アフィリエイツ (CACEIS BNK FR/EUROCLEAR FR AFFILIATES) | F-75013、パリ、プラス・ヴァルベール1-3 (1-3 PLACE VALHUBERT, PARIS, F-75013) | 2,870,267.60 | 2.38% |

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|---|---------------|------------------|
| R Cグレイグ・ノミニーズ・リミテッド (R C GREIG NOMINEES LIMITED) | グラスゴー、G2 5NN、セント・ヴィンセント・ストリート155 (155 ST. VINCENT STREET, G2 5NN, GLASGOW) | 82,909,376.27 | 30.59% |
| R Cグレイグ・ノミニーズ・リミテッドA/C SA1 (R C GREIG NOMINEES LIMITED A/C SA1) | グラスゴー、G2 5NN、セント・ヴィンセント・ストリート155 (155 ST. VINCENT STREET, G2 5NN, GLASGOW) | 23,407,773.95 | 8.64% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 22,313,697.56 | 8.23% |
| CACEISバンク・フランス/ユーロクリア・フランス・アフィリエイツ (CACEIS BNK FR/EUROCLEAR FR AFFILIATES) | F-75013、パリ、プラス・ヴァルベール1-3 (1-3 PLACE VALHUBERT, PARIS, F-75013) | 21,693,764.30 | 8.00% |
| ゼバン・ノミニーズ (ZEBAN NOMINEES) | ロンドン、E14 5HP、カナリー・ワーフ、チャーチル・プレイス1 (1 CHURCHILL PLACE, CANARY WHARF, E14 5HP, LONDON) | 17,350,805.59 | 6.40% |

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|--|--|---------------|------------------|
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 26,734,397.00 | 15.72% |
| ノーザン・トラストAVFC LE001 (NORTHERN TRUST AVFC LE001) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 16,503,216.00 | 9.70% |
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 14,499,762.00 | 8.53% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BHH01 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BHH01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 14,376,338.00 | 8.45% |
| ノートラスト・ノミニーズ・リミテッドA/C BPG03 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG03) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワーフ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 12,951,659.00 | 7.62% |

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

(2016年11月末日現在)

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株数 | 発行済総数に対する所有株数の比率 |
|---|---|---------------|------------------|
| ノーザン・トラストAVFC LEJ01 (NORTHERN TRUST AVFC LEJ01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 40,251,526.98 | 21.04% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BPG04 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG04) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 23,157,314.00 | 12.11% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BII01 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BII01) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 22,309,200.49 | 11.66% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BPG03 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG03) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 21,276,684.33 | 11.12% |
| ノートラスト・ノミニー ズ・リミテッドA/C BPG02 (NORTRUST NOMINEES LIMITED A/C BPG02) | ロンドン、E14 5NT、カナリー・ワー フ、バンク・ストリート50 (50 BANK STREET, CANARY WHARF, E14 5NT, LONDON) | 17,132,932.95 | 8.96% |

[次へ](#)

(4) 役員状況

(2016年11月末日現在)

| 氏名 | 役職名 | 略歴 | 所有投資法人株数 |
|--------------------------------------|--|--|----------|
| ヒュー・ポール・ショブリン (Hugh Paul Shovlin) | 非業務執行取締役 会長 (chairman and non-executive director) (アイルランド籍) | 多数のアイルランド企業の取締役であり、アイルランド国立図書館会長(現職) | 0株 |
| デイビッド・キングストン (David Kingston) | 非業務執行取締役 (Non-executive director) (アイルランド籍) | Acuvest Investment Advisersの業務執行取締役会長およびアイルランド・英国の多数の金融サービス会社の非業務執行取締役 | 0株 |
| シヨン・ブレイク (Sean Blake) | 非業務執行取締役 (Non-executive director) (アイルランド籍) | 金融業界において有数の経歴を持つ専門家 | 0株 |
| キショール・マンダリア (Kishor Mandalia) | 非業務執行取締役 (Non-executive director) (英国籍) | 金融業界において有数の経歴を持つ専門家であり、パークレイズ・バンク・ピーエルシー役員 | 0株 |

(5) その他

a. 基本定款および通常定款の変更

基本定款および通常定款は、以下のアイルランド中央銀行の要件に従って、2014年アイルランド会社法第191条に基づき可決される特別決議により変更される。

- ・2011年欧州共同体(譲渡可能証券への集合投資事業)規則(2011年法律第352号)(その後の改正または差替を含む。)(以下「2011年アイルランドUCITS規則」という。)
- ・2013年アイルランド中央銀行(監督および執行)法(第48条第1項)(譲渡可能証券への集団投資事業)規則、および
- ・アイルランド中央銀行により随時発行されるUCITSに適用される指令(以下、併せて、「アイルランド中央銀行の要件」という。)

b. 事業譲渡または事業譲受

本投資法人および/またはファンドの構成員は(2014年アイルランド会社法第191条に基づき可決される特別決議により、かつ/または、2011年アイルランドUCITS規則に従い、かつ、アイルランド中央銀行の要件に従い)、国内外においてその他の集団投資スキームと本投資法人またはファンドの新設合併/吸収合併を許可することができる。この場合、かかる新設合併/吸収合併は、該当する集団投資スキームの保管者/受託者(アイルランド中央銀行の規制を受ける場合もあれば、受けない場合もある。)に対する本投資法人またはファンドの資産の全部または一部の譲渡を伴うことがある。

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

半期報告書提出前6ヵ月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(英ポンド) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|---------|-------------------------------|--------------|
| 株式 | 英国 | 63,987,996 | 86.07 |
| | ジャージー | 1,094,718 | 1.47 |
| | アイルランド | 786,947 | 1.06 |
| | ケイマン諸島 | 625,316 | 0.84 |
| | カナダ | 547,834 | 0.74 |
| | オーストラリア | 545,153 | 0.73 |
| | フランス | 532,664 | 0.72 |
| | スペイン | 422,840 | 0.57 |
| | ジブラルタル | 284,223 | 0.38 |
| | オランダ | 269,992 | 0.36 |
| | イタリア | 220,695 | 0.30 |
| | ギリシャ | 166,065 | 0.22 |
| | 日本 | 118,732 | 0.16 |
| | 米国 | 116,679 | 0.16 |
| | ベルギー | 100,112 | 0.13 |
| | マン島 | 73,402 | 0.10 |
| | デンマーク | 39,418 | 0.05 |
| ドイツ | 21,933 | 0.03 | |
| 投資信託 | 英国 | 1,093,594 | 1.47 |
| 小計 | | 71,048,315 | 95.57 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 3,294,876 | 4.43 |
| 資産総額 | | 74,343,190 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 207,353 | - 0.28 (注2) |
| 純資産総額 | | 74,135,837 (約10,601,425千円) | 99.72 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

2. グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(英ポンド) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|-------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | 英国 | 122,325,196 | 90.11 |
| | 米国 | 1,705,655 | 1.26 |
| | オランダ | 1,646,689 | 1.21 |
| | ジャージー | 1,200,236 | 0.88 |
| | ガーンジー | 245,648 | 0.18 |
| 小計 | | 127,123,424 | 93.64 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 8,626,959 | 6.36 |
| 資産総額 | | 135,750,383 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 618,446 | - 0.46 (注2) |
| 純資産総額 | | 135,131,937 (約19,323,867千円) | 99.54 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|---------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | 米国 | 257,262,429 | 88.08 |
| | バミューダ | 7,647,062 | 2.62 |
| | スイス | 3,094,739 | 1.06 |
| | オランダ | 2,240,636 | 0.77 |
| | カナダ | 585,034 | 0.20 |
| | アイルランド | 429,274 | 0.15 |
| | 英国 | 212,416 | 0.07 |
| | ルクセンブルグ | 71,929 | 0.02 |
| 投資信託 | アイルランド | 7,165,932 | 2.45 |
| | 米国 | 1,148,394 | 0.39 |
| 小計 | | 279,857,846 | 95.81 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 12,235,715 | 4.19 |
| 資産総額 | | 292,093,561 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 7,852,791 | - 2.69 (注2) |
| 純資産総額 | | 284,240,770 (約33,111,207千円) | 97.31 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

4. グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|--------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | 米国 | 359,241,563 | 85.07 |
| | アイルランド | 16,568,540 | 3.92 |
| | 英国 | 11,623,118 | 2.75 |
| | バミューダ | 4,560,638 | 1.08 |
| | オランダ | 3,191,157 | 0.76 |
| | キュラソー | 2,932,860 | 0.69 |
| | スイス | 2,803,682 | 0.66 |
| | フランス | 1,806,805 | 0.43 |
| | パナマ | 1,232,282 | 0.29 |
| | バージン諸島 | 488,433 | 0.12 |
| 小計 | | 404,449,076 | 95.77 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 17,852,947 | 4.23 |
| 資産総額 | | 422,302,024 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 11,810,278 | - 2.80 (注2) |
| 純資産総額 | | 410,491,746 (約47,818,183千円) | 97.20 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

5. グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(ユーロ) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|-----------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | ドイツ | 62,016,948 | 17.59 |
| | フランス | 49,712,345 | 14.10 |
| | スイス | 38,445,290 | 10.91 |
| | デンマーク | 30,528,461 | 8.66 |
| | オランダ | 29,647,164 | 8.41 |
| | スウェーデン | 21,337,478 | 6.05 |
| | イタリア | 19,644,244 | 5.57 |
| | スペイン | 18,818,020 | 5.34 |
| | アイルランド | 16,922,781 | 4.80 |
| | 英国 | 10,808,089 | 3.07 |
| | フィンランド | 9,797,066 | 2.78 |
| | ベルギー | 7,125,970 | 2.02 |
| | ノルウェー | 6,253,660 | 1.77 |
| | オーストリア | 4,507,162 | 1.28 |
| | ジャージー | 3,460,091 | 0.98 |
| | ルクセンブルグ | 1,571,604 | 0.45 |
| ポルトガル | 1,071,039 | 0.30 | |
| 投資信託 | 英国 | 13,649,803 | 3.87 |
| 小計 | | 345,317,214 | 97.97 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 7,164,451 | 2.03 |
| 資産総額 | | 352,481,665 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 4,249,177 | - 1.21 (注2) |
| 純資産総額 | | 348,232,487 (約42,728,126千円) | 98.79 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(日本円) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|----|----------------|--------------|
| 株式 | 日本 | 14,170,571,670 | 89.10 |
| 小計 | | 14,170,571,670 | 89.10 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 1,734,411,031 | 10.90 |
| 資産総額 | | 15,904,982,701 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 266,982,785 | - 1.68 (注2) |
| 純資産総額 | | 15,637,999,916 | 98.32 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|-----------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | ケイマン諸島 | 17,389,814 | 16.46 |
| | 韓国 | 16,813,423 | 15.91 |
| | オーストラリア | 15,449,186 | 14.62 |
| | 台湾 | 12,649,434 | 11.97 |
| | インド | 7,881,039 | 7.46 |
| | 香港 | 6,784,776 | 6.42 |
| | バミューダ | 6,638,360 | 6.28 |
| | 中国 | 3,593,545 | 3.40 |
| | タイ | 2,242,469 | 2.12 |
| | シンガポール | 1,546,823 | 1.46 |
| | 日本 | 1,153,719 | 1.09 |
| | 英国 | 1,113,795 | 1.05 |
| | マン島 | 857,582 | 0.81 |
| | フィリピン | 774,127 | 0.73 |
| | フランス | 722,154 | 0.68 |
| | パプアニューギニア | 661,138 | 0.63 |
| | 米国 | 607,085 | 0.57 |
| | バージン諸島 | 508,096 | 0.48 |
| | ニュージーランド | 289,374 | 0.27 |
| アイルランド | 276,335 | 0.26 | |
| 投資信託 | ルクセンブルグ | 2,063,309 | 1.95 |
| その他証券 (参加証書) | 中国 | 3,530,743 | 3.34 |
| 小計 | | 103,546,325 | 98.00 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 2,113,723 | 2.00 |
| 資産総額 | | 105,660,048 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 2,148,579 | - 2.03 (注2) |
| 純資産総額 | | 103,511,470 (約12,058,051千円) | 97.97 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|-----------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | 韓国 | 77,209,104 | 13.49 |
| | 台湾 | 62,608,205 | 10.94 |
| | ケイマン諸島 | 44,975,520 | 7.86 |
| | インド | 44,612,600 | 7.80 |
| | ブラジル | 40,096,549 | 7.01 |
| | 香港 | 33,123,151 | 5.79 |
| | 中国 | 19,008,714 | 3.32 |
| | ロシア | 18,409,740 | 3.22 |
| | バミューダ | 17,072,614 | 2.98 |
| | ハンガリー | 16,782,885 | 2.93 |
| | 南アフリカ | 16,197,427 | 2.83 |
| | 英国 | 14,852,820 | 2.60 |
| | トルコ | 14,688,968 | 2.57 |
| | フィリピン | 10,136,632 | 1.77 |
| | チリ | 8,653,599 | 1.51 |
| | ポーランド | 8,561,544 | 1.50 |
| | シンガポール | 8,111,029 | 1.42 |
| | タイ | 7,802,004 | 1.36 |
| | アラブ首長国連邦 | 7,025,964 | 1.23 |
| | インドネシア | 5,694,218 | 0.99 |
| | 米国 | 5,457,664 | 0.95 |
| | メキシコ | 4,032,078 | 0.70 |
| | フランス | 2,815,966 | 0.49 |
| | パプアニューギニア | 1,872,340 | 0.33 |
| | ポルトガル | 1,827,069 | 0.32 |
| | スイス | 1,774,723 | 0.31 |
| | バージン諸島 | 1,682,632 | 0.29 |
| | マレーシア | 1,587,473 | 0.28 |
| | ナイジェリア | 733,173 | 0.13 |
| | チェコ共和国 | 498,159 | 0.09 |
| マーシャル諸島 | 184,119 | 0.03 | |
| ギリシャ | 119,738 | 0.02 | |
| ペルー | 117,997 | 0.02 | |
| 投資信託 | アイルランド | 17,754,402 | 3.10 |
| | ルクセンブルグ | 6,523,577 | 1.14 |
| その他証券 (参加証書) | 中国 | 2,396,315 | 0.42 |
| 小計 | | 525,000,711 | 91.74 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 47,291,173 | 8.26 |
| 資産総額 | | 572,291,884 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 8,638,317 | - 1.51 (注2) |
| 純資産総額 | | 563,653,567 (約65,660,004千円) | 98.49 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|---------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | 米国 | 68,073,809 | 50.48 |
| | 日本 | 15,113,853 | 11.21 |
| | オーストリア | 8,744,278 | 6.48 |
| | 香港 | 6,631,988 | 4.92 |
| | 英国 | 5,929,639 | 4.40 |
| | ドイツ | 5,016,367 | 3.72 |
| | フランス | 3,597,148 | 2.67 |
| | スウェーデン | 3,207,780 | 2.38 |
| | スペイン | 1,920,435 | 1.42 |
| | バミューダ | 1,309,152 | 0.97 |
| | オランダ | 988,727 | 0.73 |
| | フィンランド | 778,751 | 0.58 |
| | メキシコ | 745,548 | 0.55 |
| | シンガポール | 644,713 | 0.48 |
| | ケイマン諸島 | 633,911 | 0.47 |
| カナダ | 268,453 | 0.20 | |
| 投資信託 | アイルランド | 9,131,191 | 6.77 |
| 小計 | | 132,735,744 | 98.44 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 2,108,791 | 1.56 |
| 資産総額 | | 134,844,535 | 100.00 |
| 負債総額 | | -1,083,374 | -0.80 (注2) |
| 純資産総額 | | 133,761,161 (約15,581,838千円) | 99.20 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|----------|--------------------------------|--------------|
| 株式 | 米国 | 136,473,983 | 44.19 |
| | 英国 | 24,069,264 | 7.79 |
| | 日本 | 20,656,095 | 6.69 |
| | ドイツ | 11,795,017 | 3.82 |
| | カナダ | 9,530,960 | 3.09 |
| | スイス | 8,238,839 | 2.67 |
| | アイルランド | 8,065,325 | 2.61 |
| | イタリア | 8,004,225 | 2.59 |
| | オーストリア | 7,968,997 | 2.58 |
| | フランス | 7,534,528 | 2.44 |
| | オランダ | 6,743,607 | 2.18 |
| | デンマーク | 6,400,564 | 2.07 |
| | スウェーデン | 5,577,583 | 1.81 |
| | スペイン | 4,161,811 | 1.35 |
| | ノルウェー | 3,923,286 | 1.27 |
| | フィンランド | 3,293,263 | 1.07 |
| | バミューダ | 2,894,703 | 0.94 |
| | ポルトガル | 2,791,598 | 0.90 |
| | ブラジル | 2,693,170 | 0.87 |
| | シンガポール | 1,964,044 | 0.64 |
| | 台湾 | 1,930,769 | 0.63 |
| | チェコ共和国 | 1,928,329 | 0.62 |
| | 韓国 | 1,682,195 | 0.54 |
| | パナマ | 1,590,891 | 0.52 |
| | イタリア | 1,504,953 | 0.49 |
| | 中国 | 1,369,298 | 0.44 |
| | ケイマン諸島 | 1,364,032 | 0.44 |
| | ニュージーランド | 1,325,742 | 0.43 |
| | ルクセンブルグ | 1,245,360 | 0.40 |
| | ジャージー | 562,077 | 0.18 |
| ロシア | 423,248 | 0.14 | |
| ベルギー | 167,088 | 0.05 | |
| 香港 | 150,714 | 0.05 | |
| 南アフリカ | 77,777 | 0.03 | |
| 小計 | | 298,103,335 | 96.53 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 10,702,258 | 3.47 |
| 資産総額 | | 308,805,593 | 100.00 |
| 負債総額 | | -6,745,020 | -2.18 (注2) |
| 純資産総額 | | 302,060,573 (約35,187,036千円) | 97.82 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|--------------------|----------|-------------|--------------|
| 国債 | 米国 | 36,541,178 | 17.09 |
| | 日本 | 36,339,519 | 17.00 |
| | イタリア | 13,842,360 | 6.48 |
| | スペイン | 12,160,297 | 5.69 |
| | 英国 | 11,799,241 | 5.52 |
| | フランス | 11,264,803 | 5.27 |
| | ドイツ | 10,016,052 | 4.69 |
| | カナダ | 3,802,891 | 1.78 |
| | オーストラリア | 2,632,620 | 1.23 |
| | 南アフリカ | 2,310,185 | 1.08 |
| | ノルウェー | 2,286,627 | 1.07 |
| | ベルギー | 2,270,452 | 1.06 |
| | スロベニア | 2,268,249 | 1.06 |
| | イスラエル | 1,183,032 | 0.55 |
| | ニュージーランド | 1,117,680 | 0.52 |
| | オランダ | 1,070,778 | 0.50 |
| | メキシコ | 1,035,550 | 0.48 |
| | オーストリア | 867,889 | 0.41 |
| | サウジアラビア | 776,906 | 0.36 |
| | アイルランド | 776,660 | 0.36 |
| | スロバキア | 588,084 | 0.28 |
| | スイス | 439,453 | 0.21 |
| | フィンランド | 372,650 | 0.17 |
| | デンマーク | 363,487 | 0.17 |
| | シンガポール | 337,046 | 0.16 |
| | スウェーデン | 262,949 | 0.12 |
| ポーランド | 234,386 | 0.11 | |
| 社債 | 米国 | 12,174,622 | 5.70 |
| | フランス | 5,093,850 | 2.38 |
| | デンマーク | 3,785,603 | 1.77 |
| | 英国 | 2,892,314 | 1.35 |
| | 日本 | 2,001,764 | 0.94 |
| | オランダ | 1,874,834 | 0.88 |
| | カナダ | 1,780,113 | 0.83 |
| | スイス | 1,106,246 | 0.52 |
| | オーストラリア | 942,003 | 0.44 |
| | ベルギー | 503,790 | 0.24 |
| | ニュージーランド | 367,611 | 0.17 |
| | アイルランド | 342,708 | 0.16 |
| | イスラエル | 319,384 | 0.15 |
| | スウェーデン | 298,855 | 0.14 |
| メキシコ | 88,432 | 0.04 | |
| 投資信託 | ルクセンブルグ | 2,662,384 | 1.25 |
| FGLMC担保証券 | 米国 | 1,063,348 | 0.50 |
| FNMA担保証券 (ショート) | 米国 | - 5,341,679 | - 2.50 |

| | | | |
|-----------------|------|--------------------------------|-------------|
| 政府機関債 (地方債) | 米国 | 498,554 | 0.23 |
| 国際機関債 | 国際機関 | 159,701 | 0.07 |
| 小計 | | 189,575,462 | 88.68 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 24,198,058 | 11.32 |
| 資産総額 | | 213,773,520 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 12,053,894 | - 5.64 (注2) |
| 純資産総額 | | 201,719,626 (約23,498,319千円) | 94.36 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|---------------|---------|-------------|--------------|
| 国債 | 米国 | 19,396,092 | 5.17 |
| | イタリア | 5,008,096 | 1.34 |
| | カナダ | 2,724,052 | 0.73 |
| | アルゼンチン | 1,651,813 | 0.44 |
| | サウジアラビア | 688,279 | 0.18 |
| | ポーランド | 265,169 | 0.07 |
| | スロベニア | 220,185 | 0.06 |
| | カタール | 200,367 | 0.05 |
| | 南アフリカ | 8,081 | 0.00 |
| 社債 | 米国 | 199,668,827 | 53.26 |
| | 英国 | 27,137,493 | 7.24 |
| | オランダ | 12,554,813 | 3.35 |
| | フランス | 10,314,055 | 2.75 |
| | ベルギー | 7,040,266 | 1.88 |
| | スイス | 5,948,380 | 1.59 |
| | オーストラリア | 5,044,061 | 1.35 |
| | スペイン | 4,919,157 | 1.31 |
| | ドイツ | 3,874,955 | 1.03 |
| | 日本 | 3,679,509 | 0.98 |
| | カナダ | 2,554,043 | 0.68 |
| | メキシコ | 2,423,811 | 0.65 |
| | アイルランド | 2,274,495 | 0.61 |
| | デンマーク | 2,256,183 | 0.60 |
| | ブラジル | 1,926,277 | 0.51 |
| | イタリア | 1,740,279 | 0.46 |
| | インド | 1,123,574 | 0.30 |
| | ケイマン諸島 | 999,114 | 0.27 |
| | ジャージー | 853,095 | 0.23 |
| | 香港 | 850,507 | 0.23 |
| | 中国 | 600,846 | 0.16 |
| | リベリア | 474,000 | 0.13 |
| | バージン諸島 | 416,960 | 0.11 |
| | ノルウェー | 328,776 | 0.09 |
| | キプロス | 307,579 | 0.08 |
| | ポルトガル | 234,166 | 0.06 |
| | カタール | 213,500 | 0.06 |
| チリ | 191,186 | 0.05 | |
| スウェーデン | 107,916 | 0.03 | |
| ルクセンブルグ | 96,750 | 0.03 | |
| MBS | 米国 | 8,900,446 | 2.37 |
| FNMA担保証券 | 米国 | 4,081,564 | 1.09 |
| その他資産 担保証券 | 米国 | 669,782 | 0.18 |
| ホールローンCMO | 米国 | 154,891 | 0.04 |
| | 英国 | 94,241 | 0.03 |
| 小計 | | 344,217,628 | 91.82 |

| | | |
|-----------------|--------------------------------|-------------|
| 現金・その他資産(負債控除後) | 30,653,764 | 8.18 |
| 資産総額 | 374,871,391 | 100.00 |
| 負債総額 | - 29,084,765 | - 7.76 (注2) |
| 純資産総額 | 345,786,627 (約40,280,684千円) | 92.24 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|----------|---------------------------------|--------------|
| 株式 | 米国 | 4,392,836 | 0.46 |
| | 香港 | 557,009 | 0.06 |
| | カナダ | 31,154 | 0.00 |
| 社債 | 米国 | 711,631,526 | 73.88 |
| | カナダ | 35,188,696 | 3.65 |
| | ルクセンブルグ | 27,810,877 | 2.89 |
| | 英国 | 19,888,772 | 2.06 |
| | フランス | 8,615,699 | 0.89 |
| | ドイツ | 8,460,433 | 0.88 |
| | オランダ | 8,313,648 | 0.86 |
| | ニュージーランド | 5,719,463 | 0.59 |
| | アイルランド | 4,517,903 | 0.47 |
| | ブラジル | 3,831,870 | 0.40 |
| | イタリア | 3,106,328 | 0.32 |
| | スペイン | 1,873,421 | 0.19 |
| | オーストラリア | 1,770,939 | 0.18 |
| | ジャマイカ | 1,743,712 | 0.18 |
| | スイス | 1,690,331 | 0.18 |
| | ケイマン諸島 | 1,113,500 | 0.12 |
| | マーシャル諸島 | 1,098,500 | 0.11 |
| | メキシコ | 1,054,080 | 0.11 |
| | バミューダ | 1,030,156 | 0.11 |
| | オーストリア | 426,520 | 0.04 |
| | ベルギー | 411,000 | 0.04 |
| 中国 | 148,125 | 0.02 | |
| ワラント | 米国 | 65,728 | 0.01 |
| 小計 | | 854,492,224 | 88.71 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 108,782,948 | 11.29 |
| 資産総額 | | 963,275,172 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 23,713,957 | - 2.46 (注2) |
| 純資産総額 | | 939,561,216 (約109,449,486千円) | 97.54 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|----------|--------------------------------|--------------|
| インデックス 連動国債 | 米国 | 67,389,518 | 25.05 |
| | 英国 | 34,640,553 | 12.88 |
| | フランス | 13,019,695 | 4.84 |
| | イタリア | 10,039,619 | 3.73 |
| | カナダ | 4,612,662 | 1.71 |
| | ニュージーランド | 3,407,230 | 1.27 |
| | デンマーク | 2,899,646 | 1.08 |
| | 日本 | 2,840,604 | 1.06 |
| | ドイツ | 2,044,975 | 0.76 |
| | スペイン | 1,969,025 | 0.73 |
| | オーストラリア | 485,028 | 0.18 |
| | スウェーデン | 427,195 | 0.16 |
| 社債 | 米国 | 14,475,198 | 5.38 |
| | ドイツ | 1,631,661 | 0.61 |
| | 英国 | 1,249,112 | 0.46 |
| | デンマーク | 537,797 | 0.20 |
| | カナダ | 397,490 | 0.15 |
| | イタリア | 300,048 | 0.11 |
| | スイス | 206,853 | 0.08 |
| | オランダ | 104,500 | 0.04 |
| 国債 | 英国 | 5,799,929 | 2.16 |
| | 日本 | 5,324,908 | 1.98 |
| | フランス | 1,100,000 | 0.41 |
| | 米国 | 499,827 | 0.19 |
| | ニュージーランド | 423,215 | 0.16 |
| | メキシコ | 280,889 | 0.10 |
| FNMA担保証券 | 米国 | 8,003,753 | 2.98 |
| その他資産 担保証券 | 米国 | 3,451,559 | 1.28 |
| 政府機関債 (地方債) | 米国 | 363,545 | 0.14 |
| ホールローン CMO | 米国 | 2,674,090 | 0.99 |
| 小計 | | 190,600,122 | 70.86 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 78,383,941 | 29.14 |
| 資産総額 | | 268,984,063 | 100.00 |
| 負債総額 | | -120,095,004 | -44.65 (注2) |
| 純資産総額 | | 148,889,059 (約17,344,086千円) | 55.35 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|--------|-----------|------------|--------------|
| 国債 | ハンガリー | 17,052,194 | 5.92 |
| | ドミニカ共和国 | 12,065,897 | 4.19 |
| | アルゼンチン | 11,766,762 | 4.08 |
| | インドネシア | 11,225,479 | 3.89 |
| | トルコ | 10,861,319 | 3.77 |
| | ロシア | 10,304,607 | 3.58 |
| | コートジボワール | 9,738,442 | 3.38 |
| | ウクライナ | 8,835,066 | 3.07 |
| | ルーマニア | 7,961,462 | 2.76 |
| | スリランカ | 6,711,032 | 2.33 |
| | パナマ | 6,306,556 | 2.19 |
| | メキシコ | 6,180,420 | 2.14 |
| | ブラジル | 5,540,847 | 1.92 |
| | コロンビア | 5,287,979 | 1.83 |
| | エクアドル | 5,281,381 | 1.83 |
| | エルサルバドル | 5,030,637 | 1.75 |
| | ガーナ | 4,582,169 | 1.59 |
| | ウルグアイ | 4,222,966 | 1.47 |
| | ペルー | 4,104,250 | 1.42 |
| | レバノン | 3,885,868 | 1.35 |
| | クロアチア | 3,511,127 | 1.22 |
| | アゼルバイジャン | 3,507,539 | 1.22 |
| | ベネズエラ | 2,886,640 | 1.00 |
| | オマーン | 2,882,397 | 1.00 |
| | モンゴル | 2,870,798 | 1.00 |
| | ブルガリア | 2,781,694 | 0.97 |
| | フィリピン | 2,655,582 | 0.92 |
| | パラグアイ | 2,585,156 | 0.90 |
| | カザフスタン | 2,298,027 | 0.80 |
| | ジャマイカ | 2,279,900 | 0.79 |
| | セネガル | 2,212,431 | 0.77 |
| | モロッコ | 2,073,179 | 0.72 |
| | パキスタン | 2,072,444 | 0.72 |
| | アンゴラ | 1,921,768 | 0.67 |
| | リトアニア | 1,878,962 | 0.65 |
| | 南アフリカ | 1,501,219 | 0.52 |
| | サウジアラビア | 1,320,450 | 0.46 |
| | ザンビア | 1,164,713 | 0.40 |
| | カメルーン | 1,119,424 | 0.39 |
| | ナイジェリア | 1,097,840 | 0.38 |
| | セルビア | 1,082,160 | 0.38 |
| | ケニヤ | 1,069,155 | 0.37 |
| アイスランド | 1,017,050 | 0.35 | |
| バーレーン | 908,986 | 0.32 | |
| チュニジア | 830,481 | 0.29 | |
| コスタリカ | 822,089 | 0.29 | |
| ベトナム | 817,895 | 0.28 | |
| エジプト | 788,378 | 0.27 | |
| ヨルダン | 741,593 | 0.26 | |
| ガボン | 734,654 | 0.25 | |
| 米国 | 640,578 | 0.22 | |
| ポーランド | 609,609 | 0.21 | |

| | | | |
|-----------------|----------|--------------------------------|-------------|
| | グアテマラ | 492,690 | 0.17 |
| | イスラエル | 491,186 | 0.17 |
| | モザンビーク | 487,549 | 0.17 |
| | カタール | 435,798 | 0.15 |
| | イラク | 419,276 | 0.15 |
| | ジョージア | 383,185 | 0.13 |
| | ホンジュラス | 316,609 | 0.11 |
| | エチオピア | 300,383 | 0.10 |
| | ベリーズ | 145,775 | 0.05 |
| | アルメニア | 131,723 | 0.05 |
| | ナミビア | 127,979 | 0.04 |
| | スリナム | 107,631 | 0.04 |
| 社債 | メキシコ | 7,632,819 | 2.65 |
| | ブラジル | 6,574,728 | 2.28 |
| | ベネズエラ | 3,618,962 | 1.26 |
| | モロッコ | 2,633,257 | 0.91 |
| | カザフスタン | 2,442,893 | 0.85 |
| | 南アフリカ | 1,913,412 | 0.66 |
| | インドネシア | 1,865,720 | 0.65 |
| | 中国 | 1,362,871 | 0.47 |
| | ルクセンブルグ | 1,310,451 | 0.45 |
| | イスラエル | 1,227,238 | 0.43 |
| | ロシア | 1,166,559 | 0.40 |
| | オランダ | 1,095,651 | 0.38 |
| | アルゼンチン | 1,038,800 | 0.36 |
| | トルコ | 998,513 | 0.35 |
| | コロンビア | 993,450 | 0.34 |
| | ウクライナ | 824,838 | 0.29 |
| | アゼルバイジャン | 713,691 | 0.25 |
| | アラブ首長国連邦 | 576,697 | 0.20 |
| | コスタリカ | 502,287 | 0.17 |
| | ウルグアイ | 436,097 | 0.15 |
| | ペルー | 370,525 | 0.13 |
| | オマーン | 369,138 | 0.13 |
| | グアテマラ | 222,750 | 0.08 |
| | ジョージア | 200,750 | 0.07 |
| | ブルガリア | 192,189 | 0.07 |
| | アンゴラ | 115,281 | 0.04 |
| 投資信託 | アイルランド | 4,772,861 | 1.66 |
| 小計 | | 260,641,459 | 90.43 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 27,582,573 | 9.57 |
| 資産総額 | | 288,224,032 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 9,255,836 | - 3.21 (注2) |
| 純資産総額 | | 278,968,196 (約32,497,005千円) | 96.79 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-----------------|--------|--------------------------------|--------------|
| 国債 | ブラジル | 19,271,298 | 16.86 |
| | コロンビア | 11,648,991 | 10.19 |
| | 南アフリカ | 10,494,282 | 9.18 |
| | メキシコ | 10,286,831 | 9.00 |
| | インドネシア | 9,771,729 | 8.55 |
| | ロシア | 9,494,358 | 8.31 |
| | マレーシア | 7,808,151 | 6.83 |
| | トルコ | 7,456,947 | 6.53 |
| | ポーランド | 6,016,442 | 5.26 |
| | ペルー | 5,105,698 | 4.47 |
| | タイ | 1,341,584 | 1.17 |
| | アルゼンチン | 566,540 | 0.50 |
| | ルーマニア | 504,971 | 0.44 |
| 社債 | メキシコ | 1,037,390 | 0.91 |
| | コロンビア | 460,849 | 0.40 |
| 投資信託 | アイルランド | 6,528,751 | 5.71 |
| 小計 | | 107,794,813 | 94.33 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 6,481,823 | 5.67 |
| 資産総額 | | 114,276,636 | 100.00 |
| 負債総額 | | -1,515,817 | -1.33 (注2) |
| 純資産総額 | | 112,760,819 (約13,135,508千円) | 98.67 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

(2016年12月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) (注1) |
|-------|---------|------------|--------------|
| 社債 | 米国 | 31,473,761 | 11.86 |
| | リトアニア | 6,247,976 | 2.35 |
| | メキシコ | 5,390,541 | 2.03 |
| | 英国 | 5,132,602 | 1.93 |
| | オーストラリア | 4,387,619 | 1.65 |
| | ブラジル | 4,352,348 | 1.64 |
| | イタリア | 3,537,679 | 1.33 |
| | ドイツ | 3,385,781 | 1.28 |
| | スペイン | 3,320,852 | 1.25 |
| | カナダ | 2,728,464 | 1.03 |
| | アイスランド | 2,639,666 | 0.99 |
| | フィンランド | 2,348,211 | 0.89 |
| | ルクセンブルグ | 2,306,680 | 0.87 |
| | オランダ | 2,115,188 | 0.80 |
| | インドネシア | 1,600,698 | 0.60 |
| | ケイマン諸島 | 1,518,887 | 0.57 |
| | イスラエル | 1,341,412 | 0.51 |
| | フランス | 1,316,419 | 0.50 |
| | アイルランド | 1,128,583 | 0.43 |
| | 南アフリカ | 1,120,073 | 0.42 |
| | モロッコ | 828,800 | 0.31 |
| | アルゼンチン | 645,060 | 0.24 |
| | カザフスタン | 545,458 | 0.21 |
| 国債 | 米国 | 32,086,205 | 12.09 |
| | スロベニア | 7,005,920 | 2.64 |
| | 日本 | 6,105,775 | 2.30 |
| | クロアチア | 4,897,579 | 1.85 |
| | シンガポール | 4,604,727 | 1.74 |
| | ブルガリア | 4,300,957 | 1.62 |
| | ブラジル | 3,917,174 | 1.48 |
| | イタリア | 2,989,437 | 1.13 |
| | オーストラリア | 2,880,591 | 1.09 |
| | メキシコ | 2,486,846 | 0.94 |
| | ポーランド | 2,462,633 | 0.93 |
| | 南アフリカ | 2,200,999 | 0.83 |
| | ロシア | 2,125,928 | 0.80 |
| | カナダ | 1,975,415 | 0.74 |
| | アイスランド | 1,761,594 | 0.66 |
| | ドミニカ共和国 | 1,631,543 | 0.61 |
| | アルゼンチン | 1,581,380 | 0.60 |
| | ルーマニア | 1,552,142 | 0.59 |
| | パキスタン | 1,516,200 | 0.57 |
| | ポルトガル | 1,467,864 | 0.55 |
| | ジャマイカ | 1,307,849 | 0.49 |
| | セルビア | 1,230,335 | 0.46 |
| | ハンガリー | 1,148,196 | 0.43 |

| | | | |
|-----------------|----------|--------------------------------|-------------|
| | コートジボワール | 967,360 | 0.36 |
| | インドネシア | 851,865 | 0.32 |
| | ジンバブエ | 551,259 | 0.21 |
| | ケニア | 285,108 | 0.11 |
| GNMA2担保証券 | 米国 | 679,855 | 0.26 |
| その他資産 担保証券 | 米国 | 8,914,597 | 3.36 |
| | オーストラリア | 425,633 | 0.16 |
| MBS | 米国 | 4,986,999 | 1.88 |
| ホールローンCMO | 米国 | 7,751,798 | 2.92 |
| FNMA担保証券 | 米国 | 29,706,493 | 11.20 |
| 小計 | | 237,771,010 | 89.62 |
| 現金・その他資産(負債控除後) | | 27,537,515 | 10.38 |
| 資産総額 | | 265,308,525 | 100.00 |
| 負債総額 | | - 15,835,041 | - 5.97 (注2) |
| 純資産総額 | | 249,473,484 (約29,061,166千円) | 94.03 (注3) |

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。以下同じ。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。以下同じ。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。以下同じ。

[次へ](#)

(2) 運用実績

純資産等の推移

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|--------|------------|--------|------------|---------------------|--------|--------|
| | 千英ポンド | 千円 | 千英ポンド | 千円 | 英ポンド | 円 | |
| 2016年1月末日 | 76,758 | 10,976,394 | 76,482 | 10,936,926 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 1.8828 | 269.24 |
| 2月末日 | 76,125 | 10,885,875 | 75,808 | 10,840,544 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 1.8834 | 269.33 |
| 3月末日 | 77,045 | 11,017,435 | 76,668 | 10,963,524 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 1.9229 | 274.97 |
| 4月末日 | 77,327 | 11,057,761 | 76,842 | 10,988,406 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 1.9477 | 278.52 |
| 5月末日 | 75,260 | 10,762,180 | 74,376 | 10,635,768 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 1.9639 | 280.84 |
| 6月末日 | 72,299 | 10,338,757 | 71,731 | 10,257,533 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 1.9433 | 277.89 |
| 7月末日 | 75,345 | 10,774,335 | 75,094 | 10,738,442 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.0365 | 291.22 |
| 8月末日 | 77,643 | 11,102,949 | 77,287 | 11,052,041 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.1013 | 300.49 |
| 9月末日 | 77,782 | 11,122,826 | 77,349 | 11,060,907 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.1306 | 304.68 |
| 10月末日 | 78,767 | 11,263,681 | 78,551 | 11,232,793 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.2009 | 314.73 |
| 11月末日 | 73,337 | 10,487,191 | 72,379 | 10,350,197 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.1713 | 310.50 |
| 12月末日 | 74,343 | 10,631,049 | 74,136 | 10,601,448 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.2640 | 323.75 |

2. グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|---------------------|--------|--------|
| | 千英ポンド | 千円 | 千英ポンド | 千円 | 英ポンド | | 円 |
| 2016年1月末日 | 139,251 | 19,912,893 | 138,838 | 19,853,834 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.6669 | 381.37 |
| 2月末日 | 139,784 | 19,989,112 | 139,218 | 19,908,174 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.7028 | 386.50 |
| 3月末日 | 142,285 | 20,346,755 | 141,521 | 20,237,503 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.7666 | 395.62 |
| 4月末日 | 140,316 | 20,065,188 | 138,468 | 19,800,924 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.7689 | 395.95 |
| 5月末日 | 135,079 | 19,316,297 | 133,913 | 19,149,559 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.7904 | 399.03 |
| 6月末日 | 134,383 | 19,216,769 | 133,301 | 19,062,043 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.8147 | 402.50 |
| 7月末日 | 151,966 | 21,731,138 | 151,414 | 21,652,202 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 2.9548 | 422.54 |
| 8月末日 | 157,670 | 22,546,810 | 156,838 | 22,427,834 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 3.0113 | 430.62 |
| 9月末日 | 164,702 | 23,552,386 | 159,300 | 22,779,900 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 3.0469 | 435.71 |
| 10月末日 | 164,566 | 23,532,938 | 164,209 | 23,481,887 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 3.0806 | 440.53 |
| 11月末日 | 128,870 | 18,428,410 | 127,270 | 18,199,610 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 3.0318 | 433.55 |
| 12月末日 | 135,750 | 19,412,250 | 135,132 | 19,323,876 | クラスB(無分配型) 英ポンド建 | 3.1755 | 454.10 |

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 263,425 | 30,686,378 | 260,026 | 30,290,429 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3342 | 155.42 |
| 2月末日 | 266,657 | 31,062,874 | 259,068 | 30,178,831 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3705 | 159.65 |
| 3月末日 | 283,989 | 33,081,879 | 283,288 | 33,000,219 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4754 | 171.87 |
| 4月末日 | 281,965 | 32,846,103 | 280,318 | 32,654,244 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4917 | 173.77 |
| 5月末日 | 288,579 | 33,616,568 | 284,851 | 33,182,293 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5096 | 175.85 |
| 6月末日 | 278,131 | 32,399,480 | 267,731 | 31,187,984 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5121 | 176.14 |
| 7月末日 | 278,623 | 32,456,793 | 277,719 | 32,351,486 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5843 | 184.56 |
| 8月末日 | 279,212 | 32,525,406 | 278,253 | 32,413,692 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5937 | 185.65 |
| 9月末日 | 283,490 | 33,023,750 | 277,675 | 32,346,361 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5918 | 185.43 |
| 10月末日 | 258,433 | 30,104,860 | 255,813 | 29,799,656 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5217 | 177.26 |
| 11月末日 | 282,781 | 32,941,159 | 275,888 | 32,138,193 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6547 | 192.76 |
| 12月末日 | 292,094 | 34,026,030 | 284,241 | 33,111,234 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6884 | 196.68 |

4. グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|---------|----------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 497,296 | 57,930,011 | 490,394 | 57,125,997 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 23.6946 | 2,760.18 |
| 2月末日 | 400,145 | 46,612,891 | 482,295 | 56,182,545 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 23.7964 | 2,772.04 |
| 3月末日 | 516,520 | 60,169,415 | 515,442 | 60,043,839 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 25.2851 | 2,945.46 |
| 4月末日 | 524,196 | 61,063,592 | 522,833 | 60,904,816 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 25.6875 | 2,992.34 |
| 5月末日 | 526,722 | 61,357,846 | 518,272 | 60,373,505 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 25.7519 | 2,999.84 |
| 6月末日 | 498,554 | 58,076,555 | 477,408 | 55,613,258 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 25.8646 | 3,012.97 |
| 7月末日 | 486,312 | 56,650,485 | 484,164 | 56,400,264 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 26.7308 | 3,113.87 |
| 8月末日 | 430,436 | 50,141,490 | 428,692 | 49,938,331 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 26.9060 | 3,134.28 |
| 9月末日 | 430,630 | 50,164,089 | 423,431 | 49,325,477 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 26.7396 | 3,114.90 |
| 10月末日 | 397,609 | 46,317,472 | 393,572 | 45,847,202 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 26.2312 | 3,055.67 |
| 11月末日 | 433,593 | 50,509,249 | 419,521 | 48,870,001 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 27.7999 | 3,238.41 |
| 12月末日 | 422,302 | 49,193,960 | 410,492 | 47,818,213 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 28.2621 | 3,292.25 |

5. グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千ユーロ | 千円 | 千ユーロ | 千円 | ユーロ | | 円 |
| 2016年1月末日 | 545,750 | 66,963,525 | 540,742 | 66,349,043 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1291 | 261.24 |
| 2月末日 | 516,925 | 63,426,698 | 514,936 | 63,182,647 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.0671 | 253.63 |
| 3月末日 | 518,522 | 63,622,649 | 513,242 | 62,974,793 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1141 | 259.40 |
| 4月末日 | 505,579 | 62,034,543 | 503,528 | 61,782,886 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1068 | 258.50 |
| 5月末日 | 523,127 | 64,187,683 | 515,798 | 63,288,415 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1730 | 266.63 |
| 6月末日 | 453,626 | 55,659,910 | 444,781 | 54,574,629 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.0439 | 250.79 |
| 7月末日 | 456,560 | 56,019,912 | 455,022 | 55,831,199 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1112 | 259.04 |
| 8月末日 | 437,468 | 53,677,324 | 434,978 | 53,371,801 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1078 | 258.63 |
| 9月末日 | 429,713 | 52,725,785 | 421,006 | 51,657,436 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1062 | 258.43 |
| 10月末日 | 409,072 | 50,193,134 | 407,541 | 50,005,281 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.0774 | 254.90 |
| 11月末日 | 353,463 | 43,369,910 | 342,272 | 41,996,774 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.0450 | 250.92 |
| 12月末日 | 352,482 | 43,249,541 | 348,232 | 42,728,066 | クラスB(無分配型) ユーロ建 | 2.1446 | 263.14 |

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

| | 資産総額 | 純資産総額 | 1株当たり純資産価格 | |
|-----------|------------|------------|--------------------|------------------|
| | 千円 | 千円 | 米ドル | 円 |
| 2016年1月末日 | 26,895,999 | 26,761,088 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1706 136.36 |
| 2月末日 | 24,808,412 | 24,287,370 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.0532 122.69 |
| 3月末日 | 23,224,238 | 23,088,433 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.0924 127.25 |
| 4月末日 | 22,392,225 | 22,294,337 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.0847 126.36 |
| 5月末日 | 22,209,366 | 21,999,359 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1082 129.09 |
| 6月末日 | 18,371,661 | 17,377,720 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.9986 116.33 |
| 7月末日 | 16,196,837 | 15,975,678 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.0817 126.01 |
| 8月末日 | 15,446,129 | 15,386,004 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.0975 127.85 |
| 9月末日 | 14,910,177 | 14,662,656 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1006 128.21 |
| 10月末日 | 15,264,489 | 15,223,624 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1646 135.66 |
| 11月末日 | 16,076,713 | 15,762,695 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.2289 143.15 |
| 12月末日 | 15,904,983 | 15,638,000 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.2706 148.01 |

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 152,559 | 17,771,598 | 151,232 | 17,617,016 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.6684 | 310.84 |
| 2月末日 | 149,256 | 17,386,831 | 146,204 | 17,031,304 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.6457 | 308.20 |
| 3月末日 | 161,346 | 18,795,196 | 161,056 | 18,761,413 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.9330 | 341.67 |
| 4月末日 | 159,970 | 18,634,905 | 159,564 | 18,587,610 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.9233 | 340.54 |
| 5月末日 | 153,850 | 17,921,987 | 152,353 | 17,747,601 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.8777 | 335.22 |
| 6月末日 | 145,833 | 16,988,086 | 141,590 | 16,493,819 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.9141 | 339.46 |
| 7月末日 | 137,314 | 15,995,708 | 136,745 | 15,929,425 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 3.1002 | 361.14 |
| 8月末日 | 121,362 | 14,137,459 | 120,941 | 14,088,417 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 3.1543 | 367.44 |
| 9月末日 | 122,710 | 14,294,488 | 120,627 | 14,051,839 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 3.1850 | 371.02 |
| 10月末日 | 116,038 | 13,517,267 | 115,263 | 13,426,987 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 3.1318 | 364.82 |
| 11月末日 | 112,097 | 13,058,180 | 108,971 | 12,694,032 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 3.0547 | 355.84 |
| 12月末日 | 105,660 | 12,308,333 | 103,511 | 12,057,996 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 3.0172 | 351.47 |

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 555,683 | 64,731,513 | 525,196 | 61,180,082 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7267 | 84.65 |
| 2月末日 | 537,633 | 62,628,868 | 527,395 | 61,436,244 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7232 | 84.25 |
| 3月末日 | 621,773 | 72,430,337 | 593,379 | 69,122,720 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8074 | 94.05 |
| 4月末日 | 589,851 | 68,711,743 | 587,889 | 68,483,190 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8140 | 94.82 |
| 5月末日 | 577,229 | 67,241,406 | 568,823 | 66,262,191 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7864 | 91.61 |
| 6月末日 | 575,799 | 67,074,826 | 562,762 | 65,556,145 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8110 | 94.47 |
| 7月末日 | 577,683 | 67,294,293 | 575,976 | 67,095,444 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8567 | 99.80 |
| 8月末日 | 571,841 | 66,613,758 | 568,340 | 66,205,927 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8722 | 101.60 |
| 9月末日 | 582,719 | 67,880,936 | 575,700 | 67,063,293 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8842 | 103.00 |
| 10月末日 | 568,633 | 66,240,058 | 565,147 | 65,833,974 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8843 | 103.01 |
| 11月末日 | 579,295 | 67,482,075 | 568,625 | 66,239,126 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8529 | 99.35 |
| 12月末日 | 572,292 | 66,666,295 | 563,654 | 65,660,054 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8499 | 99.00 |

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 128,308 | 14,946,599 | 127,688 | 14,874,375 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3584 | 158.24 |
| 2月末日 | 128,158 | 14,929,125 | 127,284 | 14,827,313 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3514 | 157.42 |
| 3月末日 | 139,565 | 16,257,927 | 139,242 | 16,220,301 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4852 | 173.01 |
| 4月末日 | 137,047 | 15,964,605 | 136,694 | 15,923,484 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4721 | 171.48 |
| 5月末日 | 136,594 | 15,911,835 | 134,862 | 15,710,074 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4676 | 170.96 |
| 6月末日 | 136,640 | 15,917,194 | 135,802 | 15,819,575 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5178 | 176.81 |
| 7月末日 | 127,957 | 14,905,711 | 127,470 | 14,848,980 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5905 | 185.28 |
| 8月末日 | 128,584 | 14,978,750 | 127,992 | 14,909,788 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5548 | 181.12 |
| 9月末日 | 127,156 | 14,812,402 | 126,492 | 14,735,053 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5385 | 179.22 |
| 10月末日 | 116,463 | 13,566,775 | 115,961 | 13,508,297 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4240 | 165.88 |
| 11月末日 | 134,324 | 15,647,403 | 132,648 | 15,452,166 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3933 | 162.31 |
| 12月末日 | 134,845 | 15,708,094 | 133,761 | 15,581,819 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4203 | 165.45 |

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 309,142 | 36,011,952 | 304,651 | 35,488,795 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.0219 | 235.53 |
| 2月末日 | 307,978 | 35,876,357 | 296,853 | 34,580,406 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.0176 | 235.03 |
| 3月末日 | 320,704 | 37,358,809 | 319,998 | 37,276,567 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.1417 | 249.49 |
| 4月末日 | 320,630 | 37,350,189 | 319,498 | 37,218,322 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.1542 | 250.94 |
| 5月末日 | 319,103 | 37,172,308 | 313,205 | 36,485,250 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.1621 | 251.86 |
| 6月末日 | 290,886 | 33,885,310 | 277,289 | 32,301,396 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.1303 | 248.16 |
| 7月末日 | 283,194 | 32,989,269 | 282,355 | 32,891,534 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.2218 | 258.82 |
| 8月末日 | 269,791 | 31,427,954 | 268,587 | 31,287,700 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.2369 | 260.58 |
| 9月末日 | 275,003 | 32,035,099 | 265,231 | 30,896,759 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.2418 | 261.15 |
| 10月末日 | 245,422 | 28,589,209 | 242,118 | 28,204,326 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.1774 | 253.65 |
| 11月末日 | 311,303 | 36,263,686 | 303,683 | 35,376,033 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.1901 | 255.12 |
| 12月末日 | 308,806 | 35,972,811 | 302,061 | 35,187,086 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 2.2483 | 261.90 |

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|---|---|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 303,915 | 35,403,058 | 301,167 | 35,082,944 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 2月末日 | 304,597 | 35,482,505 | 297,561 | 34,662,881 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 3月末日 | 282,500 | 32,908,425 | 281,922 | 32,841,094 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 4月末日 | 282,268 | 32,881,399 | 281,826 | 32,829,911 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 5月末日 | 290,201 | 33,805,514 | 278,551 | 32,448,406 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 6月末日 | 278,756 | 32,472,286 | 271,246 | 31,597,447 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 7月末日 | 268,514 | 31,279,196 | 267,801 | 31,196,138 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 8月末日 | 284,223 | 33,109,137 | 283,173 | 32,986,823 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 9月末日 | 287,054 | 33,438,920 | 281,065 | 32,741,262 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 10月末日 | 265,455 | 30,922,853 | 263,463 | 30,690,805 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 11月末日 | 230,698 | 26,874,010 | 209,058 | 24,353,166 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |
| 12月末日 | 213,774 | 24,902,533 | 201,720 | 23,498,363 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | - | - |

(注) クラスB(無分配型)米ドル建は、2016年12月末日現在、運用の実績がない。

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 347,608 | 40,492,856 | 344,070 | 40,080,714 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1006 | 128.21 |
| 2月末日 | 345,426 | 40,238,675 | 337,750 | 39,344,498 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1038 | 128.58 |
| 3月末日 | 343,791 | 40,048,214 | 343,316 | 39,992,881 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1317 | 131.83 |
| 4月末日 | 349,569 | 40,721,293 | 348,947 | 40,648,836 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1443 | 133.30 |
| 5月末日 | 380,027 | 44,269,345 | 345,355 | 40,230,404 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1486 | 133.80 |
| 6月末日 | 337,489 | 39,314,094 | 328,070 | 38,216,874 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1647 | 135.68 |
| 7月末日 | 319,556 | 37,225,078 | 318,953 | 37,154,835 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1859 | 138.15 |
| 8月末日 | 383,869 | 44,716,900 | 382,785 | 44,590,625 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1939 | 139.08 |
| 9月末日 | 410,287 | 47,794,333 | 384,109 | 44,744,857 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1897 | 138.59 |
| 10月末日 | 372,904 | 43,439,587 | 370,136 | 43,117,143 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1805 | 137.52 |
| 11月末日 | 388,750 | 45,285,488 | 346,576 | 40,372,638 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1588 | 134.99 |
| 12月末日 | 374,871 | 43,668,723 | 345,787 | 40,280,728 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.1659 | 135.82 |

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|-------------|---------|-------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 863,772 | 100,620,800 | 854,365 | 99,524,979 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4893 | 173.49 |
| 2月末日 | 878,631 | 102,351,725 | 854,030 | 99,485,955 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5018 | 174.94 |
| 3月末日 | 900,258 | 104,871,054 | 898,966 | 104,720,549 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5620 | 181.96 |
| 4月末日 | 945,722 | 110,167,156 | 943,129 | 109,865,097 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6131 | 187.91 |
| 5月末日 | 960,839 | 111,928,135 | 934,629 | 108,874,932 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6190 | 188.60 |
| 6月末日 | 900,600 | 104,910,894 | 869,953 | 101,340,825 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6314 | 190.04 |
| 7月末日 | 911,297 | 106,156,988 | 909,561 | 105,954,761 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6725 | 194.83 |
| 8月末日 | 963,997 | 112,296,011 | 960,797 | 111,923,243 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7097 | 199.16 |
| 9月末日 | 997,950 | 116,251,196 | 966,699 | 112,610,767 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7167 | 199.98 |
| 10月末日 | 929,747 | 108,306,228 | 921,720 | 107,371,163 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7275 | 201.24 |
| 11月末日 | 965,145 | 112,429,741 | 940,978 | 109,614,527 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7175 | 200.07 |
| 12月末日 | 963,275 | 112,211,905 | 939,561 | 109,449,461 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7492 | 203.76 |

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 253,685 | 29,551,766 | 250,390 | 29,167,931 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3846 | 161.29 |
| 2月末日 | 250,198 | 29,145,565 | 242,357 | 28,232,167 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.3864 | 161.50 |
| 3月末日 | 247,069 | 28,781,068 | 246,591 | 28,725,386 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4110 | 164.37 |
| 4月末日 | 250,506 | 29,181,444 | 250,073 | 29,131,004 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4083 | 164.05 |
| 5月末日 | 348,591 | 40,607,366 | 248,008 | 28,890,452 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4124 | 164.53 |
| 6月末日 | 250,770 | 29,212,197 | 240,954 | 28,068,731 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4634 | 170.47 |
| 7月末日 | 236,693 | 27,572,368 | 236,109 | 27,504,337 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4815 | 172.58 |
| 8月末日 | 227,470 | 26,497,980 | 226,774 | 26,416,903 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5206 | 177.13 |
| 9月末日 | 337,303 | 39,292,426 | 224,764 | 26,182,758 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5243 | 177.57 |
| 10月末日 | 208,203 | 24,253,567 | 206,193 | 24,019,423 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.5085 | 175.73 |
| 11月末日 | 291,278 | 33,930,974 | 150,851 | 17,572,633 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4772 | 172.08 |
| 12月末日 | 268,984 | 31,333,946 | 148,889 | 17,344,080 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.4928 | 173.90 |

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 209,810 | 24,440,767 | 206,969 | 24,109,819 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6705 | 194.60 |
| 2月末日 | 213,070 | 24,820,524 | 206,262 | 24,027,460 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6958 | 197.54 |
| 3月末日 | 215,603 | 25,115,593 | 215,128 | 25,060,261 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7470 | 203.51 |
| 4月末日 | 228,665 | 26,637,186 | 225,605 | 26,280,726 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7779 | 207.11 |
| 5月末日 | 235,622 | 27,447,607 | 229,772 | 26,766,140 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7758 | 206.86 |
| 6月末日 | 230,739 | 26,878,786 | 221,808 | 25,838,414 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.8265 | 212.77 |
| 7月末日 | 226,313 | 26,363,201 | 225,644 | 26,285,270 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.8656 | 217.32 |
| 8月末日 | 284,813 | 33,177,866 | 282,289 | 32,883,846 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.9060 | 222.03 |
| 9月末日 | 305,887 | 35,632,777 | 297,391 | 34,643,078 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.9088 | 222.36 |
| 10月末日 | 278,343 | 32,424,176 | 275,508 | 32,093,927 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.8880 | 219.93 |
| 11月末日 | 293,423 | 34,180,845 | 284,830 | 33,179,847 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.8088 | 210.71 |
| 12月末日 | 288,224 | 33,575,214 | 278,968 | 32,496,982 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.8307 | 213.26 |

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|-------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 72,122 | 8,401,492 | 71,737 | 8,356,643 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.6852 | 79.82 |
| 2月末日 | 74,646 | 8,695,513 | 71,312 | 8,307,135 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.6935 | 80.79 |
| 3月末日 | 72,784 | 8,478,608 | 71,966 | 8,383,319 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7715 | 89.87 |
| 4月末日 | 79,068 | 9,210,631 | 78,510 | 9,145,630 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7970 | 92.84 |
| 5月末日 | 77,593 | 9,038,809 | 76,857 | 8,953,072 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7490 | 87.25 |
| 6月末日 | 79,488 | 9,259,557 | 78,824 | 9,182,208 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7998 | 93.17 |
| 7月末日 | 79,195 | 9,225,426 | 78,912 | 9,192,459 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8035 | 93.60 |
| 8月末日 | 77,112 | 8,982,777 | 76,698 | 8,934,550 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8009 | 93.30 |
| 9月末日 | 71,434 | 8,321,347 | 70,776 | 8,244,696 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8182 | 95.31 |
| 10月末日 | 87,679 | 10,213,727 | 87,439 | 10,185,769 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.8109 | 94.46 |
| 11月末日 | 110,782 | 12,904,995 | 109,079 | 12,706,613 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7514 | 87.53 |
| 12月末日 | 114,277 | 13,312,128 | 112,761 | 13,135,529 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 0.7683 | 89.50 |

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

| | 資産総額 | | 純資産総額 | | 1株当たり純資産価格 | | |
|-----------|---------|------------|---------|------------|--------------------|--------|--------|
| | 千米ドル | 千円 | 千米ドル | 千円 | 米ドル | | 円 |
| 2016年1月末日 | 309,548 | 36,059,247 | 303,190 | 35,318,603 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6626 | 193.68 |
| 2月末日 | 306,219 | 35,671,451 | 294,770 | 34,337,757 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6609 | 193.48 |
| 3月末日 | 305,986 | 35,644,309 | 304,888 | 35,516,403 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.6938 | 197.31 |
| 4月末日 | 307,652 | 35,838,381 | 307,084 | 35,772,215 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7034 | 198.43 |
| 5月末日 | 321,306 | 37,428,936 | 289,270 | 33,697,062 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7110 | 199.31 |
| 6月末日 | 289,519 | 33,726,068 | 275,168 | 32,054,320 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7136 | 199.62 |
| 7月末日 | 280,320 | 32,654,477 | 279,778 | 32,591,339 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7258 | 201.04 |
| 8月末日 | 268,408 | 31,266,848 | 267,738 | 31,188,800 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7406 | 202.76 |
| 9月末日 | 284,129 | 33,098,187 | 266,018 | 30,988,437 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7427 | 203.01 |
| 10月末日 | 261,699 | 30,485,317 | 258,932 | 30,162,989 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7494 | 203.79 |
| 11月末日 | 290,883 | 33,884,961 | 260,038 | 30,291,827 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7412 | 202.83 |
| 12月末日 | 265,309 | 30,905,845 | 249,473 | 29,061,110 | クラスB(無分配型) 米ドル建 | 1.7496 | 203.81 |

分配の推移

いずれのファンド証券クラスも無分配型クラスであって分配は行われなため、分配の推移に該当する事項はない。

[次へ](#)

自己資本利益率(収益率)の推移

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド クラスB(無分配型)英ポンド建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 15.83 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配落の額)

(注2) 当該ファンド証券は2012年8月21日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

2. グローバル・アクセス ユーケー・オパチュニティーズ・ファンド クラスB(無分配型)英ポンド建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 14.74 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配落の額)

(注2) 当該ファンド証券は2004年10月14日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 16.23 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配落の額)

(注2) 当該ファンド証券は2013年7月9日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

4. グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 11.40 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2015年5月20日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

5. グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド クラスB(無分配型)ユーロ建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | -6.27 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2004年10月14日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | -0.34 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2015年5月20日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 5.54 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配落の額)

(注2) 当該ファンド証券は2004年10月14日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 10.18 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配落の額)

(注2) 当該ファンド証券は2007年9月6日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | -2.46 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配落の額)

(注2) 当該ファンド証券は2015年5月21日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 4.09 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2011年12月13日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | - |

(注) 当該ファンド証券は2016年12月末日現在において運用の実績がない。

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 6.29 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2014年9月29日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 16.10 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2010年2月24日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド クラスB (無分配型) 米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 9.76 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2010年3月10日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド クラスB (無分配型) 米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 9.25 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2008年1月11日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド クラスB (無分配型) 米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 11.85 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2013年4月11日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスB (無分配型) 米ドル建

| 期間 | 収益率(%) |
|----------------------|--------|
| 2016年1月1日～2016年12月末日 | 4.87 |

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

a = 当該期間末の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格(もし分配があれば、分配額の額)

(注2) 当該ファンド証券は2015年5月22日に運用を開始した。

(注3) 当該ファンド証券については分配は行われていない。

(注4) 当該期間末の1株当たり純資産価格または当該期間の直前の日の1株当たり純資産価格のいずれかがない場合については収益率は算出していない。

(3) 投資リスク

本書提出日現在、平成28年11月30日提出の有価証券報告書、第一部ファンド情報 第1ファンドの状況 3 投資リスク、に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、本書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

a. 名称

パークレイズ・バンク・ピーエルシー (Barclays Bank PLC) (「投資運用会社」)

b. 資本金の額

平成28年12月31日現在の資本金総額は、2,344,652,515英ポンド、46,063,300米ドルおよび3,185,600ユーロの合計額(計約3,410億円)

(2) 大株主の状況

(2016年12月31日現在)

| 名称 | 住所 | 所有株式数(株) | 比率 (%) |
|--|--|--|------------------|
| パークレイズ・ ピーエルシー (Barclays PLC) | 英国、ロンドン、E14、チャーチル・ プレイス1 (1 Churchill Place, London E14 5HP, UK) | 1英ポンド優先株式 1,000株 1英ポンド普通株式 2,342,558,515株 | 100% 100% |
| BNY(ノミニ ーズ)・リミテッド (BNY(Nominees) Limited) | 英国、ロンドン、EC4V 4LA、クイ ーン・ヴィクトリア・ストリート160 (160 Queen Victoria Street, London EC4V 4LA, UK) | 0.25米ドル優先株式 161,000,000株 100米ドル優先株式 58,133株 | 100% 100% |
| クリアストリー ム・ノミニーズ・ リミテッド (Clearstream Nominees Limited) | 英国、ロンドン、E14 4HE、カナ リー・ワーフ、ウェストフェリー・ サーカス11 (11 Westferry Circus, Canary Wharf, London E14 4HE, UK) | 100ユーロ優先株式 19,684株 | 61.79% |
| ユーロクリア・ノ ミニーズ・リミ テッド (Euroclear Nominees Ltd) | 英国、ロンドン、EC4M 5SB、キャ ノン・ストリート33 (33 Cannon Street, London EC4M 5SB, UK) | 100ユーロ優先株式 12,172株 | 38.21% |
| ザ・バンク・オ ブ・ニューヨー ク・デポジトリ (ノミニーズ)リ ミテッド (The Bank of New York Depository (Nominees) Limited) | 英国、ロンドン、EC4V 4LA、クイ ーン・ヴィクトリア・ストリート160 (160 Queen Victoria Street, London EC4V 4LA, UK) | 100英ポンド優先株式 20,930株 | 100% |

(3) 役員 の 状況

(2016年12月31日現在)

| 氏名 | 役職名 | 主要略歴 | 所有株式 |
|---|--------------------------------------|--|------|
| ジョン・マクファーレン (John McFarlane) | 会長 (Chairman) | <p>ジョン・マクファーレンは、グローバル・バンキングおよび金融サービス業界において上級職を務めており、かかる分野において、40年の経験(主要な取締役としての20年の経験、最高経営責任者(CEO)としての10年の経験および会長を務めた近年の期間を含む。)を有する。</p> <p>ジョンは、パークレイズ・ピーエルシー(Barclays PLC)の会長であり、ウェストフィールド・ホールディングス(Westfield Holdings)およびオールド・オーク・ホールディングス(Old Oak Holdings)の非業務執行取締役でもある。ジョンは、ザ・シティUK(TheCityUK)の会長であり、金融サービス取引および投資委員会と欧州金融円卓会議のメンバーである。</p> <p>ジョンは、以前はアヴィヴァ・ピーエルシー(Aviva plc)の会長を務めており、同社では会社、委員会および経営の変革を監督し、アヴィヴァ社は英国の優良金融機関の一つとなった。同氏は、ファーストグループ・ピーエルシー(FirstGroup plc)の会長も短期間務めた。</p> <p>所属委員会および役職 取締役指名委員会 議長</p> | なし |
| ジェームス・エドワード・ステイラー (James Edward Staley) | グループ最高責任者 (Group Chief Executive) | <p>ジェス・ステイラー氏は、2015年12月1日にグループ最高責任者としてパークレイズに入社した。</p> <p>ステイラー氏は、銀行および金融サービス業界において約40年の豊富な経験を有している。同氏は、J.P.モルガン(J.P.Morgan)に30年以上勤務し、コマーシャル・バンカーとしてキャリアをスタートした後、株式、プライベート・バンキング、資産管理などの主要部門、最終的にはグローバル・インベストメント・バンクの責任者を歴任した。現在はブルーマウンテン・キャピタル(BlueMountain Capital)のマネージング・パートナーを務めている。</p> <p>ステイラー氏は、ボウディン大学にて経営学の学士号を取得した。</p> | なし |

| | | | |
|--|--|--|-----------|
| <p>マイケル・セント・ジョン・アシュリー (Michael St Jhon Ashley)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>マイクは、2013年9月に非業務執行取締役として取締役会に参加した。</p> <p>同氏は以前、KPMGの世界的なネットワークの一部を構成していたKPMGヨーロッパLLP(KPMG Europe LLP)(ELLP)の品質およびリスク管理部門の代表を務め、同氏の責任には専門的なリスク管理および品質管理が含まれていた。同氏は、ELLPの取締役会のメンバーであり、英国KPMGの倫理担当パートナーでもあった。マイクは、監査パートナーとして20年を超える経験を有し、その間、最近ではHSBCホールディングス(HSBC Holdings)およびスタンダードチャータード・ピーエルシー(Standard Chartered PLC)などの複数の大手金融サービスグループや、イングランド銀行の主要監査パートナーであった。マイクは、大手の世界的な銀行での具体的な経験と共に、監査および関連する規制上の問題について深い理解を有する。</p> <p>所属委員会および役職</p> <p>取締役監査委員会 議長</p> <p>取締役指名委員会</p> <p>取締役リスク委員会</p> <p>その他、主要な社外における現職</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ イングランド・ウェールズ勅許会計士協会 (Institute of Chartered Accountants in England and Wales) の倫理基準委員会 委員 ・ 英国財務省(HM Treasury)の監査委員会 委員 ・ 欧州財務報告諮問グループ(European Financial Reporting Advisory Group)の技術専門家グループ 副会長 ・ 政府内部監査機関(Government Internal Audit Agency)会長 ・ チャリティ・コミッション(Charity Commission)の理事会 理事 | <p>なし</p> |
|--|--|--|-----------|

| | | | |
|--|--|---|-----------|
| <p>ティモシー・ジェームズ・ブリードン (Timothy James Breedon)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>ティムは、2012年11月に非業務執行取締役として取締役会に任命された。</p> <p>ティムは、リーガル・アンド・ジェネラル・グループ・ピーエルシー (Legal & General Group plc) (L&G) において様々な職務を歴任した後、グループの取締役(投資担当)として同社の取締役会に参加し、グループの最高経営責任者となり、2006年1月から2012年6月まで同職に就いていた。</p> <p>ティムは、英国保険業者協会 (Association of British Insurers) (ABI) の理事を務め、同協会の会長も務めた。同氏はまた、英国におけるオルタナティブ債券市場の発展に対する構造的および行動的な障壁を調査する業界主導の特別調査委員会である英国政府のノンバンク融資特別調査委員会の会長を務めた。ティムは、財務報告評議会 (Financial Reporting Council) の理事を務め、投資運用業協会 (Investment Management Association) の理事を務めた。ティムは、金融サービスにおいて25年を超える経験を有し、規制当局および政府との関係について幅広い知識および経験を有する。同氏は、英国およびEUの規制環境およびリスク管理の理解と共に、金融サービス会社を主導する経験および知識を取締役会にもたらした。同氏がL&GおよびABIの両社において得た顧客重視および投資者へのサービスの理解は、パークレイズにとって重要である。</p> <p>所属委員会および役職</p> <p>取締役リスク委員会 議長</p> <p>取締役指名委員会</p> <p>取締役監査委員会</p> <p>取締役報酬委員会</p> <p>その他、主要な社外における現職</p> <p>・アパックス・グローバル・アルファ・リミテッド (Apax Global Alpha Limited) 取締役</p> | <p>なし</p> |
|--|--|---|-----------|

| | | | |
|---|--|--|-----------|
| <p>クロフォード・スコット・ギリス (Crawford Scott Gillies)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>クロフォードは、2014年5月に非業務執行取締役として取締役会に参加した。</p> <p>クロフォードは、30年を超える事業および経営の経験を有する。最初は、国際的経営コンサルタント企業であるベイン・アンド・カンパニー(Bain & Company)において2001年から2005年までヨーロッパ担当マネージング・ディレクターを務めた。ベインに在籍中、同氏は、複数のセクターにわたり英国、欧州大陸および北米の大手企業に業務を提供した。2007年から2016年の間、同氏は、スタンダード・ライフ・ピーエルシー(Standard Life plc)の取締役会に在籍し、報酬委員会の会長を務めている。同氏は、法律事務所であるハモンズ(Hammonds)(現在のスクワイヤ・サンダース(Squire Sanders))の会長を務め(2006年から2009年まで)、2007年からコントロール・リスク・グループ・ホールディングズ・リミテッド(Control Risks Group Holdings Ltd)の会長を務めており、革新的な医療機器会社であるタッチ・バイオニクス(Touch Bionics)の会長を務めた(2006年から2011年まで)。また、同氏は、2012年7月から2015年7月までマイティ・グループ・ピーエルシー(MITIE Group PLC)の取締役であった。同氏は、イングランドおよびスコットランドにおいて公共部門の役職に就いていた。同氏は、貿易産業省(Department of Trade & Industry)の独立メンバーを務め(2002年から2007年まで)、その監査およびリスク委員会の会長を務めた(2003年から2007年まで)。同氏は現在、スコットランド開発公社(Scottish Enterprise)の会長およびエスエスイー・ピーエルシー(SSE Plc)の上級独立取締役であり、英国産業連盟の元会長である。</p> <p>所属委員会および役職</p> <p>取締役報酬委員会 議長 取締役指名委員会 取締役監査委員会</p> <p>その他、主要な社外における現職</p> <p>・エスエスイー・ピーエルシー(SSE Plc) 非業務執行取締役</p> | <p>なし</p> |
|---|--|--|-----------|

| | | | |
|--|--|--|-----------|
| <p>ルーベン・ジェフリー三世 (Reuben Jeffery III)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>ルーベンは、2009年7月に非業務執行取締役として取締役会に参加した。</p> <p>同氏は現在、ロックフェラー・アンド・カンパニー・インク (Rockefeller & Co Inc.) およびロックフェラー・フィナンシャル・サービスズ・インク (Rockefeller Financial Services Inc.) のCEO兼社長兼取締役である。ルーベンは、経済・エネルギー・農業担当国務次官、商品先物取引委員会 (Commodity Futures Trading Commission) 委員長および国家安全保障会議 (National Security Council) スタッフ担当大統領特別補佐官として米国政府に勤務した。公職に就く前、ルーベンは、ゴールドマン・サックス・アンド・カンパニー (Goldman, Sachs & Co) に18年間勤務し、パリではゴールドマン・サックスのマネージング・パートナーを務め、ロンドンでは同社のヨーロッパ金融機関グループを主導した。ゴールドマン・サックスに入社する前、ルーベンは、デービス・ポーク・アンド・ウォードウェル (Davis Polk & Wardwell) の企業法務弁護士であった。ルーベンは、広範囲にわたる金融サービス経験 (特に投資銀行業務) を有し、さらに、米国の政治環境および規制環境に関する幅広い洞察力を有する。</p> <p>所属委員会および役職</p> <p>取締役報酬委員会 議長</p> <p>取締役指名委員会</p> <p>取締役監査委員会</p> <p>その他、主要な社外における現職</p> <ul style="list-style-type: none"> ・中国証券監督管理委員会 (China Securities Regulatory Commission) の国際諮問委員会 委員 ・タワーブルック・キャピタル・パートナーズ・エルピー (Towerbrook Capital Partners LP) の諮問委員会 委員 ・フィナンシャル・サービスズ・ボランティア・コープス (Financial Services Volunteer Corps) 取締役 ・Jロスチャイルド・キャピタル・マネジメント (J Rothschild Capital Management) の国際諮問委員会 | <p>なし</p> |
|--|--|--|-----------|

| | | | |
|--|--|--|-----------|
| <p>タシャー・ モーザリア (Tushar Morzaria)</p> | <p>グループ財務担当 取締役 (Group Finance Director)</p> | <p>タシャーは、2013年10月にグループの財務担当取締役としてパークレイズの取締役会および執行委員会に参加した。これ以前、同氏は、JPモルガン・チェース(JP Morgan Chase)の法人および投資銀行部門のCFOであった。これは、JPモルガンにおける投資銀行部門とホールセール財務/証券サービス事業部門の合併時に就いていた役職である。合併前、同氏は、投資銀行部門のCFOであり、JPモルガンでのキャリアにおいてその他の様々な職務を歴任した。タシャーは、クーパース・アンド・ライブランド・デロイト(Coopers and Lybrand Deloitte)において会計士の資格を獲得し、キャリアの大半において投資銀行業務に従事し、SGウォーバーグ(SG Warburg)、JPモルガンおよびクレディ・スイス(Credit Suisse)において様々な職務を歴任した。タシャーは、20年を超える戦略的財務管理経験を有し、これはグループの財務担当取締役としての同氏の職務において極めて重要である。</p> <p>所属委員会および役職 グループ執行委員会</p> | <p>なし</p> |
|--|--|--|-----------|

| | | | |
|---|--|--|-----------|
| <p>ダンピサ・フェリシア・モヨ (Dambisa Felicia Moyo)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>ダンピサは、2010年5月に非業務執行取締役として取締役会に参加した。</p> <p>同氏は、金融サービスの経験を有する国際的な経済学者であり、世界経済の解説者である。経済学の博士号を取得した後、同氏は、ゴールドマン・サックスの債券市場、ヘッジファンドカバレッジおよび世界的マクロ経済学チームにて勤務した。</p> <p>ダンピサは世界銀行(World Bank)での勤務経験もあり、過去にはランディン・ペトロリアムAB株式会社(Lundin Petroleum AB (publ))の非業務執行取締役を務めた。ダンピサの経済学者としての経歴、特に世界的マクロ経済問題ならびにアフリカの経済、政治および社会問題に関する知識および理解は、パークレイズの事業戦略および市民権戦略についての取締役会の議論に重要な貢献をする。</p> <p>所属委員会および役職</p> <ul style="list-style-type: none"> 取締役企業評価委員会 取締役報酬委員会 <p>その他、主要な社外における現職</p> <ul style="list-style-type: none"> ・バリック・ゴールド・コーポレーション (Barrick Gold Corporation) 非業務執行取締役 ・シーゲート・テクノロジー (Seagate Technology) 非業務執行取締役 ・シェブロン・コーポレーション (Chevron Corporation) 取締役 | <p>なし</p> |
|---|--|--|-----------|

| | | | |
|--|--|--|-----------|
| <p>ダイアン・マリー・テレーゼ・ヘレネ・デ・ミルヘ・デ・セント・ビクター (Diane Marie Therese Helene de Milhede Saint Victor)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>ダイアンは、2013年3月に非業務執行取締役に任命された。 同氏は現在、法務部長兼秘書役であり、スイスに拠点を置く国際的な電力および自動化技術の上場会社であるABBリミテッド (ABB Limited) のグループ執行委員会のメンバーである。同氏の責任には、法務・インテグリティ・グループの代表が含まれる。 同氏は以前、現在のエアバス・グループ (Airbus Group) であるヨーロッパの航空宇宙・防衛会社であるEADSグループ (EADS Group) の上級副社長兼法務部長であった。ダイアンの法務経験ならびに規制およびコンプライアンスの問題に関する知識は、取締役会およびその委員会に独自の視点を提供することを可能にしている。</p> <p>所属委員会および役職 取締役企業評価委員会</p> | <p>なし</p> |
| <p>ダイアン・リン・シュエネマン (Diane Lynn Schueneman)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>ダイアン・シュエネマンは、2015年6月に非業務執行取締役として取締役に任命された。 ダイアンは、金融サービス業界における様々な分野のグローバルなビジネス・オペレーション、顧客サービスおよびテクノロジーの管理において豊富な経験を有する。同氏は、メリルリンチ (Merrill Lynch) に37年間在籍し、同社のリテールおよびミドルマーケットの顧客に提供されるバンキング、ブローカー業務サービスおよびテクノロジーを担当する上級職を務めた。最近では、シニア・バイス・プレジデント兼グローバル・インフラストラクチャー・ソリューションズ責任者として、世界のIT、オペレーションおよび顧客サービスを担当する上級職を務めた。また、マッキンゼー・アンド・カンパニー (McKinsey & Company) のコンサルタントとして米国内国歳入長官のアドバイザーを務め、数々の非業務執行取締役を歴任した。</p> <p>その他、主要な社外における現職 ・ ICAPピーエルシー (ICAP Plc) 非業務執行取締役</p> <p>所属委員会および役職 取締役リスク委員会 取締役監査委員会</p> | <p>なし</p> |

| | | | |
|--|--|--|-----------|
| <p>スティーブ ン・ジェ ラード・ シーク (Stephene Gerrard Thieke)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non-Executive Director)</p> | <p>スティーブは、2014年1月に非業務執行取締役として取締役会に任命された。同氏は、規制および投資銀行業務の両方において40年にわたる金融サービス経験を有する。スティーブは、ニューヨーク連邦準備銀行(Federal Reserve Bank of New York)に20年間勤務し、信用および資本市場業務ならびに銀行監督において複数の上級職を務めた後、英国金融サービス機構の非業務執行取締役となった。同氏はまた、10年間勤務したJPモルガン(JP Morgan)の投資銀行業務およびリスク管理においても上級職を務めた。同氏は、債券部門の代表、グローバル・マーケットの共同代表、JPモルガン・セキュリティーズ・インク(JP Morgan Securities, Inc)の社長兼会長およびコーポレート・リスク管理グループの代表を務めた後、1999年にJPモルガンを退社した。同氏は、業務執行職および非業務執行職の両方において相当な役員職の経験を有しており、これには後に取締役会会長を務めたリスク・メトリクス・グループ(Risk Metrics Group)の取締役としての7年の経験や、PNCフィナンシャル・サービス・コーポレーション(PNC Financial Services Corp.)の取締役会における9年の経験が含まれる。</p> <p>所属委員会および役職 取締役リスク委員会 取締役報酬委員会</p> | <p>なし</p> |
|--|--|--|-----------|

| | | | |
|--|--|--|-----------|
| <p>サー・ジェリー・グリムストーン (Sir Gerry Grimstone)</p> | <p>非業務執行取締役 (Non Executive Director)</p> | <p>サー・ジェリー・グリムストーンは、パークレイズの副会長兼上級独立取締役であり、取締役会評価委員会の委員長である。</p> <p>同氏はまた、英国最大の貯蓄・投資事業の一つであるスタンダード・ライフ・ピーエルシー (Standard Life plc) の会長でもある。同氏は、デロイト・エルエルピー (Deloitte LLP) の業務執行権の無い独立取締役であり、同社において公益を代表する。</p> <p>英国の公共部門において、同氏は、国防省の業務執行権の無い主席理事であり、英国財務省の金融サービス貿易投資委員会 (Financial Services Trade and Investment Board) の委員である。2012年から2015年の間、ジェリーは、英国における金融・専門サービス業界の代表団体であるザシティUK (TheCityUK) の会長を務めた。</p> <p>ジェリーは、公共部門および民間部門の取締役職を歴任し、英国のビジネス・アンバサダーを務めた。同氏は以前、シュローダーズ (Schroders) の上級投資銀行家であり、ロンドン、ニューヨークおよびアジア太平洋地域において事業を運営していた。同氏は、世界中の大手企業の合併および買収ならびに資本調達を専門としていた。それ以前、同氏は、英国財務省の役員であり、民営化および対国営企業政策の責任者であった。</p> <p>その他、主要な社外における現職</p> <p>政府保有株式管理庁 (The Shareholder Executive)</p> <p>金融サービス貿易投資委員会 (Financial Services Trade and Investment Board)</p> <p>所属委員会および役職</p> <p>取締役企業評価委員会 議長</p> <p>取締役指名委員会</p> | <p>なし</p> |
|--|--|--|-----------|

| | | | |
|------------------------------|--------------------------------------|---|----|
| メアリー・フランシス (Mary Francis) | 非業務執行取締役 (Non-Executive Director) | メアリー・フランシスCBEは、2016年10月に非業務執行取締役として取締役会に任命された。 メアリーは、様々な業界において役員レベルの幅広い経験を有しており、現在は、スイス・リー・グループ (Swiss Re Group) およびエンスコ・ピーエルシー (Enesco plc) のボード・メンバーを務めている。同氏は以前、セントリカ (Centrica) の取締役会において社外専務取締役を務め、また、アヴィヴァ (Aviva)、ケーブル・アンド・ワイヤレス・コミュニケーションズ (Cable & Wireless Communications)、イングランド銀行 (Bank of England) およびアライアンス・アンド・レスター (Alliance & Leicester) の非業務執行取締役を務めていた。 メアリーは、行政においても抜群のキャリアを有している。同氏は、英国の大蔵省において上級公務員を12年間務め、その後は総理大臣秘書官、女王陛下付副秘書官および英国保険業者協会 (Association of British Insurers) の理事長を務めた。 所属委員会および役職 取締役企業評価委員会 取締役報酬委員会 | なし |
|------------------------------|--------------------------------------|---|----|

(4) 事業の内容及び営業の概況

パークレイズ・バンク・ピーエルシー

投資運用会社は、常に取締役会の監督および決定に従って本投資法人の資産運用につき責務を負う。

2016年11月末日現在、投資運用会社は、計4本のアイルランドの集団投資事業について、管理・運営を行っている。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、アイルランド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、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c . ファンドの原文の中間財務書類は、英ポンド、米ドルおよびユーロで表示されている。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、下記の平成28年12月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

1 英ポンド = 143.00円

1 米ドル = 116.49円

1 ユーロ = 122.70円

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

財政状態計算書

2016年11月30日現在

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | |
|---|----------------------|---------------------|----------------------|---------------------|
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 |
| 流動資産 | | | | |
| 損益を通じて公正価値評価される金融資産 | 3,756,910,468 | 537,238,197 | 3,661,322,486 | 523,569,115 |
| 担保として差し入れられた | | | | |
| 損益を通じて公正価値評価される金融資産 | 779,020 | 111,400 | 192,969 | 27,595 |
| ブローカーに対する債権 | 10,325,283 | 1,476,515 | 8,780,262 | 1,255,577 |
| その他の債権 | 124,828,957 | 17,850,541 | 53,676,810 | 7,675,784 |
| 担保として保有する現金 | 5,556,427 | 794,569 | 2,287,874 | 327,166 |
| 現金および現金同等物 | 259,171,668 | 37,061,549 | 193,376,293 | 27,652,810 |
| 流動資産合計 | 4,157,571,823 | 594,532,771 | 3,919,636,694 | 560,508,047 |
| 流動負債 | | | | |
| 損益を通じて公正価値評価される金融負債 | (41,235,821) | (5,896,722) | (16,711,824) | (2,389,791) |
| 当座借越 | (275,171) | (39,349) | (32,141) | (4,596) |
| ブローカーに対する債務 | (2,356,311) | (336,952) | (1,594,455) | (228,007) |
| 担保として保有する現金 | (5,534,016) | (791,364) | (2,287,874) | (327,166) |
| その他の債務 | (217,017,969) | (31,033,570) | (154,216,571) | (22,052,970) |
| 流動負債合計(買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産を除く) | (266,419,288) | (38,097,958) | (174,842,865) | (25,002,530) |
| 買戻可能参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 3,891,152,535 | 556,434,813 | 3,744,793,829 | 535,505,518 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。1株当たり純資産価格の詳細は、注記5に記載。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

包括利益計算書

2016年11月30日に終了した6か月間

| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
|--|------------------------|--------------|------------------------|--------------|
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 |
| 収益 | | | | |
| 営業収益 | 24,916,760 | 3,563,097 | 25,574,631 | 3,657,172 |
| 損益を通じて公正価値評価される 金融資産および負債にかかる純損失 | (163,399,977) | (23,366,197) | (214,746,103) | (30,708,693) |
| 純費用合計 | (138,483,217) | (19,803,100) | (189,171,472) | (27,051,520) |
| 営業費用 | (18,973,980) | (2,713,279) | (19,370,141) | (2,769,930) |
| 営業損失 | (157,457,197) | (22,516,379) | (208,541,613) | (29,821,451) |
| 金融費用 | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券保有者に 対する分配金 | (48,098,684) | (6,878,112) | (37,700,367) | (5,391,152) |
| 支払利息 | (253,158) | (36,202) | (109,977) | (15,727) |
| 税引前当期損失 | (205,809,039) | (29,430,693) | (246,351,957) | (35,228,330) |
| 返還請求不能源泉徴収税 | (3,040,903) | (434,849) | (2,959,558) | (423,217) |
| 税引後当期損失 | (208,849,942) | (29,865,542) | (249,311,515) | (35,651,547) |
| 事業活動による買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産の減少 | (208,849,942) | (29,865,542) | (249,311,515) | (35,651,547) |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の減少以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書

2016年11月30日に終了した6か月間

| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
|--------------------------------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 |
| 買戻可能参加型投資証券保有者に 帰属する期首純資産 | 4,189,775,759 | 599,137,934 | 4,189,775,759 | 599,137,934 |
| 名目為替調整 | 105,448,644 | 15,079,156 | 35,437,093 | 5,067,504 |
| 事業活動による買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産の減少 | (208,849,942) | (29,865,542) | (249,311,515) | (35,651,547) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 768,380,985 | 109,878,481 | 639,683,239 | 91,474,703 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (963,602,911) | (137,795,216) | (762,870,086) | (109,090,422) |
| 投資証券取引による純資産の純変動 | (195,221,926) | (27,916,735) | (123,186,847) | (17,615,719) |
| 買戻可能参加型投資証券保有者に 帰属する期末純資産 | 3,891,152,535 | 556,434,813 | 3,852,714,490 | 550,938,172 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

キャッシュ・フロー計算書

2016年11月30日に終了した6か月間

| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
|----------------------------------|------------------------|---------------------|------------------------|---------------------|
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 |
| 営業活動によるキャッシュ・フロー | | | | |
| 投資売却による受取金 | 3,434,713,086 | 491,163,971 | 3,600,087,991 | 514,812,583 |
| 投資の購入 | (3,232,067,927) | (462,185,714) | (3,530,760,532) | (504,898,756) |
| 受取利息 | 39,888 | 5,704 | 65,708 | 9,396 |
| 純受取配当金 | 25,420,786 | 3,635,172 | 24,757,213 | 3,540,281 |
| その他利益 | (187,637) | (26,832) | (200,708) | (28,701) |
| ブローカーに対する債権/(債務) | 258,613 | 36,982 | 5,774,889 | 825,809 |
| 営業費用の支払い | (19,293,838) | (2,759,019) | (19,037,388) | (2,722,346) |
| 営業活動による 純キャッシュ・インフロー | 208,882,971 | 29,870,265 | 80,687,173 | 11,538,266 |
| 財務活動によるキャッシュ・フロー | | | | |
| 分配金の支払額 | (48,098,684) | (6,878,112) | (37,700,367) | (5,391,152) |
| 利息支払額 | (258,189) | (36,921) | (116,181) | (16,614) |
| 投資証券取引 | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取額 | 757,966,048 | 108,389,145 | 637,565,998 | 91,171,938 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しによる支払額 | (937,320,017) | (134,036,762) | (730,598,546) | (104,475,592) |
| 財務活動による 純キャッシュ・アウトフロー | (227,710,842) | (32,562,650) | (130,849,096) | (18,711,421) |
| 現金および現金同等物の純減少 | (18,827,871) | (2,692,386) | (50,161,923) | (7,173,155) |
| 期首現金および現金同等物* | 291,722,420 | 41,716,306 | 291,722,420 | 41,716,306 |
| 現金および現金同等物の為替差損 | (13,998,052) | (2,001,721) | (41,134,786) | (5,882,274) |
| 期末現金および現金同等物* | 258,896,497 | 37,022,199 | 200,425,711 | 28,660,877 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

*現金および現金同等物には、銀行預金、手許現金、当座借越が含まれる。

[次へ](#)

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの財政状態計算書

2016年11月30日現在

| | グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|--|----------------------------------|-------------------|---|-------------------|--|--------------------|--|-------------------|---|--------------------|---|--------------------|
| | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 流動資産 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融資産 | 68,351,828 | 9,774,311 | 121,650,735 | 17,396,055 | 187,608,676 | 21,854,535 | 104,733,566 | 12,200,413 | 531,125,612 | 61,870,823 | 877,531,558 | 102,223,651 |
| ブローカーに対する債権 | 82,778 | 11,837 | 642,960 | 91,943 | 1,031,087 | 120,111 | 321,812 | 37,488 | 3,023,076 | 352,158 | - | - |
| その他の債権 | 714,215 | 102,133 | 2,299,634 | 328,848 | 3,943,772 | 459,410 | 488,772 | 56,937 | 18,658,747 | 2,173,557 | 11,358,980 | 1,323,208 |
| 担保として保有する現金 | - | - | - | - | 3,110,000 | 362,284 | - | - | - | - | - | - |
| 現金および現金同等物 | 4,187,847 | 598,862 | 4,276,587 | 611,552 | 35,004,402 | 4,077,663 | 6,553,320 | 763,396 | 26,488,013 | 3,085,589 | 76,254,303 | 8,882,864 |
| 流動資産合計 | 73,336,668 | 10,487,144 | 128,869,916 | 18,428,398 | 230,697,937 | 26,874,003 | 112,097,470 | 13,058,234 | 579,295,448 | 67,482,127 | 965,144,841 | 112,429,723 |
| 流動負債 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融負債 | (77,022) | (11,014) | (230,255) | (32,926) | (9,470,344) | (1,103,200) | (570,033) | (66,403) | (4,157,090) | (484,259) | (9,855,796) | (1,148,102) |
| 当座借越 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | (31,525) | (3,672) |
| 担保として差し入れ られた現金 | - | - | - | - | (3,110,000) | (362,284) | - | - | - | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | - | - | - | (34,331) | (3,999) | - | - | (189,248) | (22,045) | - | - |
| その他の債務 | (880,873) | (125,965) | (1,370,104) | (195,925) | (9,025,059) | (1,051,329) | (2,556,631) | (297,822) | (6,324,078) | (736,692) | (14,279,023) | (1,663,363) |
| 流動負債合計（買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産を除く） | (957,895) | (136,979) | (1,600,359) | (228,851) | (21,639,734) | (2,520,813) | (3,126,664) | (364,225) | (10,670,416) | (1,242,997) | (24,166,344) | (2,815,137) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する純資産 | 72,378,773 | 10,350,165 | 127,269,557 | 18,199,547 | 209,058,203 | 24,353,190 | 108,970,806 | 12,694,009 | 568,625,032 | 66,239,130 | 940,978,497 | 109,614,585 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの財政状態計算書（続き）

2016年11月30日現在

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|--|---|--------------------|---|---------------------|---|--------------------|---|-------------------|---|--------------------|---------------------------|-------------------|
| | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 流動資産 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融資産 | 349,447,545 | 40,707,145 | 201,677,721 | 23,493,438 | 259,401,812 | 30,217,717 | 130,878,058 | 15,245,985 | 243,251,143 | 28,336,326 | 269,177,828 | 31,356,525 |
| 担保として差し入れられた 損益を通じて公正価値評価 される金融資産 | - | - | 973,307 | 113,381 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ブローカーに対する債権 | 708,505 | 82,534 | 2,721,505 | 317,028 | 1,948,787 | 227,014 | - | - | 1,395,890 | 162,607 | 285,593 | 33,269 |
| その他の債権 | 17,950,609 | 2,091,066 | 75,788,293 | 8,828,578 | 4,122,482 | 480,228 | 292,409 | 34,063 | 7,865,779 | 916,285 | 1,771,147 | 206,321 |
| 担保として保有する現金 | 920,000 | 107,171 | 2,884,200 | 335,980 | - | - | - | - | 28,000 | 3,262 | - | - |
| 現金および現金同等物 | 19,723,105 | 2,297,545 | 7,233,439 | 842,623 | 27,950,378 | 3,255,940 | 3,153,544 | 367,356 | 38,342,444 | 4,466,511 | 11,546,673 | 1,345,072 |
| 流動資産合計 | 388,749,764 | 45,285,460 | 291,278,465 | 33,931,028 | 293,423,459 | 34,180,899 | 134,324,011 | 15,647,404 | 290,883,256 | 33,884,990 | 282,781,241 | 32,941,187 |
| 流動負債 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融負債 | (3,980,032) | (463,634) | (5,065,013) | (590,023) | (3,450,851) | (401,990) | (306,698) | (35,727) | (3,665,635) | (427,010) | (2,116,631) | (246,566) |
| 当座借越 | (154,367) | (17,982) | - | - | (51,572) | (6,008) | (3,481) | (406) | - | - | - | - |
| 担保として差し入れ られた現金 | (920,000) | (107,171) | (2,884,200) | (335,980) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | (29,337) | (3,417) | (101,598) | (11,835) | (1,356,835) | (158,058) | - | - | (1,310,394) | (152,648) | - | - |
| その他の債務 | (37,090,183) | (4,320,635) | (132,376,498) | (15,420,538) | (3,733,790) | (434,949) | (1,366,271) | (159,157) | (25,869,380) | (3,013,524) | (4,776,432) | (556,407) |
| 流動負債合計（買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産を除く） | (42,173,919) | (4,912,840) | (140,427,309) | (16,358,377) | (8,593,048) | (1,001,004) | (1,676,450) | (195,290) | (30,845,409) | (3,593,182) | (6,893,063) | (802,973) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する純資産 | 346,575,845 | 40,372,620 | 150,851,156 | 17,572,651 | 284,830,411 | 33,179,895 | 132,647,561 | 15,452,114 | 260,037,847 | 30,291,809 | 275,888,178 | 32,138,214 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの財政状態計算書（続き）

2016年11月30日現在

| | グローバル・アクセス 米国バリュース 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル 株式ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|--|---------------------------------|--------------------|-------------------------------|-------------------|--|-------------------|--------------------------------------|--------------------|-------------------------|
| | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 | | 2016年11月30日現在 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 流動資産 | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融資産 | 406,898,206 | 47,399,572 | 294,413,119 | 34,296,184 | 104,833,811 | 12,212,091 | 339,359,872 | 41,639,456 | 15,445,639,206 |
| ブローカーに対する債権 | 169,833 | 19,784 | - | - | - | - | - | - | 44,163,206 |
| その他の債権 | 3,186,038 | 371,142 | 1,382,009 | 160,990 | 14 | 2 | 3,461,730 | 424,754 | 81,639,911 |
| 現金および現金同等物 | 23,338,897 | 2,718,748 | 15,508,124 | 1,806,541 | 5,947,709 | 692,849 | 10,641,877 | 1,305,758 | 505,270,915 |
| 流動資産合計 | 433,592,974 | 50,509,246 | 311,303,252 | 36,263,716 | 110,781,534 | 12,904,941 | 353,463,479 | 43,369,969 | 16,076,713,238 |
| 流動負債 | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融負債 | (4,406,770) | (513,345) | (3,131,068) | (364,738) | (429,409) | (50,022) | (114,784) | (14,084) | (46,602,199) |
| 当座借越 | - | - | - | - | - | - | (19) | (2) | - |
| その他の債務 | (9,664,743) | (1,125,846) | (4,489,239) | (522,951) | (1,273,136) | (148,308) | (11,076,477) | (1,359,084) | (267,415,962) |
| 流動負債合計（買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産を除く） | (14,071,513) | (1,639,191) | (7,620,307) | (887,690) | (1,702,545) | (198,329) | (11,191,280) | (1,373,170) | (314,018,161) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する純資産 | 419,521,461 | 48,870,055 | 303,682,945 | 35,376,026 | 109,078,989 | 12,706,611 | 342,272,199 | 41,996,799 | 15,762,695,077 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの財政状態計算書（続き）

2016年5月31日現在

| | グローバル・アクセス ユークー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユークー・ オポチュニティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|--|----------------------------------|-------------------|---|-------------------|--|--------------------|--|-------------------|---|-------------------|---|--------------------|
| | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 流動資産 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融資産 | 71,242,387 | 10,187,661 | 130,236,124 | 18,623,766 | 234,613,293 | 27,330,103 | 144,358,795 | 16,816,356 | 539,824,412 | 62,884,146 | 870,950,118 | 101,456,979 |
| ブローカーに対する債権 | 230,200 | 32,919 | 189,261 | 27,064 | 2,386,298 | 277,980 | 417,050 | 48,582 | 2,916,740 | 339,771 | - | - |
| その他の債権 | 418,028 | 59,778 | 953,063 | 136,288 | 5,725,310 | 666,941 | 2,841,622 | 331,021 | 4,621,127 | 538,315 | 9,158,640 | 1,066,890 |
| 担保として保有する現金 | - | - | - | - | 880,000 | 102,511 | - | - | - | - | - | - |
| 現金および現金同等物 | 3,368,971 | 481,763 | 3,701,025 | 529,247 | 46,595,937 | 5,427,961 | 6,232,780 | 726,057 | 29,866,629 | 3,479,164 | 80,730,317 | 9,404,275 |
| 流動資産合計 | 75,259,586 | 10,762,121 | 135,079,473 | 19,316,365 | 290,200,838 | 33,805,496 | 153,850,247 | 17,922,015 | 577,228,908 | 67,241,395 | 960,839,075 | 111,928,144 |
| 流動負債 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融負債 | (237,791) | (34,004) | (391,657) | (56,007) | (7,309,306) | (851,461) | (40,711) | (4,742) | (2,719,233) | (316,763) | (3,634,567) | (423,391) |
| ブローカーに対する債務 | - | - | - | - | (247,789) | (28,865) | (215,215) | (25,070) | (29,897) | (3,483) | - | - |
| 未払現金担保 | - | - | - | - | (880,000) | (102,511) | - | - | - | - | - | - |
| その他の債務 | (646,231) | (92,411) | (775,033) | (110,830) | (3,212,621) | (374,238) | (1,241,806) | (144,658) | (5,657,039) | (658,988) | (22,575,208) | (2,629,786) |
| 流動負債合計（買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産を除く） | (884,022) | (126,415) | (1,166,690) | (166,837) | (11,649,716) | (1,357,075) | (1,497,732) | (174,471) | (8,406,169) | (979,235) | (26,209,775) | (3,053,177) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する純資産 | 74,375,564 | 10,635,706 | 133,912,783 | 19,149,528 | 278,551,122 | 32,448,420 | 152,352,515 | 17,747,544 | 568,822,739 | 66,262,161 | 934,629,300 | 108,874,967 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの財政状態計算書（続き）

2016年5月31日現在

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|--|---|--------------------|---|---------------------|---|-------------------|---|-------------------|---|--------------------|---------------------------|-------------------|
| | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 流動資産 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融資産 | 367,318,818 | 42,788,969 | 328,019,951 | 38,211,044 | 215,892,658 | 25,149,336 | 134,985,690 | 15,724,483 | 272,910,720 | 31,791,370 | 274,023,120 | 31,920,953 |
| 担保として差し入れられた 損益を通じて公正価値評価 される金融資産 | - | - | 280,867 | 32,718 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ブローカーに対する債権 | 655,116 | 76,314 | 1,504,219 | 175,226 | 1,406,679 | 163,864 | - | - | 2,502,711 | 291,541 | 90,861 | 10,584 |
| その他の債権 | 6,143,232 | 715,625 | 4,431,467 | 516,222 | 2,566,733 | 298,999 | 464,667 | 54,129 | 16,342,767 | 1,903,769 | 3,529,053 | 411,099 |
| 担保として保有する現金 | 690,000 | 80,378 | 1,760,000 | 205,022 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 現金および現金同等物 | 5,220,332 | 608,116 | 12,594,091 | 1,467,086 | 15,755,616 | 1,835,372 | 1,143,318 | 133,185 | 29,549,395 | 3,442,209 | 10,936,427 | 1,273,984 |
| 流動資産合計 | 380,027,498 | 44,269,403 | 348,590,595 | 40,607,318 | 235,621,686 | 27,447,570 | 136,593,675 | 15,911,797 | 321,305,593 | 37,428,889 | 288,579,461 | 33,616,621 |
| 流動負債 | | | | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融負債 | (971,716) | (113,195) | (1,826,572) | (212,777) | (1,487,289) | (173,254) | (182,661) | (21,278) | (838,461) | (97,672) | (465,290) | (54,202) |
| 当座借越 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | (46,781) | (5,450) |
| ブローカーに対する債務 | (29,130) | (3,393) | (9) | (1) | (609,793) | (71,035) | - | - | (1,187,157) | (138,292) | - | - |
| 担保として差し入れ られた現金 | (690,000) | (80,378) | (1,760,000) | (205,022) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他の債務 | (32,981,654) | (3,842,033) | (96,996,316) | (11,299,101) | (3,752,276) | (437,103) | (1,548,746) | (180,413) | (30,009,492) | (3,495,806) | (3,216,148) | (374,649) |
| 流動負債合計（買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産を除く） | (34,672,500) | (4,039,000) | (100,582,897) | (11,716,902) | (5,849,358) | (681,392) | (1,731,407) | (201,692) | (32,035,110) | (3,731,770) | (3,728,219) | (434,300) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する純資産 | 345,354,998 | 40,230,404 | 248,007,698 | 28,890,417 | 229,772,328 | 26,766,178 | 134,862,268 | 15,710,106 | 289,270,483 | 33,697,119 | 284,851,242 | 33,182,321 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの財政状態計算書（続き）

2016年5月31日現在

| | グローバル・アクセス 米国バリュウ 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル 株式ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|--|--------------------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|--|------------------|--------------------------------------|-------------------|-------------------------|
| | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2016年5月31日現在 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 流動資産 | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融資産 | 501,825,955 | 58,457,705 | 314,163,522 | 36,596,909 | 75,718,076 | 8,820,399 | 514,499,093 | 63,129,039 | 20,898,030,850 |
| ブローカーに対する債権 | 87,965 | 10,247 | - | - | - | - | - | - | 22,348,241 |
| その他の債権 | 6,076,506 | 707,852 | 2,155,130 | 251,051 | 164,268 | 19,136 | 6,643,108 | 815,109 | 500,737,625 |
| 現金および現金同等物 | 18,731,923 | 2,182,082 | 2,784,600 | 324,378 | 1,710,419 | 199,247 | 1,984,828 | 243,538 | 788,249,552 |
| 流動資産合計 | 526,722,349 | 61,357,886 | 319,103,252 | 37,172,338 | 77,592,763 | 9,038,781 | 523,127,029 | 64,187,686 | 22,209,366,268 |
| 流動負債 | | | | | | | | | |
| 損益を通じて公正価値 評価される金融負債 | (1,757,878) | (204,775) | (1,577,651) | (183,781) | (150,762) | (17,562) | (109,091) | (13,385) | (35,972,723) |
| ブローカーに対する債務 | - | - | - | - | - | - | - | - | (192,875) |
| その他の債務 | (6,692,116) | (779,565) | (4,320,403) | (503,284) | (584,779) | (68,121) | (7,219,839) | (885,874) | (173,842,168) |
| 流動負債合計（買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産を除く） | (8,449,994) | (984,340) | (5,898,054) | (687,064) | (735,541) | (85,683) | (7,328,930) | (899,260) | (210,007,766) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する純資産 | 518,272,355 | 60,373,547 | 313,205,198 | 36,485,274 | 76,857,222 | 8,953,098 | 515,798,099 | 63,288,427 | 21,999,358,502 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの包括利益計算書

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス ユークー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユークー・ オポチュニティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|---|----------------------------------|------------------|---|------------------|--|--------------------|--|------------------|---|------------------|---|--------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 収益 | | | | | | | | | | | | |
| 営業収益 | 1,275,498 | 182,396 | 2,171,416 | 310,512 | 9,412 | 1,096 | 1,874,337 | 218,342 | 7,645,996 | 890,682 | 100,760 | 11,738 |
| 損益を通じて公正価値評価 される金融資産および負債 にかかる純利益 / (損失) | 7,717,698 | 1,103,631 | 12,431,964 | 1,777,771 | (19,821,309) | (2,308,984) | (1,703,329) | (198,421) | 16,002,882 | 1,864,176 | (28,766,292) | (3,350,985) |
| 純収益 / (費用) 合計 | 8,993,196 | 1,286,027 | 14,603,380 | 2,088,283 | (19,811,897) | (2,307,888) | 171,008 | 19,921 | 23,648,878 | 2,754,858 | (28,665,532) | (3,339,248) |
| 営業費用 | (415,315) | (59,390) | (753,938) | (107,813) | (912,051) | (106,245) | (663,917) | (77,340) | (3,420,307) | (398,432) | (4,110,096) | (478,785) |
| 営業利益 / (損失) | 8,577,881 | 1,226,637 | 13,849,442 | 1,980,470 | (20,723,948) | (2,414,133) | (492,909) | (57,419) | 20,228,571 | 2,356,426 | (32,775,628) | (3,818,033) |
| 金融費用 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に対する分配金 支払利息 | (957,287) | (136,892) | (2,053,082) | (293,591) | (472,546) | (55,047) | (1,296,451) | (151,024) | (4,610,210) | (537,043) | (19,368,001) | (2,256,178) |
| | (3,069) | (439) | (2,737) | (391) | (22,383) | (2,607) | (8,028) | (935) | (39,170) | (4,563) | (23,642) | (2,754) |
| 税引前利益 / (損失) | 7,617,525 | 1,089,306 | 11,793,623 | 1,686,488 | (21,218,877) | (2,471,787) | (1,797,388) | (209,378) | 15,579,191 | 1,814,820 | (52,167,271) | (6,076,965) |
| 返還請求不能源泉徴収税 | (1,823) | (261) | (8,052) | (1,151) | (221) | (26) | (277,105) | (32,280) | (808,861) | (94,224) | (17,883) | (2,083) |
| 税引後当期利益 / (損失) | 7,615,702 | 1,089,045 | 11,785,571 | 1,685,337 | (21,219,098) | (2,471,813) | (2,074,493) | (241,658) | 14,770,330 | 1,720,596 | (52,185,154) | (6,079,049) |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の増加 / (減 少) | 7,615,702 | 1,089,045 | 11,785,571 | 1,685,337 | (21,219,098) | (2,471,813) | (2,074,493) | (241,658) | 14,770,330 | 1,720,596 | (52,185,154) | (6,079,049) |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の増加 / (減少) 以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの包括利益計算書(続き)

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|---|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---------------------------|-----------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 収益 | | | | | | | | | | | | |
| 営業収益 | - | - | 3,317 | 386 | 99,971 | 11,646 | 2,047,332 | 238,494 | 5,799 | 676 | 1,764,381 | 205,533 |
| 損益を通じて公正価値評価 される金融資産および負債 にかかる純損失 | (24,189,675) | (2,817,855) | (12,360,495) | (1,439,874) | (23,755,067) | (2,767,228) | (7,951,055) | (926,218) | (31,305,797) | (3,646,812) | (2,050,547) | (238,868) |
| 純費用合計 | (24,189,675) | (2,817,855) | (12,357,178) | (1,439,488) | (23,655,096) | (2,755,582) | (5,903,723) | (687,725) | (31,299,998) | (3,646,137) | (286,166) | (33,335) |
| 営業費用 | (1,381,235) | (160,900) | (759,309) | (88,452) | (1,230,487) | (143,339) | (736,357) | (85,778) | (938,213) | (109,292) | (1,531,070) | (178,354) |
| 営業損失 | (25,570,910) | (2,978,755) | (13,116,487) | (1,527,940) | (24,885,583) | (2,898,922) | (6,640,080) | (773,503) | (32,238,211) | (3,755,429) | (1,817,236) | (211,690) |
| 金融費用 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に対する分配金 | (4,285,962) | (499,272) | (1,800,578) | (209,749) | (3,988,482) | (464,618) | (2,040,619) | (237,712) | (3,186,230) | (371,164) | (25,741) | (2,999) |
| 支払利息 | (16,391) | (1,909) | (13,163) | (1,533) | (10,273) | (1,197) | (4,411) | (514) | (22,260) | (2,593) | (5,448) | (635) |
| 税引前損失 | (29,873,263) | (3,479,936) | (14,930,228) | (1,739,222) | (28,884,338) | (3,364,737) | (8,685,110) | (1,011,728) | (35,446,701) | (4,129,186) | (1,848,425) | (215,323) |
| 返還請求不能源泉徴収税 | (1,081) | (126) | (402) | (47) | - | - | (353,160) | (41,140) | - | - | (518,749) | (60,429) |
| 税引後当期損失 | (29,874,344) | (3,480,062) | (14,930,630) | (1,739,269) | (28,884,338) | (3,364,737) | (9,038,270) | (1,052,868) | (35,446,701) | (4,129,186) | (2,367,174) | (275,752) |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | (29,874,344) | (3,480,062) | (14,930,630) | (1,739,269) | (28,884,338) | (3,364,737) | (9,038,270) | (1,052,868) | (35,446,701) | (4,129,186) | (2,367,174) | (275,752) |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の減少以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの包括利益計算書（続き）

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス 米国バリュウ 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル 株式ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|---|--------------------------------|--------------------|-------------------------------|--------------------|--|------------------|--------------------------------------|--------------------|-------------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 収益 | | | | | | | | | |
| 営業収益 | 5,698,291 | 663,794 | 4,101,694 | 477,806 | 140,161 | 16,327 | 2,797,869 | 343,299 | 150,469,545 |
| 損益を通じて公正価値評価 される金融資産および負債 にかかる純損失 | (19,701,789) | (2,295,061) | (31,423,342) | (3,660,505) | (240,458) | (28,011) | (46,073,963) | (5,653,275) | (140,951,731) |
| 純（費用）/収益合計 | (14,003,498) | (1,631,267) | (27,321,648) | (3,182,699) | (100,297) | (11,684) | (43,276,094) | (5,309,977) | 9,517,814 |
| 営業費用 | (2,127,262) | (247,805) | (1,591,341) | (185,375) | (446,886) | (52,058) | (2,318,087) | (284,429) | (86,803,626) |
| 営業損失 | (16,130,760) | (1,879,072) | (28,912,989) | (3,368,074) | (547,183) | (63,741) | (45,594,181) | (5,594,406) | (77,285,812) |
| 金融費用 | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に対する分配金 | (2,747,703) | (320,080) | (4,551,139) | (530,162) | (2,549,628) | (297,006) | (6,362,712) | (780,705) | (94,358,482) |
| 支払利息 | (16,182) | (1,885) | (40,543) | (4,723) | (4,724) | (550) | (61,144) | (7,502) | (2,978,258) |
| 税引前損失 | (18,894,645) | (2,201,037) | (33,504,671) | (3,902,959) | (3,101,535) | (361,298) | (52,018,037) | (6,382,613) | (174,622,552) |
| 返還請求不能源泉徴収税 | (1,557,973) | (181,488) | (726,092) | (84,582) | (97,828) | (11,396) | 556,641 | 68,300 | (22,549,619) |
| 税引後当期損失 | (20,452,618) | (2,382,525) | (34,230,763) | (3,987,542) | (3,199,363) | (372,694) | (51,461,396) | (6,314,313) | (197,172,171) |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | (20,452,618) | (2,382,525) | (34,230,763) | (3,987,542) | (3,199,363) | (372,694) | (51,461,396) | (6,314,313) | (197,172,171) |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の減少以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの包括利益計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|---|----------------------------------|--------------------|---|--------------------|--|------------------|--|--------------------|---|---------------------|---|--------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 収益 | | | | | | | | | | | | |
| 営業収益 | 1,463,039 | 209,215 | 2,545,567 | 364,016 | 5,321 | 620 | 1,529,165 | 178,132 | 7,846,029 | 913,984 | 154,899 | 18,044 |
| 損益を通じて公正価値評価 される金融資産および負債 にかかる純損失 | (8,073,796) | (1,154,553) | (11,743,076) | (1,679,260) | (912,258) | (106,269) | (12,391,433) | (1,443,478) | (96,437,432) | (11,233,996) | (61,756,566) | (7,194,022) |
| 純費用合計 | <u>(6,610,757)</u> | <u>(945,338)</u> | <u>(9,197,509)</u> | <u>(1,315,244)</u> | <u>(906,937)</u> | <u>(105,649)</u> | <u>(10,862,268)</u> | <u>(1,265,346)</u> | <u>(88,591,403)</u> | <u>(10,320,013)</u> | <u>(61,601,667)</u> | <u>(7,175,978)</u> |
| 営業費用 | (468,943) | (67,059) | (776,983) | (111,109) | (1,093,419) | (127,372) | (650,246) | (75,747) | (3,521,382) | (410,206) | (4,183,999) | (487,394) |
| 営業損失 | <u>(7,079,700)</u> | <u>(1,012,397)</u> | <u>(9,974,492)</u> | <u>(1,426,352)</u> | <u>(2,000,356)</u> | <u>(233,021)</u> | <u>(11,512,514)</u> | <u>(1,341,093)</u> | <u>(92,112,785)</u> | <u>(10,730,218)</u> | <u>(65,785,666)</u> | <u>(7,663,372)</u> |
| 金融費用 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に対する分配金 | (1,200,550) | (171,679) | (2,073,890) | (296,566) | (576,792) | (67,191) | (929,449) | (108,272) | (4,237,102) | (493,580) | (14,924,848) | (1,738,596) |
| 支払利息 | (791) | (113) | (1,828) | (261) | (23,708) | (2,762) | (3,727) | (434) | (48,618) | (5,664) | (13,132) | (1,530) |
| 税引前損失 | <u>(8,281,041)</u> | <u>(1,184,189)</u> | <u>(12,050,210)</u> | <u>(1,723,180)</u> | <u>(2,600,856)</u> | <u>(302,974)</u> | <u>(12,445,690)</u> | <u>(1,449,798)</u> | <u>(96,398,505)</u> | <u>(11,229,462)</u> | <u>(80,723,646)</u> | <u>(9,403,498)</u> |
| 返還請求不能源泉徴収税 | (138,224) | (19,766) | (254,504) | (36,394) | (98) | (11) | (212,447) | (24,748) | (855,333) | (99,638) | (6,266) | (730) |
| 税引後当期損失 | <u>(8,419,265)</u> | <u>(1,203,955)</u> | <u>(12,304,714)</u> | <u>(1,759,574)</u> | <u>(2,600,954)</u> | <u>(302,985)</u> | <u>(12,658,137)</u> | <u>(1,474,546)</u> | <u>(97,253,838)</u> | <u>(11,329,100)</u> | <u>(80,729,912)</u> | <u>(9,404,227)</u> |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | <u>(8,419,265)</u> | <u>(1,203,955)</u> | <u>(12,304,714)</u> | <u>(1,759,574)</u> | <u>(2,600,954)</u> | <u>(302,985)</u> | <u>(12,658,137)</u> | <u>(1,474,546)</u> | <u>(97,253,838)</u> | <u>(11,329,100)</u> | <u>(80,729,912)</u> | <u>(9,404,227)</u> |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の減少以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの包括利益計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|---|---|--------------------|---|------------------|---|--------------------|---|------------------|---|--------------------|---------------------------|--------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 収益 | | | | | | | | | | | | |
| 営業収益 | 2,077 | 242 | 38,532 | 4,489 | 86,424 | 10,068 | 2,037,513 | 237,350 | 302 | 35 | 2,105,592 | 245,280 |
| 損益を通じて公正価値評価 される金融資産および負債 にかかる純損失 | (4,704,796) | (548,062) | (6,580,549) | (766,568) | (6,405,370) | (746,162) | (3,780,419) | (440,381) | (7,960,635) | (927,334) | (12,778,114) | (1,488,522) |
| 純費用合計 | <u>(4,702,719)</u> | <u>(547,820)</u> | <u>(6,542,017)</u> | <u>(762,080)</u> | <u>(6,318,946)</u> | <u>(736,094)</u> | <u>(1,742,906)</u> | <u>(203,031)</u> | <u>(7,960,333)</u> | <u>(927,299)</u> | <u>(10,672,522)</u> | <u>(1,243,242)</u> |
| 営業費用 | (1,434,434) | (167,097) | (1,020,286) | (118,853) | (1,250,634) | (145,686) | (836,884) | (97,489) | (1,254,196) | (146,101) | (1,878,425) | (218,818) |
| 営業損失 | <u>(6,137,153)</u> | <u>(714,917)</u> | <u>(7,562,303)</u> | <u>(880,933)</u> | <u>(7,569,580)</u> | <u>(881,780)</u> | <u>(2,579,790)</u> | <u>(300,520)</u> | <u>(9,214,529)</u> | <u>(1,073,400)</u> | <u>(12,550,947)</u> | <u>(1,462,060)</u> |
| 金融費用 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に対する分配金 | (5,125,110) | (597,024) | (438,763) | (51,112) | (4,058,116) | (472,730) | (1,855,729) | (216,174) | (3,833,598) | (446,576) | 115 | 13 |
| 支払利息 | (5,255) | (612) | (2,973) | (346) | (7,273) | (847) | (3,588) | (418) | (8,142) | (948) | (203) | (24) |
| 税引前損失 | <u>(11,267,518)</u> | <u>(1,312,553)</u> | <u>(8,004,039)</u> | <u>(932,391)</u> | <u>(11,634,969)</u> | <u>(1,355,358)</u> | <u>(4,439,107)</u> | <u>(517,112)</u> | <u>(13,056,269)</u> | <u>(1,520,925)</u> | <u>(12,551,035)</u> | <u>(1,462,070)</u> |
| 返還請求不能源泉徴収税 | - | - | - | - | - | - | (234,300) | (27,294) | - | - | (335,328) | (39,062) |
| 税引後当期損失 | <u>(11,267,518)</u> | <u>(1,312,553)</u> | <u>(8,004,039)</u> | <u>(932,391)</u> | <u>(11,634,969)</u> | <u>(1,355,358)</u> | <u>(4,673,407)</u> | <u>(544,405)</u> | <u>(13,056,269)</u> | <u>(1,520,925)</u> | <u>(12,886,363)</u> | <u>(1,501,132)</u> |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | <u>(11,267,518)</u> | <u>(1,312,553)</u> | <u>(8,004,039)</u> | <u>(932,391)</u> | <u>(11,634,969)</u> | <u>(1,355,358)</u> | <u>(4,673,407)</u> | <u>(544,405)</u> | <u>(13,056,269)</u> | <u>(1,520,925)</u> | <u>(12,886,363)</u> | <u>(1,501,132)</u> |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の減少以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの包括利益計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス 米国バリュース 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル 株式ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|---|---------------------------------|--------------------|-------------------------------|--------------------|--|--------------------|--------------------------------------|------------------|-------------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 収益 | | | | | | | | | |
| 営業収益 | 6,980,311 | 813,136 | 6,234,149 | 726,216 | 1,257 | 146 | 3,728,214 | 457,452 | 259,273,469 |
| 損益を通じて公正価値評価 される金融資産および負債 にかかる純（損失）/利益 | (46,944,755) | (5,468,595) | (31,507,605) | (3,670,321) | (11,829,757) | (1,378,048) | 22,987,913 | 2,820,617 | (2,723,176,685) |
| 純（費用）/収益合計 | <u>(39,964,444)</u> | <u>(4,655,458)</u> | <u>(25,273,456)</u> | <u>(2,944,105)</u> | <u>(11,828,500)</u> | <u>(1,377,902)</u> | <u>26,716,127</u> | <u>3,278,069</u> | <u>(2,463,903,216)</u> |
| 営業費用 | (3,078,828) | (358,653) | (2,320,992) | (270,372) | (514,381) | (59,920) | (3,090,443) | (379,197) | (183,487,331) |
| 営業（損失）/利益 | <u>(43,043,272)</u> | <u>(5,014,111)</u> | <u>(27,594,448)</u> | <u>(3,214,477)</u> | <u>(12,342,881)</u> | <u>(1,437,822)</u> | <u>23,625,684</u> | <u>2,898,871</u> | <u>(2,647,390,547)</u> |
| 金融費用 | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に対する分配金 | (2,124,823) | (247,521) | (7,139,308) | (831,658) | (2,075,289) | (241,750) | (4,355,812) | (534,458) | (118,799,070) |
| 支払利息 | (1,978) | (230) | (15,665) | (1,825) | (4,965) | (578) | (22,340) | (2,741) | (202,925) |
| 税引前（損失）/利益 | <u>(45,170,073)</u> | <u>(5,261,862)</u> | <u>(34,749,421)</u> | <u>(4,047,960)</u> | <u>(14,423,135)</u> | <u>(1,680,151)</u> | <u>19,247,532</u> | <u>2,361,672</u> | <u>(2,766,392,542)</u> |
| 返還請求不能源泉徴収税 | (1,010,626) | (117,728) | (757,766) | (88,272) | (103,934) | (12,107) | (112,856) | (13,847) | (39,041,227) |
| 税引後当期（損失）/利益 | <u>(46,180,699)</u> | <u>(5,379,590)</u> | <u>(35,507,187)</u> | <u>(4,136,232)</u> | <u>(14,527,069)</u> | <u>(1,692,258)</u> | <u>19,134,676</u> | <u>2,347,825</u> | <u>(2,805,433,769)</u> |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の（減少）/増 加 | <u>(46,180,699)</u> | <u>(5,379,590)</u> | <u>(35,507,187)</u> | <u>(4,136,232)</u> | <u>(14,527,069)</u> | <u>(1,692,258)</u> | <u>19,134,676</u> | <u>2,347,825</u> | <u>(2,805,433,769)</u> |

本投資法人の買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の（減少）/増加以外に、当期中に発生した認識済損益はない。当期業績を導出するに当たり、上記の全金額は継続事業に関係付けている。

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|---|----------------------------------|-------------|---|-------------|--|--------------|--|-------------|---|--------------|---|--------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期首純資産 | 74,375,564 | 10,635,706 | 133,912,783 | 19,149,528 | 278,551,122 | 32,448,420 | 152,352,515 | 17,747,544 | 568,822,739 | 66,262,161 | 934,629,300 | 108,874,967 |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の増加 / (減 少) | 7,615,702 | 1,089,045 | 11,785,571 | 1,685,337 | (21,219,098) | (2,471,813) | (2,074,493) | (241,658) | 14,770,330 | 1,720,596 | (52,185,154) | (6,079,049) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 2,181,289 | 311,924 | 34,445,825 | 4,925,753 | 42,474,418 | 4,947,845 | 11,091,965 | 1,292,103 | 98,698,080 | 11,497,339 | 243,059,383 | 28,313,988 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (11,793,782) | (1,686,511) | (52,874,622) | (7,561,071) | (90,748,239) | (10,571,262) | (52,399,181) | (6,103,981) | (113,666,117) | (13,240,966) | (184,525,032) | (21,495,321) |
| 投資証券取引による 純資産の純変動 | (9,612,493) | (1,374,586) | (18,428,797) | (2,635,318) | (48,273,821) | (5,623,417) | (41,307,216) | (4,811,878) | (14,968,037) | (1,743,627) | 58,534,351 | 6,818,667 |
| 投資主資本の 純（減少）/増加 | (1,996,791) | (285,541) | (6,643,226) | (949,981) | (69,492,919) | (8,095,230) | (43,381,709) | (5,053,535) | (197,707) | (23,031) | 6,349,197 | 739,618 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期末純資産 | 72,378,773 | 10,350,165 | 127,269,557 | 18,199,547 | 209,058,203 | 24,353,190 | 108,970,806 | 12,694,009 | 568,625,032 | 66,239,130 | 940,978,497 | 109,614,585 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書（続き）

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|--|---|-------------|---|--------------|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---------------------------|-------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期首純資産 | 345,354,998 | 40,230,404 | 248,007,698 | 28,890,417 | 229,772,328 | 26,766,178 | 134,862,268 | 15,710,106 | 289,270,483 | 33,697,119 | 284,851,242 | 33,182,321 |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | (29,874,344) | (3,480,062) | (14,930,630) | (1,739,269) | (28,884,338) | (3,364,737) | (9,038,270) | (1,052,868) | (35,446,701) | (4,129,186) | (2,367,174) | (275,752) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 111,101,048 | 12,942,161 | 18,652,071 | 2,172,780 | 126,291,156 | 14,711,657 | 33,863,740 | 3,944,787 | 63,065,158 | 7,346,460 | 24,402,107 | 2,842,601 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (80,005,857) | (9,319,882) | (100,877,983) | (11,751,276) | (42,348,735) | (4,933,204) | (27,040,177) | (3,149,910) | (56,851,093) | (6,622,584) | (30,997,997) | (3,610,957) |
| 投資証券取引による 純資産の純変動 | 31,095,191 | 3,622,279 | (82,225,912) | (9,578,496) | 83,942,421 | 9,778,453 | 6,823,563 | 794,877 | 6,214,065 | 723,876 | (6,595,890) | (768,355) |
| 投資主資本の 純増加 / (減少) | 1,220,847 | 142,216 | (97,156,542) | (11,317,766) | 55,058,083 | 6,413,716 | (2,214,707) | (257,991) | (29,232,636) | (3,405,310) | (8,963,064) | (1,044,107) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期末純資産 | 346,575,845 | 40,372,620 | 150,851,156 | 17,572,651 | 284,830,411 | 33,179,895 | 132,647,561 | 15,452,114 | 260,037,847 | 30,291,809 | 275,888,178 | 32,138,214 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書（続き）

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス 米国バリュウ 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル株式 ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|--|--------------------------------|--------------|-------------------------------|-------------|--|-------------|--------------------------------------|--------------|-------------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期首純資産 | 518,272,355 | 60,373,547 | 313,205,198 | 36,485,274 | 76,857,222 | 8,953,098 | 515,798,099 | 63,288,427 | 21,999,358,502 |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | (20,452,618) | (2,382,525) | (34,230,763) | (3,987,542) | (3,199,363) | (372,694) | (51,461,396) | (6,314,313) | (197,172,171) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 37,594,358 | 4,379,367 | 69,558,733 | 8,102,897 | 50,554,806 | 5,889,129 | 16,102,221 | 1,975,743 | 773,347,099 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (115,892,634) | (13,500,333) | (44,850,223) | (5,224,602) | (15,133,676) | (1,762,922) | (138,166,725) | (16,953,057) | (6,812,838,353) |
| 投資証券取引による 純資産の純変動 | (78,298,276) | (9,120,966) | 24,708,510 | 2,878,294 | 35,421,130 | 4,126,207 | (122,064,504) | (14,977,315) | (6,039,491,254) |
| 投資主資本の 純（減少）/増加 | (98,750,894) | (11,503,492) | (9,522,253) | (1,109,247) | 32,221,767 | 3,753,514 | (173,525,900) | (21,291,628) | (6,236,663,425) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期末純資産 | 419,521,461 | 48,870,055 | 303,682,945 | 35,376,026 | 109,078,989 | 12,706,611 | 342,272,199 | 41,996,799 | 15,762,695,077 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|--|----------------------------------|-------------|---|-------------|--|-------------|--|-------------|---|--------------|---|--------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期首純資産 | 92,559,479 | 13,236,005 | 158,993,400 | 22,736,056 | 323,413,345 | 37,674,421 | 124,170,414 | 14,464,612 | 617,561,443 | 71,939,732 | 882,257,663 | 102,774,195 |
| 事業活動による買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産の減少 | (8,419,265) | (1,203,955) | (12,304,714) | (1,759,574) | (2,600,954) | (302,985) | (12,658,137) | (1,474,546) | (97,253,838) | (11,329,100) | (80,729,912) | (9,404,227) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 4,288,464 | 613,250 | 18,689,498 | 2,672,598 | 23,271,103 | 2,710,851 | 3,725,960 | 434,037 | 96,006,198 | 11,183,762 | 316,526,842 | 36,872,212 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (5,842,780) | (835,518) | (20,053,780) | (2,867,691) | (32,925,252) | (3,835,463) | (9,035,805) | (1,052,581) | (100,689,734) | (11,729,347) | (187,561,848) | (21,849,080) |
| 投資証券取引による 純資産の純変動 | (1,554,316) | (222,267) | (1,364,282) | (195,092) | (9,654,149) | (1,124,612) | (5,309,845) | (618,544) | (4,683,536) | (545,585) | 128,964,994 | 15,023,132 |
| 投資主資本の 純（減少）/増加 | (9,973,581) | (1,426,222) | (13,668,996) | (1,954,666) | (12,255,103) | (1,427,597) | (17,967,982) | (2,093,090) | (101,937,374) | (11,874,685) | 48,235,082 | 5,618,905 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期末純資産 | 82,585,898 | 11,809,783 | 145,324,404 | 20,781,390 | 311,158,242 | 36,246,824 | 106,202,432 | 12,371,521 | 515,624,069 | 60,065,048 | 930,492,745 | 108,393,100 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|--|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---|-------------|---------------------------|--------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期首純資産 | 396,293,165 | 46,164,191 | 280,046,527 | 32,622,620 | 263,656,189 | 30,713,309 | 148,609,122 | 17,311,477 | 365,292,848 | 42,552,964 | 357,448,803 | 41,639,211 |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の減少 | (11,267,518) | (1,312,553) | (8,004,039) | (932,391) | (11,634,969) | (1,355,358) | (4,673,407) | (544,405) | (13,056,269) | (1,520,925) | (12,886,363) | (1,501,132) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 15,526,213 | 1,808,649 | 49,683,390 | 5,787,618 | 24,979,235 | 2,909,831 | 3,982,451 | 463,916 | 139,962,014 | 16,304,175 | 51,832,258 | 6,037,940 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (29,698,679) | (3,459,599) | (45,407,983) | (5,289,576) | (52,330,287) | (6,095,955) | (10,294,897) | (1,199,253) | (80,952,443) | (9,430,150) | (91,475,045) | (10,655,928) |
| 投資証券取引による 純資産の純変動 | (14,172,466) | (1,650,951) | 4,275,407 | 498,042 | (27,351,052) | (3,186,124) | (6,312,446) | (735,337) | 59,009,571 | 6,874,025 | (39,642,787) | (4,617,988) |
| 投資主資本の 純（減少）/増加 | (25,439,984) | (2,963,504) | (3,728,632) | (434,348) | (38,986,021) | (4,541,482) | (10,985,853) | (1,279,742) | 45,953,302 | 5,353,100 | (52,529,150) | (6,119,121) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期末純資産 | 370,853,181 | 43,200,687 | 276,317,895 | 32,188,272 | 224,670,168 | 26,171,828 | 137,623,269 | 16,031,735 | 411,246,150 | 47,906,064 | 304,919,653 | 35,520,090 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとの買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス 米国バリュウ 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル株式 ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|---|--------------------------------|--------------|-------------------------------|--------------|--|-------------|--|--------------|-------------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期首純資産 | 745,040,083 | 86,789,719 | 473,141,608 | 55,116,266 | 99,938,986 | 11,641,892 | 550,479,166 | 67,543,794 | 41,915,639,665 |
| 事業活動による買戻可能参 加型投資証券保有者に帰属 する純資産の（減少）/増 加 | (46,180,699) | (5,379,590) | (35,507,187) | (4,136,232) | (14,527,069) | (1,692,258) | 19,134,676 | 2,347,825 | (2,805,433,769) |
| 買戻可能参加型投資証券の 発行による受取金 | 40,015,222 | 4,661,373 | 27,128,112 | 3,160,154 | 1,651,634 | 192,399 | 124,188,156 | 15,237,887 | 2,396,348,133 |
| 買戻可能参加型投資証券の 買戻しにかかる支払額 | (170,722,262) | (19,887,436) | (115,663,809) | (13,473,677) | (9,597,296) | (1,117,989) | (105,018,165) | (12,885,729) | (10,310,802,801) |
| 投資証券取引による 純資産の純変動 | (130,707,040) | (15,226,063) | (88,535,697) | (10,313,523) | (7,945,662) | (925,590) | 19,169,991 | 2,352,158 | (7,914,454,668) |
| 投資主資本の 純（減少）/増加 | (176,887,739) | (20,605,653) | (124,042,884) | (14,449,756) | (22,472,731) | (2,617,848) | 38,304,667 | 4,699,983 | (10,719,888,437) |
| 買戻可能参加型投資証券保 有者に帰属する期末純資産 | 568,152,344 | 66,184,067 | 349,098,724 | 40,666,510 | 77,466,255 | 9,024,044 | 588,783,833 | 72,243,776 | 31,195,751,228 |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとのキャッシュ・フロー計算書

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|--|----------------------------------|--------------------|---|--------------------|--|--------------------|--|--------------------|---|--------------------|---|--------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 投資売却による受取金 | 23,239,649 | 3,323,270 | 44,102,710 | 6,306,688 | 336,491,973 | 39,197,950 | 60,322,955 | 7,027,021 | 151,648,028 | 17,665,479 | 317,525,038 | 36,988,492 |
| 投資の購入 | (12,726,097) | (1,819,832) | (22,711,126) | (3,247,691) | (302,940,756) | (35,289,569) | (22,576,054) | (2,629,885) | (131,087,669) | (15,270,403) | (371,190,787) | (43,240,015) |
| 受取利息 | 979 | 140 | 743 | 106 | 9,475 | 1,104 | 1,563 | 182 | 10,853 | 1,264 | 1,153 | 134 |
| 純受取配当金 | 1,360,340 | 194,529 | 2,567,005 | 367,082 | - | - | 1,817,075 | 211,671 | 7,682,679 | 894,955 | (11,384) | (1,326) |
| その他利益 | 147 | 21 | 277 | 40 | 7 | 1 | - | - | - | - | (7,326) | (853) |
| ブローカーに対する （債務）/債権 | 147,422 | 21,081 | (460,829) | (65,899) | 1,141,753 | 133,003 | (119,977) | (13,976) | 53,015 | 6,176 | - | - |
| 営業費用の支払い | (384,811) | (55,028) | (693,723) | (99,202) | (989,461) | (115,262) | (701,449) | (81,712) | (3,356,842) | (391,039) | (4,009,581) | (467,076) |
| 営業活動による 純キャッシュ・ インフロー/ （アウトフロー） | <u>11,637,629</u> | <u>1,664,181</u> | <u>22,805,057</u> | <u>3,261,123</u> | <u>33,712,991</u> | <u>3,927,226</u> | <u>38,744,113</u> | <u>4,513,302</u> | <u>24,950,064</u> | <u>2,906,433</u> | <u>(57,692,887)</u> | <u>(6,720,644)</u> |
| 財務活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 分配金の支払額 | (957,287) | (136,892) | (2,053,082) | (293,591) | (472,546) | (55,047) | (1,296,451) | (151,024) | (4,610,210) | (537,043) | (19,368,001) | (2,256,178) |
| 利息支払額 | (2,863) | (409) | (3,210) | (459) | (22,773) | (2,653) | (9,017) | (1,050) | (39,227) | (4,570) | (24,453) | (2,849) |
| 投資証券取引 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 の発行による受取額 | 2,051,258 | 293,330 | 32,661,823 | 4,670,641 | 42,291,264 | 4,926,509 | 13,222,970 | 1,540,344 | 83,757,129 | 9,756,868 | 236,370,523 | 27,534,802 |
| 買戻可能参加型投資証券 の買戻しによる支払額 | (11,690,480) | (1,671,739) | (52,570,003) | (7,517,510) | (89,835,479) | (10,464,935) | (51,720,915) | (6,024,969) | (111,556,139) | (12,995,175) | (179,320,007) | (20,888,988) |
| 財務活動による 純キャッシュ・ （アウトフロー）/ インフロー | <u>(10,599,372)</u> | <u>(1,515,710)</u> | <u>(21,964,472)</u> | <u>(3,140,919)</u> | <u>(48,039,534)</u> | <u>(5,596,125)</u> | <u>(39,803,413)</u> | <u>(4,636,700)</u> | <u>(32,448,447)</u> | <u>(3,779,920)</u> | <u>37,658,062</u> | <u>4,386,788</u> |
| 現金および現金同等物の 純増加 /（減少） | <u>1,038,257</u> | <u>148,471</u> | <u>840,585</u> | <u>120,204</u> | <u>(14,326,543)</u> | <u>(1,668,899)</u> | <u>(1,059,300)</u> | <u>(123,398)</u> | <u>(7,498,383)</u> | <u>(873,487)</u> | <u>(20,034,825)</u> | <u>(2,333,857)</u> |
| 期首現金および 現金同等物 | 3,368,971 | 481,763 | 3,701,025 | 529,247 | 46,595,937 | 5,427,961 | 6,232,780 | 726,057 | 29,866,629 | 3,479,164 | 80,730,317 | 9,404,275 |
| 現金および現金同等物の 為替（差損）/差益 | (219,381) | (31,371) | (265,023) | (37,898) | 2,735,008 | 318,601 | 1,379,840 | 160,738 | 4,119,767 | 479,912 | 15,527,286 | 1,808,774 |
| 期末現金および 現金同等物 | <u>4,187,847</u> | <u>598,862</u> | <u>4,276,587</u> | <u>611,552</u> | <u>35,004,402</u> | <u>4,077,663</u> | <u>6,553,320</u> | <u>763,396</u> | <u>26,488,013</u> | <u>3,085,589</u> | <u>76,222,778</u> | <u>8,879,191</u> |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

* 現金および現金同等物には、銀行預金、手許現金、当座借越が含まれる。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとのキャッシュ・フロー計算書（続き）

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|--|---|--------------------|---|--------------------|---|--------------------|---|------------------|---|--------------------|---------------------------|------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 投資売却による受取金 | 845,338,247 | 98,473,452 | 1,194,124,416 | 139,103,553 | 145,844,195 | 16,989,390 | 91,558,177 | 10,665,612 | 146,752,918 | 17,095,247 | 61,506,932 | 7,164,943 |
| 投資の購入 | (864,293,353) | (100,681,533) | (1,123,164,696) | (130,837,455) | (218,823,082) | (25,490,701) | (95,030,160) | (11,070,063) | (157,104,947) | (18,301,155) | (61,195,489) | (7,128,663) |
| 受取利息 | - | - | 3,317 | 386 | 915 | 107 | 33 | 4 | 5,800 | 676 | 532 | 62 |
| 純受取配当金 | - | - | (402) | (47) | 99,056 | 11,539 | 1,734,511 | 202,053 | - | - | 1,414,956 | 164,828 |
| その他利益 | (102,743) | (11,969) | - | - | (3,835) | (447) | 443 | 52 | (76,261) | (8,884) | (8,207) | (956) |
| ブローカーに対する 債務 / (債権) | (53,182) | (6,195) | (1,115,697) | (129,968) | 204,934 | 23,873 | - | - | 1,202,058 | 140,028 | (194,732) | (22,684) |
| 営業費用の支払い | (1,263,246) | (147,156) | (786,096) | (91,572) | (1,074,285) | (125,143) | (745,699) | (86,866) | (1,003,290) | (116,873) | (1,547,006) | (180,211) |
| 営業活動による 純キャッシュ・ (アウトフロー) /インフロー | <u>(20,374,277)</u> | <u>(2,373,400)</u> | <u>69,060,842</u> | <u>8,044,897</u> | <u>(73,752,102)</u> | <u>(8,591,382)</u> | <u>(2,482,695)</u> | <u>(289,209)</u> | <u>(10,223,722)</u> | <u>(1,190,961)</u> | <u>(23,014)</u> | <u>(2,681)</u> |
| 財務活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 分配金の支払額 | (4,285,962) | (499,272) | (1,800,578) | (209,749) | (3,988,482) | (464,618) | (2,040,619) | (237,712) | (3,186,230) | (371,164) | (25,741) | (2,999) |
| 利息支払額 | (16,395) | (1,910) | (10,047) | (1,170) | (11,003) | (1,282) | (4,127) | (481) | (22,254) | (2,592) | (9,152) | (1,066) |
| 投資証券取引 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 の発行による受取額 | 111,016,393 | 12,932,300 | 18,656,747 | 2,173,324 | 127,028,734 | 14,797,577 | 33,586,793 | 3,912,526 | 63,473,348 | 7,394,010 | 26,318,259 | 3,065,814 |
| 買戻可能参加型投資証券 の買戻しによる支払額 | (77,772,719) | (9,059,744) | (99,500,219) | (11,590,781) | (42,700,799) | (4,974,216) | (27,282,302) | (3,178,115) | (46,944,863) | (5,468,607) | (29,480,776) | (3,434,216) |
| 財務活動による 純キャッシュ・ インフロー/ (アウトフロー) | <u>28,941,317</u> | <u>3,371,374</u> | <u>(82,654,097)</u> | <u>(9,628,376)</u> | <u>80,328,450</u> | <u>9,357,461</u> | <u>4,259,745</u> | <u>496,218</u> | <u>13,320,001</u> | <u>1,551,647</u> | <u>(3,197,410)</u> | <u>(372,466)</u> |
| 現金および現金同等物の 純増加 / (減少) | <u>8,567,040</u> | <u>997,974</u> | <u>(13,593,255)</u> | <u>(1,583,478)</u> | <u>6,576,348</u> | <u>766,079</u> | <u>1,777,050</u> | <u>207,009</u> | <u>3,096,279</u> | <u>360,686</u> | <u>(3,220,424)</u> | <u>(375,147)</u> |
| 期首現金および 現金同等物 | 5,220,332 | 608,116 | 12,594,091 | 1,467,086 | 15,755,616 | 1,835,372 | 1,143,318 | 133,185 | 29,549,395 | 3,442,209 | 10,889,646 | 1,268,535 |
| 現金および 現金同等物の為替差益 | 5,781,366 | 673,471 | 8,232,603 | 959,016 | 5,566,842 | 648,481 | 229,695 | 26,757 | 5,696,770 | 663,617 | 3,877,451 | 451,684 |
| 期末現金および 現金同等物 | <u>19,568,738</u> | <u>2,279,562</u> | <u>7,233,439</u> | <u>842,623</u> | <u>27,898,806</u> | <u>3,249,932</u> | <u>3,150,063</u> | <u>366,951</u> | <u>38,342,444</u> | <u>4,466,511</u> | <u>11,546,673</u> | <u>1,345,072</u> |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

* 現金および現金同等物には、銀行預金、手許現金、当座借越が含まれる。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとのキャッシュ・フロー計算書（続き）

2016年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス 米国バリュー 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル 株式ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|--|--------------------------------|--------------------|-------------------------------|--------------------|--|--------------------|--------------------------------------|---------------------|-------------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 | | 2016年11月30日に 終了した期間 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | |
| 投資売却による受取金 | 209,300,850 | 24,381,456 | 323,463,313 | 37,680,241 | 22,472,687 | 2,617,843 | 390,667,637 | 47,934,919 | 6,060,149,668 |
| 投資の購入 | (138,060,092) | (16,082,620) | (337,692,421) | (39,337,790) | (51,779,738) | (6,031,822) | (263,485,948) | (32,329,726) | (805,180,453) |
| 受取利息 | 1,991 | 232 | 3,509 | 409 | 1,562 | 182 | 7,042 | 864 | 138,767 |
| 純受取配当金 | 4,824,739 | 562,034 | 3,785,055 | 440,921 | 138,588 | 16,144 | 3,739,638 | 458,854 | 253,802,864 |
| その他利益 | (21,975) | (2,560) | (5,196) | (605) | 1,366 | 159 | (11,111) | (1,363) | (995,645) |
| ブローカーに対する 債務 | (81,868) | (9,537) | - | - | - | - | - | - | (22,007,840) |
| 営業費用の支払い | (2,367,857) | (275,832) | (1,691,607) | (197,055) | (406,199) | (47,318) | (2,536,710) | (311,254) | (107,583,731) |
| 営業活動による 純キャッシュ・ インフロー/ （アウトフロー） | <u>73,595,788</u> | <u>8,573,173</u> | <u>(12,137,347)</u> | <u>(1,413,880)</u> | <u>(29,571,734)</u> | <u>(3,444,811)</u> | <u>128,380,548</u> | <u>15,752,293</u> | <u>5,378,323,630</u> |
| 財務活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | |
| 分配金の支払額 | (2,747,703) | (320,080) | (4,551,139) | (530,162) | (2,549,628) | (297,006) | (6,362,712) | (780,705) | (94,358,482) |
| 利息支払額 | (18,162) | (2,116) | (43,310) | (5,045) | (2,575) | (300) | (61,418) | (7,536) | (2,982,586) |
| 投資証券取引 | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 の発行による受取額 | 39,160,635 | 4,561,822 | 69,552,235 | 8,102,140 | 50,681,641 | 5,903,904 | 18,341,101 | 2,250,453 | 1,054,638,111 |
| 買戻可能参加型投資証券 の買戻しによる支払額 | (112,318,425) | (13,083,973) | (45,402,899) | (5,288,984) | (14,424,563) | (1,680,317) | (134,430,457) | (16,494,617) | (6,691,670,267) |
| 財務活動による 純キャッシュ・ （アウトフロー）/ インフロー | <u>(75,923,655)</u> | <u>(8,844,347)</u> | <u>19,554,887</u> | <u>2,277,949</u> | <u>33,704,875</u> | <u>3,926,281</u> | <u>(122,513,486)</u> | <u>(15,032,405)</u> | <u>(5,734,373,224)</u> |
| 現金および現金同等物の 純（減少）/増加 | <u>(2,327,867)</u> | <u>(271,173)</u> | <u>7,417,540</u> | <u>864,069</u> | <u>4,133,141</u> | <u>481,470</u> | <u>5,867,062</u> | <u>719,889</u> | <u>(356,049,594)</u> |
| 期首現金および 現金同等物 | 18,731,923 | 2,182,082 | 2,784,600 | 324,378 | 1,710,419 | 199,247 | 1,984,828 | 243,538 | 788,249,552 |
| 現金および 現金同等物の為替差益 | 6,934,841 | 807,840 | 5,305,984 | 618,094 | 104,149 | 12,132 | 2,789,968 | 342,329 | 73,070,957 |
| 期末現金および 現金同等物 | <u>23,338,897</u> | <u>2,718,748</u> | <u>15,508,124</u> | <u>1,806,541</u> | <u>5,947,709</u> | <u>692,849</u> | <u>10,641,858</u> | <u>1,305,756</u> | <u>505,270,915</u> |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

* 現金および現金同等物には、銀行預金、手許現金、当座借越が含まれる。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとのキャッシュ・フロー計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ ファンド | | グローバル・アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド | |
|--|----------------------------------|------------------|---|------------------|--|--------------------|--|------------------|---|------------------|---|---------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
| | 英ポンド | 千円 | 英ポンド | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 投資売却による受取金 | 17,570,930 | 2,512,643 | 20,739,312 | 2,965,722 | 584,656,111 | 68,106,590 | 32,508,200 | 3,786,880 | 192,848,485 | 22,464,920 | 343,352,865 | 39,997,175 |
| 投資の購入 | (17,595,946) | (2,516,220) | (22,567,554) | (3,227,160) | (585,438,248) | (68,197,702) | (29,115,610) | (3,391,677) | (184,406,034) | (21,481,459) | (436,307,637) | (50,825,477) |
| 受取利息 | 13 | 2 | 1 | 0 | 5,618 | 654 | 811 | 94 | 23,112 | 2,692 | 99 | 12 |
| 純受取配当金 | 1,454,906 | 208,052 | 2,615,832 | 374,064 | - | - | 1,467,948 | 171,001 | 8,074,199 | 940,563 | 147,169 | 17,144 |
| その他利益 | (286,394) | (40,954) | 602 | 86 | 76,559 | 8,918 | 33 | 4 | 2,302 | 268 | 3,364 | 392 |
| ブローカーに対する （債務）/債権 | (66,983) | (9,579) | 332,503 | 47,548 | 3,487,393 | 406,246 | 122,170 | 14,232 | 465,902 | 54,273 | - | - |
| 営業費用の支払い | (446,650) | (63,871) | (759,205) | (108,566) | (967,720) | (112,730) | (604,169) | (70,380) | (3,789,982) | (441,495) | (3,717,833) | (433,090) |
| 営業活動による 純キャッシュ・ インフロー/ （アウトフロー） | <u>629,876</u> | <u>90,072</u> | <u>361,491</u> | <u>51,693</u> | <u>1,819,713</u> | <u>211,978</u> | <u>4,379,383</u> | <u>510,154</u> | <u>13,217,984</u> | <u>1,539,763</u> | <u>(96,521,973)</u> | <u>(11,243,845)</u> |
| 財務活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 分配金の支払額 | (1,200,550) | (171,679) | (2,073,890) | (296,566) | (576,792) | (67,191) | (929,449) | (108,272) | (4,237,102) | (493,580) | (14,924,848) | (1,738,596) |
| 利息支払額 | (789) | (113) | (1,829) | (262) | (23,116) | (2,693) | (3,735) | (435) | (48,665) | (5,669) | (13,135) | (1,530) |
| 投資証券取引 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 の発行による受取額 | 3,715,218 | 531,276 | 18,784,495 | 2,686,183 | 23,082,650 | 2,688,898 | 3,680,613 | 428,755 | 96,079,618 | 11,192,315 | 313,236,131 | 36,488,877 |
| 買戻可能参加型投資証券 の買戻しによる支払額 | (5,310,392) | (759,386) | (19,926,031) | (2,849,422) | (33,055,156) | (3,850,595) | (8,641,076) | (1,006,599) | (97,795,104) | (11,392,152) | (147,443,085) | (17,175,645) |
| 財務活動による 純キャッシュ・ アウトフロー/ （インフロー） | <u>(2,796,513)</u> | <u>(399,901)</u> | <u>(3,217,255)</u> | <u>(460,067)</u> | <u>(10,572,414)</u> | <u>(1,231,581)</u> | <u>(5,893,647)</u> | <u>(686,551)</u> | <u>(6,001,253)</u> | <u>(699,086)</u> | <u>150,855,063</u> | <u>17,573,106</u> |
| 現金および現金同等物の 純（減少）/増加 | <u>(2,166,637)</u> | <u>(309,829)</u> | <u>(2,855,764)</u> | <u>(408,374)</u> | <u>(8,752,701)</u> | <u>(1,019,602)</u> | <u>(1,514,264)</u> | <u>(176,397)</u> | <u>7,216,731</u> | <u>840,677</u> | <u>54,333,090</u> | <u>6,329,262</u> |
| 期首現金および 現金同等物 | 5,403,232 | 772,662 | 2,161,880 | 309,149 | 28,422,331 | 3,310,917 | 6,710,379 | 781,692 | 24,843,175 | 2,893,981 | 73,522,842 | 8,564,676 |
| 現金および現金同等物 の為替差益/（差損） | 297,962 | 42,609 | 663,775 | 94,920 | (2,933,541) | (341,728) | (1,238,124) | (144,229) | (3,692,476) | (430,137) | (9,248,434) | (1,077,350) |
| 期末現金および 現金同等物 | <u>3,534,557</u> | <u>505,442</u> | <u>(30,109)</u> | <u>(4,306)</u> | <u>16,736,089</u> | <u>1,949,587</u> | <u>3,957,991</u> | <u>461,066</u> | <u>28,367,430</u> | <u>3,304,522</u> | <u>118,607,498</u> | <u>13,816,587</u> |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

* 現金および現金同等物には、銀行預金、手許現金、当座借越が含まれる。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとのキャッシュ・フロー計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | | グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | | グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | |
|--|---|--------------------|---|------------------|---|--------------------|---|------------------|---|--------------------|---------------------------|--------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 投資売却による受取金 | 376,960,338 | 43,912,110 | 1,807,185,774 | 210,519,071 | 154,720,634 | 18,023,407 | 36,498,721 | 4,251,736 | 526,950,397 | 61,384,452 | 181,425,143 | 21,134,215 |
| 投資の購入 | (377,233,939) | (43,943,982) | (1,810,116,111) | (210,860,426) | (133,317,207) | (15,530,121) | (30,595,733) | (3,564,097) | (595,897,975) | (69,416,155) | (148,386,259) | (17,285,515) |
| 受取利息 | 2,085 | 243 | 38,432 | 4,477 | 131 | 15 | 2 | 0 | 302 | 35 | 18 | 2 |
| 純受取配当金 | - | - | - | - | 102,006 | 11,883 | 1,767,459 | 205,891 | - | - | 1,752,838 | 204,188 |
| その他利益 | 40,407 | 4,707 | - | - | - | - | (414) | (48) | (544) | (63) | (45) | (5) |
| ブローカーに対する 債権 / (債務) | 927,131 | 108,001 | (38,873) | (4,528) | (79,104) | (9,215) | - | - | (861,540) | (100,361) | 591,804 | 68,939 |
| 営業費用の支払い | (1,377,516) | (160,467) | (993,264) | (115,705) | (1,321,978) | (153,997) | (833,921) | (97,143) | (968,527) | (112,824) | (1,897,844) | (221,080) |
| 営業活動による 純キャッシュ・ (アウトフロー) /インフロー | <u>(681,494)</u> | <u>(79,387)</u> | <u>(3,924,042)</u> | <u>(457,112)</u> | <u>20,104,482</u> | <u>2,341,971</u> | <u>6,836,114</u> | <u>796,339</u> | <u>(70,777,887)</u> | <u>(8,244,916)</u> | <u>33,485,655</u> | <u>3,900,744</u> |
| 財務活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | | | | |
| 分配金の支払額 | (5,125,110) | (597,024) | (438,763) | (51,112) | (4,058,116) | (472,730) | (1,855,729) | (216,174) | (3,833,598) | (446,576) | 115 | 13 |
| 利息支払額 | (5,317) | (619) | (2,984) | (348) | (8,171) | (952) | (3,746) | (436) | (8,096) | (943) | (224) | (26) |
| 投資証券取引 | | | | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 の発行による受取額 | 16,055,842 | 1,870,345 | 50,240,178 | 5,852,478 | 25,382,966 | 2,956,862 | 3,847,138 | 448,153 | 139,861,899 | 16,292,513 | 52,148,839 | 6,074,818 |
| 買戻可能参加型投資証券 の買戻しによる支払額 | (30,082,243) | (3,504,280) | (45,157,205) | (5,260,363) | (49,739,469) | (5,794,151) | (10,065,805) | (1,172,566) | (80,997,947) | (9,435,451) | (92,052,278) | (10,723,170) |
| 財務活動による 純キャッシュ・ (アウトフロー) /インフロー | <u>(19,156,828)</u> | <u>(2,231,579)</u> | <u>4,641,226</u> | <u>540,656</u> | <u>(28,422,790)</u> | <u>(3,310,971)</u> | <u>(8,078,142)</u> | <u>(941,023)</u> | <u>55,022,258</u> | <u>6,409,543</u> | <u>(39,903,548)</u> | <u>(4,648,364)</u> |
| 現金および現金同等物の 純(減少)/増加 | <u>(19,838,322)</u> | <u>(2,310,966)</u> | <u>717,184</u> | <u>83,545</u> | <u>(8,318,308)</u> | <u>(969,000)</u> | <u>(1,242,028)</u> | <u>(144,684)</u> | <u>(15,755,629)</u> | <u>(1,835,373)</u> | <u>(6,417,893)</u> | <u>(747,620)</u> |
| 期首現金および 現金同等物 | 24,596,940 | 2,865,298 | 14,146,088 | 1,647,878 | 22,786,508 | 2,654,400 | 2,137,520 | 249,000 | 64,088,582 | 7,465,679 | 22,282,357 | 2,595,672 |
| 現金および 現金同等物の為替差損 | (4,201,086) | (489,385) | (4,444,912) | (517,788) | (3,576,647) | (416,644) | (107,077) | (12,473) | (8,275,254) | (963,984) | (4,883,365) | (568,863) |
| 期末現金および 現金同等物 | <u>557,532</u> | <u>64,947</u> | <u>10,418,360</u> | <u>1,213,635</u> | <u>10,891,553</u> | <u>1,268,757</u> | <u>788,415</u> | <u>91,842</u> | <u>40,057,699</u> | <u>4,666,321</u> | <u>10,981,099</u> | <u>1,279,188</u> |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

* 現金および現金同等物には、銀行の現金、手許現金、当座借越が含まれる。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ファンドごとのキャッシュ・フロー計算書（続き）

2015年11月30日に終了した6か月間

| | グローバル・アクセス 米国バリュー 株式ファンド | | グローバル・アクセス グローバル 株式ファンド | | グローバル・アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・カレンシー・ デット・ファンド | | グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・ アルファ・ファンド | | グローバル・アクセス ジャパン・ファンド |
|--|--------------------------------|---------------------|-------------------------------|---------------------|--|--------------------|--------------------------------------|--------------------|-------------------------|
| | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 | | 2015年11月30日に 終了した期間 |
| | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | 米ドル | 千円 | ユーロ | 千円 | 日本円 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | |
| 投資売却による受取金 | 658,016,909 | 76,652,390 | 223,409,302 | 26,024,950 | 39,972,650 | 4,656,414 | 246,756,702 | 30,277,047 | 7,806,488,981 |
| 投資の購入 | (579,612,111) | (67,519,015) | (140,939,362) | (16,418,026) | (30,452,942) | (3,547,463) | (261,841,846) | (32,127,995) | (1,712,136,772) |
| 受取利息 | 4 | 0 | 25,656 | 2,989 | 1,584 | 185 | 3,165 | 388 | 788 |
| 純受取配当金 | 5,630,453 | 655,891 | 5,791,200 | 674,617 | - | - | 3,977,129 | 487,994 | 339,319,082 |
| その他利益 | 5,072 | 591 | 2,012 | 234 | 939 | 109 | 1,446 | 177 | - |
| ブローカーに対する 債権 | 2,209,204 | 257,350 | 1,620,364 | 188,756 | - | - | - | - | 6,939,863 |
| 営業費用の支払い | (3,251,418) | (378,758) | (2,399,304) | (279,495) | (509,714) | (59,377) | (3,008,058) | (369,089) | (188,942,642) |
| 営業活動による 純キャッシュ・ インフロー/ （アウトフロー） | <u>82,998,113</u> | <u>9,668,450</u> | <u>87,509,868</u> | <u>10,194,025</u> | <u>9,012,517</u> | <u>1,049,868</u> | <u>(14,111,462)</u> | <u>(1,731,476)</u> | <u>6,251,669,300</u> |
| 財務活動による キャッシュ・フロー | | | | | | | | | |
| 分配金の支払額 | (2,124,823) | (247,521) | (7,139,308) | (831,658) | (2,075,289) | (241,750) | (4,355,812) | (534,458) | (118,799,070) |
| 利息支払額 | (2,725) | (317) | (20,710) | (2,413) | (5,470) | (637) | (24,776) | (3,040) | (203,708) |
| 投資証券取引 | | | | | | | | | |
| 買戻可能参加型投資証券 の発行による受取額 | 40,109,864 | 4,672,398 | 26,851,069 | 3,127,881 | 816,435 | 95,107 | 124,544,384 | 15,281,596 | 2,393,089,995 |
| 買戻可能参加型投資証券 の買戻しによる支払額 | (167,198,371) | (19,476,938) | (116,017,561) | (13,514,886) | (9,806,097) | (1,142,312) | (105,056,095) | (12,890,383) | (10,247,731,651) |
| 財務活動による 純キャッシュ・ （アウトフロー）/ インフロー | <u>(129,216,055)</u> | <u>(15,052,378)</u> | <u>(96,326,510)</u> | <u>(11,221,075)</u> | <u>(11,070,421)</u> | <u>(1,289,593)</u> | <u>15,107,701</u> | <u>1,853,715</u> | <u>(7,973,644,434)</u> |
| 現金および現金同等物の 純（減少）/増加 | <u>(46,217,942)</u> | <u>(5,383,928)</u> | <u>(8,816,642)</u> | <u>(1,027,051)</u> | <u>(2,057,904)</u> | <u>(239,725)</u> | <u>996,239</u> | <u>122,239</u> | <u>(1,721,975,134)</u> |
| 期首現金および 現金同等物 | 77,695,153 | 9,050,708 | 34,368,309 | 4,003,564 | 3,416,532 | 397,992 | 10,794,861 | 1,324,529 | 2,908,420,974 |
| 現金および 現金同等物の為替差損 | (8,167,698) | (951,455) | (6,612,617) | (770,304) | (401,276) | (46,745) | (7,487,325) | (918,695) | (267,329,721) |
| 期末現金および 現金同等物 | <u>23,309,513</u> | <u>2,715,325</u> | <u>18,939,050</u> | <u>2,206,210</u> | <u>957,352</u> | <u>111,522</u> | <u>4,303,775</u> | <u>528,073</u> | <u>919,116,119</u> |

添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

* 現金および現金同等物には、銀行預金、手許現金、当座借越が含まれる。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

未監査財務諸表注記

2016年11月30日に終了した6か月間

1. 重要な会計方針

a) 作成の基礎

当中間報告書および未監査財務諸表は、国際会計基準（以下「IAS」という。）第34号「中間財務報告書」、ならびに国際財務報告基準（以下「IFRS」という。）、欧州委員会（譲渡可能証券への集団投資事業）規則2011（以下「UCITS規制」という。）、および2013年中央銀行（監督および執行）法（第48(1)条）（譲渡可能証券への集団投資事業）規則2015（以下「中央銀行UCITS規制」という。）に準拠して財務報告を行う企業に適用される2014年会社法の該当箇所に準拠して作成されている。当中間報告書および未監査財務諸表は、IFRSに準拠した完全な一体としての財務諸表に求められている情報をすべて網羅している訳ではない。ただし、前回の2016年5月31日現在および同日に終了した会計年度の年次財務諸表以降の当ファンドのポジションおよびパフォーマンスの変動を理解する上で重要な事象や取引を説明するため、一部の注記が掲載されている。したがって、これらの概要および未監査財務諸表は、2016年5月31日に終了した会計年度におけるパークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー（以下「本投資法人」という。）の年次財務諸表と併せて、読むべきである。

本投資法人は、2016年11月30日現在トレーディングされている以下の17のサブファンド（以下「ファンド」という。）で構成されている。つまり、グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド、グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド、グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド、グローバル・アクセス パシフィック・リム（除く日本）・ファンド、グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド、グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド、グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド、グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド、グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド、グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド、グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド、グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド、グローバル・アクセス 米国バリューストックファンド、グローバル・アクセス グローバル株式ファンド、グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド、グローバル・アクセス 欧州（除く英国）・アルファ・ファンド、グローバル・アクセス ジャパン・ファンドである。

IFRSに従った財務諸表の作成では、報告日現在の資産および負債の報告金額、ならびに当該報告期間中の収益および費用の報告金額に影響を及ぼす特定の重要な見積りおよび仮定を使用することが要求される。これらの見積りは、金額、事象または活動に関する経営陣の最善の知識に基づくが、最終的な実際の結果はこれらの見積りとは異なることがある。

国際会計基準：

公表済なもの、2016年6月1日から始まる会計期に発効しておらず、早期適用されていない新基準、改訂および解釈指針

開示イニシアティブ - IAS第7号「キャッシュ・フロー計算書」の改訂（以下「改訂」という。）。これによる主な変更点は以下のとおりである。

- ）財務諸表利用者が財務活動から生じる負債の変動を評価できる開示を提供することが要求される。
- ）財務活動から生じる負債について、財政状態計算書において期首残高と期末残高との調整表を提供することが提案されているが、この適用は強制ではない。

同基準の強制発効日は2017年1月1日以降に開始する年度である。

1. 重要な会計方針(続き)

a) 作成の基礎(続き)

国際会計基準(続き):

公表済なもの、2016年6月1日から始まる会計期に発効しておらず、早期適用されていない新基準、改訂および解釈指針

- ・ IFRS第9号「金融商品」は、金融資産および金融負債の分類、測定および認識を取り扱っている。IFRS第9号は2009年11月および2010年10月に発表された。当基準は、IAS第39号の金融商品の分類および測定に関する部分と置き換えられる。IFRS第9号は、金融資産を2つの測定カテゴリー、つまり公正価値測定および償却原価測定に分類することを要求している。この決定は、当初認識において行われる。この分類は、金融商品を管理する事業体の事業モデルおよび商品の契約上のキャッシュ・フローの特徴に基づく。
- ・ 金融負債については、当基準はIAS第39号の要件のほとんどを留保している。主要な変更は、金融負債に公正価値オプションを利用する場合、事業体自身の信用リスクによる公正価値変動の一部が、損益計算書ではなく、その他の包括利益に計上されることである。但し、これにより会計上のミスマッチが生じる場合を除く。本投資法人はまだ、IFRS第9号の完全な影響を評価していない。当基準の強制効力発生日は2018年1月1日以降に始まる会計年度だが、早期適用も認められている。

未だ発効していないが、本投資法人に重大な影響を及ぼす見込みの他の基準、解釈指針、または既存の基準の改訂はない。

b) 外国為替

本投資法人のほとんどの投資家が英国を拠点とするため、本投資法人は機能通貨および表示通貨として英ポンドを採用している。外貨取引は、外貨建金額に取引日現在の機能通貨と外貨との実際の為替レートを適用して、機能通貨で計上される。

各ファンドの機能通貨および表示通貨は英ポンドであるが、以下を例外とする。

() グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド(機能通貨がユーロ)

() グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド
 グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド
 グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド
 グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド
 グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド
 グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド
 グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド
 グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド
 グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
 グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド
 グローバル・アクセス 米国バリューストックファンド
 グローバル・アクセス グローバル株式ファンド
 グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・
 デット・ファンド

(機能通貨が米ドル)

() グローバル・アクセス ジャパン・ファンド(機能通貨が日本円)

1. 重要な会計方針(続き)

b) 外国為替(続き)

()、()、()のファンドの上記財政状態計算書は、本投資法人の総計を算出するため、期末の実勢為替レートでユーロ、米ドル、日本円から英ポンドに換算されている。

投資を含め、外貨建の資産および負債は、期末の実勢為替レートで英ポンドに換算される。投資の換算に基づく為替換算差損益は、損益を通じて公正価値評価される金融負債および金融負債にかかる純利益/(損失)に含まれる。

期中に処理された外貨取引は、取引日の為替レートで換算される。為替換算差損益は、包括利益計算書で、損益を通じて公正価値評価される金融負債および金融負債にかかる純利益/(損失)に含まれる。

表示通貨への換算

ファンドの財務諸表を結合して(アイルランド会社法で要求される)本投資法人の合算値にするために、財務諸表の金額は、2016年11月30日の実勢為替レートで表示通貨である英ポンドに換算されている。換算により、個々のファンドに帰属する1株当たり純資産価格に影響はない。

結果として生じた換算差益105,448,644英ポンド(2016年5月31日:206,291,360英ポンドの差益)は、2016年6月1日から2016年11月30日までの為替レートの変動によるものである。これは、個別のファンドの個々の投資証券クラスに帰属する1株当たり純資産価値には影響しない、想定上の利益/(損失)である。

買戻可能参加型投資証券の募集による受取金および買戻しによる支払金額は、取引日の実勢為替レートに近似した平均レートで換算される。損益を通じて公正価値評価して保有される株式などの非貨幣性項目の換算差額は、包括利益計算書で公正価値損益の一部として計上され、キャッシュ・フロー計算書では現金および現金同等物にかかる為替差益として計上される。

1. 重要な会計方針(続き)

b) 外国為替(続き)

表示通貨への換算(続き)

投資、資産および負債を本投資法人の機能通貨に換算するために、以下の為替レートが使用されている。

| 米ドル | 2016年11月30日現在 | 2016年5月31日現在 | 2015年11月30日現在 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|
| 豪ドル | 1.3535 | 1.3804 | 1.3826 |
| ブラジル・レアル | 3.3825 | 3.6020 | 3.8690 |
| 英ポンド | 0.8004 | 0.6870 | 0.6653 |
| カナダ・ドル | 1.3446 | 1.3081 | 1.3355 |
| チリ・ペソ | 673.0500 | 689.3500 | 710.6501 |
| 中国人民元 | 6.8870 | 6.5850 | 6.3981 |
| コロンビア・ペソ | 3,056.0650 | 3,090.4650 | 3,144.6005 |
| チェコ・コルナ | 25.5082 | 24.2744 | 25.5890 |
| デンマーク・クローネ | 7.0136 | 6.6818 | 7.0611 |
| エジプト・ポンド | 17.7750 | 8.8800 | 7.8301 |
| ユーロ | 0.9427 | 0.8983 | 0.9470 |
| 香港ドル | 7.7567 | 7.7682 | 7.7535 |
| ハンガリー・フォリント | 295.2112 | 281.6888 | 294.2408 |
| インド・ルピー | 68.4490 | 67.2850 | 66.6550 |
| インドネシア・ルピア | 13,552.5000 | 13,660.0000 | 13,835.0000 |
| イスラエル・シェケル | 3.8339 | 3.8509 | 3.8716 |
| 日本円 | 113.9450 | 110.9050 | 123.1000 |
| マレーシア・リンギット | 4.4660 | 4.1290 | 4.2640 |
| メキシコ・ペソ | 20.4725 | 18.4032 | 16.5783 |
| ニュージーランド・ドル | 1.4108 | 1.4781 | 1.5205 |
| ナイジェリア・ナイラ | 314.6200 | 199.0500 | 199.0500 |
| ノルウェー・クローネ | 8.5132 | 8.3632 | 8.6906 |
| フィリピン・ペソ | 49.7300 | 46.7650 | 47.1400 |
| ポーランド・ズロチ | 4.1921 | 3.9442 | 4.0411 |
| ルーマニア・レウ | 4.2420 | 4.0582 | 4.2182 |
| ロシア・ルーブル | 64.5750 | 66.0763 | 66.3000 |
| 南アフリカ・ランド | 14.0263 | 15.7280 | 14.4560 |
| 韓国ウォン | 1,169.0500 | 1,191.8000 | 1,158.0501 |
| シンガポール・ドル | 1.4324 | 1.3768 | 1.4106 |
| スウェーデン・クローナ | 9.2320 | 8.3533 | 8.7218 |
| スイス・フラン | 1.0187 | 0.9942 | 1.0289 |
| 台湾ドル | 31.8730 | 32.6125 | 32.6420 |
| タイ・バーツ | 35.6795 | 35.7250 | 35.8200 |
| トルコ・リラ | 3.4288 | 2.9517 | 2.9133 |
| ウルグアイ・ペソ | 29.0250 | 30.7800 | 29.6350 |

1. 重要な会計方針(続き)

b) 外国為替(続き)

表示通貨への換算(続き)

| ユーロ | 2016年11月30日現在 | 2016年5月31日現在 | 2015年11月30日現在 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|
| 英ポンド | 0.8490 | 0.7649 | 0.7015 |
| デンマーク・クローネ | 7.4400 | 7.4385 | 7.4604 |
| ノルウェー・クローネ | 9.0307 | 9.3103 | 9.1820 |
| ポーランド・ズロチ | 4.4469 | 4.3908 | 4.2698 |
| スウェーデン・クローナ | 9.7933 | 9.2993 | 9.2150 |
| スイス・フラン | 1.0806 | 1.1068 | 1.0870 |
| トルコ・リラ | 3.6373 | 3.2859 | 3.0780 |
| 米ドル | 1.0608 | 1.1133 | 1.0566 |

| 英ポンド | 2016年11月30日現在 | 2016年5月31日現在 | 2015年11月30日現在 |
|------------|---------------|--------------|---------------|
| デンマーク・クローネ | 8.7628 | 9.7253 | 10.6347 |
| ユーロ | 1.1778 | 1.3074 | 1.4255 |
| 日本円 | 142.3629 | 161.4222 | 185.4010 |
| ノルウェー・クローネ | 10.6363 | 12.1726 | 13.0889 |
| スイス・フラン | 1.2727 | 1.4471 | 1.5495 |
| 米ドル | 1.2494 | 1.4555 | 1.5061 |

| 日本円 | 2016年11月30日現在 | 2016年5月31日現在 | 2015年11月30日現在 |
|---------|---------------|--------------|---------------|
| 英ポンド | 0.0070 | 0.0062 | 0.0054 |
| ユーロ | 0.0083 | 0.0081 | 0.0077 |
| スイス・フラン | 0.0089 | 0.0090 | 0.0084 |
| 米ドル | 0.0088 | 0.0090 | 0.0081 |

以下の平均為替レートが、本投資法人の包括利益計算書および買戻可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書の取引残高を表示通貨に換算するために用いられている。

| 英ポンド | 2016年11月30日現在 | 2015年11月30日現在 |
|------|---------------|---------------|
| ユーロ | 1.1775 | 1.1869 |
| 日本円 | 135.9285 | 132.4164 |
| 米ドル | 1.3060 | 1.5516 |

2. 効率的なポートフォリオ管理

効率的なポートフォリオ管理および為替リスクのヘッジのために、当ファンドは、為替に関して先物契約の締結、コール・オプションの売建、プット・オプションの買建を実施することがある。但し、これらの取引は、定期的に取り引が行われる規制された市場で取引され、組織されおよび公開されている契約のみに関係していることを条件としている。当ファンドは、この種類の取引を専門とする高格付けの金融機関と「店頭」取り決めによる、為替の先渡売買契約、または為替の交換を締結することもある。当期中に、当ファンドは投資ならびに保有現金にかかる為替リスクをヘッジする目的で、ベンチマーク・リスクをヘッジし、ユーロ建、米ドル建、日本円建および英ポンド建投資証券の特定クラスの価値をヘッジするために、先物契約および為替先渡契約を締結した。2016年11月30日現在の契約残高は、関連するファンドの投資明細書に開示されている。効率的なポートフォリオ管理目的に使用される金融商品にかかる実現・未実現公正価値損益は、包括利益計算書に含まれる。

[次へ](#)

3. 金融リスク管理

公正価値階層の開示

IFRS第13号「公正価値測定」は、当ファンドが、貸借対照表の資産および負債の測定に使用されるインプットの重要性を反映した公正価値階層を使用して、公正価値測定を分類することを要求している。

この開示は、公正価値を測定するための評価手法に用いられるインプットに関する、3つのレベルの公正価値階層に基づく。活発な市場で取引される金融資産および金融負債（トレーディング証券など）の公正価値は、期末日の取引終了時点における相場価格仲値に基づく。当ファンドが保有する為替契約の公正価値は、価格決定モデルを用いて算出される。

金融商品は、相場価格が容易かつ定期的に、取引所、ディーラー、ブローカー、産業グループ、価格決定サービスまたは規制当局から入手でき、かかる価格が実際また定期的に生じる第三者間ベースでの市場取引を表す場合、活発な市場での相場があるとみなされる。

活発な市場で取引されていない金融資産および金融負債の公正価値は、評価手法を用いて決定される。当ファンドは多様な方法を利用し、期末日現在の市場状況に基づく仮定を行っている。当ファンドは、測定を行う場合に用いられるインプットの重要性を反映した公正価値階層を利用して、公正価値測定を分類している。公正価値階層は、以下のレベルに分類される。

- () 同一の資産または負債に関する活発な市場での（未調整の）相場価格（レベル1）
- () レベル1に含まれる相場価格以外で、資産または負債に関して、直接（つまり価格）または間接的（つまり価格から算出される）に、観察可能なインプット（レベル2）
- () 観察可能な市場データに基づかない資産または負債に関するインプット（つまり、観察不能なインプット）（レベル3）

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

以下は、ポートフォリオ資産および負債の評価における、2016年11月30日および2016年5月31日現在のインプットに従った公正価値評価の要約である。

グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|-------------------|------------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 英債券 | 英債券 | 英債券 |
| 株式 | 67,288,537 | - | - |
| 投資ファンド | - | 1,039,763 | - |
| デリバティブ | 13,250 | 10,278 | - |
| 資産合計 | 67,301,787 | 1,050,041 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 77,022 | - |
| 負債合計 | - | 77,022 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|-------------------|------------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 英債券 | 英債券 | 英債券 |
| 株式 | 70,051,447 | 19,775 | - |
| 投資ファンド | - | 1,160,318 | - |
| デリバティブ | 10,350 | 497 | - |
| 資産合計 | 70,061,797 | 1,180,590 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 237,791 | - |
| 負債合計 | - | 237,791 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|------------------|----------------|----------|
| | 英ポンド | 英ポンド | 英ポンド |
| ブローカーに対する債権 | - | 82,778 | - |
| その他の債権 | - | 714,215 | - |
| 現金および現金同等物 | 4,187,847 | - | - |
| 資産合計 | 4,187,847 | 796,993 | - |
| 負債 | | | |
| その他の債務 | - | 480,552 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 400,321 | - |
| 負債合計 | - | 880,873 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|------------------|----------------|----------|
| | 英ポンド | 英ポンド | 英ポンド |
| ブローカーに対する債権 | - | 230,200 | - |
| その他の債権 | - | 418,028 | - |
| 現金および現金同等物 | 3,368,971 | - | - |
| 資産合計 | 3,368,971 | 648,228 | - |
| 負債 | | | |
| その他の債務 | - | 349,212 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 297,019 | - |
| 負債合計 | - | 646,231 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|----------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 英債券 | 英債券 | 英債券 |
| 株式 | 121,555,066 | - | - |
| デリバティブ | - | 95,669 | - |
| 資産合計 | 121,555,066 | 95,669 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 92,510 | 137,745 | - |
| 負債合計 | 92,510 | 137,745 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|----------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 英債券 | 英債券 | 英債券 |
| 株式 | 130,194,126 | - | - |
| デリバティブ | 37,893 | 4,105 | - |
| 資産合計 | 130,232,019 | 4,105 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 391,657 | - |
| 負債合計 | - | 391,657 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|------------------|------------------|----------|
| | 英ポンド | 英ポンド | 英ポンド |
| ブローカーに対する債権 | - | 642,960 | - |
| その他の債権 | - | 2,299,634 | - |
| 現金および現金同等物 | 4,276,587 | - | - |
| 資産合計 | 4,276,587 | 2,942,594 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 850,413 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 519,691 | - |
| 負債合計 | - | 1,370,104 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|------------------|------------------|----------|
| | 英ポンド | 英ポンド | 英ポンド |
| ブローカーに対する債権 | - | 189,261 | - |
| その他の債権 | - | 953,063 | - |
| 現金および現金同等物 | 3,701,025 | - | - |
| 資産合計 | 3,701,025 | 1,142,324 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 559,961 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 215,072 | - |
| 負債合計 | - | 775,033 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|----------------|--------------------|----------|
| トレーディング目的の 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 178,125,601 | - |
| 投資ファンド | - | 2,680,354 | - |
| デリバティブ | 114,037 | 6,688,684 | - |
| 資産合計 | 114,037 | 187,494,639 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
| TBA売却コミットメント | - | 5,369,064 | - |
| デリバティブ | 224,998 | 3,876,282 | - |
| 負債合計 | 224,998 | 9,245,346 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|-------------------|-------------------|----------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 1,031,087 | - |
| その他の債権 | - | 3,943,772 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 3,110,000 | - |
| 現金および現金同等物 | 35,004,402 | - | - |
| 資産合計 | 35,004,402 | 8,084,859 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 34,331 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 3,110,000 | - |
| その他の債務 | - | 6,599,359 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 2,425,700 | - |
| 負債合計 | - | 12,169,390 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|----------------|--------------------|----------|
| トレーディング目的の 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 224,360,149 | - |
| 投資ファンド | - | 4,000,931 | - |
| デリバティブ | 210,680 | 4,691,950 | - |
| 資産合計 | 210,680 | 233,053,030 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
| TBA売却コミットメント | - | 5,424,305 | - |
| デリバティブ | 174,061 | 1,710,940 | - |
| 負債合計 | 174,061 | 7,135,245 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|-------------------|-------------------|----------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 2,386,298 | - |
| その他の債権 | - | 7,074,893 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 880,000 | - |
| 現金および現金同等物 | 46,595,937 | - | - |
| 資産合計 | 46,595,937 | 10,341,191 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 247,789 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 880,000 | - |
| その他の債務 | - | 1,699,681 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 1,512,940 | - |
| 負債合計 | - | 4,340,410 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス パシフィック・リム（除く日本）・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|-------------------|------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 98,816,335 | - | - |
| 投資ファンド | - | 2,122,421 | - |
| デリバティブ | 16,495 | 1,391 | - |
| Pノート | - | 3,776,924 | - |
| 資産合計 | 98,832,830 | 5,900,736 | - |

負債

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 570,033 | - |
| 負債合計 | - | 570,033 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 137,185,122 | 5,120 | - |
| 投資ファンド | - | 2,709,666 | - |
| デリバティブ | - | 643,337 | - |
| Pノート | - | 3,815,550 | - |
| 資産合計 | 137,185,122 | 7,173,673 | - |

負債

| | | | |
|-------------|--------------|---------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 4,184 | 36,527 | - |
| 負債合計 | 4,184 | 36,527 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

3. 金融リスク管理(続き)

公正価値階層の開示(続き)

グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド(続き)

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|------------------|------------------|----------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 321,812 | - |
| その他の債権 | - | 488,772 | - |
| 現金および現金同等物 | 6,553,320 | - | - |
| 資産合計 | 6,553,320 | 810,584 | - |
| 負債 | | | |
| ブローカーに対する債務 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 1,573,305 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 983,326 | - |
| 負債合計 | - | 2,556,631 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------------------|------------------|------------------|----------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 417,050 | - |
| その他の債権 | - | 2,841,622 | - |
| 現金および現金同等物 | 6,232,780 | - | - |
| 資産合計 | 6,232,780 | 3,258,672 | - |
| 負債 | | | |
| ブローカーに対する債務 | - | 215,215 | - |
| その他の債務 | - | 936,746 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 305,060 | - |
| 負債合計 | - | 1,457,021 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 507,395,457 | 23 | - |
| 投資ファンド | 14,393,047 | 6,710,472 | - |
| デリバティブ | - | 83,710 | - |
| Pノート | - | 2,542,903 | - |
| 資産合計 | 521,788,504 | 9,337,108 | - |

負債

| | | | |
|-------------|----------------|------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 698,609 | 3,458,481 | - |
| 負債合計 | 698,609 | 3,458,481 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|-------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 517,173,524 | - | - |
| 投資ファンド | 10,627,256 | 7,825,580 | - |
| デリバティブ | 553,392 | 1,506,145 | - |
| Pノート | - | 2,138,515 | - |
| 資産合計 | 528,354,172 | 11,470,240 | - |

負債

| | | | |
|-------------|----------|------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 2,719,233 | - |
| 負債合計 | - | 2,719,233 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 3,023,076 | - |
| その他の債権 | - | 18,658,747 | - |
| 現金および現金同等物 | 26,488,013 | - | - |
| 資産合計 | 26,488,013 | 21,681,823 | - |
| 負債 | | | |
| ブローカーに対する債務 | - | 189,248 | - |
| その他の債務 | - | 2,642,819 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 3,681,259 | - |
| 負債合計 | - | 6,513,326 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 2,916,740 | - |
| その他の債権 | - | 4,621,127 | - |
| 現金および現金同等物 | 29,866,629 | - | - |
| 資産合計 | 29,866,629 | 7,537,867 | - |
| 負債 | | | |
| ブローカーに対する債務 | - | 29,897 | - |
| その他の債務 | - | 4,085,758 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 1,571,281 | - |
| 負債合計 | - | 5,686,936 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・ハイールド・ボンド・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|------------------|--------------------|-------------------|
| トレーディング目的の 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 4,099,364 | - | 2,085,992 |
| 債券 | - | 853,246,309 | 15,915,405 |
| デリバティブ | - | 2,184,488 | - |
| 資産合計 | 4,099,364 | 855,430,797 | 18,001,397 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 9,855,796 | - |
| 負債合計 | - | 9,855,796 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年11月30日に終了した会計期における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式および取締役会が価格決定した証券で構成されている。

| | 株式 米ドル | 債権 米ドル | 合計 米ドル |
|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 期首残高 | 2,220,658 | 17,808,945 | 20,029,603 |
| 取得 | 92,003 | 12,625 | 104,628 |
| 売却 | - | - | - |
| レベル3へ/(から)の振り替え | (151,618) | (2,089,104) | (2,240,722) |
| 損益計算書で認識された損益 | (75,051) | 182,939 | 107,888 |
| 期末残高 | 2,085,992 | 15,915,405 | 18,001,397 |

当期末に保有する資産に関し

| | | | |
|----------------|----------|---------|---------|
| 損益勘定に含まれる当期損益額 | (75,051) | 182,939 | 107,888 |
|----------------|----------|---------|---------|

2016年11月30日または2016年5月31日現在、投資運用会社は、かかる資産および負債の評価に関して、観察不能なインプット（例としては、単一の情報源によるブローカーの相場、第三者による価格および以前の取引が含まれるがこれらに限らない）を構築していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|------------------|--------------------|-------------------|
| トレーディング目的の 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 3,531,423 | - | 2,220,658 |
| 債券 | - | 826,517,757 | 17,808,945 |
| デリバティブ | - | 6,501,821 | - |
| 資産合計 | 3,531,423 | 833,019,578 | 20,029,603 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 3,634,567 | - |
| 負債合計 | - | 3,634,567 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年5月31日に終了した年度における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式および取締役会が価格決定した証券で構成されている。

| | 株式 米ドル | 債権 米ドル | 合計 米ドル |
|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 期首残高 | 1,625,374 | 32,677,787 | 34,303,161 |
| 取得 | - | 696,532 | 696,532 |
| 売却 | - | (1,525,612) | (1,525,612) |
| レベル3へ/(から)の振り替え | 584,838 | (13,922,062) | (13,337,224) |
| 損益計算書で認識された損益 | 10,446 | (117,700) | (107,254) |
| 期末残高 | 2,220,658 | 17,808,945 | 20,029,603 |

当期末に保有する資産に関し

| | | | |
|----------------|--------|-----------|-----------|
| 損益勘定に含まれる当期損益額 | 10,446 | (117,700) | (107,254) |
|----------------|--------|-----------|-----------|

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| その他の債権 | - | 11,358,980 | - |
| 現金および現金同等物 | 76,254,303 | - | - |
| 資産合計 | 76,254,303 | 11,358,980 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | 31,525 | - | - |
| その他の債務 | - | 5,794,220 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 8,484,803 | - |
| 負債合計 | 31,525 | 14,279,023 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| その他の債権 | - | 23,528,154 | - |
| 現金および現金同等物 | 80,730,317 | - | - |
| 資産合計 | 80,730,317 | 23,528,154 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 19,295,430 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 3,279,778 | - |
| 負債合計 | - | 22,575,208 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|----------------|--------------------|------------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 345,190,800 | 2,015,009 |
| デリバティブ | 290,067 | 1,951,669 | - |
| 資産合計 | 290,067 | 347,142,469 | 2,015,009 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 71,679 | 3,908,353 | - |
| 負債合計 | 71,679 | 3,908,353 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年11月30日に終了した会計期における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 債券 | 合計 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 5,548,220 | 5,548,220 |
| 売却 | - | - |
| レベル3からの振り替え | (3,572,211) | (3,572,211) |
| 損益計算書で認識された損益 | 39,000 | 39,000 |
| 期末残高 | 2,015,009 | 2,015,009 |
| 当期末に保有する資産に関し | | |
| 損益勘定に含まれる当期損益額 | 39,000 | 39,000 |

2016年11月30日または2016年5月31日現在、投資運用会社は、かかる資産および負債の評価に関して、観察不能なインプット（例としては、単一の情報源によるブローカーの相場、第三者による価格および以前の取引が含まれるがこれらに限らない）を構築していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|----------------|--------------------|------------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 355,043,288 | 5,548,220 |
| デリバティブ | 29,700 | 3,028,780 | - |
| 資産合計 | 29,700 | 358,072,068 | 5,548,220 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 110,516 | 861,200 | - |
| 負債合計 | 110,516 | 861,200 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年5月31日に終了した年度における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 債券 | 合計 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 6,827,864 | 6,827,864 |
| 売却 | (208,059) | (208,059) |
| レベル3からの振り替え | (1,030,036) | (1,030,036) |
| 損益計算書で認識された損益 | (41,549) | (41,549) |
| 期末残高 | 5,548,220 | 5,548,220 |
| 当期末に保有する資産に関し | | |
| 損益勘定に含まれる当期損益額 | (41,549) | (41,549) |

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------|-------------------|-------------------|----------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 708,505 | - |
| その他の債権 | - | 17,950,609 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 920,000 | - |
| 現金および現金同等物 | 19,723,105 | - | - |
| 資産合計 | 19,723,105 | 19,579,114 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | 154,367 | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 29,337 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 920,000 | - |
| その他の債務 | - | 31,603,934 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | - | - | - |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 5,486,249 | - |
| 負債合計 | 154,367 | 38,039,520 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|----------------|------------------|-------------------|----------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 655,116 | - |
| その他の債権 | - | 9,812,062 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 690,000 | - |
| 現金および現金同等物 | 5,220,332 | - | - |
| 資産合計 | 5,220,332 | 11,157,178 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 29,130 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 690,000 | - |
| その他の債務 | - | 29,728,543 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | - | - | - |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 3,253,111 | - |
| 負債合計 | - | 33,700,784 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|----------------|--------------------|----------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 196,123,357 | 849,921 |
| デリバティブ | 190,516 | 4,513,927 | - |
| 資産合計 | 190,516 | 200,637,284 | 849,921 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 57,914 | 5,007,099 | - |
| 負債合計 | 57,914 | 5,007,099 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年11月30日に終了した会計期における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、スタイル・プライス株式で構成されている。

| | 債券 | 合計 |
|---------------|----------------|----------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 848,266 | 848,266 |
| 売却 | (123,986) | (123,986) |
| レベル3への振り替え | 196,329 | 196,329 |
| 損益計算書で認識された損益 | (70,688) | (70,688) |
| 期末残高 | 849,921 | 849,921 |

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|----------------|--------------------|----------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 322,195,906 | 848,266 |
| デリバティブ | 21,523 | 4,089,096 | - |
| 資産合計 | 21,523 | 326,285,002 | 848,266 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 132,139 | 1,694,433 | - |
| 負債合計 | 132,139 | 1,694,433 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年5月31日に終了した年度における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。

| | 債券 | 合計 |
|---------------|----------------|----------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | - | - |
| 売却 | - | - |
| レベル3への振り替え | 848,266 | 848,266 |
| 損益計算書で認識された損益 | - | - |
| 期末残高 | 848,266 | 848,266 |

2016年11月30日または2016年5月31日現在、投資運用会社は、かかる資産および負債の評価に関して、観察不能なインプット（例としては、単一の情報源によるブローカーの相場、第三者による価格および以前の取引が含まれるがこれらに限らない）を構築していない。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|------------------|--------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 2,721,505 | - |
| その他の債権 | - | 75,788,293 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 2,884,200 | - |
| 現金および現金同等物 | 7,233,439 | - | - |
| 資産合計 | 7,233,439 | 81,393,998 | - |
| 負債 | | | |
| ブローカーに対する債務 | - | 101,598 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 2,884,200 | - |
| その他の債務 | - | 130,422,984 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 1,953,514 | - |
| 負債合計 | - | 135,362,296 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 1,504,219 | - |
| その他の債権 | - | 5,577,494 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 1,760,000 | - |
| 現金および現金同等物 | 12,594,091 | - | - |
| 資産合計 | 12,594,091 | 8,841,713 | - |
| 負債 | | | |
| ブローカーに対する債務 | - | 9 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 1,760,000 | - |
| その他の債務 | - | 96,420,566 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 575,750 | - |
| 負債合計 | - | 98,756,325 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------------|--------------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 253,134,441 | - |
| 投資ファンド | 4,735,643 | - | - |
| デリバティブ | 450,394 | 1,081,334 | - |
| 資産合計 | 5,186,037 | 254,215,775 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 120,010 | 3,330,841 | - |
| 負債合計 | 120,010 | 3,330,841 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年11月30日に終了した会計期における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 債券 | 合計 |
|-------------|-----------|-----------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 270,930 | 270,930 |
| レベル3への振り替え | (270,930) | (270,930) |
| 期末残高 | - | - |

2016年11月30日または2016年5月31日現在、投資運用会社は、かかる資産および負債の評価に関して、観察不能なインプット（例としては、単一の情報源によるブローカーの相場、第三者による価格および以前の取引が含まれるがこれらに限らない）を構築していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------------|--------------------|----------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 203,876,053 | 270,930 |
| 投資ファンド | 7,299,437 | - | - |
| デリバティブ | 26,281 | 1,640,820 | - |
| 資産合計 | 7,325,718 | 205,516,873 | 270,930 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 191,780 | 1,295,509 | - |
| 負債合計 | 191,780 | 1,295,509 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年5月31日に終了した年度における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 債券 | 合計 |
|-------------|----------------|----------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | - | - |
| レベル3への振り替え | 270,930 | 270,930 |
| 期末残高 | 270,930 | 270,930 |

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 1,948,787 | - |
| その他の債権 | - | 4,122,482 | - |
| 現金および現金同等物 | 27,950,378 | - | - |
| 資産合計 | 27,950,378 | 6,071,269 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | 51,572 | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 1,356,835 | - |
| その他の債務 | - | 3,563,898 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 169,892 | - |
| 負債合計 | 51,572 | 5,090,625 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 1,406,679 | - |
| その他の債権 | - | 5,345,870 | - |
| 現金および現金同等物 | 15,755,616 | - | - |
| 資産合計 | 15,755,616 | 6,752,549 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 609,793 | - |
| その他の債務 | - | 3,230,320 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 521,956 | - |
| 負債合計 | - | 4,362,069 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|--------------------|---------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 121,885,842 | - | - |
| 投資ファンド | 8,965,586 | - | - |
| デリバティブ | - | 26,630 | - |
| 資産合計 | 130,851,428 | 26,630 | - |

負債

| | | | |
|-------------------|----------|----------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 306,698 | - |
| 負債合計 | - | 306,698 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------------|----------------|------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| その他の債権 | - | 292,409 | - |
| 現金および現金同等物 | 3,153,544 | - | - |
| 資産合計 | 3,153,544 | 292,409 | - |

負債

| | | | |
|----------------------------|--------------|------------------|----------|
| 当座借越 | 3,481 | - | - |
| その他の債務 | - | 1,196,115 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 170,156 | - |
| 負債合計 | 3,481 | 1,366,271 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|--------------------|----------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 129,529,706 | 119,798 | - |
| 投資ファンド | 5,286,039 | - | - |
| デリバティブ | - | 50,147 | - |
| 資産合計 | 134,815,745 | 169,945 | - |

負債

| | | | |
|-------------------|----------|----------------|----------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 182,661 | - |
| 負債合計 | - | 182,661 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------------|----------------|------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| その他の債権 | - | 464,667 | - |
| 現金および現金同等物 | 1,143,318 | - | - |
| 資産合計 | 1,143,318 | 464,667 | - |

負債

| | | | |
|----------------------------|----------|------------------|----------|
| 当座借越 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 1,136,465 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 412,281 | - |
| 負債合計 | - | 1,548,746 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|------------|---------|-------------|------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 240,444,741 | - |
| 投資ファンド | - | - | - |
| デリバティブ | 300,442 | 2,505,960 | - |
| 資産合計 | 300,442 | 242,950,701 | - |

負債

| | | | |
|------------|---|-----------|---|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 3,665,635 | - |
| 負債合計 | - | 3,665,635 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------|-----------|------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 1,395,890 | - |
| その他の債権 | - | 7,865,779 | - |
| 担保として保有する現金 | - | 28,000 | - |
| 現金および現金同等物 | 38,342,444 | - | - |
| 資産合計 | 38,342,444 | 9,289,669 | - |

負債

| | | | |
|----------------|---|------------|---|
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | - | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | 1,310,394 | - |
| その他の債務 | - | 13,854,877 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | - | - | - |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 12,014,503 | - |
| 負債合計 | - | 27,179,774 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|------------|--------|-------------|------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 266,627,588 | - |
| 投資ファンド | - | - | - |
| デリバティブ | 56,880 | 3,736,459 | - |
| 資産合計 | 56,880 | 270,364,047 | - |

負債

| | | | |
|------------|--------|---------|---|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | 73,359 | 765,102 | - |
| 負債合計 | 73,359 | 765,102 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------|------------|------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 2,502,711 | - |
| その他の債権 | - | 18,832,560 | - |
| 担保として保有する現金 | - | - | - |
| 現金および現金同等物 | 29,549,395 | - | - |
| 資産合計 | 29,549,395 | 21,335,271 | - |

負債

| | | | |
|----------------|---|------------|---|
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 1,187,157 | - |
| 担保として差し入れられた現金 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 27,901,219 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | - | - | - |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 2,108,273 | - |
| 負債合計 | - | 31,196,649 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|--------------------|------------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 267,162,662 | - | - |
| 投資ファンド | 897,063 | 1,033,658 | - |
| デリバティブ | 29,157 | 55,288 | - |
| 資産合計 | 268,088,882 | 1,088,946 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 2,116,631 | - |
| 負債合計 | - | 2,116,631 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|--------------------|------------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 268,054,536 | - | - |
| 投資ファンド | 1,805,124 | 2,580,042 | - |
| デリバティブ | 45,590 | 1,537,828 | - |
| 資産合計 | 269,905,250 | 4,117,870 | - |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 465,290 | - |
| 負債合計 | - | 465,290 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年5月31日に終了した年度における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 株式 | 合計 |
|-------------|-------------|-------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 1,740,589 | 1,740,589 |
| レベル3への振り替え | (1,740,589) | (1,740,589) |
| 期末残高 | - | - |

2016年11月30日または2016年5月31日現在、投資運用会社は、かかる資産および負債の評価に関して、観察不能なインプット（例としては、単一の情報源によるブローカーの相場、第三者による価格および以前の取引が含まれるがこれらに限らない）を構築していない。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 285,593 | - |
| その他の債権 | - | 1,771,147 | - |
| 現金および現金同等物 | 11,546,673 | - | - |
| 資産合計 | 11,546,673 | 2,056,740 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 2,625,234 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 2,151,198 | - |
| 負債合計 | - | 4,776,432 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|----------------------------|-------------------|------------------|-------------|
| ブローカーに対する債権 | - | 90,861 | - |
| その他の債権 | - | 3,529,053 | - |
| 現金および現金同等物 | 10,936,427 | - | - |
| 資産合計 | 10,936,427 | 3,619,914 | - |
| 負債 | | | |
| 当座借越 | 46,781 | - | - |
| その他の債務 | - | 2,582,171 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 633,977 | - |
| 負債合計 | 46,781 | 3,216,148 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|--------------------|---------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 406,865,019 | - | - |
| 投資ファンド | - | - | - |
| デリバティブ | - | 33,187 | - |
| 資産合計 | 406,865,019 | 33,187 | - |

負債

| トレーディング目的の | | | |
|-------------------|----------|------------------|----------|
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 4,406,770 | - |
| 負債合計 | - | 4,406,770 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|-------------------|------------------|------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 169,833 | - |
| その他の債権 | - | 3,186,038 | - |
| 現金および現金同等物 | 23,338,897 | - | - |
| 資産合計 | 23,338,897 | 3,355,871 | - |

負債

| | | | |
|-------------|----------|------------------|----------|
| その他の債務 | - | 3,599,591 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | | | |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 6,065,152 | - |
| 負債合計 | - | 9,664,743 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------------|--------------------|------------------|------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 497,475,684 | - | - |
| 投資ファンド | 1,285,055 | - | - |
| デリバティブ | 10,533 | 3,054,683 | - |
| 資産合計 | 498,771,272 | 3,054,683 | - |

負債

| トレーディング目的の | | | |
|-------------------|----------|------------------|----------|
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 1,757,878 | - |
| 負債合計 | - | 1,757,878 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|-------------------|------------------|------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| ブローカーに対する債権 | - | 87,965 | - |
| その他の債権 | - | 6,076,506 | - |
| 現金および現金同等物 | 18,731,923 | - | - |
| 資産合計 | 18,731,923 | 6,164,471 | - |

負債

| | | | |
|-------------|----------|------------------|----------|
| その他の債務 | - | 4,201,173 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | | | |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 2,490,943 | - |
| 負債合計 | - | 6,692,116 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|------------------|---------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 292,862,196 | 6,141 | 16,677 |
| デリバティブ | - | 1,528,105 | - |
| 資産合計 | 292,862,196 | 1,534,246 | 16,677 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 3,131,068 | - |
| 負債合計 | - | 3,131,068 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年11月30日に終了した会計期における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 株式 | 合計 |
|-------------|---------------|---------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 16,677 | 16,677 |
| レベル3への振り替え | - | - |
| 期末残高 | 16,677 | 16,677 |

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|------------------|---------------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 株式 | 311,531,324 | 40,214 | 16,677 |
| デリバティブ | - | 2,575,307 | - |
| 資産合計 | 311,531,324 | 2,615,521 | 16,677 |
| 負債 | | | |
| トレーディング目的の | | | |
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 1,577,651 | - |
| 負債合計 | - | 1,577,651 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

下表は、2016年5月31日に終了した年度における、レベル3商品の変動を金融商品のクラス別に表したものである。レベル3証券は、ステイル・プライス株式で構成されている。

| | 株式 | 合計 |
|-------------|---------------|---------------|
| | 米ドル | 米ドル |
| 期首残高 | 16,677 | 16,677 |
| レベル3への振り替え | - | - |
| 期末残高 | 16,677 | 16,677 |

2016年11月30日または2016年5月31日現在、投資運用会社は、かかる資産および負債の評価に関して、観察不能なインプット（例としては、単一の情報源によるブローカーの相場、第三者による価格および以前の取引が含まれるがこれらに限らない）を構築していない。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス グローバル株式ファンド（続き）

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|-------------|-------------------|------------------|-------------|
| その他の債権 | - | 1,382,009 | - |
| 現金および現金同等物 | 15,508,124 | - | - |
| 資産合計 | 15,508,124 | 1,382,009 | - |
| 負債 | | | |
| その他の債務 | - | 3,217,423 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | | | |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 1,271,816 | - |
| 負債合計 | - | 4,489,239 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 米ドル | レベル2 米ドル | レベル3 米ドル |
|-------------|------------------|------------------|-------------|
| その他の債権 | - | 2,155,130 | - |
| 現金および現金同等物 | 2,784,600 | - | - |
| 資産合計 | 2,784,600 | 2,155,130 | - |
| 負債 | | | |
| その他の債務 | - | 2,495,911 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | | | |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 1,824,492 | - |
| 負債合計 | - | 4,320,403 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|------------|-----------|-------------|------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 100,634,764 | - |
| 投資ファンド | 3,832,245 | - | - |
| デリバティブ | - | 366,802 | - |
| 資産合計 | 3,832,245 | 101,001,566 | - |

負債

| トレーディング目的の | | | |
|------------|---|---------|---|
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 429,409 | - |
| 負債合計 | - | 429,409 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|------------|-----------|------|------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| その他の債権 | - | 14 | - |
| 現金および現金同等物 | 5,947,709 | - | - |
| 資産合計 | 5,947,709 | 14 | - |

負債

| | | | |
|-------------|---|-----------|---|
| その他の債務 | - | 370,831 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | | | |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 902,305 | - |
| 負債合計 | - | 1,273,136 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|------------|-----------|------------|------|
| トレーディング目的の | | | |
| 金融資産： | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 債券 | - | 66,214,296 | - |
| 投資ファンド | 7,495,565 | - | - |
| デリバティブ | - | 274,347 | - |
| 資産合計 | 7,495,565 | 66,488,643 | - |

負債

| トレーディング目的の | | | |
|------------|---|---------|---|
| 金融負債： | | | |
| デリバティブ | - | 150,762 | - |
| 負債合計 | - | 150,762 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|------------|-----------|-----------|------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| その他の債権 | - | 1,898,136 | - |
| 現金および現金同等物 | 1,710,419 | - | - |
| 資産合計 | 1,710,419 | 1,898,136 | - |

負債

| | | | |
|-------------|---|---------|---|
| その他の債務 | - | 391,587 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 | | | |
| 保有者に帰属する純資産 | - | 193,192 | - |
| 負債合計 | - | 584,779 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|--------------------|------------------|----------|
| トレーディング目的の 金融資産： | ユーロ | ユーロ | ユーロ |
| 株式 | 334,897,207 | - | - |
| 投資ファンド | 2,844,648 | - | - |
| デリバティブ | - | 1,618,017 | - |
| 資産合計 | 337,741,855 | 1,618,017 | - |

負債

| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
|---------------------|----------|----------------|----------|
| デリバティブ | - | 114,784 | - |
| 負債合計 | - | 114,784 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|-------------------|------------------|----------|
| | ユーロ | ユーロ | ユーロ |
| ブローカーに対する債権 | - | - | - |
| その他の債権 | - | 3,461,730 | - |
| 現金および現金同等物 | 10,641,877 | - | - |
| 資産合計 | 10,641,877 | 3,461,730 | - |

負債

| | | | |
|----------------------------|-----------|-------------------|----------|
| 当座借越 | 19 | - | - |
| その他の債務 | - | 3,074,822 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 8,001,655 | - |
| 負債合計 | 19 | 11,076,477 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|--------------------|------------------|----------|
| トレーディング目的の 金融資産： | ユーロ | ユーロ | ユーロ |
| 株式 | 507,384,397 | - | - |
| 投資ファンド | 838,888 | - | - |
| デリバティブ | - | 6,275,808 | - |
| 資産合計 | 508,223,285 | 6,275,808 | - |

負債

| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
|---------------------|----------|----------------|----------|
| デリバティブ | - | 109,091 | - |
| 負債合計 | - | 109,091 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|------------------|------------------|----------|
| | ユーロ | ユーロ | ユーロ |
| ブローカーに対する債権 | - | - | - |
| その他の債権 | - | 6,643,108 | - |
| 現金および現金同等物 | 1,984,828 | - | - |
| 資産合計 | 1,984,828 | 6,643,108 | - |

負債

| | | | |
|----------------------------|----------|------------------|----------|
| 当座借越 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 2,954,452 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 4,265,387 | - |
| 負債合計 | - | 7,219,839 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

2016年11月30日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|-----------------------|--------------------|----------|
| トレーディング目的の 金融資産： | 日本円 | 日本円 | 日本円 |
| 株式 | 14,857,784,080 | - | - |
| デリバティブ | 30,303,636 | 557,551,490 | - |
| 資産合計 | 14,888,087,716 | 557,551,490 | - |

負債

| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
|---------------------|----------|-------------------|----------|
| デリバティブ | - | 46,602,199 | - |
| 負債合計 | - | 46,602,199 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|--------------------|----------|
| | 日本円 | 日本円 | 日本円 |
| ブローカーに対する債権 | - | 44,163,206 | - |
| その他の債権 | - | 81,639,911 | - |
| 現金および現金同等物 | 505,270,915 | - | - |
| 資産合計 | 505,270,915 | 125,803,117 | - |

負債

| | | | |
|----------------------------|----------|--------------------|----------|
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | - | - |
| その他の債務 | - | 54,382,006 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 213,033,956 | - |
| 負債合計 | - | 267,415,962 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

2016年5月31日現在

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|---------------------|-----------------------|--------------------|----------|
| トレーディング目的の 金融資産： | 日本円 | 日本円 | 日本円 |
| 株式 | 20,527,883,515 | - | - |
| デリバティブ | 29,285,000 | 340,862,335 | - |
| 資産合計 | 20,557,168,515 | 340,862,335 | - |

負債

| トレーディング目的の 金融負債： | | | |
|---------------------|----------|-------------------|----------|
| デリバティブ | - | 35,972,723 | - |
| 負債合計 | - | 35,972,723 | - |

当期中に、レベル1とレベル2の間で重要な振り替えはない。

当期中に、当ファンドはレベル3証券を保有していない。

| 資産 | レベル1 | レベル2 | レベル3 |
|-------------|--------------------|--------------------|----------|
| | 日本円 | 日本円 | 日本円 |
| ブローカーに対する債権 | - | 22,348,241 | - |
| その他の債権 | - | 500,737,625 | - |
| 現金および現金同等物 | 788,249,552 | - | - |
| 資産合計 | 788,249,552 | 523,085,866 | - |

負債

| | | | |
|----------------------------|----------|--------------------|----------|
| 当座借越 | - | - | - |
| ブローカーに対する債務 | - | 192,875 | - |
| その他の債務 | - | 81,976,298 | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | - | 91,865,870 | - |
| 負債合計 | - | 174,035,043 | - |

上記の表に含まれる資産および負債は、償却原価で計上されている。その償却原価は公正価値の合理的な近似値である。

3. 金融リスク管理（続き）

公正価値階層の開示（続き）

公正価値階層の開示 - 感応度分析

感応度分析は、その他の全ての変数を一定に保ったまま、1つの変数の変動に基づいたものである。株式については、EBITDA倍数および支配権プレミアム・インプットの上昇が、それぞれ見積価値の上昇につながる。しかし、市場性の欠如による割引の増加は、価値の減少につながる。債券については、資本コストおよび債務不履行の確率性の上昇の両方が、見積価値を下落させる。

レベル3の株式で、当ファンドの評価に用いられる観察不能インプットの間には、相互関係がないことが確認されている。しかし、レベル3の債券については、債務不履行の確率性に用いられる仮定の変動が、資本コストの方向的に類似の変動と同時に行き起こることが予想される。

当期または前期のレベル3ポジションに関する感応度分析は、インプットの合理的な変動の影響が重要な値ではないと思われるため、表示されていない。

[次へ](#)

4. 公表純資産価格と
一致させるための、
買戻可能参加型
投資証券保有者に
帰属する純資産の
調整

| | グローバル・ アクセス ユーケー・ アルファ・ ファンド | グローバル・ アクセス ユーケー・ オポチュニティーズ・ ファンド | グローバル・ アクセス グローバル・ ガバメント・ ボンド・ファンド | グローバル・ アクセス パシフィック・ リム（除く日本）・ ファンド | グローバル・ アクセス エマージング・ マーケット・ エクイティ・ ファンド | グローバル・ アクセス グローバル・ ハイイールド・ ボンド・ファンド |
|--------------------------------------|--|---|--|--|---|---|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 英ポンド | 2016年11月30日に 終了した期間 英ポンド | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル |
| 公表価格での買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 72,378,773 | 126,497,187 | 208,940,479 | 108,938,590 | 568,478,810 | 940,252,708 |
| 遡求的TA調整 | - | 772,370 | 117,724 | 32,216 | 146,222 | 725,789 |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | <u>72,378,773</u> | <u>127,269,557</u> | <u>209,058,203</u> | <u>108,970,806</u> | <u>568,625,032</u> | <u>940,978,497</u> |
| | 2016年5月31日に 終了した年度 英ポンド | 2016年5月31日に 終了した年度 英ポンド | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル |
| 公表価格での買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 74,656,438 | 133,857,219 | 278,383,741 | 152,462,081 | 568,246,897 | 933,846,994 |
| 遡求的TA調整 | (280,237) | 60,133 | 167,381 | (106,170) | 575,842 | 828,031 |
| 米国源泉徴収税過少 支払いの調整 | (637) | (4,569) | - | (3,396) | - | (45,725) |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | <u>74,375,564</u> | <u>133,912,783</u> | <u>278,551,122</u> | <u>152,352,515</u> | <u>568,822,739</u> | <u>934,629,300</u> |

4. 公表純資産価格と
一致させるための、
買戻可能参加型
投資証券保有者に
帰属する純資産の
調整（続き）

| | グローバル・ アクセス グローバル・ コーポレート・ ボンド・ファンド | グローバル・ アクセス グローバル・ インフレーション・ リンク・ボンド・ ファンド | グローバル・ アクセス エマージング・ マーケット・ デット・ファンド | グローバル・ アクセス グローバル・ プロパティ・ セキュリティーズ・ ファンド | グローバル・ アクセス グローバル・ ショート・ デュレーション・ ボンド・ファンド | グローバル・ アクセス 米国中小型 株式ファンド |
|--------------------------------------|---|---|---|---|---|-----------------------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル |
| 公表価格での買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 347,368,623 | 150,803,747 | 284,669,240 | 132,782,455 | 260,051,870 | 275,681,148 |
| 遡求的TA調整 | (792,778) | 47,409 | 161,171 | (134,894) | (14,023) | 207,030 |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | <u>346,575,845</u> | <u>150,851,156</u> | <u>284,830,411</u> | <u>132,647,561</u> | <u>260,037,847</u> | <u>275,888,178</u> |
| | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル |
| 公表価格での買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 344,530,744 | 248,040,393 | 229,380,611 | 135,191,851 | 288,872,264 | 285,458,827 |
| 分配調整 | - | 11,342 | - | - | - | - |
| 遡求的TA調整 | 824,254 | (44,037) | 391,717 | 77,816 | 398,219 | (39,133) |
| 米国源泉徴収税過少 支払いの調整 | - | - | - | (407,399) | - | (568,452) |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | <u>345,354,998</u> | <u>248,007,698</u> | <u>229,772,328</u> | <u>134,862,268</u> | <u>289,270,483</u> | <u>284,851,242</u> |

4. 公表純資産価格と
一致させるための、
買戻可能参加型
投資証券保有者に
帰属する純資産の
調整(続き)

| | グローバル・ アクセス 米国バリュー 株式ファンド | グローバル・ アクセス グローバル 株式ファンド | グローバル・ アクセス エマージング・ マーケット・ ローカル・ カレンシー・ デット・ファンド | グローバル・ アクセス 欧州(除く英国)・ アルファ・ファンド | グローバル・ アクセス ジャパン・ ファンド |
|--------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|--|--|---------------------------------|
| | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 米ドル | 2016年11月30日に 終了した期間 ユーロ | 2016年11月30日に 終了した期間 日本円 |
| 公表価格での買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 419,680,452 | 303,696,796 | 109,097,040 | 345,008,911 | 15,787,005,297 |
| 遡求的TA調整 | (158,991) | (13,851) | (18,051) | (2,736,712) | (24,310,220) |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | 419,521,461 | 303,682,945 | 109,078,989 | 342,272,199 | 15,762,695,077 |
| | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 米ドル | 2016年5月31日に 終了した年度 ユーロ | 2016年5月31日に 終了した年度 日本円 |
| 公表価格での買戻可能 参加型投資証券保有者に 帰属する純資産 | 520,546,612 | 314,020,750 | 76,838,507 | 515,846,369 | 22,011,127,700 |
| 分配調整 | 7,531 | - | - | - | - |
| 遡求的TA調整 | (402,675) | (76,983) | 18,715 | (48,270) | (11,769,198) |
| 米国源泉徴収税過少 支払いの調整 | (1,879,113) | (738,569) | - | - | - |
| 買戻可能参加型投資証券 保有者に帰属する純資産 | 518,272,355 | 313,205,198 | 76,857,222 | 515,798,099 | 21,999,358,502 |

5. 純資産価額

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|--|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド | | | | | | |
| クラスA（無分配型） | 68,264 | £2.0800 | 68,264 | £1.8838 | 68,264 | £1.8883 |
| クラスA（分配型） | 142,655 | £2.0213 | 141,119 | £1.8522 | 140,527 | £1.8651 |
| クラスB（無分配型） | 465,028 | £2.1713 | 1,210,058 | £1.9639 | 1,528,017 | £1.9661 |
| クラスB（分配型）ユーロ建 | 62,889 | €2.3171 | 62,889 | €2.1235 | 62,889 | €2.1417 |
| クラスI（無分配型） | 33,489 | £2.1919 | 40,707 | £1.9796 | 40,186 | £1.9788 |
| クラスI（分配型） | 1,574 | £2.0095 | 3,581 | £1.8422 | 1,829 | £1.8551 |
| クラスI（無分配型）ユーロ建 | 2,028,868 | €2.5573 | 2,028,868 | €2.3106 | 2,028,868 | €2.3133 |
| クラスM（無分配型） | 1,678,170 | £2.1533 | 1,778,202 | £1.9434 | 2,056,445 | £1.9411 |
| クラスM（分配型） | 28,850,203 | £2.0114 | 32,693,312 | £1.8429 | 36,454,713 | £1.8558 |
| クラスM（無分配型）ユーロ建 | 877,399 | €3.5830 | 1,100,867 | €3.2349 | 1,046,161 | €3.2363 |
| クラスM（無分配型）米ドル建 | 113,685 | \$3.6103 | 113,685 | \$3.2311 | 113,685 | \$3.2267 |
| クラスM（分配型）米ドル建 | 164,433 | \$3.4560 | 164,433 | \$3.1391 | 164,433 | \$3.1598 |
| クラスZ（無分配型） | 42,211 | £2.1526 | 81,256 | £1.9549 | 93,134 | £1.9650 |
| クラスZ（無分配型）ユーロ建 | 529,483 | €2.5533 | 359,086 | €2.3196 | 567,996 | €2.3351 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ ファンド | | | | | | |
| クラスA（無分配型） | 118,307 | £2.6077 | 308,269 | £2.4035 | 363,054 | £2.4030 |
| クラスA（分配型） | 21,533 | £2.4819 | 21,533 | £2.3184 | 21,533 | £2.3299 |
| クラスA（無分配型）ユーロ建 | 128,804 | €3.0117 | 156,084 | €2.7825 | 56,205 | €2.7874 |
| クラスB（無分配型） | 610,000 | £3.0318 | 660,030 | £2.7904 | 766,206 | £2.7863 |
| クラスB（無分配型）米ドル建 | 164,178 | \$4.3212 | 164,178 | \$3.9520 | 164,178 | \$3.9466 |
| クラスI（無分配型） | 43,341 | £2.6282 | 177,098 | £2.4156 | 156,436 | £2.4080 |
| クラスI（分配型） | 9,105 | £2.4706 | 10,601 | £2.3078 | 9,676 | £2.3189 |
| クラスI（無分配型）ユーロ建 | 36,355 | €3.1819 | 40,594 | €2.9312 | 439,777 | €2.9280 |
| クラスI（無分配型）米ドル建 | 249,022 | \$4.4011 | 246,900 | \$4.0181 | 311,119 | \$4.0053 |
| クラスM（無分配型） | 3,636,860 | £2.7577 | 3,682,205 | £2.5318 | 3,472,874 | £2.5218 |
| クラスM（分配型） | 37,701,148 | £2.4684 | 46,113,508 | £2.3057 | 51,268,097 | £2.3169 |
| クラスM（無分配型）ユーロ建 | 2,000,374 | €3.1129 | 1,463,798 | €2.8656 | 291,817 | €2.8601 |
| クラスM（無分配型）米ドル建 | 819,768 | \$4.3780 | 642,935 | \$3.9942 | 648,238 | \$3.9787 |
| クラスM（分配型）ユーロ建 | 475,752 | €2.9464 | 183,453 | €2.7581 | 192,068 | €2.7769 |
| クラスM（分配型）米ドル建 | 989,962 | \$3.9823 | 585,714 | \$3.6948 | 589,626 | \$3.7128 |
| クラスZ（無分配型） | 92,121 | £5.1415 | 90,285 | £4.7499 | 88,784 | £4.7610 |
| クラスZ（無分配型）ユーロ建 | 2,623,756 | €3.1337 | 2,862,682 | €2.9024 | 3,669,789 | €2.9156 |

5. 純資産価額（続き）

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|---|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ ボンド・ファンド | | | | | | |
| クラスA（無分配型） | - | - | 207,820 | \$1.1915 | 207,820 | \$1.1773 |
| クラスA（無分配型）ユーロ建 | 9,513 | €1.0252 | 9,513 | €1.0405 | 9,513 | €1.0338 |
| クラスB（分配型） | 498,536 | \$1.1713 | 498,536 | \$1.1782 | 498,536 | \$1.1630 |
| クラスB（無分配型）ユーロ建 | 432,843 | €0.9386 | 432,843 | €0.9517 | 463,041 | €0.9448 |
| クラスB（分配型）ユーロ建 | 23,753 | €1.3875 | 23,753 | €1.4069 | 23,753 | €1.3966 |
| クラスB（分配型）英ポンド建 | 68 | £0.7886 | 68 | £0.7982 | 68 | £0.7827 |
| クラスI（無分配型） | 167,119 | \$1.1833 | 234,893 | \$1.1883 | 289,077 | \$1.1709 |
| クラスI（無分配型）英ポンド建 | 104,416 | £0.7511 | 40,582 | £0.7559 | 23,643 | £0.7461 |
| クラスI（分配型）英ポンド建 | 5,777 | £0.7332 | 5,777 | £0.7376 | 4,422 | £0.7290 |
| クラスM（無分配型） | 3,678,689 | \$1.3467 | 3,499,312 | \$1.3513 | 4,102,476 | \$1.3305 |
| クラスM（分配型） | 57,221,159 | \$1.1749 | 89,613,263 | \$1.1812 | 113,681,605 | \$1.1652 |
| クラスM（無分配型）ユーロ建 | 21,597,374 | €0.9202 | 35,055,747 | €0.9308 | 32,476,528 | €0.9218 |
| クラスM（無分配型）英ポンド建 | 4,162,229 | £0.7579 | 4,286,168 | £0.7623 | 3,451,617 | £0.7519 |
| クラスM（分配型）ユーロ建 | 7,325,705 | €0.8640 | 7,779,014 | €0.8755 | 7,245,713 | €0.8685 |
| クラスM（分配型）英ポンド建 | 97,185,898 | £0.7785 | 95,671,831 | £0.7835 | 105,838,350 | £0.7743 |
| クラスZ（無分配型） | 806,235 | \$1.1615 | 797,881 | \$1.1695 | 201,827 | \$1.1555 |
| クラスZ（無分配型）ユーロ建 | 9,518,563 | €0.8232 | 8,161,868 | €0.8354 | 6,797,914 | €0.8303 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス パシフィック・リム （除く日本）・ファンド | | | | | | |
| クラスA（無分配型） | 30,148 | \$2.7316 | 63,521 | \$2.5761 | 63,521 | \$2.5808 |
| クラスB（無分配型） | 55,000 | \$3.0547 | 195,000 | \$2.8777 | 195,000 | \$2.8792 |
| クラスB（無分配型）ユーロ建 | - | - | 85,373 | €1.8594 | 85,373 | €1.8703 |
| クラスB（無分配型）英ポンド建 | 70,457 | £1.7401 | 70,457 | £1.6476 | 70,457 | £1.6556 |
| クラスI（無分配型）英ポンド建 | 44,603 | £1.6829 | 44,576 | £1.5906 | 48,637 | £1.5954 |
| クラスI（分配型）英ポンド建 | 3,066 | £1.6084 | 3,066 | £1.5338 | 3,118 | £1.5410 |
| クラスM（無分配型） | 5,896,918 | \$1.2996 | 6,436,050 | \$1.2211 | 4,202,452 | \$1.2187 |
| クラスM（分配型） | 22,027,160 | \$2.6028 | 28,860,663 | \$2.4688 | 21,785,082 | \$2.4703 |
| クラスM（無分配型）ユーロ建 | 16,181 | €2.0901 | 22,454 | €1.9838 | 23,234 | €1.9904 |
| クラスM（無分配型）英ポンド建 | 389,323 | £1.8066 | 333,710 | £1.7064 | 307,232 | £1.7102 |
| クラスM（分配型）英ポンド建 | 20,557,426 | £1.6142 | 31,431,529 | £1.5392 | 19,260,712 | £1.5466 |
| クラスZ（無分配型） | 17,098 | \$2.6530 | 22,361 | \$2.5082 | 25,722 | \$2.5191 |
| クラスZ（無分配型）ユーロ建 | 498,701 | €1.9868 | 336,051 | €1.8977 | 195,145 | €1.9162 |

5. 純資産価額（続き）

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|----------------------|---------------|----------------|--------------|----------------|---------------|----------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| エマージング・マーケット・ | | | | | | |
| エクイティ・ファンド | | | | | | |
| クラスA（無分配型） | 12,475,570 | \$0.9433 | 15,133,574 | \$0.8708 | 17,748,215 | \$0.8765 |
| クラスA（分配型） | 414,079 | \$0.8909 | 942,182 | \$0.8278 | 475,515 | \$0.8332 |
| クラスA（無分配型）ユーロ建 | 2,170,255 | €0.6632 | 2,226,270 | €0.6187 | 3,064,044 | €0.6262 |
| クラスA（無分配型）英ポンド建 | - | - | 126,193 | £0.5403 | 126,193 | £0.5463 |
| クラスA（分配型）ユーロ建 | 651,594 | €0.6755 | 651,594 | €0.6345 | 750,408 | €0.6422 |
| クラスA（分配型）英ポンド建 | 598,403 | £0.5534 | 595,654 | £0.5183 | 595,654 | £0.5242 |
| クラスB（無分配型） | 4,422,509 | \$0.8529 | 3,835,171 | \$0.7864 | 4,032,360 | \$0.7905 |
| クラスB（分配型） | 302,568 | \$0.8947 | 302,568 | \$0.8324 | 207,568 | \$0.8372 |
| クラスB（無分配型）ユーロ建 | 2,126,129 | €0.6847 | 2,537,305 | €0.6381 | 2,528,627 | €0.6449 |
| クラスB（無分配型）英ポンド建 | 395,522 | £0.5615 | 395,522 | £0.5218 | 694,828 | £0.5271 |
| クラスB（分配型）ユーロ建 | 60,901 | €0.6774 | 121,803 | €0.6369 | 121,803 | €0.6440 |
| クラスB（分配型）英ポンド建 | 874,732 | £0.5796 | 959,680 | £0.5435 | 2,432,222 | £0.5493 |
| クラスI（無分配型） | 8,308,913 | \$0.9320 | 8,531,500 | \$0.8586 | 9,281,550 | \$0.8625 |
| クラスI（無分配型）ユーロ建 | 479,919 | €0.6837 | 665,223 | €0.6367 | 4,233,629 | €0.6438 |
| クラスI（無分配型）英ポンド建 | 714,942 | £0.5704 | 867,488 | £0.5295 | 892,113 | £0.5344 |
| クラスI（分配型）英ポンド建 | 483,549 | £0.5485 | 859,860 | £0.5142 | 862,382 | £0.5195 |
| クラスM（無分配型） | 36,982,803 | \$0.9094 | 36,147,104 | \$0.8372 | 27,976,960 | \$0.8403 |
| クラスM（分配型） | 358,899,249 | \$0.8924 | 354,508,952 | \$0.8302 | 281,037,527 | \$0.8349 |
| クラスM（無分配型）ユーロ建 | 21,580,369 | €0.6982 | 20,962,480 | €0.6497 | 13,729,768 | €0.6557 |
| クラスM（無分配型）英ポンド建 | 41,164,151 | £0.6016 | 42,766,978 | £0.5583 | 32,535,276 | £0.5630 |
| クラスM（分配型）ユーロ建 | 5,673,527 | €0.6564 | 5,210,835 | €0.6170 | 3,224,823 | €0.6238 |
| クラスM（分配型）英ポンド建 | 150,560,299 | £0.5468 | 170,832,268 | £0.5127 | 185,701,826 | £0.5180 |
| クラスZ（無分配型） | 310,373 | \$0.9203 | 338,984 | \$0.8517 | 384,280 | \$0.8594 |
| クラスZ（無分配型）ユーロ建 | 46,553,480 | €0.6212 | 48,160,357 | €0.5811 | 55,158,031 | €0.5896 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|----------------------|---------------|----------------|--------------|----------------|---------------|----------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| グローバル・ハイイールド・ | | | | | | |
| ボンド・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 3,871,580 | \$1.5792 | 4,919,364 | \$1.4903 | 8,168,855 | \$1.4188 |
| クラスA(分配型) | 5,321,509 | \$1.1523 | 6,852,630 | \$1.1141 | 7,035,896 | \$1.0874 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 13,117,371 | €1.1037 | 16,002,071 | €1.0492 | 17,851,630 | €1.0040 |
| クラスA(無分配型)英ポンド建 | 871,206 | £0.9432 | 796,679 | £0.8915 | 1,028,275 | £0.8511 |
| クラスA(分配型)ユーロ建 | 8,297,430 | €0.8495 | 7,816,262 | €0.8275 | 8,317,169 | €0.8118 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 4,074,033 | £0.7191 | 3,192,047 | £0.6971 | 3,052,135 | £0.6827 |
| クラスB(無分配型) | 3,637,543 | \$1.7175 | 5,989,317 | \$1.6190 | 6,329,853 | \$1.5400 |
| クラスB(分配型) | 14,684,167 | \$1.1685 | 14,636,832 | \$1.1296 | 14,409,093 | \$1.1026 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 1,562,251 | €1.2231 | 1,456,000 | €1.1616 | 2,132,517 | €1.1103 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 4,406,697 | £1.0968 | 4,336,892 | £1.0355 | 5,410,199 | £0.9876 |
| クラスB(分配型)ユーロ建 | 5,429,342 | €0.8596 | 5,066,360 | €0.8374 | 5,477,984 | €0.8213 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 3,067,754 | £0.7723 | 4,314,074 | £0.7485 | 4,661,256 | £0.7330 |
| クラスI(無分配型) | 389,432 | \$1.4758 | 429,791 | \$1.3895 | 710,743 | \$1.3199 |
| クラスI(分配型) | 1,320,779 | \$1.1657 | 1,019,055 | \$1.1269 | 1,019,055 | \$1.0999 |
| クラスI(無分配型)ユーロ建 | 11,763,636 | €1.1063 | 20,583,971 | €1.0492 | 24,133,529 | €1.0017 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 1,189,459 | £0.8816 | 1,235,278 | £0.8313 | 1,349,274 | £0.7920 |
| クラスI(分配型)ユーロ建 | 878,345 | €0.8688 | 4,339,945 | €0.8466 | 4,339,945 | €0.8305 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 4,403,591 | £0.7402 | 5,870,646 | £0.7175 | 3,409,727 | £0.7026 |
| クラスM(無分配型) | 12,354,154 | \$2.1560 | 11,600,111 | \$2.0289 | 13,550,125 | \$1.9264 |
| クラスM(分配型) | 174,309,965 | \$1.1541 | 176,999,778 | \$1.1157 | 183,392,000 | \$1.0890 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 33,812,373 | €1.2500 | 29,174,994 | €1.1850 | 27,753,770 | €1.1305 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 21,246,048 | £1.1229 | 22,045,034 | £1.0583 | 17,459,396 | £1.0076 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 13,570,382 | €0.8512 | 10,732,420 | €0.8291 | 9,606,925 | €0.8134 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 523,890,604 | £0.7247 | 452,504,099 | £0.7025 | 449,295,377 | £0.6880 |
| クラスZ(無分配型) | 1,420,846 | \$1.7047 | 1,396,021 | \$1.6118 | 1,664,003 | \$1.5379 |
| クラスZ(分配型) | 228,214 | \$1.1666 | 228,214 | \$1.1279 | 326,365 | \$1.1010 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 35,423,007 | €1.1525 | 27,827,442 | €1.0978 | 28,353,762 | €1.0525 |
| クラスZ(分配型)ユーロ建 | 4,877,415 | €0.8703 | 5,294,301 | €0.8478 | 5,772,936 | €0.8317 |
| クラスZ(分配型)英ポンド建 | 172,579 | £0.7543 | 310,057 | £0.7311 | 302,790 | £0.7159 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| グローバル・コーポレート・ | | | | | | |
| ボンド・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 100,832 | \$1.2529 | 100,832 | \$1.2431 | 100,832 | \$1.2010 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | - | - | 62,186 | €0.8528 | 62,186 | €0.8285 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 254,737 | £0.7151 | 251,857 | £0.7191 | 248,489 | £0.7060 |
| クラスB(無分配型) | 1,501,088 | \$1.1588 | 1,481,088 | \$1.1486 | 1,821,092 | \$1.1085 |
| クラスB(分配型) | 355,131 | \$1.1153 | 180,000 | \$1.1190 | 180,000 | \$1.0954 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 50,000 | €0.9585 | 50,000 | €0.9575 | 927,796 | €0.9273 |
| クラスB(分配型)ユーロ建 | 929,549 | €0.8561 | 613,825 | €0.8657 | 613,825 | €0.8519 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 693,299 | £0.7388 | 693,299 | £0.7428 | 693,299 | £0.7292 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 49,707 | £0.7611 | 54,910 | £0.7547 | 15,754 | £0.7294 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 133,108 | £0.6843 | 85,455 | £0.6880 | 25,539 | £0.6753 |
| クラスM(無分配型) | 14,535,675 | \$1.5427 | 15,454,647 | \$1.5260 | 16,239,245 | \$1.4699 |
| クラスM(分配型) | 89,237,809 | \$1.1025 | 117,155,559 | \$1.1062 | 124,006,896 | \$1.0829 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 6,006,165 | €1.0070 | 6,591,292 | €1.0039 | 6,109,107 | €0.9724 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 111,919 | £0.7771 | 117,224 | £0.7700 | 65,206 | £0.7436 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 211,561,352 | £0.7412 | 150,868,104 | £0.7453 | 168,879,288 | £0.7318 |
| クラスZ(無分配型) | 1,087,152 | \$1.2580 | 1,363,548 | \$1.2512 | 1,321,756 | \$1.2119 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 17,133,071 | €0.9621 | 14,072,779 | €0.9645 | 13,893,468 | €0.9392 |
| クラスZ(無分配型)英ポンド建 | 299,371 | £0.7667 | 259,578 | £0.7639 | 257,595 | £0.7421 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| グローバル・インフレーション・ | | | | | | |
| リンク・ボンド・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 339,578 | \$1.4388 | 413,872 | \$1.3771 | 413,872 | \$1.3564 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 358,811 | €1.0557 | 447,688 | €1.0180 | 647,484 | €1.0092 |
| クラスA(無分配型)英ポンド建 | 11,343 | £0.9028 | 11,343 | £0.8638 | 65,830 | £0.8524 |
| クラスA(分配型)ユーロ建 | 219,482 | €1.0584 | 219,482 | €1.0257 | 219,482 | €1.0199 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 1,042,630 | £0.8902 | 1,040,437 | £0.8566 | 1,101,452 | £0.8479 |
| クラスB(無分配型) | 1,737,912 | \$1.4772 | 1,544,112 | \$1.4124 | 2,244,112 | \$1.3897 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 794,644 | €1.0733 | 794,644 | €1.0339 | 794,644 | €1.0240 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 918,692 | £0.9796 | 945,199 | £0.9369 | 945,199 | £0.9234 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|---|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・ リンク・ボンド・ファンド (続き) | | | | | | |
| クラスB(分配型)ユーロ建 | 106,280 | €0.9466 | 106,280 | €0.9171 | 106,280 | €0.9115 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 41,382 | €0.9600 | 55,559 | €0.9234 | 158,000 | €0.9132 |
| クラスI(無分配型) | - | - | - | - | 31,945 | \$1.3633 |
| クラスI(分配型) | - | - | 570,000 | \$1.3677 | 570,000 | \$1.3495 |
| クラスI(無分配型)ユーロ建 | 31,901 | €1.0582 | 5,113,401 | €1.0176 | 5,113,401 | €1.0061 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 938,309 | €0.9124 | 919,004 | €0.8711 | 982,803 | €0.8570 |
| クラスI(分配型)ユーロ建 | - | - | 256,136 | €1.0294 | 256,136 | €1.0223 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 252,345 | €0.8833 | 447,184 | €0.8502 | 501,405 | €0.8405 |
| クラスM(無分配型) | 4,748,896 | \$1.5675 | 6,923,248 | \$1.4951 | 6,898,697 | \$1.4675 |
| クラスM(分配型) | 18,340,132 | \$1.4196 | 30,495,421 | \$1.3663 | 32,470,050 | \$1.3482 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 1,197,839 | €1.1183 | 2,144,111 | €1.0842 | 2,165,020 | €1.0617 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 9,384,688 | €0.9377 | 16,892,152 | €0.8945 | 16,095,810 | €0.8795 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 6,553,523 | €1.0482 | 8,586,496 | €1.0140 | 10,708,581 | €1.0092 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 70,049,838 | €0.9745 | 105,848,313 | €0.9382 | 121,093,611 | €0.9275 |
| クラスZ(無分配型) | 346,518 | \$1.5285 | 172,319 | \$1.4629 | 250,387 | \$1.4408 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 3,352,312 | €0.9551 | 1,084,976 | €0.9209 | 1,162,258 | €0.9130 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ デット・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 155,492 | \$1.4156 | 179,342 | \$1.3912 | 179,342 | \$1.3322 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 169,945 | €1.0731 | 469,077 | €1.0623 | 672,758 | €1.0226 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 375,970 | €0.7944 | 372,381 | €0.7991 | 369,119 | €0.7827 |
| クラスB(無分配型) | 724,680 | \$1.8088 | 2,222,663 | \$1.7758 | 2,358,198 | \$1.6988 |
| クラスB(分配型) | 317,592 | \$1.2392 | 165,153 | \$1.2438 | 165,153 | \$1.2140 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 205,889 | €1.1631 | 205,889 | €1.1502 | 205,890 | €1.1061 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 1,790,898 | €1.0225 | 1,790,898 | €1.0047 | 1,790,898 | €0.9643 |
| クラスB(分配型)ユーロ建 | 129,534 | €0.9208 | 129,534 | €0.9311 | 129,534 | €0.9136 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 118,063 | €0.8289 | 118,063 | €0.8338 | 118,063 | €0.8169 |
| クラスI(無分配型) | 106,601 | \$1.3803 | 241,500 | \$1.3528 | 243,410 | \$1.2918 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|--|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ デット・ファンド(続き) | | | | | | |
| クラスI(無分配型)ユーロ建 | 12,780,117 | €0.9880 | 19,447,913 | €0.9754 | 18,246,776 | €0.9364 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 36,667 | £0.8942 | 38,013 | £0.8771 | 38,013 | £0.8403 |
| クラスI(分配型)ユーロ建 | 50,556 | €0.9256 | 50,556 | €0.9359 | 50,556 | €0.9183 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 85,154 | £0.7600 | 86,703 | £0.7645 | 127,259 | £0.7488 |
| クラスM(無分配型) | 3,961,725 | \$1.9009 | 3,634,751 | \$1.8621 | 3,382,436 | \$1.7773 |
| クラスM(分配型) | 42,084,391 | \$1.2277 | 24,157,586 | \$1.2322 | 25,819,120 | \$1.2027 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 9,702,003 | €1.2595 | 9,074,694 | €1.2427 | 8,130,724 | €1.1925 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 7,033,418 | £1.0539 | 6,492,777 | £1.0332 | 5,863,643 | £0.9894 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 2,586,584 | €0.9485 | 2,084,595 | €0.9591 | 1,925,594 | €0.9411 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 182,999,927 | £0.7662 | 118,164,378 | £0.7708 | 117,713,813 | £0.7551 |
| クラスZ(無分配型) | 288,467 | \$1.6825 | 268,734 | \$1.6560 | 237,661 | \$1.5881 |
| クラスZ(分配型) | 42,751 | \$1.2364 | 42,347 | \$1.2409 | 42,347 | \$1.2112 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 5,137,086 | €1.0940 | 4,320,614 | €1.0845 | 4,701,608 | €1.0457 |
| クラスZ(分配型)ユーロ建 | 72,573 | €0.9201 | 72,573 | €0.9303 | 72,573 | €0.9127 |
| クラスZ(分配型)英ポンド建 | 50,003 | £0.8211 | 110,700 | £0.8254 | 110,700 | £0.8085 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・ セキュリティーズ・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 86,266 | \$1.4170 | 131,654 | \$1.4940 | 131,654 | \$1.4587 |
| クラスA(分配型) | 41,633 | \$1.3192 | 64,139 | \$1.4150 | 64,139 | \$1.3991 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 71,146 | €1.0621 | 71,146 | €1.1313 | 71,146 | €1.1105 |
| クラスA(分配型)ユーロ建 | 3,466 | €0.9580 | 3,466 | €1.0374 | 3,466 | €1.0315 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 282,486 | £0.8639 | 282,486 | £0.9343 | 282,486 | £0.9280 |
| クラスB(無分配型) | 160,000 | \$1.3933 | 450,000 | \$1.4676 | 450,000 | \$1.4311 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 149,649 | £0.8215 | 149,649 | £0.8724 | 149,649 | £0.8543 |
| クラスB(分配型)ユーロ建 | 96,834 | €0.9402 | 142,653 | €1.0173 | 142,653 | €1.0102 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 117,000 | £0.8591 | 117,000 | £0.9280 | 117,000 | £0.9206 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|---|---------------|----------------|--------------|----------------|---------------|----------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・ セキュリティーズ・ファンド (続き) | | | | | | |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 37,691 | £0.9026 | 37,421 | £0.9568 | 39,963 | £0.9353 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 95 | £0.8257 | 15,523 | £0.8867 | 15,523 | £0.8782 |
| クラスM(無分配型) | 1,192,444 | \$1.4367 | 505,348 | \$1.5104 | 572,413 | \$1.4704 |
| クラスM(分配型) | 85,038,090 | \$1.3414 | 84,296,802 | \$1.4344 | 89,426,342 | \$1.4141 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 6,310,731 | €0.9548 | 4,404,742 | €1.0138 | 2,680,715 | €0.9921 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 3,772,458 | £0.8871 | 2,286,104 | £0.9403 | 1,779,651 | £0.9191 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 1,375,817 | €0.9615 | 901,835 | €1.0386 | 598,558 | €1.0293 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 3,030,087 | £0.8097 | 918,513 | £0.8732 | 1,367,612 | £0.8648 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 554,536 | €1.0460 | 696,515 | €1.1168 | 551,175 | €1.0992 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス グローバル・ショート・ デュレーション・ボンド・ ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 235,518 | \$1.7284 | 231,717 | \$1.6998 | 250,668 | \$1.6648 |
| クラスA(分配型)ユーロ建 | 72,783 | €1.2376 | 72,783 | €1.2406 | 106,744 | €1.2347 |
| クラスB(無分配型) | 696,380 | \$1.7412 | 576,380 | \$1.7110 | 1,076,380 | \$1.6743 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 284,424 | £1.1185 | 239,011 | £1.1001 | 239,011 | £1.0796 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 740,746 | £1.0778 | 5 | £1.0992 | 5 | £1.0645 |
| クラスI(無分配型)ユーロ建 | - | - | 46,532 | €1.3389 | 46,532 | €1.3175 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 52 | £1.0928 | 52 | £1.0701 | 5 | £1.0645 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 18,228 | £1.0444 | 18,228 | £1.0416 | 18,228 | £1.0375 |
| クラスM(無分配型) | 8,410,008 | \$1.8102 | 3,923,960 | \$1.7779 | 6,414,578 | \$1.7392 |
| クラスM(分配型) | 1,697,913 | \$1.6824 | 1,037,907 | \$1.6747 | 1,570,249 | \$1.6585 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 9,404,273 | €1.2436 | 10,754,389 | €1.2297 | 15,288,479 | €1.2092 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 8,259,267 | £1.1163 | 5,766,311 | £1.0972 | 7,895,727 | £1.0761 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 2,689,101 | €1.2104 | 3,031,859 | €1.2132 | 3,369,923 | €1.2076 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 154,374,299 | £1.0636 | 160,403,449 | £1.0609 | 225,176,847 | £1.0540 |
| クラスZ(無分配型) | 671,999 | \$1.7150 | 516,546 | \$1.6865 | 314,479 | \$1.6520 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 3,725,887 | €1.2999 | 1,403,371 | €1.2870 | 607,765 | €1.2675 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|---------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| 米国中小型株式ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 2,992,787 | \$1.6318 | 3,948,651 | \$1.4907 | 4,983,566 | \$1.4731 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | - | - | - | - | 228,141 | €1.1417 |
| クラスA(無分配型)英ポンド建 | 388,061 | £1.0335 | 367,031 | £0.9515 | 367,031 | £0.9437 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 60,753 | £0.9764 | 60,753 | £0.8989 | 60,753 | £0.8916 |
| クラスB(無分配型) | 4,118,957 | \$1.6547 | 4,464,835 | \$1.5096 | 4,479,938 | \$1.4898 |
| クラスB(分配型) | 154,500 | \$1.6525 | 154,500 | \$1.5077 | 154,500 | \$1.4880 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 130,548 | €0.7887 | 67,207 | €0.7252 | 67,207 | €0.7183 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 58,204 | £1.0376 | 58,204 | £0.9542 | 254,628 | £0.9453 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | - | - | - | - | 357,663 | £0.9374 |
| クラスI(無分配型) | 9,383,001 | \$1.6662 | 9,445,648 | \$1.5186 | 10,440,715 | \$1.4973 |
| クラスI(分配型) | - | - | 205,580 | \$1.5204 | 405,580 | \$1.4988 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 380,220 | £1.0246 | 411,513 | £0.9412 | 347,693 | £0.9314 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 296,264 | £1.0246 | 315,400 | £0.9412 | 307,173 | £0.9314 |
| クラスM(無分配型) | 27,928,426 | \$1.6772 | 30,195,329 | \$1.5275 | 29,331,386 | \$1.5049 |
| クラスM(分配型) | 13,055,631 | \$1.6768 | 9,304,515 | \$1.5274 | 11,018,701 | \$1.5049 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 7,189,955 | €1.1224 | 7,818,852 | €1.0304 | 11,668,586 | €1.0189 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 7,905,406 | £1.0090 | 12,283,406 | £0.9261 | 13,222,935 | £0.9158 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 311,828 | €1.1122 | 335,496 | €1.0212 | 328,989 | €1.0097 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 117,329,033 | £1.0235 | 117,876,303 | £0.9396 | 122,763,024 | £0.9292 |
| クラスZ(無分配型) | 1,507,672 | \$1.6072 | 1,352,813 | \$1.4718 | 1,347,135 | \$1.4580 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 5,128,867 | €1.2100 | 4,954,092 | €1.1170 | 5,520,665 | €1.1105 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| 米国バリュー株式ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 617,279 | \$25.2317 | 856,590 | \$23.4097 | 926,766 | \$23.6345 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 41,300 | €19.7300 | 41,300 | €18.4522 | 49,095 | €18.6977 |
| クラスA(無分配型)英ポンド建 | 7,426 | £16.0904 | 7,456 | £15.0167 | 7,456 | £15.2111 |
| クラスB(無分配型) | 130,500 | \$27.7999 | 308,000 | \$25.7519 | 291,500 | \$25.9656 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 17,596 | £16.2516 | 29,137 | £15.1171 | 45,580 | £15.3246 |
| クラスI(無分配型) | 2,316 | \$26.7604 | 2,316 | \$24.7586 | 9,101 | \$24.9263 |
| クラスI(無分配型)ユーロ建 | - | - | 5,475 | €18.9905 | 7,589 | €19.1858 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 5,754 | £16.6057 | 6,049 | £15.4508 | 6,997 | £15.6016 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 437 | £16.0553 | 949 | £15.0590 | 980 | £15.3012 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|---|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス 米国バリューストックファンド (続き) | | | | | | |
| クラスM(無分配型) | 2,423,720 | \$26.3525 | 2,378,760 | \$24.3459 | 1,980,858 | \$24.4730 |
| クラスM(分配型) | 677,767 | \$27.5010 | 31,746 | \$25.6195 | 28,743 | \$25.9424 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 670,453 | €19.7247 | 977,603 | €18.3316 | 943,680 | €18.4945 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 333,469 | £16.8045 | 330,397 | £15.6109 | 98,487 | £15.7433 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 63,419 | €20.2287 | 98,804 | €18.9317 | 109,417 | €19.2408 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 12,371,694 | £16.0900 | 15,868,953 | £15.0695 | 17,612,135 | £15.3123 |
| クラスZ(無分配型) | 189,849 | \$24.4844 | 223,722 | \$22.7518 | 228,875 | \$23.0290 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 2,055,384 | €18.5760 | 2,417,879 | €17.4097 | 2,842,803 | €17.6861 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス グローバル株式ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 572,907 | \$2.1580 | 2,010,641 | \$2.1332 | 904,271 | \$2.1560 |
| クラスA(分配型) | 2,354,860 | \$1.8407 | 4,794,987 | \$1.8559 | 3,275,190 | \$1.8987 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 771,578 | €1.5646 | 1,163,161 | €1.5602 | 834,718 | €1.5840 |
| クラスA(無分配型)英ポンド建 | 93,384 | £1.3712 | 127,608 | £1.3665 | 93,384 | £1.3865 |
| クラスA(分配型)ユーロ建 | 4,770,306 | €1.3265 | 7,198,194 | €1.3491 | 6,416,411 | €1.3864 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 663,308 | £1.1599 | 863,156 | £1.1793 | 823,346 | £1.2114 |
| クラスB(無分配型) | 2,533,630 | \$2.1901 | 7,482,073 | \$2.1621 | 3,791,726 | \$2.1826 |
| クラスB(分配型) | 2,710,196 | \$1.8622 | 6,207,621 | \$1.8753 | 3,786,190 | \$1.9161 |
| クラスB(無分配型)ユーロ建 | 4,168,917 | €1.6405 | 7,165,295 | €1.6338 | 4,689,480 | €1.6567 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 730,802 | £1.3869 | 932,302 | £1.3803 | 724,263 | £1.3987 |
| クラスB(分配型)ユーロ建 | 1,988,845 | €1.4149 | 2,266,620 | €1.4372 | 2,799,969 | €1.4752 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | 1,175,097 | £1.1829 | 1,586,872 | £1.2011 | 2,584,883 | £1.2324 |
| クラスI(無分配型) | 80,081 | \$2.1517 | 169,810 | \$2.1205 | 301,811 | \$2.1372 |
| クラスI(分配型) | 1,890,151 | \$1.9184 | 3,644,920 | \$1.9284 | 1,890,151 | \$1.9668 |
| クラスI(無分配型)ユーロ建 | 147,059 | €1.6077 | 235,064 | €1.5984 | 147,059 | €1.6179 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 1,523,848 | £1.3128 | 2,002,182 | £1.3043 | 1,761,466 | £1.3193 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 2,348,317 | £1.1826 | 2,972,439 | £1.1987 | 2,886,011 | £1.2277 |
| クラスM(無分配型) | 88,466 | \$2.1828 | 190,159 | \$2.1495 | 284,524 | \$2.1644 |
| クラスM(分配型) | 4,345,775 | \$1.9133 | 7,992,061 | \$1.9218 | 7,281,111 | \$1.9587 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 917,434 | €1.1762 | 5,717,020 | €1.1691 | 4,314,627 | €1.1825 |

5. 純資産価額(続き)

| 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | | |
|------------------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|----------|
| 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| グローバル株式ファンド(続き) | | | | | | |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 9,823,204 | £1.4288 | 15,397,201 | £1.4186 | 11,648,090 | £1.4339 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 473,892 | €1.4448 | 1,148,879 | €1.4639 | 864,020 | €1.4987 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 135,150,946 | £1.2147 | 133,582,261 | £1.2302 | 111,349,215 | £1.2590 |
| クラスZ(無分配型) | 231,737 | \$2.0598 | 497,188 | \$2.0412 | 220,481 | \$2.0680 |
| クラスZ(分配型) | 15,377 | \$1.8322 | 28,478 | \$1.8520 | 15,377 | \$1.8995 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 11,959,406 | €1.6052 | 19,661,543 | €1.6046 | 12,302,848 | €1.6332 |
| クラスZ(無分配型)英ポンド建 | 151,588 | £1.5770 | 201,105 | £1.2609 | 159,487 | £1.2862 |
| クラスZ(分配型)ユーロ建 | 688,809 | €1.3666 | 978,386 | €1.3934 | 754,704 | €1.4355 |
| 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| エマージング・マーケット・ | | | | | | |
| ローカル・カレンシー・ | | | | | | |
| デット・ファンド | | | | | | |
| クラスA(分配型)ユーロ建 | - | - | 62,850 | €0.4996 | 125,786 | €0.4889 |
| クラスB(無分配型) | 2,732,719 | \$0.7514 | 2,046,887 | \$0.7490 | 2,732,719 | \$0.7076 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 32,667 | £0.4020 | 39 | £0.4166 | 94 | £0.4105 |
| クラスM(分配型) | 166,554,962 | \$0.6397 | 74,196,715 | \$0.6615 | 116,549,324 | \$0.6430 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 735,294 | £0.4992 | 366,967 | £0.4991 | 735,294 | £0.4726 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 15,080 | £0.4138 | 6,484 | £0.4300 | 15,080 | £0.4198 |
| 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| 欧州(除く英国)・ | | | | | | |
| アルファ・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | 5,167,113 | €1.9261 | 7,385,801 | €2.0491 | 9,083,836 | €2.2235 |
| クラスA(分配型) | 87,122 | €1.8082 | 86,509 | €1.9461 | 86,509 | €2.1101 |
| クラスA(無分配型)英ポンド建 | 753,913 | £1.6226 | 846,014 | £1.7307 | 874,539 | £1.8794 |
| クラスA(無分配型)米ドル建 | 640,544 | \$2.8004 | 1,256,087 | \$2.9539 | 1,395,433 | \$3.2033 |
| クラスA(分配型)英ポンド建 | 95,975 | £1.4706 | 95,975 | £1.5867 | 95,975 | £1.7231 |
| クラスB(無分配型) | 297,739 | €2.0450 | 412,195 | €2.1730 | 862,195 | €2.3535 |
| クラスB(分配型) | 48,497 | €1.8245 | 48,497 | €1.9662 | 48,497 | €2.1292 |
| クラスB(無分配型)英ポンド建 | 987,762 | £1.2141 | 1,879,669 | £1.2931 | 1,879,669 | £1.4024 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 1,215,706 | \$1.7473 | 1,529,265 | \$1.8406 | 1,695,839 | \$1.9935 |
| クラスB(分配型)英ポンド建 | - | - | - | - | 107,991 | £1.7785 |

5. 純資産価額(続き)

| | 2016年11月30日現在 | | 2016年5月31日現在 | | 2015年11月30日現在 | |
|----------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| 欧州(除く英国)・ | | | | | | |
| アルファ・ファンド(続き) | | | | | | |
| クラスI(無分配型) | 2,151,154 | €1.9458 | 2,509,844 | €2.0640 | 5,689,272 | €2.2312 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 107,054 | £1.5621 | 127,563 | £1.6611 | 141,010 | £1.7984 |
| クラスI(無分配型)米ドル建 | 300,932 | \$2.5898 | 348,314 | \$2.7236 | 481,098 | \$2.9445 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 25,932 | £1.4704 | 70,013 | £1.5924 | 89,610 | £1.7240 |
| クラスM(無分配型) | 32,605,056 | €1.3642 | 40,076,933 | €1.4460 | 34,948,072 | €1.5619 |
| クラスM(分配型) | 54,442,730 | €1.8181 | 87,559,990 | €1.9644 | 87,081,000 | €2.1220 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 4,247,096 | £1.5385 | 5,256,239 | £1.6347 | 3,404,928 | £1.7688 |
| クラスM(無分配型)米ドル建 | 3,284,533 | \$2.6125 | 3,949,079 | \$2.7453 | 4,938,669 | \$2.9658 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 58,987,343 | £1.5360 | 76,058,050 | £1.6645 | 76,143,772 | £1.8008 |
| クラスM(分配型)米ドル建 | 993,901 | \$2.3969 | 1,060,056 | \$2.5672 | 1,059,691 | \$2.7735 |
| クラスZ(無分配型) | 27,800,031 | €1.8481 | 31,968,490 | €1.9711 | 36,205,321 | €2.1422 |
| | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 | 発行済株式数 | 1株当たり 純資産価格 |
| グローバル・アクセス | | | | | | |
| ジャパン・ファンド | | | | | | |
| クラスA(無分配型) | - | - | - | - | 51,017 | ¥157.4323 |
| クラスA(無分配型)ユーロ建 | 380,400 | €1.1938 | 3,754,101 | €1.0897 | 4,178,984 | €1.2859 |
| クラスA(無分配型)米ドル建 | 44,432 | \$1.5154 | 86,953 | \$1.3681 | 214,162 | \$1.6076 |
| クラスB(無分配型) | 74,941 | ¥153.5550 | 74,941 | ¥138.5799 | 74,941 | ¥161.7445 |
| クラスB(無分配型)米ドル建 | 5,820,000 | \$1.2289 | 6,990,000 | \$1.1082 | 6,920,000 | \$1.3007 |
| クラスI(無分配型)英ポンド建 | 17,734 | £1.1090 | 17,684 | £1.0119 | 16,613 | £1.1888 |
| クラスI(分配型)英ポンド建 | 21,475 | £1.0769 | 10,877 | £0.9878 | 10,877 | £1.1605 |
| クラスM(無分配型) | 8,269,582 | ¥152.0984 | 8,724,606 | ¥136.9617 | 5,962,265 | ¥159.4905 |
| クラスM(分配型) | 35,629,105 | ¥149.3951 | 48,913,514 | ¥135.2266 | 68,006,746 | ¥157.7247 |
| クラスM(無分配型)ユーロ建 | 3,386,292 | €1.2240 | 6,561,240 | €1.1133 | 6,400,643 | €1.3091 |
| クラスM(無分配型)英ポンド建 | 169,155 | £0.8777 | 2,552,628 | £0.8015 | 2,359,335 | £0.9411 |
| クラスM(無分配型)米ドル建 | 280,450 | \$1.2703 | 374,104 | \$1.1429 | 363,371 | \$1.3385 |
| クラスM(分配型)ユーロ建 | 752,454 | €1.0469 | 2,689,619 | €0.9586 | 579,116 | €1.1303 |
| クラスM(分配型)英ポンド建 | 44,578,584 | £1.0776 | 59,890,080 | £0.9885 | 66,646,060 | £1.1625 |
| クラスM(分配型)米ドル建 | 468,733 | \$1.1951 | 5,185,090 | \$1.0825 | 130,605 | \$1.2708 |
| クラスZ(無分配型) | 59,931 | ¥144.9150 | 59,931 | ¥131.2604 | 59,931 | ¥153.7782 |
| クラスZ(無分配型)ユーロ建 | 5,103,774 | €1.1630 | 7,749,928 | €1.0641 | 9,901,261 | €1.2588 |

[次へ](#)

6. 関連当事者間取引

中央銀行UCITS規制第41 (1)条に従い、UCITSの運用会社または保管機関、それらの代理人または副代理人、およびかかる運用会社、保管機関、代理人、または副代理人の関連会社またはグループ(以下「関連当事者」という。)が、UCITSと行った取引は、第三者間で交渉された取引であるかのように実施する必要がある。かかる取引は、投資主利益が最大限になるように行われなければならない。こうした取引の他に、本投資法人のために関連当事者が行い、取締役が直接関わらず、かつ当該取引に関して取締役は、その取引を行う関連当事者が同様に第三者間取引ベースで取引を実施するという、本投資法人の代理人による保証に依存しなければならない取引もある。

投資主は、前期末現在の監査済財務諸表に掲載されているコーポレート・ガバナンス・ステートメント・レポートに具体的に記載されているところの本投資法人の統治構造、および取締役会が一般的に監督する本投資法人の各代理人の役割と責任を注視すべきである。投資主は、様々な関連当事者間取引、および主要な関連当事者との契約上の取決めの一般的な性質を明記した目論見書を参照すべきだが、かかる目論見書はすべての関連当事者間取引を網羅しているわけではない。さらに、利益相反に関する目論見書の規定も参照すべきである。

そこで取締役会は、本投資法人の経営陣および代理人による確認を踏まえて、次の点を確信している。

- () 上記の義務が全関連当事者間取引に課せられるよう徹底するため、(投資運用会社が書面化した手続により証明されるように)取り決めていること。
- () 取締役への定期的な最新報告を通じて立証されているように、期中の関連当事者間取引がこれらの義務を遵守していたこと。

7. 税金

現行の法律および慣習に基づき、当ファンドは、1997年所得税法(改訂)第739B条に規定された投資事業体として適格である。この基準により、当ファンドには、所得または利益に関するアイルランドの税金が課せられていない。

しかし、アイルランド課税は、「課税イベント」の発生により生じることがある。課税イベントには、投資主に対する分配金の支払、現金化、投資証券の買戻し、解約または譲渡、およびかかる投資証券の取得から8年間の各年末の投資証券の保有が含まれる。

以下に関する課税イベントについては、当ファンドに対し、アイルランド課税は生じない。

- (a) 課税イベントの時点で、アイルランド居住者でも税法上アイルランドの通常の居住者でもない投資主。但し、1997年所得税法(改訂)の規定に従った適切で有効な宣言書が当ファンドにより保有されるか、または適切な宣言書がない場合に、当ファンドが総額で支払いを行うことをアイルランド歳入庁により承認されていることを条件とする。
- (b) 必要な署名済の法定宣言書を当ファンドに提出した特定のアイルランドの課税居住者である一定の免税投資主

当ファンドが行った投資に関して受け取った配当、利息、キャピタル・ゲイン(もしあれば)は、投資収益/利益が発生する国での課税対象となり、当ファンドまたは投資主はかかる税金の還付を受けることができないことがある。

8. ソフトコミッション契約

投資運用会社および副投資運用会社は、ブローカーとソフトコミッション契約を締結できる。それにより、投資運用会社および副投資運用会社は、投資判断のサポートに用いられる特定の財およびサービスを受けることができる。投資運用会社および副投資運用会社は、これらのサービスに対し直接支払いを行わないが、当ファンドのために、ブローカーと合意された金額で事業取引を行う。手数料は、これらの取引に関し当ファンドにより支払われる。当ファンドに関して使用される財・サービスに含まれるものは、次のとおりである。

- ・ 調査分析サービス（投資判断のサポートに用いられる経済的要因、トレンドおよびコンピューター・サービスを含む。）
- ・ 顧客に代わって運用される投資に関する、保護預かりサービス
- ・ パフォーマンスおよび評価サービス

9. 当期中の重要な事象

2016年5月31日現在の期末監査承認後、米国株式の受取配当金に誤った源泉徴収税率が適用されていた件について、問題が特定された。会計年度の期首に、実際は30%の税率が適用されるべきところ誤って15%という低い税率が適用されていたものである。2016年5月31日（同日を含む）までに、当該期間中に税率を引き上げて適用することになった対象サブファンドの財務上の影響額の詳細は次のとおりである。

これにより重大な影響を受けた投資家は補填を受けた。またファンドが負担する税率を修正し、それぞれのNAVに反映させた。

| ファンド | 通貨 | 調整額 | ベースポイント 影響 |
|--------------------------------------|------|-----------|---------------|
| グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド | 英ポンド | 637 | 0.09 |
| グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド | 英ポンド | 4,569 | 0.34 |
| グローバル・アクセス パシフィック・リム（除く日本）・ファンド | 米ドル | 3,396 | 0.22 |
| グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド | 米ドル | 45,725 | 0.49 |
| グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド | 米ドル | 407,399 | 30.12 |
| グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | 米ドル | 568,452 | 19.92 |
| グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド | 米ドル | 1,879,113 | 36.13 |
| グローバル・アクセス グローバル株式ファンド | 米ドル | 738,569 | 23.53 |

2016年6月1日および2016年9月1日に、分配可能な純利益に基づき、各ファンドによって以下の配当が宣言された。

| ファンド | 通貨 | 支払金額 | 支払金額 |
|---|------|------------|------------|
| | | 2016年6月1日 | 2016年9月1日 |
| グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド | 英ポンド | 532,464 | 394,784 |
| グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド | 英ポンド | 1,183,829 | 805,344 |
| グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド | 米ドル | 244,604 | 192,784 |
| グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド | 米ドル | 516,310 | 644,924 |
| グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド | 米ドル | 2,262,796 | 223,000 |
| グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド | 米ドル | 9,638,714 | 10,405,697 |
| グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド | 米ドル | 2,331,762 | 2,137,534 |
| グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド | 米ドル | 430,977 | 1,292,147 |
| グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド | 米ドル | 2,235,086 | 2,426,522 |
| グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド | 米ドル | 1,074,402 | 931,788 |
| グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド | 米ドル | 1,741,328 | 1,780,945 |
| グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド | 米ドル | 25,674 | - |
| グローバル・アクセス 米国バリューストック株式ファンド | 米ドル | 1,483,499 | 1,092,280 |
| グローバル・アクセス グローバル株式ファンド | 米ドル | 2,935,185 | 1,545,425 |
| グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド | 米ドル | 1,622,572 | 1,213,757 |
| グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド | ユーロ | 5,389,608 | 874,087 |
| グローバル・アクセス ジャパン・ファンド | 日本円 | 90,431,467 | - |

2016年6月2日付けで本投資法人の株式上場市場は、アイルランド証券取引所の主要証券市場(以下「MSM」という。)からグローバル取引市場(以下「GEM」という。)に移行した。GEMは、EU金融商品市場指令2004/39/ECに規定される多角的取引システムとしてアイルランド中央銀行により承認されている。

期中に、当ファンドにおいて様々な投資証券クラスが満了した。詳しくは、「本投資法人の背景」の「ファンドの一瞥」欄を参照のこと。また、投資運用会社の報告に記載された通り、当期中に多くの副投資運用会社の任命と退任があった。

本投資法人の取締役会の意見では、上記以外に、2016年11月30日に終了した6か月間の財務諸表の改訂もしくは開示を必要とする重要な事象は当期中になかった。

10. 後発事象

本投資法人の取締役会の意見では、2016年11月30日に終了した6か月間の財務諸表に影響を及ぼした可能性がある後発事象はなかった。

11. 財務諸表の承認

取締役会は、2017年1月12日に当財務諸表を承認した。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|----------------|--------------|
| | 株式 : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | オーストラリア : 0.84% (31 May 2016: 0.63%) | | |
| | 鉱業 : 0.84% (31 May 2016: 0.63%) | | |
| 375,221 | South32 Ltd Com NPV | 611,610 | 0.84 |
| | オーストラリア合計 | 611,610 | 0.84 |
| | ベルギー : 0.14% (31 May 2016: 5.06%) | | |
| | 食品 : 0.14% (31 May 2016: 5.06%) | | |
| 2,500 | Colruyt SA Com NPV | 101,238 | 0.14 |
| | ベルギー合計 | 101,238 | 0.14 |
| | カナダ : 0.63% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| | 鉱業 : 0.56% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 33,622 | Barrick Gold Corp Com NPV | 404,061 | 0.56 |
| | 石油・ガス : 0.07% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 59,723 | Ithaca Energy Inc Com NPV | 50,317 | 0.07 |
| | カナダ合計 | 454,378 | 0.63 |
| | ケイマン諸島 : 0.83% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| | 保険 : 0.83% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| 85,222 | Phoenix Group Holdings Com EURO.0001 | 603,585 | 0.83 |
| | ケイマン諸島合計 | 603,585 | 0.83 |
| | デンマーク : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 運輸 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 30 | AP Moeller - Maersk A/S Class B Com DKK1000.00 | 32,010 | 0.04 |
| | デンマーク合計 | 32,010 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|----------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | フランス : 0.61% (31 May 2016: 1.52%) | | |
| | 航空 : 0.00% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | 通信 : 0.61% (31 May 2016: 1.32%) | | |
| 37,876 | Orange SA Com EUR4.00 | 442,260 | 0.61 |
| | フランス合計 | 442,260 | 0.61 |
| | ドイツ : 0.03% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 余暇 : 0.00% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| | 通信 : 0.03% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 1,570 | Deutsche Telekom AG Com NPV | 19,782 | 0.03 |
| | ドイツ合計 | 19,782 | 0.03 |
| | ジブラルタル : 0.37% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| | 娯楽 : 0.37% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 130,303 | 888 Holdings PLC Com GBPO.005 | 272,822 | 0.37 |
| | ジブラルタル合計 | 272,822 | 0.37 |
| | ギリシャ : 0.22% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| | 銀行 : 0.22% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 946,605 | Piraeus Bank SA Com EURO.30 | 160,341 | 0.22 |
| | ギリシャ合計 | 160,341 | 0.22 |
| | アイルランド : 1.03% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| | 航空 : 0.39% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 24,089 | Ryanair Holdings PLC Com EURO.006 | 282,145 | 0.39 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|---|----------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | アイルランド(つづき) : 1.03% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| | バイオテクノロジー : 0.05% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 3,532 | Malin Corp PLC Com EURO.001 | 36,136 | 0.05 |
| | 建設資材 : 0.44% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 11,865 | CRH PLC Com EURO.32 | 315,668 | 0.44 |
| | 住宅建設 : 0.15% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 101,683 | Cairn Homes PLC Com EURO.001 | 110,507 | 0.15 |
| | アイルランド合計 | 744,456 | 1.03 |
| | マン島 : 0.30% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| | 娯楽 : 0.12% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 12,981 | GVC Holdings PLC Com EURO.01 | 84,669 | 0.12 |
| | ソフトウェア : 0.18% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 15,097 | Playtech PLC Com NPV | 129,608 | 0.18 |
| | マン島合計 | 214,277 | 0.30 |
| | イタリア : 0.28% (31 May 2016: 0.80%) | | |
| | 航空・防衛 : 0.03% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 1,779 | Leonardo-Finmeccanica SpA Com EUR4.40 | 18,488 | 0.03 |
| | 銀行 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,657 | Intesa Sanpaolo SpA Com EURO.52 | 8,292 | 0.01 |
| 1,499 | Mediobanca SpA Com EURO.50 | 8,285 | 0.01 |
| 4,569 | Unione di Banche Italiane SpA Com EUR2.50 | 8,181 | 0.01 |
| | メディア : 0.05% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 19,307 | Mediaset SpA Com EURO.52 | 37,457 | 0.05 |
| | 通信 : 0.17% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 201,539 | Telecom Italia SpA/Milano Com NPV | 122,134 | 0.17 |
| | イタリア合計 | 202,837 | 0.28 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 日本 : 0.17% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 300 | 花王 | 11,094 | 0.02 |
| | インターネット : 0.04% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 3,500 | 楽天 | 27,726 | 0.04 |
| | 通信 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 500 | ソフトバンクグループ | 23,563 | 0.03 |
| | 玩具/ゲーム/趣味 : 0.08% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 300 | 任天堂 | 58,498 | 0.08 |
| | 日本合計 | 120,881 | 0.17 |
| | ジャージー : 1.54% (31 May 2016: 1.39%) | | |
| | 商業サービス : 0.49% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 23,690 | Experian PLC Com USD0.10 | 357,837 | 0.49 |
| | 鉱業 : 0.58% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 150,611 | Glencore PLC Com USD0.01 | 420,694 | 0.58 |
| | 石油・ガス : 0.04% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 34,241 | Genel Energy Plc Com GBPO.10 | 25,938 | 0.04 |
| | 医薬品 : 0.43% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 6,625 | Shire PLC Com GBPO.05 | 308,742 | 0.43 |
| | ジャージー合計 | 1,113,211 | 1.54 |
| | オランダ : 0.37% (31 May 2016: 1.02%) | | |
| | 商業サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 保険 : 0.20% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 31,875 | Delta Lloyd NV Com EURO.20 | 147,103 | 0.20 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|---|----------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | オランダ(つづき) : 0.37% (31 May 2016: 1.02%) | | |
| | 各種機械 : 0.06% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 5,900 | CNH Industrial NV Com EURO.01 | 40,288 | 0.06 |
| | 通信 : 0.11% (31 May 2016: 0.68%) | | |
| 34,421 | Koninklijke KPN NV Com EURO.04 | 79,331 | 0.11 |
| | オランダ合計 | 266,722 | 0.37 |
| | スペイン : 0.57% (31 May 2016: 0.75%) | | |
| | 航空 : 0.51% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 85,199 | International Consolidated Airlines Group SA Class D Com EURO.50 | 369,423 | 0.51 |
| | 銀行 : 0.06% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 57,244 | Banco Popular Espanol SA Com EURO.50 | 40,219 | 0.06 |
| | スペイン合計 | 409,642 | 0.57 |
| | 英国 : 84.94% (31 May 2016: 84.42%) | | |
| | 航空・防衛 : 2.25% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| 181,046 | BAE Systems PLC Com GBPO.03 | 1,087,634 | 1.50 |
| 280,742 | Chemring Group PLC Com GBPO.01 | 466,383 | 0.64 |
| 50,316 | Cobham PLC Com GBPO.03 | 82,720 | 0.11 |
| | 農業 : 0.46% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 1,187 | British American Tobacco PLC Com GBPO.25 | 52,157 | 0.07 |
| 8,280 | Imperial Brands PLC Com GBPO.10 | 284,294 | 0.39 |
| | アパレル : 0.49% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 22,779 | Burberry Group PLC Com GBPO.0005 | 325,398 | 0.45 |
| 999 | Ted Baker PLC Com GBPO.05 | 25,634 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 英国(つづき) : 84.94% (31 May 2016: 84.42%) | | |
| | 銀行 : 11.73% (31 May 2016: 11.91%) | | |
| 1,015,866 | Barclays PLC Com GBPO.25^ | 2,194,017 | 3.03 |
| 486,666 | HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 3,090,329 | 4.27 |
| 823,802 | Lloyds Banking Group PLC Com GBPO.10 | 476,775 | 0.66 |
| 729,116 | Royal Bank of Scotland Group PLC Com GBP1.00 | 1,415,943 | 1.96 |
| 204,932 | Standard Chartered PLC Com USD0.50 | 1,313,614 | 1.81 |
| | 飲料 : 0.47% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 31,607 | Fevertree Drinks PLC Com GBPO.0025 | 338,037 | 0.47 |
| | バイオテクノロジー : 0.17% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 97,821 | PureTech Health Plc Com GBPO.01 | 122,399 | 0.17 |
| | 建設資材 : 0.48% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| 118,475 | Marshall's PLC Com GBPO.25 | 348,553 | 0.48 |
| | 化学 : 0.95% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 14,068 | Johnson Matthey PLC Com GBP1.11 | 440,258 | 0.61 |
| 67,216 | Synthomer PLC Com GBPO.10 | 249,136 | 0.34 |
| | 商業サービス : 2.48% (31 May 2016: 3.22%) | | |
| 965 | Aggreko PLC Com GBPO.05 | 7,891 | 0.01 |
| 58,708 | De La Rue PLC Com GBPO.45 | 337,278 | 0.47 |
| 184,625 | Hays PLC Com GBPO.01 | 256,536 | 0.35 |
| 14,227 | Mears Group PLC Com GBPO.01 | 66,262 | 0.09 |
| 193,201 | QinetiQ Group PLC Com GBPO.01 | 469,575 | 0.65 |
| 1,840 | RELX PLC Com GBPO.14 | 25,282 | 0.03 |
| 296,744 | Rentokil Initial PLC Com GBPO.01 | 635,922 | 0.88 |
| | コンピューター : 1.19% (31 May 2016: 1.17%) | | |
| 67,955 | Computacenter PLC Com GBPO.08 | 496,411 | 0.69 |
| 41,618 | FDM Group Holdings PLC Com GBPO.01 | 220,471 | 0.30 |
| 106,788 | Serco Group PLC Com GBPO.02 | 141,975 | 0.20 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,126 | Unilever PLC Com GBPO.03 | 35,984 | 0.05 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 英国(つづき) : 84.94% (31 May 2016: 84.42%) | | |
| | 各種金融サービス : 4.01% (31 May 2016: 3.44%) | | |
| 150,000 | Ashmore Group PLC Com GBPO.0001 | 411,300 | 0.57 |
| 165,348 | ICAP PLC Com GBPO.10 | 805,575 | 1.11 |
| 50,142 | IG Group Holdings PLC Com GBPO.00005 | 421,820 | 0.58 |
| 8,694 | London Stock Exchange Group PLC Com GBPO.07 | 239,215 | 0.33 |
| 190,018 | Man Group PLC Com USD0.03 | 215,575 | 0.30 |
| 117,444 | Tullett Prebon PLC Com GBPO.25 | 522,567 | 0.72 |
| 108,656 | Worldpay Group PLC Com GBPO.03 | 292,393 | 0.40 |
| | 電子 : 0.60% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 96,949 | Electrocomponents PLC Com GBPO.10 | 434,186 | 0.60 |
| | エンジニアリング・建設 : 1.23% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 332,698 | Balfour Beatty PLC Com GBPO.50 | 890,799 | 1.23 |
| | 娯楽 : 2.18% (31 May 2016: 2.58%) | | |
| 691,898 | Ladbrokes Coral Group PLC Com GBPO.28 | 858,299 | 1.19 |
| 82,316 | Merlin Entertainments PLC Com GBPO.01 | 358,815 | 0.50 |
| 182,808 | Rank Group PLC Com GBPO.14 | 354,556 | 0.49 |
| | 環境規制 : 0.13% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 103,224 | Shanks Group PLC Com GBPO.10 | 93,418 | 0.13 |
| | 食品 : 6.55% (31 May 2016: 5.53%) | | |
| 114,732 | J Sainsbury PLC Com GBPO.29 | 264,974 | 0.37 |
| 110,749 | SSP Group Plc Com GBPO.01 | 409,716 | 0.57 |
| 35,619 | Tate & Lyle PLC Com GBPO.25 | 241,586 | 0.33 |
| 1,491,729 | Tesco PLC Com GBPO.05 | 3,114,357 | 4.30 |
| 324,834 | Wm Morrison Supermarkets PLC Com GBPO.10 | 707,001 | 0.98 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|---|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 英国(つづき) : 84.94% (31 May 2016: 84.42%) | | |
| | 林産品・紙製品 : 0.19% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 8,465 | Mondi PLC Com EURO.20 | 138,191 | 0.19 |
| | ガス : 2.22% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| 744,314 | Centrica PLC Com GBPO.06 | 1,564,548 | 2.16 |
| 4,427 | National Grid PLC Com GBPO.11 | 40,430 | 0.06 |
| | ヘルスケア用品 : 0.61% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 39,081 | Smith & Nephew PLC Com USD0.20 | 440,638 | 0.61 |
| | 各種持株会社 : 0.38% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 96,319 | Drax Group PLC Com GBPO.12 | 273,064 | 0.38 |
| | 住宅建設 : 0.12% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 58,362 | Taylor Wimpey PLC Com GBPO.01 | 86,522 | 0.12 |
| | 保険 : 5.99% (31 May 2016: 6.86%) | | |
| 360,876 | Aviva PLC Com GBPO.25 | 1,613,296 | 2.23 |
| 3,517 | Jardine Lloyd Thompson Group PLC Com GBPO.05 | 33,719 | 0.05 |
| 178,634 | Legal & General Group PLC Com GBPO.03 | 421,130 | 0.58 |
| 29,421 | Prudential PLC Com GBPO.05 | 455,364 | 0.63 |
| 109,093 | RSA Insurance Group PLC Com GBPO.01 | 589,920 | 0.81 |
| 429,590 | Saga PLC Com GBPO.01 | 819,443 | 1.13 |
| 41,141 | St James's Place PLC Com GBPO.15 | 386,520 | 0.53 |
| 7,242 | Standard Life PLC Com GBPO.12 | 25,032 | 0.03 |
| | 投資会社 : 0.72% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 284,934 | Melrose Industries PLC Com GBPO.07 | 521,785 | 0.72 |
| | 余暇 : 0.00% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| | 宿泊施設 : 0.30% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| 6,308 | Whitbread PLC Com GBPO.77 | 218,478 | 0.30 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 英国(つづき) : 84.94% (31 May 2016: 84.42%) | | |
| | メディア : 4.05% (31 May 2016: 3.32%) | | |
| 71,788 | Daily Mail & General Trust PLC Class A Com GBPO.13 | 547,563 | 0.76 |
| 82,375 | Informa PLC Com GBPO.001 | 534,820 | 0.74 |
| 179,498 | ITV PLC Com GBPO.10 | 301,646 | 0.42 |
| 63,159 | Johnston Press PLC Com GBPO.01 | 8,684 | 0.01 |
| 179,401 | Pearson PLC Com GBPO.25 | 1,426,687 | 1.97 |
| 13,888 | Sky PLC Com GBPO.50 | 108,500 | 0.15 |
| | 鉱業 : 4.71% (31 May 2016: 3.26%) | | |
| 149,027 | Anglo American PLC Com USD0.55 | 1,766,343 | 2.44 |
| 59,800 | Antofagasta PLC Com GBPO.05 | 412,321 | 0.57 |
| 29,825 | BHP Billiton PLC Com USD0.50 | 391,826 | 0.54 |
| 55,239 | Hochschild Mining PLC Com GBPO.25 | 120,476 | 0.17 |
| 36,361 | KAZ Minerals PLC Com GBPO.20 | 131,518 | 0.18 |
| 30,996 | Lonmin PLC Com USD0.0001 | 46,378 | 0.06 |
| 18,219 | Rio Tinto PLC Com GBPO.10 | 544,703 | 0.75 |
| | 各種製造業 : 1.69% (31 May 2016: 1.36%) | | |
| 81,351 | Morgan Advanced Materials PLC Com GBPO.25 | 229,654 | 0.32 |
| 70,248 | Smiths Group PLC Com GBPO.38 | 990,848 | 1.37 |
| | 石油・ガス : 10.45% (31 May 2016: 8.79%) | | |
| 913,957 | BP PLC Com USD0.25 | 4,199,632 | 5.80 |
| 68,493 | Cairn Energy PLC Com GBPO.01 | 143,390 | 0.20 |
| 36,685 | EnQuest PLC Com GBPO.05 | 10,868 | 0.02 |
| 135,360 | Royal Dutch Shell PLC Class B Com EURO.07 | 2,867,263 | 3.96 |
| 114,156 | Tullow Oil PLC Com GBPO.10 | 339,900 | 0.47 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.58% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| 44,792 | Amec Foster Wheeler PLC Com GBPO.50 | 195,428 | 0.27 |
| 27,601 | John Wood Group PLC Com GBPO.04 | 227,225 | 0.31 |
| | 医薬品 : 4.08% (31 May 2016: 5.45%) | | |
| 22,647 | AstraZeneca PLC Com USD0.25 | 939,681 | 1.30 |
| 134,605 | GlaxoSmithKline PLC Com GBPO.25 | 2,013,691 | 2.78 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 英国(つづき) : 84.94% (31 May 2016: 84.42%) | | |
| | プライベート・エクイティ:0.11% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 11,276 | 3i Group PLC Com GBPO.74 | 77,664 | 0.11 |
| | 小売 : 3.17% (31 May 2016: 3.89%) | | |
| 41,313 | Card Factory PLC Com NPV | 105,080 | 0.15 |
| 24,797 | Conviviality PLC Com GBPO.0002 | 51,113 | 0.07 |
| 297,381 | Debenhams PLC Com GBPO.0001 | 164,675 | 0.23 |
| 1,180 | Dunelm Group PLC Com GBPO.01 | 8,717 | 0.01 |
| 110,000 | Halfords Group PLC Com GBPO.01 | 376,475 | 0.52 |
| 5,961 | Kingfisher PLC Com GBPO.16 | 21,054 | 0.03 |
| 180,546 | Marks & Spencer Group PLC Com GBPO.25 | 593,635 | 0.82 |
| 62,022 | Mitchells & Butlers PLC Com GBPO.09 | 141,131 | 0.19 |
| 4,080 | Next PLC Com GBPO.10 | 200,063 | 0.28 |
| 118,573 | Pets at Home Group Plc Com GBPO.01 | 252,146 | 0.35 |
| 34,299 | Restaurant Group PLC Com GBPO.28 | 111,266 | 0.15 |
| 19,750 | Travis Perkins PLC Com GBPO.10 | 264,848 | 0.37 |
| | 半導体 : 0.18% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 47,489 | Telit Communications PLC Com GBPO.01 | 127,330 | 0.18 |
| | ソフトウェア : 2.98% (31 May 2016: 2.87%) | | |
| 54,549 | Micro Focus International PLC Com GBPO.10 | 1,151,802 | 1.59 |
| 101,089 | Sage Group PLC Com GBPO.01 | 664,155 | 0.92 |
| 80,709 | SDL PLC Com GBPO.01 | 340,390 | 0.47 |
| | 通信 : 4.64% (31 May 2016: 5.57%) | | |
| 12,314 | ARRIS International PLC Com GBPO.0001 | 282,717 | 0.39 |
| 335,562 | BT Group PLC Com GBPO.05 | 1,197,872 | 1.66 |
| 378,893 | Spirent Communications PLC Com GBPO.03 | 305,009 | 0.42 |
| 810,682 | Vodafone Group PLC Com USD0.21 | 1,572,115 | 2.17 |
| | 運輸 : 2.35% (31 May 2016: 3.34%) | | |
| 918,007 | Firstgroup PLC Com GBPO.05 | 934,072 | 1.29 |
| 35,000 | National Express Group PLC Com GBPO.05 | 124,443 | 0.17 |
| 61,892 | Royal Mail PLC Com GBPO.01 | 289,995 | 0.40 |
| 172,972 | Stagecoach Group PLC Com GBPO.005482 | 352,949 | 0.49 |
| | 英国合計 | 61,480,861 | 84.94 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 92.96% (31 May 2016: 99.03%) | | |
| | 米国 : 0.05% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 銀行 : 0.05% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 574 | First Republic Bank/CA Com USD0.01 | 37,624 | 0.05 |
| | 米国合計 | <u>37,624</u> | <u>0.05</u> |
| | 株式合計 | <u>67,288,537</u> | <u>92.96</u> |
| | 投資ファンド : 1.44% (31 May 2016: 1.56%) | | |
| | ルクセンブルグ : 1.44% (31 May 2016: 1.56%) | | |
| 352,989 | Majedie UK Smaller Companies Fund NPV | 1,039,763 | 1.44 |
| | 投資ファンド合計 | <u>1,039,763</u> | <u>1.44</u> |
| | 権利証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | スペイン : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | | 未実現 利益 英ポンド | 純資産 比率(%) |
| 契約数 | 先物契約** : 0.02% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 23 | FTSE 100 Index Future December 2016 | 13,250 | 0.02 |
| | 未決済先物契約に係る評価益合計 | <u>13,250</u> | <u>0.02</u> |
| | 先物契約合計 | <u>13,250</u> | <u>0.02</u> |
| | 先渡為替契約 : -0.09% (31 May 2016: -0.32%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|---------|-----|---------|----------------|-------------------|--------------|
| UBS | USD | 562,720 | GBP | 444,648 | 15/12/2016 | 5,570 | 0.01 |
| UBS | USD | 406,449 | GBP | 321,166 | 15/12/2016 | 4,023 | 0.01 |
| UBS | GBP | 106,319 | EUR | 124,703 | 15/12/2016 | 413 | - |

先渡為替契約：-0.09% (31 May 2016: -0.32%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|-------------------|---------------|
| UBS | GBP | 19,005 | EUR | 22,131 | 15/12/2016 | 210 | - |
| UBS | GBP | 13,168 | EUR | 15,438 | 15/12/2016 | 57 | - |
| UBS | EUR | 153,383 | GBP | 130,259 | 15/12/2016 | 5 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 10,278 | 0.02 |
| UBS | GBP | 5,015 | EUR | 5,917 | 15/12/2016 | (10) | - |
| UBS | EUR | 962 | GBP | 830 | 15/12/2016 | (13) | - |
| UBS | EUR | 59,719 | GBP | 50,742 | 15/12/2016 | (25) | - |
| UBS | EUR | 28,538 | GBP | 24,331 | 15/12/2016 | (95) | - |
| UBS | EUR | 5,343 | GBP | 4,762 | 15/12/2016 | (224) | - |
| UBS | EUR | 754,815 | GBP | 641,355 | 15/12/2016 | (312) | - |
| UBS | EUR | 45,987 | GBP | 39,517 | 15/12/2016 | (461) | - |
| UBS | EUR | 144,350 | GBP | 123,827 | 15/12/2016 | (1,235) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,091,896 | GBP | 936,658 | 15/12/2016 | (9,343) | (0.01) |
| UBS | EUR | 2,494,452 | GBP | 2,139,808 | 15/12/2016 | (21,344) | (0.03) |
| UBS | EUR | 5,137,580 | GBP | 4,407,155 | 15/12/2016 | (43,960) | (0.06) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (77,022) | (0.11) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (66,744) | (0.09) |
| 投資総額 | | | | | | 68,274,806 | 94.33 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 4,270,625 | 5.90 |
| その他の純負債 | | | | | | (166,658) | (0.23) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 72,378,773 | 100.00 |

総資産の分析**総資産
比率(%)**

| | |
|---|--------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 91.75 |
| 投資ファンドおよびAIF | 1.42 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.03 |
| その他の資産 | 6.80 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される82,778英ポンドを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、ゴールドマン・サックスである。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 株式 : 95.50% (31 May 2016: 97.22%) | | |
| | ガンジー : 0.20% (31 May 2016: 0.33%) | | |
| | 商業サービス : 0.20% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 303,269 | iEnergizer Ltd Com GBPO.01 | 248,681 | 0.20 |
| | 不動産投資信託 : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | ガンジー合計 | 248,681 | 0.20 |
| | アイルランド : 0.00% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| | 飲料 : 0.00% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| | ジャージー : 1.05% (31 May 2016: 1.43%) | | |
| | 商業サービス : 1.05% (31 May 2016: 1.43%) | | |
| 37,889 | Cape PLC Com GBPO.25 | 54,181 | 0.04 |
| 179,785 | UBM PLC Com GBPO.1125 | 1,282,317 | 1.01 |
| | ジャージー合計 | 1,336,498 | 1.05 |
| | オランダ : 1.28% (31 May 2016: 1.41%) | | |
| | 飲料 : 1.28% (31 May 2016: 1.41%) | | |
| 28,974 | Heineken Holding NV Com EUR1.60 | 1,630,139 | 1.28 |
| | オランダ合計 | 1,630,139 | 1.28 |
| | 英国 : 91.77% (31 May 2016: 91.95%) | | |
| | 航空・防衛 : 4.65% (31 May 2016: 3.04%) | | |
| 275,200 | BAE Systems PLC Com GBPO.025 | 1,653,264 | 1.30 |
| 422,119 | Chemring Group PLC Com GBPO.01 | 701,245 | 0.55 |
| 1,165,715 | Cobham PLC Com GBPO.025 | 1,916,435 | 1.51 |
| 81,020 | Ultra Electronics Holdings PLC Com GBPO.05 | 1,640,655 | 1.29 |
| | 農業 : 2.31% (31 May 2016: 2.72%) | | |
| 32,569 | British American Tobacco PLC Com GBPO.25 | 1,431,082 | 1.12 |
| 44,211 | Imperial Brands PLC Com GBPO.10 | 1,517,985 | 1.19 |
| | アパレル : 1.54% (31 May 2016: 1.28%) | | |
| 137,109 | Burberry Group PLC Com GBPO.0005 | 1,958,602 | 1.54 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 95.50% (31 May 2016: 97.22%) | | |
| | 英国(つづき) : 91.77% (31 May 2016: 91.95%) | | |
| | 銀行 : 4.38% (31 May 2016: 3.75%) | | |
| 862,264 | Barclays PLC Com GBPO.25^ | 1,862,275 | 1.46 |
| 353,960 | HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 2,247,646 | 1.77 |
| 2,529,063 | Lloyds Banking Group PLC Com GBPO.10 | 1,463,695 | 1.15 |
| | 飲料 : 5.36% (31 May 2016: 5.61%) | | |
| 82,201 | A.G. Barr PLC Com GBPO.04167 | 411,745 | 0.32 |
| 110,779 | Britvic PLC Com GBPO.20 | 633,656 | 0.50 |
| 221,929 | Diageo PLC Com GBPO.2893518 | 4,450,231 | 3.50 |
| 517,326 | Stock Spirits Group PLC Com GBPO.10 | 869,108 | 0.68 |
| 34,167 | Young & Co's Brewery PLC Class A Com GBPO.125 | 453,909 | 0.36 |
| | 化学 : 0.32% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 93,817 | Elementis PLC Com GBPO.05 | 236,653 | 0.19 |
| 41,418 | Essentra PLC Com GBPO.25 | 164,202 | 0.13 |
| | 商業サービス : 11.04% (31 May 2016: 9.03%) | | |
| 211,477 | Aggreko PLC Com GBPO.04832911 | 1,729,353 | 1.36 |
| 102,425 | Ascential PLC Com GBPO.01 | 283,051 | 0.22 |
| 97,602 | De La Rue PLC Com GBPO.4486857 | 560,723 | 0.44 |
| 1,996,418 | Hays PLC Com GBPO.01 | 2,774,023 | 2.18 |
| 298,964 | Mears Group PLC Com GBPO.01 | 1,392,425 | 1.09 |
| 543,277 | Pagegroup PLC Com GBPO.01 | 2,012,298 | 1.58 |
| 553,355 | QinetiQ Group PLC Com GBPO.01 | 1,344,929 | 1.06 |
| 219,780 | RELX PLC Com GBPO.144397 | 3,019,777 | 2.37 |
| 143,857 | Robert Walters PLC Com GBPO.20 | 490,552 | 0.39 |
| 66,650 | Savills PLC Com GBPO.025 | 446,722 | 0.35 |
| | コンピューター : 0.00% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| | 化粧品/パーソナルケア : 2.61% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 103,763 | Unilever PLC Com GBPO.0311 | 3,316,006 | 2.61 |
| | 販売/卸売 : 1.05% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| 280,898 | Headlam Group PLC Com GBPO.05 | 1,333,212 | 1.05 |
| | 各種金融サービス : 11.12% (31 May 2016: 13.15%) | | |
| 195,927 | CMC Markets PLC Com GBPO.25 | 367,461 | 0.29 |
| 199,336 | Hargreaves Lansdown PLC Com GBPO.004 | 2,345,188 | 1.84 |
| 117,347 | London Stock Exchange Group PLC Com GBPO.06918605 | 3,228,803 | 2.54 |
| 483,022 | Man Group PLC Com USD0.03428571 | 547,988 | 0.43 |
| 203,455 | Numis Corp PLC Com GBPO.05 | 461,843 | 0.36 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 95.50% (31 May 2016: 97.22%) | | |
| | 英国(つづき) : 91.77% (31 May 2016: 91.95%) | | |
| | 各種金融サービス(つづき) : 11.12% (31 May 2016: 13.15%) | | |
| 126,363 | Rathbone Brothers PLC Com GBPO.05 | 2,323,184 | 1.83 |
| 96,070 | Schroders PLC Com NON VTG GBP1.00 | 1,964,151 | 1.54 |
| 87,166 | Schroders PLC Com VTG GBP1.00 | 2,409,704 | 1.89 |
| 269,254 | Urban & Civic PLC Com GBPO.20 | 508,217 | 0.40 |
| | 電子 : 4.79% (31 May 2016: 4.39%) | | |
| 110,079 | Acal PLC Com GBPO.05 | 236,670 | 0.19 |
| 311,961 | Electrocomponents PLC Com GBPO.10 | 1,397,117 | 1.10 |
| 719,165 | Rotork PLC Com GBPO.005 | 1,687,880 | 1.33 |
| 100,921 | Spectris PLC Com GBPO.05 | 2,062,321 | 1.62 |
| 508,313 | TT Electronics plc Com GBPO.25 | 698,930 | 0.55 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.30% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 509,336 | Severfield PLC Com GBPO.025 | 381,365 | 0.30 |
| | 食品 : 2.63% (31 May 2016: 6.39%) | | |
| 232,200 | Tesco PLC Com GBPO.05 | 484,776 | 0.38 |
| 1,314,167 | Wm Morrison Supermarkets PLC Com GBPO.10 | 2,860,284 | 2.25 |
| | 林産品・紙製品 : 0.47% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 151,518 | DS Smith PLC Com GBPO.10 | 595,238 | 0.47 |
| | ガス : 0.00% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| | 各種持株会社 : 1.46% (31 May 2016: 1.73%) | | |
| 901,713 | Mitie Group PLC Com GBPO.025 | 1,853,471 | 1.46 |
| | 家庭用品・雑貨 : 1.12% (31 May 2016: 1.21%) | | |
| 384,918 | McBride PLC Com GBPO.10 | 668,314 | 0.52 |
| 11,320 | Reckitt Benckiser Group PLC Com GBPO.10 | 765,345 | 0.60 |
| | 保険 : 1.64% (31 May 2016: 1.76%) | | |
| 343,351 | Aviva PLC Com GBPO.25 | 1,534,951 | 1.21 |
| 288,862 | Saga PLC Com GBPO.01 | 551,004 | 0.43 |
| | メディア : 8.27% (31 May 2016: 8.08%) | | |
| 512,041 | Daily Mail & General Trust PLC Class A Com GBPO.125 | 3,905,593 | 3.07 |
| 218,453 | Euromoney Institutional Investor PLC Com GBPO.0025 | 2,337,447 | 1.84 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|--------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 95.50% (31 May 2016: 97.22%) | | |
| | 英国(つづき) : 91.77% (31 May 2016: 91.95%) | | |
| | メディア(つづき) : 8.27% (31 May 2016: 8.08%) | | |
| 477,033 | Pearson PLC Com GBPO.25 | 3,793,605 | 2.98 |
| 62,395 | Sky PLC Com GBPO.50 | 487,461 | 0.38 |
| | 鉱業 : 3.83% (31 May 2016: 3.46%) | | |
| 48,748 | Acacia Mining PLC Com GBPO.10 | 193,554 | 0.15 |
| 99,460 | Anglo American PLC Com USD0.54945 | 1,178,850 | 0.93 |
| 116,969 | Rio Tinto PLC Com GBPO.10 | 3,497,081 | 2.75 |
| | 各種製造業 : 5.46% (31 May 2016: 4.37%) | | |
| 420,256 | Fenner PLC Com GBPO.25 | 1,027,001 | 0.81 |
| 229,124 | IMI PLC Com GBPO.2857 | 2,221,930 | 1.74 |
| 205,849 | Senior PLC Com GBPO.10 | 379,894 | 0.30 |
| 187,574 | Smiths Group PLC Com GBPO.375 | 2,645,731 | 2.08 |
| 107,370 | Vitec Group PLC Com GBPO.20 | 679,115 | 0.53 |
| | 石油・ガス : 3.34% (31 May 2016: 4.22%) | | |
| 450,528 | BP PLC Com USD0.25 | 2,070,176 | 1.63 |
| 102,855 | Royal Dutch Shell PLC Class B Com EURO.07 | 2,178,726 | 1.71 |
| | 医薬品 : 4.51% (31 May 2016: 4.91%) | | |
| 60,650 | AstraZeneca PLC Com USD0.25 | 2,516,520 | 1.98 |
| 215,537 | GlaxoSmithKline PLC Com GBPO.25 | 3,224,434 | 2.53 |
| | プライベート・エクイティ : 1.17% (31 May 2016: 1.34%) | | |
| 216,418 | 3i Group PLC Com GBPO.738636 | 1,490,579 | 1.17 |
| | 不動産投資信託 : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 55,941 | NewRiver REIT PLC NPV | 187,193 | 0.14 |
| | 小売 : 1.73% (31 May 2016: 1.56%) | | |
| 45,323 | Greene King PLC Com GBPO.125 | 311,256 | 0.24 |
| 126,552 | Majestic Wine PLC Com GBPO.075 | 380,922 | 0.30 |
| 169,714 | Restaurant Group PLC Com GBPO.28125 | 550,552 | 0.43 |
| 72,144 | Travis Perkins PLC Com GBPO.10 | 967,451 | 0.76 |
| | 半導体 : 0.48% (31 May 2016: 0.41%) | | |
| 238,295 | E2V technologies PLC Com GBPO.05 | 418,506 | 0.33 |
| 86,648 | Imagination Technologies Group PLC Com GBPO.10 | 194,741 | 0.15 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|---------|--|--------------------|---------------|
| | 株式(つづき) : 95.50% (31 May 2016: 97.22%) | | |
| | 英国(つづき) : 91.77% (31 May 2016: 91.95%) | | |
| | ソフトウェア : 3.41% (31 May 2016: 3.67%) | | |
| 54,467 | Fidessa Group PLC Com GBPO.10 | 1,231,227 | 0.96 |
| 381,463 | Sage Group PLC Com GBPO.01051948 | 2,506,212 | 1.97 |
| 144,672 | SDL PLC Com GBPO.01 | 610,154 | 0.48 |
| | 通信 : 1.02% (31 May 2016: 1.37%) | | |
| 671,228 | Vodafone Group PLC Com USD0.2095 | 1,301,679 | 1.02 |
| | 運輸 : 1.62% (31 May 2016: 1.74%) | | |
| 58,701 | Clarkson PLC Com GBPO.25 | 1,243,287 | 0.97 |
| 231,640 | National Express Group PLC Com GBPO.05 | 823,596 | 0.65 |
| | 英国合計 | 116,804,137 | 91.77 |
| | 米国 : 1.20% (31 May 2016: 1.51%) | | |
| | 食品 : 1.20% (31 May 2016: 1.51%) | | |
| 46,517 | Mondelez International Inc Class A Com NPV | 1,535,611 | 1.20 |
| | 米国合計 | 1,535,611 | 1.20 |
| | 株式合計 | 121,555,066 | 95.50 |
| | | 未実現 損失 英ポンド | 純資産 比率(%) |
| 契約数 | 先物契約** : -0.07% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 46 | FTSE 100 Index Future December 2016 | (92,510) | (0.07) |
| | 先物契約合計 | (92,510) | (0.07) |
| | 先渡為替契約 : -0.03% (31 May 2016: -0.28%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|-------------------|--------------|
| UBS | USD | 4,005,119 | GBP | 3,164,753 | 15/12/2016 | 39,644 | 0.03 |
| UBS | USD | 3,531,473 | GBP | 2,790,488 | 15/12/2016 | 34,956 | 0.03 |
| UBS | USD | 1,101,581 | GBP | 870,444 | 15/12/2016 | 10,904 | 0.01 |
| UBS | USD | 706,452 | GBP | 558,222 | 15/12/2016 | 6,993 | 0.01 |
| UBS | GBP | 84,378 | EUR | 97,962 | 15/12/2016 | 1,182 | - |
| UBS | GBP | 14,262 | EUR | 16,357 | 15/12/2016 | 371 | - |
| UBS | GBP | 65,738 | USD | 81,843 | 15/12/2016 | 257 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.03% (31 May 2016: -0.28%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|-------------------|---------------|
| UBS | GBP | 55,365 | EUR | 64,908 | 15/12/2016 | 240 | - |
| UBS | GBP | 55,591 | USD | 69,210 | 15/12/2016 | 217 | - |
| UBS | GBP | 12,792 | EUR | 14,825 | 15/12/2016 | 202 | - |
| UBS | GBP | 9,419 | EUR | 10,870 | 15/12/2016 | 187 | - |
| UBS | GBP | 3,322 | EUR | 3,774 | 15/12/2016 | 117 | - |
| UBS | GBP | 2,976 | EUR | 3,381 | 15/12/2016 | 105 | - |
| UBS | GBP | 4,523 | EUR | 5,220 | 15/12/2016 | 90 | - |
| UBS | USD | 116,515 | GBP | 93,146 | 15/12/2016 | 74 | - |
| UBS | GBP | 981 | EUR | 1,101 | 15/12/2016 | 46 | - |
| UBS | GBP | 8,632 | USD | 10,750 | 15/12/2016 | 31 | - |
| UBS | GBP | 999 | EUR | 1,162 | 15/12/2016 | 12 | - |
| UBS | GBP | 3,002 | USD | 3,738 | 15/12/2016 | 11 | - |
| UBS | GBP | 855 | EUR | 995 | 15/12/2016 | 11 | - |
| UBS | GBP | 494 | EUR | 574 | 15/12/2016 | 7 | - |
| UBS | GBP | 548 | EUR | 638 | 15/12/2016 | 6 | - |
| UBS | GBP | 1,064 | EUR | 1,250 | 15/12/2016 | 3 | - |
| UBS | GBP | 930 | EUR | 1,092 | 15/12/2016 | 3 | - |
| UBS | EUR | 7,673 | GBP | 6,516 | 15/12/2016 | - | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 95,669 | 0.08 |
| UBS | GBP | 1,428 | EUR | 1,682 | 15/12/2016 | - | - |
| UBS | EUR | 257 | GBP | 222 | 15/12/2016 | (3) | - |
| UBS | USD | 10,703 | GBP | 8,570 | 15/12/2016 | (7) | - |
| UBS | GBP | 4,287 | EUR | 5,058 | 15/12/2016 | (8) | - |
| UBS | EUR | 26,455 | GBP | 22,479 | 15/12/2016 | (10) | - |
| UBS | GBP | 18,115 | EUR | 21,370 | 15/12/2016 | (35) | - |
| UBS | EUR | 15,000 | GBP | 12,789 | 15/12/2016 | (50) | - |
| UBS | EUR | 2,383 | GBP | 2,077 | 15/12/2016 | (54) | - |
| UBS | EUR | 6,416 | GBP | 5,509 | 15/12/2016 | (61) | - |
| UBS | EUR | 8,557 | GBP | 7,349 | 15/12/2016 | (81) | - |
| UBS | EUR | 42,985 | GBP | 36,616 | 15/12/2016 | (111) | - |
| UBS | EUR | 36,246 | GBP | 30,904 | 15/12/2016 | (121) | - |
| UBS | EUR | 9,471 | GBP | 8,172 | 15/12/2016 | (129) | - |
| UBS | EUR | 53,943 | GBP | 45,958 | 15/12/2016 | (146) | - |
| UBS | EUR | 125,508 | GBP | 106,930 | 15/12/2016 | (339) | - |
| UBS | EUR | 14,479 | GBP | 12,903 | 15/12/2016 | (607) | - |
| UBS | EUR | 115,142 | GBP | 98,772 | 15/12/2016 | (985) | - |
| UBS | EUR | 391,342 | GBP | 335,704 | 15/12/2016 | (3,349) | - |
| UBS | EUR | 1,347,034 | GBP | 1,155,522 | 15/12/2016 | (11,526) | (0.01) |
| UBS | EUR | 5,842,285 | GBP | 5,011,670 | 15/12/2016 | (49,990) | (0.04) |
| UBS | EUR | 8,196,476 | GBP | 7,031,159 | 15/12/2016 | (70,133) | (0.06) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (137,745) | (0.11) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (42,076) | (0.03) |

| | 公正価値 英ポンド | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 121,420,480 | 95.40 |
| 現金および現金同等物 [*] | 4,919,547 | 3.87 |
| その他の純資産 | 929,530 | 0.73 |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>127,269,557</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 94.33 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.07 |
| その他の資産 | 5.60 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される642,960英ポンドを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、ゴールドマン・サックスである。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券 : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | オーストラリア : 1.39% (31 May 2016: 1.17%) | | |
| | 社債 : 0.10% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 200,000 | Westpac Banking Corp 2.25% 09/11/2020 | 200,200 | 0.10 |
| | 国債 : 1.29% (31 May 2016: 1.06%) | | |
| 270,000 | Australia Government Bond 3.75% 21/04/2037 | 210,769 | 0.10 |
| 2,840,000 | Australia Government Bond 5.75% 15/07/2022 | 2,484,574 | 1.19 |
| | オーストラリア合計 | 2,895,543 | 1.39 |
| | オーストリア : 0.41% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| | 国債 : 0.41% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 106,000 | Austria Government Bond 1.5% 02/11/2086 | 102,481 | 0.05 |
| 130,000 | Austria Government Bond 3.15% 20/06/2044 | 199,061 | 0.10 |
| 430,000 | Austria Government Bond 3.4% 22/11/2022 | 552,577 | 0.26 |
| | オーストリア合計 | 854,119 | 0.41 |
| | ベルギー : 1.14% (31 May 2016: 1.09%) | | |
| | 国債 : 1.14% (31 May 2016: 1.09%) | | |
| 300,000 | Belgium Government Bond 1.25% 22/06/2018 | 327,829 | 0.16 |
| 120,000 | Belgium Government Bond 2.15% 22/06/2066 | 141,281 | 0.07 |
| 700,000 | Belgium Government Bond 2.875% 18/09/2024 | 716,497 | 0.34 |
| 70,000 | Belgium Government Bond 3% 28/09/2019 | 81,755 | 0.04 |
| 150,000 | Belgium Government Bond 3.75% 22/06/2045 | 245,108 | 0.12 |
| 530,000 | Belgium Government Bond 5.5% 28/03/2028 | 857,729 | 0.41 |
| | ベルギー合計 | 2,370,199 | 1.14 |
| | カナダ : 2.37% (31 May 2016: 3.64%) | | |
| | 社債 : 0.53% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| 300,000 | Royal Bank of Canada 2.3% 22/03/2021 | 300,005 | 0.14 |
| 600,000 | Toronto-Dominion Bank 2.25% 15/03/2021 | 599,112 | 0.29 |
| 200,000 | Toronto-Dominion Bank FRN 13/07/2021 | 202,136 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | カナダ(つづき) : 2.37% (31 May 2016: 3.64%) | | |
| | 国債 : 0.81% (31 May 2016: 3.10%) | | |
| 800,000 | Canadian Government Bond 1.25% 01/02/2018 | 599,259 | 0.29 |
| 1,060,000 | Canadian Government Bond 2.75% 01/06/2022 | 856,877 | 0.41 |
| 240,000 | Canadian Government Bond 3.5% 01/12/2045 | 229,280 | 0.11 |
| | 州債 : 1.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 500,000 | Province of Alberta Canada 2.35% 01/06/2025 | 371,304 | 0.18 |
| 1,200,000 | Province of Ontario Canada 2.85% 02/06/2023 | 940,776 | 0.45 |
| 700,000 | Province of Quebec Canada 2.375% 22/01/2024 | 848,766 | 0.40 |
| | カナダ合計 | 4,947,515 | 2.37 |
| | チェコ共和国 : 0.00% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| | デンマーク : 1.98% (31 May 2016: 0.96%) | | |
| | 社債 : 1.80% (31 May 2016: 0.78%) | | |
| 3,100,000 | BRFkredit A/S 2% 01/10/2047 | 427,081 | 0.20 |
| 3,654,171 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2.5% 01/10/2047 | 520,231 | 0.25 |
| 1,563,140 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 3% 01/10/2047 | 228,779 | 0.11 |
| 1 | Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2037 | - | - |
| 4,699,774 | Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2047 | 635,249 | 0.30 |
| 1,064,503 | Nykredit Realkredit BDS 2.5% 01/10/2047 | 151,815 | 0.07 |
| 3,186,092 | Nykredit Realkredit NTS A/S 2.5% 01/10/2047 | 449,163 | 0.21 |
| - | Realkredit Danmark A/S 2% 01/10/2037 | - | - |
| 7,269,155 | Realkredit Danmark A/S 2% 01/10/2047 [†] | 999,125 | 0.48 |
| 1 | Realkredit Danmark A/S 2.5% 01/10/2037 | - | - |
| 2,623,781 | Realkredit Danmark A/S 2.5% 01/10/2047 | 373,538 | 0.18 |
| | 国債 : 0.18% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 690,000 | Denmark Government Bond 4% 15/11/2019 | 111,620 | 0.05 |
| 480,000 | Denmark Government Bond 4.5% 15/11/2039 | 119,128 | 0.06 |
| 620,000 | Denmark Government Bond 7% 10/11/2024 | 136,702 | 0.07 |
| | デンマーク合計 | 4,152,431 | 1.98 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | フィンランド : 0.18% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| | 国債 : 0.18% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 290,000 | Finland Government Bond 0.375% 15/09/2020 | 317,540 | 0.15 |
| 40,000 | Finland Government Bond 2.625% 04/07/2042 | 57,711 | 0.03 |
| | フィンランド合計 | 375,251 | 0.18 |
| | フランス : 3.88% (31 May 2016: 6.28%) | | |
| | 社債 : 1.80% (31 May 2016: 1.92%) | | |
| 300,000 | Air Liquide Finance SA 2.25% 27/09/2023 | 287,486 | 0.14 |
| 900,000 | Dexia Credit Local SA 1.875% 15/09/2021 | 870,068 | 0.42 |
| 2,000,000 | Dexia Credit Local SA/New York NY 1.875% 29/01/2020 | 1,977,959 | 0.95 |
| 600,000 | Electricite de France SA 3.625% 13/10/2025 | 602,185 | 0.29 |
| | 国債 : 2.08% (31 May 2016: 4.36%) | | |
| 3,000,000 | France Government Bond OAT 0.5% 25/05/2025 | 3,188,959 | 1.52 |
| 120,000 | France Government Bond OAT 1.75% 25/05/2066 | 123,585 | 0.06 |
| 390,000 | France Government Bond OAT 3.25% 25/05/2045 | 572,826 | 0.27 |
| 290,000 | France Government Bond OAT 4.75% 25/04/2035 | 486,029 | 0.23 |
| | フランス合計 | 8,109,097 | 3.88 |
| | ドイツ : 4.71% (31 May 2016: 3.53%) | | |
| | 国債 : 4.71% (31 May 2016: 3.53%) | | |
| 370,000 | Deutschland Bundesrepublik 2.5% 04/01/2021 | 442,450 | 0.21 |
| 620,000 | Deutschland Bundesrepublik 6.25% 04/01/2030 | 1,144,796 | 0.55 |
| 7,140,000 | Deutschland Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.75% 15/04/2018 [†] | 8,264,416 | 3.95 |
| | ドイツ合計 | 9,851,662 | 4.71 |
| | アイルランド : 0.52% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| | 社債 : 0.15% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 300,000 | GE Capital International Funding Co Unlimited Co 3.373% 15/11/2025 | 303,986 | 0.15 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------------|--|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | アイルランド(つづき) : 0.52% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| | 国債 : 0.37% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 400,000 | Ireland Government Bond 1% 15/05/2026 | 429,463 | 0.21 |
| 10,000 | Ireland Government Bond 2% 18/02/2045 | 11,170 | - |
| 230,000 | Ireland Government Bond 5.4% 13/03/2025 | 336,676 | 0.16 |
| | アイルランド合計 | 1,081,295 | 0.52 |
| | イタリア : 4.48% (31 May 2016: 4.88%) | | |
| | 国債 : 4.48% (31 May 2016: 4.88%) | | |
| 900,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 01/06/2021 | 941,031 | 0.45 |
| 1,130,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.5% 01/12/2024 | 1,271,342 | 0.61 |
| 400,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.7% 01/03/2047 | 397,841 | 0.19 |
| 390,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.8% 01/03/2067 | 359,027 | 0.17 |
| 2,060,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.25% 01/09/2019 | 2,415,073 | 1.16 |
| 320,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 01/09/2044 | 448,846 | 0.21 |
| 600,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5% 01/03/2025 | 796,934 | 0.38 |
| 400,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5% 01/09/2040 | 572,628 | 0.27 |
| 980,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.25% 01/11/2029 | 1,391,191 | 0.67 |
| 500,000 | Italy Government International Bond 6% 04/08/2028 | 766,940 | 0.37 |
| | イタリア合計 | 9,360,853 | 4.48 |
| | 日本 : 13.43% (31 May 2016: 9.89%) | | |
| | 社債 : 0.81% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 600,000 | 中日本高速道路 2.091% 14/09/2021 | 584,924 | 0.28 |
| 500,000 | 中日本高速道路 2.293% 23/04/2021 | 492,333 | 0.24 |
| 600,000 | 三井住友フィナンシャルグループ FRN 09/03/2021 | 616,210 | 0.29 |
| | 国債 : 12.53% (31 May 2016: 9.49%) | | |
| 1,200,000 | 日本政策投資銀行 2% 19/10/2021 | 1,165,727 | 0.56 |
| 230,000,000 | 国庫短期証券 0% 05/12/2016 | 2,018,498 | 0.97 |
| 2,090,000,000 | 国庫短期証券 0% 12/12/2016 | 18,342,008 | 8.77 |
| 300,000,000 | 国庫短期証券 0% 16/01/2017 | 2,633,531 | 1.26 |
| 230,000,000 | 国庫短期証券 0% 06/03/2017 | 2,019,973 | 0.97 |
| | 地方債 : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 200,000 | 東京都債 2% 17/05/2021 | 196,360 | 0.09 |
| | 日本合計 | 28,069,564 | 13.43 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | メキシコ : 0.55% (31 May 2016: 0.95%) | | |
| | 国債 : 0.55% (31 May 2016: 0.95%) | | |
| 18,530,000 | Mexican Bonos 10% 05/12/2024 | 1,058,732 | 0.51 |
| 100,000 | Mexico Government International Bond 4% 15/03/2115 | 90,619 | 0.04 |
| | メキシコ合計 | 1,149,351 | 0.55 |
| | オランダ : 1.08% (31 May 2016: 0.94%) | | |
| | 社債 : 0.56% (31 May 2016: 0.33%) | | |
| 500,000 | Bank Nederlandse Gemeenten NV 4.55% 15/02/2019 [†] | 396,099 | 0.19 |
| 500,000 | Cooperatieve Rabobank UA 3.875% 08/02/2022 | 529,109 | 0.25 |
| 250,000 | ING Bank NV 2.625% 05/12/2022 | 248,949 | 0.12 |
| | 国債 : 0.52% (31 May 2016: 0.61%) | | |
| 710,000 | Netherlands Government Bond 1.75% 15/07/2023 | 845,633 | 0.40 |
| 160,000 | Netherlands Government Bond 2.75% 15/01/2047 | 246,079 | 0.12 |
| | オランダ合計 | 2,265,869 | 1.08 |
| | ニュージーランド : 0.55% (31 May 2016: 1.15%) | | |
| | 国債 : 0.55% (31 May 2016: 1.15%) | | |
| 1,275,000 | New Zealand Government Bond 6% 15/12/2017 | 941,776 | 0.45 |
| 250,000 | New Zealand Government Bond 6% 15/05/2021 | 203,332 | 0.10 |
| | ニュージーランド合計 | 1,145,108 | 0.55 |
| | ノルウェー : 1.12% (31 May 2016: 1.30%) | | |
| | 国債 : 1.12% (31 May 2016: 1.30%) | | |
| 8,000,000 | Norway Government Bond 1.75% 13/03/2025 | 952,315 | 0.46 |
| 1,050,000 | Norway Government Bond 2% 24/05/2023 | 128,204 | 0.06 |
| 9,500,000 | Norway Government Bond 3.75% 25/05/2021 | 1,244,586 | 0.60 |
| | ノルウェー合計 | 2,325,105 | 1.12 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | ポーランド : 0.11% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 国債 : 0.11% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 1,000,000 | Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025 | 233,039 | 0.11 |
| | ポーランド合計 | 233,039 | 0.11 |
| | サウジアラビア : 0.37% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.37% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 800,000 | Saudi Government International Bond 2.375% 26/10/2021 | 780,256 | 0.37 |
| | サウジアラビア合計 | 780,256 | 0.37 |
| | シンガポール : 0.17% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| | 国債 : 0.17% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 160,000 | Singapore Government Bond 2.875% 01/07/2029 | 115,331 | 0.06 |
| 310,000 | Singapore Government Bond 4% 01/09/2018 | 227,296 | 0.11 |
| | シンガポール合計 | 342,627 | 0.17 |
| | スロバキア : 0.33% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| | 国債 : 0.33% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 550,000 | Slovakia Government Bond 3% 28/02/2023 | 697,194 | 0.33 |
| | スロバキア合計 | 697,194 | 0.33 |
| | スロベニア : 1.09% (31 May 2016: 1.21%) | | |
| | 国債 : 1.09% (31 May 2016: 1.21%) | | |
| 1,150,000 | Slovenia Government International Bond 4.125% 18/02/2019 | 1,197,569 | 0.57 |
| 950,000 | Slovenia Government International Bond 5.85% 10/05/2023 | 1,083,136 | 0.52 |
| | スロベニア合計 | 2,280,705 | 1.09 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | 南アフリカ : 0.50% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| | 国債 : 0.50% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 1,320,000 | South Africa Government Bond 6.25% 31/03/2036 | 66,491 | 0.03 |
| 11,420,000 | South Africa Government Bond 6.75% 31/03/2021 | 765,092 | 0.37 |
| 570,000 | South Africa Government Bond 7.25% 15/01/2020 | 39,531 | 0.02 |
| 220,000 | South Africa Government Bond 8% 21/12/2018 | 15,683 | 0.01 |
| 1,020,000 | South Africa Government Bond 8.75% 31/01/2044 | 65,723 | 0.03 |
| 1,160,000 | South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026 | 90,684 | 0.04 |
| | 南アフリカ合計 | 1,043,204 | 0.50 |
| | スペイン : 3.02% (31 May 2016: 3.60%) | | |
| | 国債 : 3.02% (31 May 2016: 3.60%) | | |
| 500,000 | Spain Government Bond 1.3% 31/10/2026 | 518,930 | 0.25 |
| 800,000 | Spain Government Bond 1.95% 30/04/2026 | 882,342 | 0.42 |
| 1,600,000 | Spain Government Bond 2.15% 31/10/2025 | 1,797,221 | 0.86 |
| 600,000 | Spain Government Bond 2.9% 31/10/2046 | 657,374 | 0.31 |
| 150,000 | Spain Government Bond 3.45% 30/07/2066 | 170,724 | 0.08 |
| 930,000 | Spain Government Bond 4.3% 31/10/2019 | 1,103,972 | 0.53 |
| 140,000 | Spain Government Bond 5.75% 30/07/2032 | 222,453 | 0.11 |
| 710,000 | Spain Government Bond 5.85% 31/01/2022 | 953,187 | 0.46 |
| | スペイン合計 | 6,306,203 | 3.02 |
| | 国際機関 : 0.08% (31 May 2016: 0.75%) | | |
| | 国債 : 0.08% (31 May 2016: 0.75%) | | |
| 200,000 | European Investment Bank 6% 06/08/2020 | 164,902 | 0.08 |
| | 国際機関合計 | 164,902 | 0.08 |
| | スウェーデン : 0.26% (31 May 2016: 1.86%) | | |
| | 社債 : 0.14% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 300,000 | Svenska Handelsbanken AB 2.4% 01/10/2020 | 299,417 | 0.14 |
| | 国債 : 0.12% (31 May 2016: 1.75%) | | |
| 2,190,000 | Sweden Government Bond 1.5% 13/11/2023 | 260,717 | 0.12 |
| | スウェーデン合計 | 560,134 | 0.26 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | スイス : 0.54% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| | 社債 : 0.33% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 200,000 | Credit Suisse Group FRN 12/09/2017 | 200,000 | 0.09 |
| 500,000 | Credit Suisse AG/New York NY 3.625% 09/09/2024 | 503,278 | 0.24 |
| | 国債 : 0.21% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 390,000 | Swiss Confederation Government Bond 1.5% 24/07/2025 | 441,619 | 0.21 |
| | スイス合計 | 1,144,897 | 0.54 |
| | トルコ : 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 英国 : 6.35% (31 May 2016: 5.44%) | | |
| | 社債 : 0.74% (31 May 2016: 1.36%) | | |
| 300,000 | HSBC Holdings PLC 4.3% 08/03/2026 | 308,552 | 0.15 |
| 400,000 | Lloyds Bank Plc 4.875% 30/03/2027 | 618,659 | 0.30 |
| 600,000 | Santander UK PLC FRN 14/03/2019 | 608,379 | 0.29 |
| | 国債 : 5.61% (31 May 2016: 4.08%) | | |
| 1,110,000 | United Kingdom Gilt 1.25% 22/07/2018 | 1,412,629 | 0.67 |
| 1,100,000 | United Kingdom Gilt 1.5% 22/01/2021 | 1,426,702 | 0.68 |
| 700,000 | United Kingdom Gilt 2% 22/07/2020 | 923,556 | 0.44 |
| 700,000 | United Kingdom Gilt 2.75% 07/09/2024 | 980,142 | 0.47 |
| 1,000,000 | United Kingdom Gilt 3.25% 22/01/2044 | 1,565,873 | 0.75 |
| 1,745,000 | United Kingdom Gilt 3.5% 22/01/2045 | 2,863,261 | 1.37 |
| 940,000 | United Kingdom Gilt 3.75% 07/09/2021 | 1,348,018 | 0.64 |
| 720,000 | United Kingdom Gilt 4.25% 07/03/2036 | 1,233,937 | 0.59 |
| | 英国合計 | 13,289,708 | 6.35 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | 米国 : 34.16% (31 May 2016: 28.78%) | | |
| | 社債 : 2.20% (31 May 2016: 2.61%) | | |
| 300,000 | American Express Credit Corp 2.375% 26/05/2020 | 300,519 | 0.14 |
| 300,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.65% 01/02/2021 | 301,331 | 0.14 |
| 200,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.65% 01/02/2026 | 201,944 | 0.10 |
| 100,000 | Bank of New York Mellon Corp 2.6% 17/08/2020 | 100,932 | 0.05 |
| 400,000 | Florida Power & Light Co 3.25% 01/06/2024 | 410,051 | 0.20 |
| 400,000 | Massachusetts Institute of Technology 5.6% 01/07/2111 | 491,860 | 0.24 |
| 500,000 | Metropolitan Life Global Funding I 2% 14/04/2020 | 494,019 | 0.24 |
| 200,000 | Microsoft Corp 2.4% 08/08/2026 | 190,154 | 0.09 |
| 200,000 | Microsoft Corp 3.7% 08/08/2046 | 186,628 | 0.09 |
| 300,000 | MUFG Americas Holdings Corp 3% 10/02/2025 | 289,728 | 0.14 |
| 400,000 | Roche Holdings Inc 2.625% 15/05/2026 | 384,486 | 0.18 |
| 500,000 | UnitedHealth Group Inc 3.75% 15/07/2025 | 520,035 | 0.25 |
| 700,000 | Wells Fargo & Co 3.55% 29/09/2025 | 702,460 | 0.34 |
| | FGLMC 担保証券 : 0.52% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 1,000,000 | Freddie Mac Gold Pool 3% 15/12/2046 | 995,625 | 0.48 |
| 66,018 | Freddie Mac Gold Pool 6% 01/01/2036 | 75,670 | 0.04 |
| | FNMA 担保証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | 国債 : 31.21% (31 May 2016: 25.57%) | | |
| 11,000,000 | United States Treasury Bill 0% 22/12/2016 | 10,998,471 | 5.26 |
| 12,000,000 | United States Treasury Bill 0% 02/02/2017 | 11,991,258 | 5.74 |
| 16,200,000 | United States Treasury Bill 0% 16/02/2017 | 16,184,707 | 7.74 |
| 7,200,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2021 | 7,375,458 | 3.53 |
| 300,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/07/2024 | 300,455 | 0.14 |
| 510,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/07/2026 | 499,648 | 0.24 |
| 2,200,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/01/2025 | 2,211,941 | 1.06 |
| 300,000 | United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/08/2026 | 277,090 | 0.13 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|---|--------------------|---------------|
| | 債券(つづき) : 84.77% (31 May 2016: 80.54%) | | |
| | 米国(つづき) : 34.16% (31 May 2016: 28.78%) | | |
| | 国債(つづき) : 31.21% (31 May 2016: 25.57%) | | |
| 1,890,000 | United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/11/2022 | 1,843,083 | 0.88 |
| 1,830,000 | United States Treasury Note/Bond 1.875% 31/08/2022 | 1,813,916 | 0.87 |
| 1,300,000 | United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/02/2045 | 1,167,817 | 0.56 |
| 875,000 | United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/02/2046 | 783,450 | 0.37 |
| 3,050,000 | United States Treasury Note/Bond 3.125% 15/05/2019 | 3,187,191 | 1.52 |
| 2,300,000 | United States Treasury Note/Bond 3.125% 15/08/2044 | 2,349,145 | 1.12 |
| 3,410,000 | United States Treasury Note/Bond 6.25% 15/08/2023 | 4,291,538 | 2.05 |
| | 地方債 : 0.23% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 200,000 | American Municipal Power Inc 7.334% 15/02/2028 [†] | 258,346 | 0.12 |
| 200,000 | Port Authority of New York & New Jersey 5.647% 01/11/2040 [†] | 242,136 | 0.11 |
| | 米国合計 | 71,421,092 | 34.16 |
| | 債券合計 | 177,216,923 | 84.77 |
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る 未収収益 : 0.43% (31 May 2016: 0.48%) | 908,678 | 0.43 |
| | 投資信託 : 1.28% (31 May 2016: 1.44%) | | |
| | ルクセンブルグ : 1.28% (31 May 2016: 1.44%) | | |
| 1,961 | Pioneer Institutional Funds - Currency High Alpha [†] | 2,680,354 | 1.28 |
| | 投資信託合計 | 2,680,354 | 1.28 |
| | TBA売却契約 : -2.56% (31 May 2016: -1.94%) | | |
| | 米国 : -2.56% (31 May 2016: -1.94%) | | |
| | FNMA 担保証券 : -2.56% (31 May 2016: -1.94%) | | |
| (1,000,000) | Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | (1,053,516) | (0.50) |
| (4,000,000) | Fannie Mae Pool 4.50% 15/12/2046 | (4,315,548) | (2.06) |
| | 米国合計 | (5,369,064) | (2.56) |
| | TBA売却契約合計 | (5,369,064) | (2.56) |

| 契約数 | 先物契約** :-0.06% (31 May 2016: 0.01%) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------|---|------------------|---------------|
| (5) | Euro-BUXL 30 Yr Bond EUX Future December 2016 | 63,458 | 0.03 |
| (76) | Euro-Bund EUX Future December 2016 | 40,119 | 0.02 |
| (15) | US 2 Year Note CBT Future March 2017 | 4,922 | - |
| 27 | Euro-Bund EUX Future March 2017 | 4,296 | - |
| (11) | Canada 10 Yr MSE Future March 2017 | 1,242 | - |
| 未決済先物契約に係る評価益合計 | | 114,037 | 0.05 |
| 37 | Euro-BTP EUX Future December 2016 | (63,755) | (0.03) |
| 7 | Korea 10 Yr Bond KFE Future December 2016 | (36,885) | (0.02) |
| 15 | US Long Bond CBT Future march 2017 | (20,742) | (0.01) |
| 92 | Euro-BOBL EUX Future March 2017 | (18,999) | (0.01) |
| 40 | Australia 3 Yr SFE Future December 2016 | (16,206) | (0.01) |
| 14 | Korea 3 Yr Bond KFE Future December 2016 | (15,927) | (0.01) |
| (48) | Euro-SCHATZ EUX Future December 2016 | (12,475) | (0.01) |
| 48 | US 5 Year Note CBT Future March 2017 | (11,468) | (0.01) |
| 23 | Euro-OAT EUX Future December 2016 | (11,340) | - |
| 81 | US 10 Year Note CBT Future March 2017 | (9,999) | - |
| (5) | Long Gilt ICE Future March 2017 | (4,623) | - |
| (3) | Japan 10 Yr Bond OSE Future December 2016 | (1,316) | - |
| (13) | Australia 10 Yr SFE Future December 2016 | (974) | - |
| 1 | US Ultra CBT Future March 2017 | (289) | - |
| 未決済先物契約に係る評価損合計 | | (224,998) | (0.11) |
| 先物契約合計 | | (110,961) | (0.06) |

先渡為替契約 : 1.34% (31 May 2016: 1.07%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------|-----|------------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| ANZ | USD | 1,967,667 | AUD | 2,586,938 | 02/12/2016 | 56,307 | 0.03 |
| Bank of America | USD | 11,039,860 | EUR | 10,000,000 | 19/01/2017 | 405,153 | 0.19 |
| Merill Lynch | USD | 1,980,123 | DKK | 13,100,000 | 03/01/2017 | 108,889 | 0.05 |
| Bank of America | USD | 679,689 | MXN | 12,962,278 | 19/01/2017 | 50,118 | 0.02 |
| Merill Lynch | USD | 487,174 | MXN | 9,347,892 | 13/02/2017 | 34,573 | 0.02 |
| Bank of America | USD | 622,251 | EUR | 555,100 | 19/01/2017 | 31,918 | 0.02 |
| Merill Lynch | USD | 608,281 | EUR | 550,000 | 19/01/2017 | 23,372 | 0.01 |

先渡為替契約(つづき) : 1.34% (31 May 2016: 1.07%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------------------------------|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| Bank of America Merill Lynch | USD | 594,320 | CHF | 585,000 | 19/01/2017 | 18,083 | 0.01 |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 275,956 | DKK | 1,818,000 | 03/04/2017 | 15,092 | 0.01 |
| Bank of America Merill Lynch | ZAR | 2,085,000 | USD | 143,417 | 19/01/2017 | 3,860 | - |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 388,210 | NZD | 545,932 | 19/01/2017 | 1,862 | - |
| Bank of America Merill Lynch | AUD | 508,000 | USD | 373,590 | 19/01/2017 | 1,316 | - |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 141,000 | MXN | 2,888,184 | 13/02/2017 | 1,161 | - |
| Bank of America Merill Lynch | GBP | 125,000 | USD | 156,128 | 19/01/2017 | 265 | - |
| Barclays^ | USD | 7,603,886 | EUR | 6,885,620 | 19/01/2017 | 281,232 | 0.13 |
| Barclays^ | USD | 1,399,481 | AUD | 1,840,000 | 19/01/2017 | 41,554 | 0.02 |
| Barclays^ | USD | 1,503,078 | CAD | 1,974,097 | 19/01/2017 | 34,111 | 0.02 |
| Barclays^ | USD | 102,179 | TRY | 320,000 | 19/01/2017 | 9,815 | - |
| Barclays^ | CAD | 645,761 | USD | 477,551 | 19/01/2017 | 2,973 | - |
| Barclays^ | GBP | 420,000 | USD | 524,004 | 19/01/2017 | 1,476 | - |
| Barclays^ | USD | 149,113 | CAD | 200,000 | 19/01/2017 | 289 | - |
| Barclays^ | CAD | 94,820 | USD | 70,400 | 19/01/2017 | 157 | - |
| Barclays^ | EUR | 300,000 | USD | 318,998 | 19/01/2017 | 43 | - |
| BNP Paribas | USD | 10,471,951 | EUR | 9,573,742 | 02/12/2016 | 316,125 | 0.15 |
| BNP Paribas | GBP | 1,352,000 | USD | 1,679,177 | 02/12/2016 | 10,012 | - |
| Chase Manhattan | USD | 2,231,851 | JPY | 230,000,000 | 05/12/2016 | 213,200 | 0.10 |
| Chase Manhattan | USD | 761,816 | ZAR | 10,516,102 | 07/02/2017 | 21,664 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 761,270 | AUD | 1,005,000 | 02/12/2016 | 18,726 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 3,230,655 | CAD | 4,325,000 | 02/12/2016 | 14,085 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 717,682 | JPY | 80,000,000 | 06/03/2017 | 12,313 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 234,036 | DKK | 1,550,000 | 03/07/2017 | 10,549 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 430,495 | DKK | 3,000,000 | 03/01/2017 | 1,968 | - |
| Chase Manhattan | USD | 218,114 | NZD | 306,000 | 02/12/2016 | 1,221 | - |
| Chase Manhattan | MXN | 642,058 | USD | 31,000 | 13/02/2017 | 87 | - |
| Citibank | USD | 4,007,506 | EUR | 3,560,914 | 06/01/2017 | 222,833 | 0.11 |
| Citibank | USD | 1,345,798 | JPY | 150,000,000 | 06/03/2017 | 23,232 | 0.01 |
| Citibank | USD | 549,505 | EUR | 505,000 | 02/12/2016 | 13,801 | 0.01 |
| Citibank | USD | 557,930 | SGD | 779,846 | 17/01/2017 | 13,460 | 0.01 |
| Citibank | USD | 258,400 | CAD | 342,637 | 19/01/2017 | 3,436 | - |
| Citibank | USD | 256,300 | CAD | 341,743 | 19/01/2017 | 2,002 | - |
| Citibank | GBP | 1,141,000 | USD | 1,423,765 | 02/12/2016 | 1,800 | - |
| Deutsche | USD | 356,512 | PLN | 1,394,713 | 07/02/2017 | 24,088 | 0.01 |

先渡為替契約(つづき) : 1.34% (31 May 2016: 1.07%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------|-----|------------|-----|---------------|----------------|------------------|--------------|
| Goldman Sachs | USD | 20,643,606 | JPY | 2,090,000,000 | 12/12/2016 | 2,291,684 | 1.10 |
| Goldman Sachs | USD | 2,909,796 | JPY | 300,000,000 | 19/01/2017 | 269,812 | 0.13 |
| Goldman Sachs | USD | 973,644 | NZD | 1,359,000 | 02/12/2016 | 10,385 | - |
| Goldman Sachs | USD | 120,000 | INR | 8,121,600 | 07/12/2016 | 1,397 | - |
| Marine Midland Bank | USD | 3,567,729 | NOK | 29,441,485 | 02/12/2016 | 109,375 | 0.05 |
| Marine Midland Bank | USD | 1,640,040 | SGD | 2,286,995 | 17/01/2017 | 43,315 | 0.02 |
| Marine Midland Bank | USD | 2,439,500 | AUD | 3,276,938 | 06/01/2017 | 20,380 | 0.01 |
| Marine Midland Bank | USD | 610,415 | SGD | 862,333 | 17/01/2017 | 8,354 | - |
| Marine Midland Bank | BRL | 104,865 | USD | 29,900 | 13/02/2017 | 462 | - |
| Morgan Stanley | USD | 118,000 | BRL | 385,624 | 20/01/2017 | 5,585 | - |
| Morgan Stanley | USD | 85,600 | INR | 5,882,432 | 21/02/2017 | 467 | 0.01 |
| Societe Generale | USD | 11,040,424 | EUR | 10,000,000 | 19/01/2017 | 405,717 | 0.19 |
| Societe Generale | USD | 2,983,307 | DKK | 20,105,000 | 19/01/2017 | 109,205 | 0.05 |
| Societe Generale | USD | 374,488 | SGD | 520,000 | 19/01/2017 | 11,435 | 0.01 |
| Societe Generale | USD | 185,540 | NOK | 1,520,000 | 19/01/2017 | 6,947 | - |
| Societe Generale | SEK | 1,632,000 | USD | 176,720 | 19/01/2017 | 576 | - |
| Standard Chartered | USD | 11,041,520 | EUR | 10,000,000 | 19/01/2017 | 406,813 | 0.20 |
| Standard Chartered | USD | 4,321,247 | JPY | 451,700,000 | 02/12/2016 | 357,054 | 0.17 |
| Standard Chartered | USD | 235,957 | SGD | 334,000 | 17/01/2017 | 2,767 | - |
| Standard Chartered | EUR | 9,437,000 | USD | 10,034,549 | 19/01/2017 | 1,424 | - |
| Standard Chartered | USD | 13,000 | KRW | 14,792,700 | 17/01/2017 | 406 | - |
| Standard Chartered | DKK | 5,123,000 | USD | 732,269 | 19/01/2017 | 87 | - |
| UBS | USD | 11,041,250 | EUR | 10,000,000 | 19/01/2017 | 406,543 | 0.20 |
| UBS | EUR | 3,547,101 | SEK | 34,397,462 | 19/01/2017 | 35,395 | 0.02 |
| UBS | GBP | 1,794,000 | USD | 2,215,809 | 19/01/2017 | 28,740 | 0.01 |
| UBS | USD | 434,900 | JPY | 46,755,533 | 19/01/2017 | 23,454 | 0.01 |
| UBS | USD | 520,235 | EUR | 474,737 | 15/12/2016 | 16,307 | 0.01 |
| UBS | USD | 363,876 | SEK | 3,260,000 | 02/12/2016 | 10,756 | 0.01 |
| UBS | USD | 223,221 | EUR | 200,000 | 19/01/2017 | 10,527 | 0.01 |
| UBS | GBP | 312,000 | USD | 382,374 | 02/12/2016 | 7,439 | - |
| UBS | USD | 246,069 | EUR | 225,000 | 19/01/2017 | 6,789 | - |
| UBS | USD | 237,637 | EUR | 217,100 | 19/01/2017 | 6,757 | - |
| UBS | NZD | 647,442 | EUR | 425,100 | 19/01/2017 | 6,104 | - |
| UBS | USD | 227,395 | EUR | 209,000 | 19/01/2017 | 5,130 | - |

先渡為替契約(つづき) : 1.34% (31 May 2016: 1.07%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-----------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 307,256 | EUR | 286,656 | 15/12/2016 | 2,975 | - |
| UBS | NZD | 243,900 | USD | 171,247 | 19/01/2017 | 1,357 | - |
| UBS | USD | 127,845 | EUR | 119,273 | 15/12/2016 | 1,237 | - |
| UBS | USD | 26,717 | EUR | 24,159 | 15/12/2016 | 1,073 | - |
| UBS | GBP | 146,603 | USD | 182,171 | 15/12/2016 | 1,065 | - |
| UBS | USD | 97,528 | EUR | 90,989 | 15/12/2016 | 944 | - |
| UBS | USD | 88,125 | EUR | 82,489 | 15/12/2016 | 564 | - |
| UBS | NZD | 641,212 | EUR | 426,200 | 19/01/2017 | 525 | - |
| UBS | USD | 15,669 | EUR | 14,299 | 15/12/2016 | 491 | - |
| UBS | EUR | 52,550 | USD | 55,377 | 15/12/2016 | 405 | - |
| UBS | USD | 971,144 | GBP | 777,000 | 02/12/2016 | 361 | - |
| UBS | USD | 30,138 | EUR | 28,079 | 15/12/2016 | 332 | - |
| UBS | USD | 9,000 | KRW | 10,237,500 | 17/01/2017 | 284 | - |
| UBS | USD | 6,917 | EUR | 6,254 | 15/12/2016 | 278 | - |
| UBS | USD | 9,000 | KRW | 10,250,100 | 17/01/2017 | 273 | - |
| UBS | USD | 10,154 | EUR | 9,325 | 15/12/2016 | 256 | - |
| UBS | USD | 4,974 | EUR | 4,567 | 15/12/2016 | 125 | - |
| UBS | USD | 7,773 | EUR | 7,242 | 15/12/2016 | 86 | - |
| UBS | EUR | 26,237 | USD | 27,784 | 15/12/2016 | 66 | - |
| UBS | USD | 6,715 | EUR | 6,265 | 15/12/2016 | 65 | - |
| UBS | USD | 24,398 | EUR | 22,954 | 15/12/2016 | 32 | - |
| UBS | EUR | 7,580 | USD | 8,021 | 15/12/2016 | 25 | - |
| UBS | USD | 22,408 | EUR | 21,093 | 15/12/2016 | 17 | - |
| UBS | GBP | 1,218 | USD | 1,512 | 15/12/2016 | 10 | - |
| UBS | EUR | 15,450 | USD | 16,393 | 15/12/2016 | 8 | - |
| UBS | EUR | 3,010 | USD | 3,190 | 15/12/2016 | 6 | - |
| UBS | USD | 527 | EUR | 491 | 15/12/2016 | 5 | - |
| UBS | USD | 5,803 | EUR | 5,463 | 15/12/2016 | 5 | - |
| UBS | USD | 1,993 | EUR | 1,875 | 15/12/2016 | 3 | - |
| UBS | USD | 158 | EUR | 148 | 15/12/2016 | 2 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 6,688,684 | 3.19 |
| ANZ | AUD | 315,000 | USD | 235,531 | 02/12/2016 | (2,793) | - |
| Bank of America | DKK | 2,450,000 | USD | 353,062 | 03/01/2017 | (3,098) | - |
| Bank of America | EUR | 1,300,000 | USD | 1,424,470 | 19/01/2017 | (41,958) | (0.02) |
| Barclays^ | EUR | 191,000 | USD | 205,782 | 19/01/2017 | (2,659) | - |
| Barclays^ | USD | 332,506 | GBP | 269,447 | 19/01/2017 | (4,611) | - |

先渡為替契約(つづき) : 1.34% (31 May 2016: 1.07%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|-----|-------------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| Barclays^ | USD | 409,222 | ZAR | 5,900,000 | 19/01/2017 | (7,532) | - |
| Barclays^ | USD | 872,144 | GBP | 715,000 | 19/01/2017 | (22,423) | (0.01) |
| Barclays^ | USD | 7,944,724 | GBP | 6,512,648 | 19/01/2017 | (203,525) | (0.10) |
| BNP Paribas | USD | 8,171,691 | GBP | 6,535,000 | 06/01/2017 | (2,359) | - |
| BNP Paribas | USD | 4,752,455 | EUR | 4,480,742 | 06/01/2017 | (9,846) | - |
| Chase Manhattan | KRW | 84,542,400 | USD | 72,000 | 17/01/2017 | (23) | - |
| Chase Manhattan | KRW | 53,879,860 | USD | 47,000 | 17/01/2017 | (1,128) | - |
| Chase Manhattan | MXN | 3,675,000 | USD | 179,072 | 13/02/2017 | (1,138) | - |
| Chase Manhattan | GBP | 397,000 | USD | 500,732 | 02/12/2016 | (4,720) | - |
| Chase Manhattan | USD | 2,290,807 | NOK | 19,561,485 | 06/01/2017 | (7,434) | - |
| Citibank | USD | 119,400 | RUB | 7,732,344 | 02/12/2016 | (342) | - |
| Citibank | USD | 313,200 | JPY | 35,643,256 | 19/01/2017 | (459) | - |
| Citibank | USD | 115,600 | BRL | 412,056 | 13/02/2017 | (3,705) | - |
| Citibank | BRL | 378,603 | USD | 118,000 | 20/01/2017 | (7,632) | - |
| Citibank | MXN | 2,755,000 | USD | 144,069 | 13/02/2017 | (10,678) | (0.01) |
| Citibank | EUR | 217,000 | USD | 245,275 | 19/01/2017 | (14,502) | (0.01) |
| Citibank | EUR | 1,445,000 | USD | 1,552,006 | 02/12/2016 | (19,150) | (0.01) |
| Citibank | EUR | 2,707,000 | USD | 2,898,335 | 02/12/2016 | (26,750) | (0.01) |
| Citibank | EUR | 812,000 | USD | 893,772 | 02/12/2016 | (32,402) | (0.02) |
| Citibank | JPY | 456,600,000 | USD | 4,294,360 | 02/12/2016 | (287,164) | (0.14) |
| Goldman Sachs | USD | 356,502 | DKK | 2,505,000 | 03/01/2017 | (1,318) | - |
| Goldman Sachs | INR | 8,054,400 | USD | 120,000 | 07/12/2016 | (2,378) | - |
| Goldman Sachs | CAD | 1,150,000 | USD | 857,932 | 02/12/2016 | (2,659) | - |
| Goldman Sachs | RUB | 7,530,558 | USD | 119,400 | 02/12/2016 | (2,783) | - |
| Goldman Sachs | SEK | 3,230,000 | USD | 352,740 | 02/12/2016 | (2,870) | - |
| Goldman Sachs | DKK | 695,000 | USD | 103,955 | 03/01/2017 | (4,680) | - |
| Goldman Sachs | CAD | 335,811 | USD | 258,400 | 19/01/2017 | (8,516) | - |
| Marine Midland | PLN | 341,000 | USD | 82,289 | 07/02/2017 | (1,013) | - |
| Marine Midland | SGD | 1,269,314 | USD | 897,000 | 17/01/2017 | (10,795) | (0.01) |
| Marine Midland | EUR | 425,100 | NZD | 656,448 | 19/01/2017 | (12,477) | (0.01) |
| Royal Bank of Canada | DKK | 2,445,000 | USD | 349,916 | 03/01/2017 | (667) | - |
| Royal Bank of Canada | DKK | 1,820,000 | USD | 270,365 | 03/04/2017 | (9,214) | - |
| Societe Generale | USD | 1,178,400 | NZD | 1,665,000 | 06/01/2017 | (335) | - |
| Societe Generale | EUR | 300,000 | USD | 322,344 | 19/01/2017 | (3,303) | - |
| Societe Generale | NOK | 9,880,000 | USD | 1,166,597 | 02/12/2016 | (6,039) | - |
| Societe Generale | EUR | 579,593 | USD | 646,669 | 19/01/2017 | (30,289) | (0.01) |
| Societe Generale | EUR | 3,140,000 | USD | 3,503,338 | 19/01/2017 | (164,040) | (0.08) |
| Societe Generale | SEK | 31,189,186 | USD | 3,553,010 | 19/01/2017 | (164,705) | (0.08) |
| Societe Generale | USD | 10,956,736 | GBP | 8,960,000 | 02/12/2016 | (237,888) | (0.11) |
| Standard Chartered | USD | 286,450 | GBP | 230,000 | 19/01/2017 | (1,313) | - |
| Standard Chartered | USD | 2,353,595 | CAD | 3,175,000 | 06/01/2017 | (8,619) | - |

先渡為替契約(つづき) : 1.34% (31 May 2016: 1.07%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 2 | GBP | 2 | 15/12/2016 | - | - |
| UBS | USD | 87 | GBP | 69 | 15/12/2016 | - | - |
| UBS | GBP | 56 | USD | 70 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 1,224 | GBP | 982 | 15/12/2016 | (3) | - |
| UBS | USD | 19,454 | EUR | 18,336 | 15/12/2016 | (10) | - |
| UBS | EUR | 2,706 | USD | 2,890 | 15/12/2016 | (18) | - |
| UBS | USD | 6,158 | EUR | 5,819 | 15/12/2016 | (19) | - |
| UBS | USD | 4,907 | GBP | 3,954 | 15/12/2016 | (35) | - |
| UBS | USD | 15,174 | EUR | 14,329 | 15/12/2016 | (37) | - |
| UBS | EUR | 3,695 | USD | 3,967 | 15/12/2016 | (45) | - |
| UBS | USD | 6,293 | EUR | 5,972 | 15/12/2016 | (46) | - |
| UBS | GBP | 4,308 | USD | 5,445 | 15/12/2016 | (61) | - |
| UBS | USD | 11,809 | GBP | 9,522 | 15/12/2016 | (92) | - |
| UBS | USD | 49,910 | GBP | 40,024 | 15/12/2016 | (116) | - |
| UBS | USD | 33,842 | GBP | 27,230 | 15/12/2016 | (192) | - |
| UBS | EUR | 9,906 | USD | 10,771 | 15/12/2016 | (256) | - |
| UBS | EUR | 38,236 | USD | 41,057 | 15/12/2016 | (470) | - |
| UBS | EUR | 33,468 | USD | 36,391 | 15/12/2016 | (865) | - |
| UBS | GBP | 82,251 | USD | 103,962 | 15/12/2016 | (1,158) | - |
| UBS | EUR | 196,532 | USD | 209,965 | 15/12/2016 | (1,349) | - |
| UBS | CHF | 152,000 | USD | 151,083 | 19/01/2017 | (1,360) | - |
| UBS | USD | 454,199 | GBP | 364,496 | 15/12/2016 | (1,378) | - |
| UBS | EUR | 106,500 | NZD | 162,271 | 19/01/2017 | (1,577) | - |
| UBS | USD | 1,643,701 | GBP | 1,318,130 | 15/12/2016 | (3,806) | (0.01) |
| UBS | EUR | 175,139 | USD | 191,886 | 19/01/2017 | (5,631) | (0.01) |
| UBS | USD | 814,999 | GBP | 656,745 | 15/12/2016 | (5,855) | (0.01) |
| UBS | USD | 1,567,751 | GBP | 1,260,381 | 15/12/2016 | (7,577) | (0.01) |
| UBS | EUR | 412,642 | USD | 448,675 | 15/12/2016 | (10,660) | (0.01) |
| UBS | USD | 2,271,034 | GBP | 1,829,401 | 15/12/2016 | (15,502) | (0.01) |
| UBS | EUR | 576,000 | USD | 631,289 | 02/12/2016 | (20,268) | (0.01) |
| UBS | JPY | 44,778,304 | USD | 434,900 | 19/01/2017 | (40,853) | (0.02) |
| UBS | GBP | 3,051,054 | USD | 3,856,419 | 15/12/2016 | (42,960) | (0.02) |
| UBS | USD | 13,748,426 | GBP | 11,095,673 | 15/12/2016 | (119,862) | (0.06) |
| UBS | EUR | 6,423,502 | USD | 6,984,409 | 15/12/2016 | (165,936) | (0.08) |
| UBS | EUR | 8,081,699 | USD | 8,787,401 | 15/12/2016 | (208,771) | (0.10) |
| UBS | EUR | 20,408,953 | USD | 22,191,083 | 15/12/2016 | (527,217) | (0.25) |
| UBS | GBP | 92,210,484 | USD | 116,550,640 | 15/12/2016 | (1,298,364) | (0.62) |

先渡為替契約に係る評価損合計

(3,876,282)(1.85)

先渡為替契約合計

2,812,4021.34

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 178,138,332 | 85.20 |
| 現金および現金等価物 [*] | 36,001,158 | 17.23 |
| その他の純負債 | (5,081,287) | (2.43) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>209,058,203</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 77.00 |
| 投資ファンドおよびAIF | 1.00 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 3.00 |
| その他の資産 | 19.00 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるパークレイズ・キャピタル、ゴールドマン・サックスおよびソシエテ・ジェネラルにより、それぞれ担保として保有される869,032米ドル、850,049米ドルおよび260,000米ドルならびに先渡契約の担保として供される現金3,110,000米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、パークレイズ・キャピタルおよびゴールドマン・サックスである。

† ファンドの純資産の6.45%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式 : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | オーストラリア : 13.76% (31 May 2016: 13.43%) | | |
| | 広告 : 0.06% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 42,157 | IVE Group Ltd Com NPV | 64,164 | 0.06 |
| | 自動車部品・装置 : 0.04% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 23,793 | PWR Holdings Ltd Com NPV | 46,410 | 0.04 |
| | 銀行 : 4.39% (31 May 2016: 4.11%) | | |
| 58,378 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd Com NPV | 1,224,534 | 1.12 |
| 32,280 | Commonwealth Bank of Australia Com NPV | 1,875,928 | 1.72 |
| 25,935 | National Australia Bank Ltd Com NPV | 553,497 | 0.51 |
| 49,273 | Westpac Banking Corp Com NPV | 1,138,031 | 1.04 |
| | 飲料 : 0.20% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| 26,885 | Treasury Wine Estates Ltd Com NPV | 214,432 | 0.20 |
| | バイオテクノロジー : 0.52% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 6,523 | CSL Ltd Com NPV | 472,554 | 0.43 |
| 189,477 | Starpharma Holdings Ltd Com NPV | 93,097 | 0.09 |
| | 建設資材 : 0.06% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 27,122 | Reliance Worldwide Corp Ltd Com NPV | 62,622 | 0.06 |
| | 化学 : 0.20% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 95,143 | Incitec Pivot Ltd Com NPV | 221,082 | 0.20 |
| | 商業サービス : 0.31% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 78,526 | 3P Learning Ltd Com NPV | 67,157 | 0.06 |
| 12,372 | Brambles Ltd Com NPV | 107,864 | 0.10 |
| 97,803 | QANTM Intellectual Property Ltd Com NPV | 160,782 | 0.15 |
| | 各種金融サービス : 0.84% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 46,868 | Blue Sky Alternative Investments Ltd Com NPV | 265,600 | 0.24 |
| 10,513 | Macquarie Group Ltd Com NPV | 651,502 | 0.60 |
| | 電気 : 0.40% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 98,263 | Origin Energy Ltd Com NPV | 431,617 | 0.40 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.45% (31 May 2016: 0.67%) | | |
| 106,217 | Sydney Airport Com NPV | 492,452 | 0.45 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | オーストラリア(つづき) : 13.76% (31 May 2016: 13.43%) | | |
| | 娯楽 : 0.16% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 15,524 | Aristocrat Leisure Ltd Com NPV | 171,991 | 0.16 |
| | 食品 : 0.00% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| | ヘルスケア用品 : 0.30% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 136,220 | Adherium Ltd Com NPV | 31,200 | 0.03 |
| 76,375 | Asaleo Care Ltd Com NPV | 87,043 | 0.08 |
| 1,306 | Cochlear Ltd Com NPV | 114,553 | 0.11 |
| 97,828 | ImpediMed Ltd Com NPV | 88,363 | 0.08 |
| | ヘルスケア・サービス : 0.29% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 5,953 | Ramsay Health Care Ltd Com NPV | 311,207 | 0.29 |
| | 保険 : 0.90% (31 May 2016: 0.90%) | | |
| 64,889 | QBE Insurance Group Ltd Com NPV | 535,766 | 0.49 |
| 97,108 | Steadfast Group Ltd Com NPV | 148,160 | 0.14 |
| 31,777 | Suncorp Group Ltd Com NPV | 293,363 | 0.27 |
| | インターネット : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 余暇 : 0.21% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 17,081 | Corporate Travel Management Ltd Com NPV | 224,389 | 0.21 |
| | 鉱業 : 1.61% (31 May 2016: 1.23%) | | |
| 31,500 | BHP Billiton Ltd Com NPV | 568,346 | 0.52 |
| 265,820 | Covata Ltd Com NPV | 17,185 | 0.02 |
| 97,448 | Evolution Mining Ltd Com NPV | 138,419 | 0.13 |
| 11,340 | Newcrest Mining Ltd Com NPV | 163,759 | 0.15 |
| 15,286 | Rio Tinto Ltd Com NPV | 652,514 | 0.60 |
| 110,930 | Salt Lake Potash Ltd Com NPV | 42,210 | 0.04 |
| 79,896 | Syrah Resources Ltd Com NPV | 164,402 | 0.15 |
| | 石油・ガス : 0.16% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 7,885 | Caltex Australia Ltd Com NPV | 175,066 | 0.16 |
| | 包装・容器 : 0.08% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 18,111 | Pact Group Holdings Ltd Com NPV | 87,179 | 0.08 |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.24%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | オーストラリア(つづき) : 13.76% (31 May 2016: 13.43%) | | |
| | 不動産 : 0.11% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 219,442 | Propertylink Group NPV | 117,953 | 0.11 |
| | 不動産投資信託 : 0.58% (31 May 2016: 0.94%) | | |
| 9,834 | Carindale Property Trust Reits NPV | 55,220 | 0.05 |
| 53,996 | Goodman Group Reits NPV | 265,900 | 0.24 |
| 11,603 | Vicinity Centres Reits NPV | 25,076 | 0.02 |
| 43,405 | Westfield Corp Reits NPV | 292,957 | 0.27 |
| | 小売 : 0.68% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| 24,080 | Wesfarmers Ltd Com NPV | 743,685 | 0.68 |
| | ソフトウェア : 0.52% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 55,549 | Aconex Ltd Com NPV | 187,358 | 0.17 |
| 49,815 | Bravura Solutions Ltd Com NPV | 50,976 | 0.05 |
| 109,255 | Resapp Health Ltd Com NPV | 29,262 | 0.03 |
| 69,435 | WiseTech Global Ltd Com NPV | 297,295 | 0.27 |
| | 通信 : 0.65% (31 May 2016: 0.99%) | | |
| 144,591 | Telstra Corp Ltd Com NPV | 540,031 | 0.49 |
| 34,088 | TPG Telecom Ltd NPV | 179,953 | 0.16 |
| | 繊維 : 0.04% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 106,460 | Alexium International Group Ltd Com NPV | 44,245 | 0.04 |
| | オーストラリア合計 | 14,988,351 | 13.76 |
| | バミューダ : 6.18% (31 May 2016: 5.82%) | | |
| | 商業サービス : 1.63% (31 May 2016: 2.08%) | | |
| 1,671,311 | Cosco Shipping Ports Ltd HKD0.10 | 1,779,767 | 1.63 |
| | 電気部品・設備 : 0.98% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| 371,125 | Johnson Electric Holdings Ltd Com HKD0.05 | 1,072,947 | 0.98 |
| | 各種持株会社 : 1.35% (31 May 2016: 1.08%) | | |
| 44,297 | Jardine Strategic Holdings Ltd Com USD0.05 | 1,468,224 | 1.35 |
| | 石油・ガス : 0.67% (31 May 2016: 0.74%) | | |
| 990,000 | Kunlun Energy Co Ltd Com HKD0.01 | 724,952 | 0.67 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | パミューダ(つづき) : 6.18% (31 May 2016: 5.82%) | | |
| | 不動産 : 0.98% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| 166,700 | Hongkong Land Holdings Ltd Com USD0.10 | 1,066,046 | 0.98 |
| | 小売 : 0.57% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 334,000 | Chow Sang Sang Holdings International Ltd Com HKD0.25 | 623,506 | 0.57 |
| | パミューダ合計 | 6,735,442 | 6.18 |
| | ケイマン諸島 : 16.08% (31 May 2016: 17.67%) | | |
| | アパレル : 0.69% (31 May 2016: 0.71%) | | |
| 122,000 | Shenzhou International Group Holdings Ltd Com HKD0.10 | 750,640 | 0.69 |
| | 自動車部品・装置 : 0.44% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| 639,247 | Xinyi Glass Holdings Ltd Com HKD0.10 | 475,110 | 0.44 |
| | 商業サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| | 電子 : 0.80% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| 96,500 | AAC Technologies Holdings Inc Class I Com USD0.01 | 873,665 | 0.80 |
| | 食品 : 0.67% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 619,872 | Tingyi Cayman Islands Holding Corp Com USD0.005 | 735,217 | 0.67 |
| | 各種持株会社 : 0.64% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 56,824 | CK Hutchison Holdings Ltd Com HKD1.00 | 692,109 | 0.64 |
| | インターネット : 9.83% (31 May 2016: 9.39%) | | |
| 44,192 | Alibaba Group Holding Ltd ADR USD0.000025 | 4,154,490 | 3.81 |
| 12,156 | Baidu Inc ADR USD0.00005 | 2,029,262 | 1.86 |
| 5,497 | Ctrip.com International Ltd ADR NPV | 248,602 | 0.23 |
| 50,976 | JD.com Inc ADR USD0.00002 | 1,369,980 | 1.26 |
| 116,400 | Tencent Holdings Ltd Com HKD0.00002 | 2,907,505 | 2.67 |
| | 建設機械・採掘機械 : 0.00% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | 各種機械 : 0.70% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 379,000 | Haitian International Holdings Ltd Com HKD0.10 | 761,259 | 0.70 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 1.95%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | ケイマン諸島(つづき) : 16.08% (31 May 2016: 17.67%) | | |
| | 小売 : 1.80% (31 May 2016: 2.53%) | | |
| 879,660 | Belle International Holdings Ltd Com HKD0.01 | 505,796 | 0.46 |
| 2,234,000 | China Dongxiang Group Co Ltd Class C Com HKD0.01 | 444,977 | 0.41 |
| 182,500 | Lifestyle China Group Ltd Com HKD0.005 | 47,527 | 0.04 |
| 758,000 | Lifestyle International Holdings Ltd Com HKD0.005 | 971,363 | 0.89 |
| | 半導体 : 0.51% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 55,500 | ASM Pacific Technology Ltd Com HKD0.10 | 556,492 | 0.51 |
| | ケイマン諸島合計 | 17,523,994 | 16.08 |
| | フランス : 0.64% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| | アパレル : 0.64% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| 3,837 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE Com EURO.30 | 698,869 | 0.64 |
| | フランス合計 | 698,869 | 0.64 |
| | 香港 : 6.65% (31 May 2016: 6.34%) | | |
| | ガス : 0.62% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 146,984 | Beijing Enterprises Holdings Ltd Com NPV | 679,337 | 0.62 |
| | 工具・工作機械 : 1.15% (31 May 2016: 1.16%) | | |
| 323,000 | Techtronic Industries Co Ltd Com NPV | 1,255,497 | 1.15 |
| | 各種持株会社 : 0.72% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 312,600 | China Merchants Port Holdings Ltd Com NPV | 785,868 | 0.72 |
| | 保険 : 1.99% (31 May 2016: 1.95%) | | |
| 354,800 | AIA Group Ltd Com NPV | 2,162,424 | 1.99 |
| | 宿泊施設 : 0.23% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 51,000 | Galaxy Entertainment Group Ltd Com NPV | 252,973 | 0.23 |
| | 不動産 : 1.56% (31 May 2016: 1.12%) | | |
| 36,000 | Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 470,848 | 0.43 |
| 408,750 | Swire Properties Ltd Com NPV | 1,234,421 | 1.13 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | 香港(つづき) : 6.65% (31 May 2016: 6.34%) | | |
| | 通信 : 0.38% (31 May 2016: 1.04%) | | |
| 38,500 | China Mobile Ltd Com NPV | 420,531 | 0.38 |
| | 香港合計 | 7,261,899 | 6.65 |
| | インド : 7.16% (31 May 2016: 8.81%) | | |
| | 銀行 : 2.37% (31 May 2016: 2.46%) | | |
| 96,980 | HDFC Bank Ltd Com INR2.00 | 1,698,345 | 1.56 |
| 55,760 | IndusInd Bank Ltd Com INR10.00 | 881,991 | 0.81 |
| | コンピューター : 0.25% (31 May 2016: 1.07%) | | |
| 19,039 | Infosys Ltd Com INR5.00 | 270,841 | 0.25 |
| | 電気 : 0.75% (31 May 2016: 0.87%) | | |
| 294,107 | Power Grid Corp of India Ltd Com INR10.00 | 822,073 | 0.75 |
| | ガス : 1.00% (31 May 2016: 1.24%) | | |
| 175,809 | GAIL India Ltd Com INR10.00 | 1,088,324 | 1.00 |
| | ヘルスケア・サービス : 0.58% (31 May 2016: 0.64%) | | |
| 36,548 | Apollo Hospitals Enterprise Ltd Com INR5.00 | 636,289 | 0.58 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.61% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 180,407 | Marico Ltd Com INR1.00 | 663,260 | 0.61 |
| | 各種機械 : 0.00% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | メディア : 0.93% (31 May 2016: 0.85%) | | |
| 145,604 | Zee Entertainment Enterprises Ltd Com INR1.00 | 964,096 | 0.88 |
| 355,263 | ZEE Entertainment Enterprises Pref INR10.00 | 50,345 | 0.05 |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| | 不動産 : 0.67% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 127,153 | Phoenix Mills Ltd Com INR2.00 | 729,121 | 0.67 |
| | ソフトウェア : 0.00% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| | インド合計 | 7,804,685 | 7.16 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | アイルランド : 0.27% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| | 建設資材 : 0.27% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 19,032 | James Hardie Industries PLC EURO.59 | 293,118 | 0.27 |
| | アイルランド合計 | 293,118 | 0.27 |
| | マン島 : 0.84% (31 May 2016: 0.89%) | | |
| | 娯楽 : 0.84% (31 May 2016: 0.89%) | | |
| 1,355,400 | Genting Singapore PLC Com USD0.10 | 920,222 | 0.84 |
| | マン島合計 | 920,222 | 0.84 |
| | 日本 : 1.02% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| | ソフトウェア : 1.02% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 79,400 | ネクソン | 1,114,575 | 1.02 |
| | 日本合計 | 1,114,575 | 1.02 |
| | ルクセンブルグ : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | ニュージーランド : 0.39% (31 May 2016: 0.56%) | | |
| | 食品 : 0.36% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 225,686 | a2 Milk Co Ltd Com NPV | 397,694 | 0.36 |
| | ソフトウェア : 0.03% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 8,605 | Vista Group International Ltd Com NPV | 36,875 | 0.03 |
| | 通信 : 0.00% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| | ニュージーランド合計 | 434,569 | 0.39 |
| | バブア・ニューギニア : 0.69% (31 May 2016: 1.01%) | | |
| | 石油・ガス : 0.69% (31 May 2016: 1.01%) | | |
| 157,913 | Oil Search Ltd Com NPV | 751,964 | 0.69 |
| | バブア・ニューギニア合計 | 751,964 | 0.69 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | 中国 : 3.33% (31 May 2016: 3.18%) | | |
| | 自動車製造 : 0.90% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| 966,000 | Dongfeng Motor Group Co Ltd Com CNY1.00 | 983,230 | 0.90 |
| | 化学 : 0.53% (31 May 2016: 0.64%) | | |
| 2,503,944 | China BlueChemical Ltd Com HKD1.00 | 577,834 | 0.53 |
| | エンジニアリング・建設 : 1.06% (31 May 2016: 1.11%) | | |
| 1,172,000 | Beijing Capital International Airport Co Ltd Com CNY1.00 | 1,159,663 | 1.06 |
| | 保険 : 0.84% (31 May 2016: 0.78%) | | |
| 235,000 | China Pacific Insurance Group Co Ltd Com CNY1.00 | 914,199 | 0.84 |
| | 中国合計 | 3,634,926 | 3.33 |
| | フィリピン : 0.73% (31 May 2016: 0.92%) | | |
| | 不動産 : 0.73% (31 May 2016: 0.92%) | | |
| 1,204,500 | Ayala Land Inc Com PHP1.00 | 796,259 | 0.73 |
| | フィリピン合計 | 796,259 | 0.73 |
| | 韓国 : 15.21% (31 May 2016: 12.72%) | | |
| | アパレル : 0.78% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 36,571 | Youngone Corp Com KRW500.00 | 859,491 | 0.78 |
| | 自動車製造 : 0.49% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,742 | Hyundai Motor Co Com KRW5000.00 | 538,472 | 0.49 |
| | 化学 : 1.66% (31 May 2016: 1.72%) | | |
| 5,506 | LG Chem Ltd Com KRW5000.00 | 1,067,949 | 0.98 |
| 31,469 | LOTTE Fine Chemical Co Ltd Com KRW5000.00 | 746,314 | 0.68 |
| | 各種金融サービス : 2.73% (31 May 2016: 2.17%) | | |
| 28,776 | Daishin Securities Co Ltd Com KRW5000.00 | 257,225 | 0.24 |
| 38,081 | Hana Financial Group Inc Com KRW5000.00 | 1,048,079 | 0.96 |
| 30,716 | KB Financial Group Inc Com KRW5000.00 | 1,106,806 | 1.02 |
| 8,156 | KIWOOM Securities Co Ltd Com KRW5000.00 | 445,805 | 0.41 |
| 3,028 | Samsung Card Co Ltd Class C Com KRW5000.00 | 108,462 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | 韓国(つづき) : 15.21% (31 May 2016: 12.72%) | | |
| | 電気 : 0.00% (31 May 2016: 1.61%) | | |
| | エンジニアリング・建設 : 0.87% (31 May 2016: 0.93%) | | |
| 28,139 | Hyundai Engineering & Construction Co Ltd Com KRW5000.00 | 947,755 | 0.87 |
| | ガス : 0.00% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| | 保険 : 1.30% (31 May 2016: 1.15%) | | |
| 5,650 | Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd Com KRW500.00 | 1,418,481 | 1.30 |
| | インターネット : 0.61% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 973 | NAVER Corp Com KRW500.00 | 663,759 | 0.61 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.19% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,715 | Hyundai Steel Co Class C Com KRW5000.00 | 201,357 | 0.19 |
| | 医薬品 : 0.36% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 2,345 | Yuhan Corp Com KRW5000.00 | 395,664 | 0.36 |
| | 小売 : 1.41% (31 May 2016: 1.06%) | | |
| 8,167 | E-MART Inc Com KRW5000.00 | 1,315,117 | 1.21 |
| 1,446 | GS Home Shopping Inc Com KRW5000.00 | 213,056 | 0.20 |
| | 半導体 : 3.96% (31 May 2016: 2.22%) | | |
| 2,887 | Samsung Electronics Co Ltd Com KRW5000.00 | 4,310,559 | 3.96 |
| | 通信 : 0.85% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 11,704 | Samsung SDI Co Ltd Com KRW5000.00 | 924,566 | 0.85 |
| | 韓国合計 | 16,568,917 | 15.21 |
| | シンガポール : 1.44% (31 May 2016: 1.28%) | | |
| | 販売/卸売 : 0.42% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 16,200 | Jardine Cycle & Carriage Ltd Com NPV | 453,236 | 0.42 |
| | 電子 : 0.58% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 93,200 | Venture Corp Ltd Com NPV | 633,089 | 0.58 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.20%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | シンガポール(つづき) : 1.44% (31 May 2016: 1.28%) | | |
| | 通信 : 0.44% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 181,100 | Singapore Telecommunications Ltd Com NPV | 478,542 | 0.44 |
| | シンガポール合計 | 1,564,867 | 1.44 |
| | 台湾 : 12.26% (31 May 2016: 10.21%) | | |
| | コンピューター : 0.52% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 216,010 | Foxconn Technology Co Ltd Com TWD10.00 | 566,914 | 0.52 |
| | 電気部品・設備 : 0.48% (31 May 2016: 0.41%) | | |
| 104,356 | Delta Electronics Inc Com TWD10.00 | 523,041 | 0.48 |
| | 電子 : 1.65% (31 May 2016: 1.62%) | | |
| 400 | Coretronic Corp Com TWD10.00 | 427 | - |
| 380,933 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd Com TWD10.00 | 980,628 | 0.90 |
| 475,000 | Nan Ya Printed Circuit Board Corp Com TWD10.00 | 361,023 | 0.33 |
| 154,000 | Simplio Technology Co Ltd Com TWD10.00 | 455,627 | 0.42 |
| | 保険 : 0.93% (31 May 2016: 0.68%) | | |
| 952,225 | China Life Insurance Co Ltd/Taiwan Com TWD10.00 | 1,015,023 | 0.93 |
| | 余暇 : 0.62% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 114,000 | Giant Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 678,678 | 0.62 |
| | 各種製造業 : 0.85% (31 May 2016: 0.71%) | | |
| 8,000 | Largan Precision Co Ltd Com TWD10.00 | 924,921 | 0.85 |
| | 半導体 : 6.88% (31 May 2016: 5.82%) | | |
| 276,000 | Chipbond Technology Corp Com TWD10.00 | 385,125 | 0.35 |
| 152,000 | MediaTek Inc Com TWD10.00 | 1,057,509 | 0.97 |
| 605,748 | Powertech Technology Inc Com TWD10.00 | 1,559,364 | 1.43 |
| 783,183 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 4,502,817 | 4.13 |
| | 通信 : 0.33% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 153,000 | Far EastOne Telecommunications Co Ltd Com TWD10.00 | 354,742 | 0.33 |
| | 台湾合計 | 13,365,839 | 12.26 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 90.66% (31 May 2016: 89.26%) | | |
| | タイ : 1.99% (31 May 2016: 2.52%) | | |
| | 銀行 : 0.78% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 177,700 | Kasikornbank PCL THB10.00 | 846,677 | 0.78 |
| | 住宅建設 : 0.86% (31 May 2016: 0.92%) | | |
| 488,600 | AP Thailand PCL NVDR THB1.00 | 95,174 | 0.09 |
| 4,301,491 | AP Thailand PCL THB1.00 | 837,886 | 0.77 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| | 通信 : 0.35% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 270,500 | Intouch Holdings PCL THB1.00 | 378,122 | 0.35 |
| | タイ合計 | 2,157,859 | 1.99 |
| | 英国 : 0.99% (31 May 2016: 0.96%) | | |
| | 銀行 : 0.22% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 30,800 | HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 242,516 | 0.22 |
| | 鉱業 : 0.77% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 22,527 | Rio Tinto PLC Com GBPO.10 | 841,472 | 0.77 |
| | 英国合計 | 1,083,988 | 0.99 |
| | 米国 : 0.55% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| | コンピューター : 0.55% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| 10,808 | Cognizant Technology Solutions Corp Class A Com USD0.01 | 595,359 | 0.55 |
| | 米国合計 | 595,359 | 0.55 |
| | バージン諸島 : 0.48% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| | 各種機械 : 0.48% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 27,554 | Hollysys Automation Technologies Ltd Com USD0.0001 | 520,633 | 0.48 |
| | バージン諸島合計 | 520,633 | 0.48 |
| | 株式合計 | 98,816,335 | 90.66 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 投資ファンド：1.95% (31 May 2016: 1.78%) | | |
| | ルクセンブルグ：1.95% (31 May 2016: 1.78%) | | |
| 7,548 | Schroder International Selection Fund - Asian Smaller Companies Class I Acc NPV | 2,122,421 | 1.95 |
| | 投資ファンド合計 | 2,122,421 | 1.95 |
| | 参加証券：3.46% (31 May 2016: 2.50%) | | |
| | ケイマン諸島：0.00% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| | シンガポール：1.29% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| 269,770 | Wuliangye Yibin Co Ltd NPV | 1,407,606 | 1.29 |
| | シンガポール合計 | 1,407,606 | 1.29 |
| | スイス：0.68% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 204,808 | Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd 17/04/2017 | 743,310 | 0.68 |
| | スイス合計 | 743,310 | 0.68 |
| | 米国：1.49% (31 May 2016: 1.18%) | | |
| 311,627 | Wuliangye Yibin Co Ltd NPV | 1,626,008 | 1.49 |
| | 米国合計 | 1,626,008 | 1.49 |
| | 参加証券合計 | 3,776,924 | 3.46 |
| | | 未実現 利益 | 純資産 |
| 契約数 | 先物契約 ^{**} ：0.02% (31 May 2016: 0.00%) | 米ドル | 比率(%) |
| 27 | SPI 200 SFE December 2016 | 16,495 | 0.02 |
| | 先物契約合計 | 16,495 | 0.02 |
| | 先渡為替契約：-0.50% (31 May 2016: 0.40%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|---------|-----|---------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 800,322 | GBP | 639,808 | 15/12/2016 | 638 | - |
| UBS | USD | 32,276 | EUR | 30,091 | 15/12/2016 | 335 | - |
| UBS | EUR | 19,067 | USD | 20,093 | 15/12/2016 | 146 | - |

先渡為替契約：-0.50% (31 May 2016: 0.40%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|------------|-----|------------|----------------|------------------|---------------|
| UBS | USD | 177,123 | EUR | 166,733 | 15/12/2016 | 138 | - |
| UBS | USD | 5,527 | EUR | 5,153 | 15/12/2016 | 57 | - |
| UBS | EUR | 18,877 | USD | 20,003 | 15/12/2016 | 34 | - |
| UBS | USD | 1,081 | EUR | 993 | 15/12/2016 | 27 | - |
| UBS | USD | 1,138 | EUR | 1,061 | 15/12/2016 | 12 | - |
| UBS | USD | 2,571 | EUR | 2,420 | 15/12/2016 | 2 | - |
| UBS | GBP | 403 | USD | 502 | 15/12/2016 | 2 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 1,391 | - |
| Barclays^ | EUR | 523 | USD | 555 | 15/12/2016 | - | - |
| UBS | USD | 181 | GBP | 145 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 576 | EUR | 545 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | USD | 2,688 | GBP | 2,158 | 15/12/2016 | (9) | - |
| UBS | USD | 4,609 | GBP | 3,700 | 15/12/2016 | (15) | - |
| UBS | USD | 11,500 | EUR | 10,880 | 15/12/2016 | (50) | - |
| UBS | GBP | 5,059 | USD | 6,394 | 15/12/2016 | (71) | - |
| UBS | USD | 28,221 | GBP | 22,654 | 15/12/2016 | (94) | - |
| UBS | EUR | 35,291 | USD | 38,372 | 15/12/2016 | (912) | - |
| UBS | GBP | 76,939 | USD | 97,248 | 15/12/2016 | (1,083) | - |
| UBS | GBP | 125,836 | USD | 159,052 | 15/12/2016 | (1,772) | - |
| UBS | USD | 496,542 | GBP | 398,837 | 15/12/2016 | (1,957) | - |
| UBS | USD | 1,275,109 | GBP | 1,023,564 | 15/12/2016 | (4,226) | - |
| UBS | EUR | 171,363 | USD | 186,327 | 15/12/2016 | (4,427) | - |
| UBS | GBP | 722,826 | USD | 913,625 | 15/12/2016 | (10,178) | (0.01) |
| UBS | USD | 983,058 | GBP | 798,283 | 15/12/2016 | (14,702) | (0.01) |
| UBS | EUR | 963,270 | USD | 1,047,384 | 15/12/2016 | (24,884) | (0.02) |
| UBS | GBP | 35,911,537 | USD | 45,390,854 | 15/12/2016 | (505,650) | (0.46) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (570,033) | (0.50) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (568,642) | (0.50) |

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 104,163,533 | 95.59 |
| 現金および現金等価物 [*] | 4,167,153 | 6.31 |
| その他の純負債 | (560,298) | (1.90) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>106,202,432</u> | <u>100.00</u> |

総資産額の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 91.52 |
| 投資ファンドおよびAIF | 1.89 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.01 |
| その他の資産 | 6.58 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される321,812米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、ゴールドマン・サックスである。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 株式 : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | バミューダ : 3.03% (31 May 2016: 2.83%) | | |
| | 銀行 : 0.10% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 3,626 | Credicorp Ltd Com USD5.00 | 568,557 | 0.10 |
| | 商業サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| | コンピューター : 0.15% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 34,775 | Genpact Ltd Com USD0.01 | 833,035 | 0.15 |
| | 電気部品・設備 : 0.58% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 1,131,025 | Johnson Electric Holdings Ltd Com HKD0.05 | 3,269,870 | 0.58 |
| | 林産品・紙製品 : 0.11% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 736,000 | Nine Dragons Paper Holdings Ltd Com HKD0.10 | 649,022 | 0.11 |
| | 各種持株会社 : 0.73% (31 May 2016: 0.85%) | | |
| 77,200 | Jardine Matheson Holdings Ltd Com USD0.25 | 4,176,906 | 0.73 |
| | 石油・ガス : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 182,000 | Kunlun Energy Co Ltd Com HKD0.01 | 133,274 | 0.02 |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 不動産 : 0.66% (31 May 2016: 0.63%) | | |
| 583,400 | Hongkong Land Holdings Ltd Com USD0.10 | 3,730,843 | 0.66 |
| | 小売 : 0.31% (31 May 2016: 0.31%) | | |
| 948,000 | Chow Sang Sang Holdings International Ltd Com HKD0.25 | 1,769,712 | 0.31 |
| | 繊維 : 0.10% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 736,000 | Texwinca Holdings Ltd Com HKD0.05 | 538,480 | 0.10 |
| | 運輸 : 0.27% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 9,536,000 | Pacific Basin Shipping Ltd Com USD0.01 | 1,561,334 | 0.27 |
| | バミューダ合計 | 17,231,033 | 3.03 |
| | ブラジル : 6.83% (31 May 2016: 5.36%) | | |
| | 航空・防衛 : 0.06% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 72,303 | Embraer SA Com NPV | 354,835 | 0.06 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ブラジル(つづき) : 6.83% (31 May 2016: 5.36%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.05% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 31,675 | Iochpe Maxion SA Com NPV | 123,844 | 0.02 |
| 132,123 | Marcopolo SA Pref NPV | 103,316 | 0.02 |
| 22,380 | Tupy SA Com NPV | 76,717 | 0.01 |
| | 銀行 : 1.09% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 58,882 | Banco Bradesco SA ADR NPV | 509,624 | 0.09 |
| 65,900 | Banco Bradesco SA Com NPV | 566,165 | 0.10 |
| 151,050 | Banco Bradesco SA Pref NPV | 1,328,749 | 0.23 |
| 9,300 | Banco do Brasil SA ADR NPV [†] | 76,446 | 0.01 |
| 154,320 | Banco do Brasil SA Com NPV | 1,300,029 | 0.23 |
| 25,272 | Banco Santander Brasil SA ADR NPV | 208,620 | 0.04 |
| 50,200 | Banco Santander Brasil SA NPV | 417,777 | 0.07 |
| 48,272 | Itau Unibanco Holding SA ADR NPV | 499,374 | 0.09 |
| 125,768 | Itau Unibanco Holding SA Pref NPV | 1,318,471 | 0.23 |
| | 飲料 : 0.47% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 526,461 | Ambev SA Com NPV | 2,670,827 | 0.47 |
| | 建設資材 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 66,300 | Duratex SA Com NPV | 134,364 | 0.02 |
| | 化学 : 0.06% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 17,388 | Ultrapar Participacoes SA Com NPV | 355,342 | 0.06 |
| | 商業サービス : 0.12% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| 77,300 | Qualicorp SA Com NPV | 417,409 | 0.07 |
| 312,975 | Santos Brasil Participacoes SA Com NPV | 254,914 | 0.05 |
| | 各種金融サービス : 0.22% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| 152,228 | BM&FBovespa SA Com NPV | 748,426 | 0.13 |
| 68,061 | BTG Pactual Group BRL1.00 | 307,155 | 0.05 |
| 17,712 | CETIP SA - Mercados Organizados Com NPV | 231,159 | 0.04 |
| | 電気 : 0.85% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| 30,487 | AES Tiete Energia SA NPV | 132,133 | 0.02 |
| 102,588 | Centrais Eletricas Brasileiras SA ADR Com NPV | 764,794 | 0.14 |
| 18,000 | Centrais Eletricas Brasileiras SA Class B Pref NPV | 151,157 | 0.03 |
| 37,100 | Centrais Eletricas Brasileiras SA Com NPV | 280,896 | 0.05 |
| 63,404 | Cia Energetica de Minas Gerais ADR NPV | 142,976 | 0.03 |
| 39,200 | Cia Energetica de Minas Gerais Pref BRL5.00 | 91,901 | 0.02 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ブラジル(つづき) : 6.83% (31 May 2016: 5.36%) | | |
| | 電気(つづき) : 0.85% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| 135,745 | Cia Energetica de Sao Paulo Class B Pref NPV | 526,727 | 0.09 |
| 3,400 | Cia Paranaense de Energia Com NPV | 21,285 | - |
| 96,729 | Cia Paranaense de Energia Pref NPV | 828,595 | 0.15 |
| 19,391 | CPFL Energia SA Com NPV | 140,882 | 0.03 |
| 201,294 | EDP - Energias do Brasil SA Com NPV | 839,692 | 0.15 |
| 74,836 | Eletropaulo Metropolitana Eletricidade de Sao Paulo SA Pref NPV | 193,478 | 0.03 |
| 58,154 | Engie Brasil Energia SA Com NPV | 616,183 | 0.11 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 食品 : 0.15% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| 25,898 | Cia Brasileira de Distribuicao Pref NPV | 417,737 | 0.07 |
| 2,300 | M Dias Branco SA Com NPV | 79,502 | 0.01 |
| 206,405 | Marfrig Global Foods SA Com NPV | 397,250 | 0.07 |
| | 林産品・紙製品 : 0.05% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 57,137 | Klabin SA NPV | 287,332 | 0.05 |
| | 各種持株会社 : 0.20% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 456,081 | Itausa - Investimentos Itau SA Pref NPV | 1,161,608 | 0.20 |
| | 保険 : 1.07% (31 May 2016: 0.96%) | | |
| 57,700 | BB Seguridade Participacoes SA Com NPV | 482,241 | 0.09 |
| 660,114 | Porto Seguro SA Com NPV | 5,584,379 | 0.98 |
| | インターネット : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 58,681 | B2W Cia Digital Com NPV | 196,557 | 0.03 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.75% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 21,900 | Gerdau SA Com NPV | 61,216 | 0.01 |
| 304,764 | Gerdau SA Pref NPV | 1,225,363 | 0.22 |
| 617,887 | Metalurgica Gerdau SA Pref NPV | 1,067,716 | 0.19 |
| 761,351 | Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Class A Pref NPV | 935,229 | 0.17 |
| 119,919 | Vale SA Pref NPV | 908,655 | 0.16 |
| | 建設機械・採掘機械 : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 659,900 | Randon SA Implementos e Participacoes Pref NPV | 691,603 | 0.12 |
| | 石油・ガス : 0.54% (31 May 2016: 2.18%) | | |
| 16,575 | Cosan SA Industria e Comercio Com NPV | 193,240 | 0.03 |
| 612,687 | Petroleo Brasileiro SA Pref NPV | 2,899,056 | 0.51 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ブラジル(つづき) : 6.83% (31 May 2016: 5.36%) | | |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| | 不動産 : 0.08% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 101,920 | BR Malls Participacoes SA Com NPV | 324,818 | 0.06 |
| 49,800 | Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes Com NPV | 136,849 | 0.02 |
| | 小売 : 0.07% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 58,453 | Lojas Americanas SA Com NPV | 220,160 | 0.04 |
| 30,805 | Lojas Americanas SA Pref NPV | 149,039 | 0.03 |
| | 通信 : 0.35% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 113,600 | Telefonica Brasil SA ADR NPV | 1,481,912 | 0.26 |
| 37,681 | Telefonica Brasil SA Pref NPV | 501,968 | 0.09 |
| | 運輸 : 0.04% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 133,600 | Rumo Logistica Operadora Multimodal SA Com NPV | 251,006 | 0.04 |
| | 水道 : 0.44% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 16,999 | Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR NPV | 149,676 | 0.03 |
| 261,800 | Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo Com NPV | 2,320,403 | 0.41 |
| | ブラジル合計 | 38,858,777 | 6.83 |
| | ケイマン諸島 : 8.13% (31 May 2016: 8.00%) | | |
| | アパレル : 0.56% (31 May 2016: 0.66%) | | |
| 441,000 | Shenzhou International Group Holdings Ltd Com HKDO.10 | 2,713,378 | 0.48 |
| 267,000 | Stella International Holdings Ltd Com HKDO.10 | 452,650 | 0.08 |
| | 化学 : 0.02% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 35,000 | Kingboard Chemical Holdings Ltd Com HKDO.10 | 97,916 | 0.02 |
| | 電子 : 0.70% (31 May 2016: 0.80%) | | |
| 424,500 | AAC Technologies Holdings Inc Class I Com USD0.01 | 3,843,220 | 0.68 |
| 33,000 | Casetek Holdings Ltd Com TWD10.00 | 90,232 | 0.02 |
| | 食品 : 0.00% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 21,100 | Qinqin Foodstuffs Group Cayman Co Ltd Com HKDO.01 | 6,692 | - |
| | ヘルスケア用品 : 0.46% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 336,000 | Hengan International Group Co Ltd Com HKDO.10 | 2,648,875 | 0.46 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ケイマン諸島(つづき) : 8.13% (31 May 2016: 8.00%) | | |
| | 各種持株会社 : 0.52% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 244,756 | CK Hutchison Holdings Ltd Com HKD1.00 | 2,981,097 | 0.52 |
| | インターネット : 4.26% (31 May 2016: 4.41%) | | |
| 88,765 | Alibaba Group Holding Ltd ADR USD0.000025 | 8,344,798 | 1.47 |
| 18,222 | Ctrip.com International Ltd ADR NPV | 824,090 | 0.14 |
| 24,500 | Tencent Holdings Ltd ADR NPV [†] | 611,030 | 0.11 |
| 578,200 | Tencent Holdings Ltd Com HKD0.00002 | 14,442,607 | 2.54 |
| | 投資会社 : 0.00% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| | 各種機械 : 0.50% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 1,414,000 | Haitian International Holdings Ltd Com HKD0.10 | 2,840,159 | 0.50 |
| | 鉱業 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 289,000 | China Hongqiao Group Ltd Com USD0.01 | 268,446 | 0.05 |
| | 医薬品 : 0.11% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 583,000 | China Shineway Pharmaceutical Group Ltd Com HKD0.10 | 620,081 | 0.11 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| | 小売 : 0.21% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 3,849,000 | China Dongxiang Group Co Ltd Class C Com HKD0.01 | 766,659 | 0.13 |
| 1,447,000 | China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd Com HKD0.10 | 431,862 | 0.08 |
| | 半導体 : 0.43% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 184,000 | ASM Pacific Technology Ltd Com HKD0.10 | 1,844,946 | 0.32 |
| 30,200 | Himax Technologies Inc ADR USD0.0001 | 222,725 | 0.04 |
| 8,800 | Silicon Motion Technology Corp ADR USD0.01 | 404,844 | 0.07 |
| | ソフトウェア : 0.31% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,907 | NetEase Inc ADR USD0.0001 | 1,771,998 | 0.31 |
| | ケイマン諸島合計 | 46,228,305 | 8.13 |
| | チリ : 1.57% (31 May 2016: 1.65%) | | |
| | 銀行 : 0.01% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 4,500 | Itau CorpBanca ADR NPV | 54,967 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | チリ(つづき) : 1.57% (31 May 2016: 1.65%) | | |
| | 飲料 : 0.62% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| 338,790 | Cia Cervecerias Unidas SA Com NPV | 3,397,867 | 0.60 |
| 5,000 | Embotelladora Andina SA Class B ADR NPV | 110,775 | 0.02 |
| | 電気 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 投資会社 : 0.48% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 2,342,628 | Administradora de Fondos de Pensiones Habitat SA Com CLP1.18 | 2,740,984 | 0.48 |
| | 水道 : 0.46% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 2,601,309 | Aguas Andinas SA Class A Com NPV | 1,623,514 | 0.29 |
| 575,233 | Inversiones Aguas Metropolitanas SA Com NPV | 979,490 | 0.17 |
| | チリ合計 | 8,907,597 | 1.57 |
| | コロンビア : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 銀行 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | チェコ共和国 : 0.09% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | 銀行 : 0.06% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 107,152 | Moneta Money Bank AS Class A Com CZK1.00 | 349,603 | 0.06 |
| | 電気 : 0.03% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 9,265 | CEZ AS Class A Com CZK100.00 | 152,442 | 0.03 |
| | チェコ共和国合計 | 502,045 | 0.09 |
| | フランス : 0.48% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| | アパレル : 0.48% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 14,962 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE Com EURO.30 | 2,725,169 | 0.48 |
| | フランス合計 | 2,725,169 | 0.48 |
| | ギリシャ : 0.02% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 小売 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,000 | FF Group Com EURO.30 | 129,365 | 0.02 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|----------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ギリシャ(つづき) : 0.02% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 通信 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | ギリシャ合計 | 129,365 | 0.02 |
| | 香港 : 6.16% (31 May 2016: 7.87%) | | |
| | 農業 : 0.32% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 4,474,000 | China Agri-Industries Holdings Ltd Com NPV | 1,796,718 | 0.32 |
| | 自動車製造 : 0.07% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 1,025,000 | Dah Chong Hong Holdings Ltd Com NPV | 409,648 | 0.07 |
| | コンピューター : 0.40% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 5,800 | Lenovo Group Ltd ADR NPV | 71,891 | 0.01 |
| 3,614,000 | Lenovo Group Ltd Com NPV | 2,238,759 | 0.39 |
| | 電気 : 0.34% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 1,182,000 | China Resources Power Holdings Co Ltd Com NPV | 1,945,961 | 0.34 |
| | ガス : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 30,000 | Beijing Enterprises Holdings Ltd Com NPV | 138,655 | 0.02 |
| | 工具・工作機械 : 0.72% (31 May 2016: 0.89%) | | |
| 1,050,500 | Techtronic Industries Co Ltd Com NPV | 4,083,280 | 0.72 |
| | 各種持株会社 : 0.00% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| | 保険 : 1.30% (31 May 2016: 1.48%) | | |
| 1,212,000 | AIA Group Ltd Com NPV | 7,386,862 | 1.30 |
| | 宿泊施設 : 0.15% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 174,000 | Galaxy Entertainment Group Ltd Com NPV | 863,085 | 0.15 |
| | 石油・ガス : 0.38% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 1,687,000 | CNOOC Ltd Com NPV | 2,129,235 | 0.38 |
| | 不動産 : 1.08% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| 314,000 | China Jinmao Holdings Group Ltd Com NPV | 84,809 | 0.01 |
| 121,000 | Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 1,582,571 | 0.28 |
| 1,492,200 | Swire Properties Ltd Com NPV | 4,506,428 | 0.79 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 香港(つづき) : 6.16% (31 May 2016: 7.87%) | | |
| | 小売 : 0.08% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 520,500 | Sun Art Retail Group Ltd Com NPV | 443,891 | 0.08 |
| | 通信 : 1.30% (31 May 2016: 2.99%) | | |
| 8,370 | China Mobile Ltd ADR NPV | 457,713 | 0.08 |
| 582,000 | China Mobile Ltd Com NPV | 6,357,119 | 1.12 |
| 464,000 | China Unicom Hong Kong Ltd Com NPV | 563,800 | 0.10 |
| | 香港合計 | 35,060,425 | 6.16 |
| | ハンガリー : 2.89% (31 May 2016: 2.59%) | | |
| | 銀行 : 1.84% (31 May 2016: 2.05%) | | |
| 384,791 | OTP Bank PLC Com HUF100.00 | 10,437,322 | 1.84 |
| | 石油・ガス : 0.84% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 76,886 | MOL Hungarian Oil & Gas PLC Com HUF1000.00 | 4,801,287 | 0.84 |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 879 | Richter Gedeon Nyrt Com HUF100.00 | 17,489 | - |
| | 通信 : 0.21% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 716,712 | Magyar Telekom Telecommunications PLC Com HUF100.00 | 1,196,903 | 0.21 |
| | ハンガリー合計 | 16,453,001 | 2.89 |
| | インド : 8.04% (31 May 2016: 10.07%) | | |
| | 農業 : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | 自動車製造 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 52,224 | Tata Motors Ltd Com INR2.00 | 226,714 | 0.04 |
| | 銀行 : 2.18% (31 May 2016: 2.97%) | | |
| 245,023 | Axis Bank Ltd Com INR2.00 | 1,680,017 | 0.29 |
| 344,300 | Bank of Baroda Com INR2.00 | 825,302 | 0.14 |
| 320,163 | HDFC Bank Ltd Com INR2.00 | 5,606,797 | 0.99 |
| 185,672 | IndusInd Bank Ltd Com INR10.00 | 2,936,891 | 0.52 |
| 238,715 | Punjab National Bank Com INR2.00 | 481,884 | 0.08 |
| 242,725 | State Bank of India Com INR1.00 | 914,089 | 0.16 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | インド(つづき) : 8.04% (31 May 2016: 10.07%) | | |
| | 飲料 : 0.00% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| | 建設資材 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 32,025 | Ambuja Cements Ltd Com INR2.00 | 98,767 | 0.02 |
| | 化学 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 15,659 | UPL Ltd Com INR2.00 | 145,062 | 0.03 |
| | コンピューター : 0.59% (31 May 2016: 1.85%) | | |
| 112,163 | Infosys Ltd Com INR5.00 | 1,595,582 | 0.28 |
| 256,696 | Wipro Ltd Com INR2.00 | 1,742,428 | 0.31 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.00% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| | 電気 : 0.88% (31 May 2016: 0.67%) | | |
| 3,572,706 | NHPC Ltd Com INR10.00 | 1,465,380 | 0.26 |
| 539,700 | NTPC Ltd Com INR10.00 | 1,285,010 | 0.23 |
| 786,999 | Power Grid Corp of India Ltd Com INR10.00 | 2,199,779 | 0.39 |
| | ヘルスケア・サービス : 0.36% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 118,563 | Apollo Hospitals Enterprise Ltd Com INR5.00 | 2,064,145 | 0.36 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.43% (31 May 2016: 0.71%) | | |
| 668,015 | Marico Ltd Com INR1.00 | 2,455,932 | 0.43 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 22,064 | JSW Steel Ltd Com INR10.00 | 553,486 | 0.10 |
| | 余暇 : 0.18% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 22,043 | Hero MotoCorp Ltd Com INR2.00 | 1,017,818 | 0.18 |
| | 各種機械 : 0.00% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | メディア : 0.54% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| 464,098 | ZEE Entertainment Enterprises Ltd Com INR1.00 | 3,072,959 | 0.54 |
| | 鉱業 : 0.86% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 743,580 | Hindalco Industries Ltd Com INR1.00 | 1,907,863 | 0.33 |
| 437,573 | Hindustan Zinc Ltd Com INR2.00 | 1,804,657 | 0.32 |
| 114,430 | NMDC Ltd Com INR1.00 | 203,871 | 0.04 |
| 284,011 | Vedanta Ltd Com INR1.00 | 952,769 | 0.17 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | インド(つづき) : 8.04% (31 May 2016: 10.07%) | | |
| | 石油・ガス : 0.41% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 142,135 | Cairn India Ltd Com INR10.00 | 521,516 | 0.09 |
| 69,258 | Hindustan Petroleum Corp Ltd Com INR10.00 | 471,938 | 0.08 |
| 39,066 | Indian Oil Corp Ltd Com INR10.00 | 175,186 | 0.03 |
| 82,025 | Reliance Industries Ltd Com INR10.00 | 1,184,797 | 0.21 |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | 不動産 : 0.35% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 347,813 | Phoenix Mills Ltd Com INR2.00 | 1,994,429 | 0.35 |
| | ソフトウェア : 1.07% (31 May 2016: 0.98%) | | |
| 518,788 | HCL Technologies Ltd Com INR2.00 | 6,104,474 | 1.07 |
| | インド合計 | 45,689,542 | 8.04 |
| | インドネシア : 1.07% (31 May 2016: 0.87%) | | |
| | 農業 : 0.15% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 143,300 | Gudang Garam Tbk PT Com IDR500.00 | 685,175 | 0.12 |
| 585,000 | Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT Com IDR4.00 | 164,245 | 0.03 |
| | 銀行 : 0.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 276,600 | Bank Danamon Indonesia Tbk PT Com NPV | 66,433 | 0.01 |
| | 石炭 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,573,100 | Adaro Energy Tbk PT Com IDR100.00 | 178,174 | 0.03 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.05% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 87,200 | Unilever Indonesia Tbk PT Com IDR10.00 | 260,989 | 0.05 |
| | 鉱業 : 0.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 270,800 | Vale Indonesia Tbk PT Com IDR25.00 | 67,438 | 0.01 |
| | 通信 : 0.82% (31 May 2016: 0.66%) | | |
| 25,478 | Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT ADR IDR50.00 | 715,804 | 0.13 |
| 14,026,702 | Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT Com IDR50.00 | 3,917,437 | 0.69 |
| | インドネシア合計 | 6,055,695 | 1.07 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ルクセンブルグ : 0.00% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.00% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| | マレーシア : 0.37% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| | 農業 : 0.02% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 101,800 | IOI Corp Bhd Com MYR0.10 | 99,270 | 0.02 |
| | 化学 : 0.05% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| 177,400 | Petronas Chemicals Group Bhd Com MYR0.10 | 271,105 | 0.05 |
| | 宿泊施設 : 0.30% (31 May 2016: 0.31%) | | |
| 1,607,400 | Genting Malaysia Bhd Com MYR0.10 | 1,686,222 | 0.30 |
| | 各種製造業 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | マレーシア合計 | 2,056,597 | 0.37 |
| | マーシャル諸島 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 運輸 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 32,849 | Costamare Inc Com USD0.0001 | 189,210 | 0.03 |
| | マーシャル諸島合計 | 189,210 | 0.03 |
| | メキシコ : 0.94% (31 May 2016: 1.54%) | | |
| | 銀行 : 0.05% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 117,546 | Gentera SAB de CV Class C Com NPV | 186,776 | 0.03 |
| 6,930 | Grupo Elektra SAB DE CV Com NPV | 86,841 | 0.02 |
| | 飲料 : 0.14% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 12,400 | Arca Continental SAB de CV Class C Com NPV | 65,920 | 0.01 |
| 93,000 | Fomento Economico Mexicano SAB de CV NPV | 730,940 | 0.13 |
| | 建設資材 : 0.17% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 27,900 | Cemex SAB de CV ADR NPV | 217,759 | 0.04 |
| 927,000 | Cemex SAB de CV NPV | 725,163 | 0.13 |
| | 化学 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 80,741 | Mexichem SAB de CV Com NPV | 192,974 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | メキシコ(つづき) : 0.94% (31 May 2016: 1.54%) | | |
| | 商業サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 4,312 | OHL Mexico SAB de CV Class C Com NPV | 3,708 | - |
| | エンジニアリング・建設 : 0.15% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 289 | Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV ADR NPV | 24,610 | - |
| 742 | Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ADR NPV | 107,163 | 0.02 |
| 31,808 | Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV Class B Com NPV | 462,729 | 0.08 |
| 6,352 | Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV Com NPV Class L | 47,634 | 0.01 |
| 27,505 | Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV Com NPV | 243,068 | 0.04 |
| | 食品 : 0.09% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 6,107 | Gruma SAB de CV Class B Com NPV | 73,500 | 0.01 |
| 145,217 | Grupo Bimbo SAB de CV Class A Com NPV | 337,108 | 0.06 |
| 39,200 | Organizacion Soriana SAB de CV Class B Com NPV | 86,796 | 0.02 |
| | 林産品・紙製品 : 0.00% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 15,723 | Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV Class A Com NPV | 27,637 | - |
| | 各種持株会社 : 0.03% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 143,700 | Alfa SAB de CV Class A Com NPV | 190,711 | 0.03 |
| | 鉱業 : 0.26% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 411,100 | Grupo Mexico SAB de CV Com NPV | 1,133,851 | 0.20 |
| 15,252 | Industrias Penoles SAB de CV Com NPV | 328,567 | 0.06 |
| | 小売 : 0.01% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 43,000 | Grupo Comercial Chedraui SA de CV Com NPV | 78,869 | 0.01 |
| | メキシコ合計 | 5,352,324 | 0.94 |
| | ナイジェリア : 0.12% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | 銀行 : 0.12% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 38,879,926 | Access Bank PLC Com NGNO.50 | 672,261 | 0.12 |
| | ナイジェリア合計 | 672,261 | 0.12 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | バプア・ニューギニア : 0.30% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| | 石油・ガス : 0.30% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 361,807 | Oil Search Ltd Com NPV | 1,722,884 | 0.30 |
| | バプア・ニューギニア合計 | 1,722,884 | 0.30 |
| | 中国 : 3.24% (31 May 2016: 2.70%) | | |
| | 航空 : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | 自動車製造 : 0.28% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 1,592,000 | Dongfeng Motor Group Co Ltd Com CNY1.00 | 1,620,395 | 0.28 |
| | 銀行 : 0.76% (31 May 2016: 0.81%) | | |
| 1,411,000 | Dongfeng Motor Group Co Ltd Com CNY1.00 | 592,112 | 0.10 |
| 1,159,000 | Bank of China Ltd Com CNY1.00 | 528,200 | 0.09 |
| 1,000,000 | Bank of Communications Co Ltd Com CNY1.00 | 770,307 | 0.14 |
| 20,188 | China Construction Bank Corp Com ADR NPV [†] | 301,003 | 0.05 |
| 1,349,000 | China Construction Bank Corp Com CNY1.00 | 1,006,969 | 0.18 |
| 125,000 | China Merchants Bank Co Ltd Com CNY1.00 | 309,090 | 0.05 |
| 122,000 | Huishang Bank Corp Ltd Com CNY1.00 | 61,891 | 0.01 |
| 1,271,000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd Com CNY1.00 | 779,151 | 0.14 |
| | 飲料 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 84,878 | Yantai Changyu Pioneer Wine Co Ltd Com CNY1.00 | 234,555 | 0.04 |
| | 建設資材 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 101,614 | CSG Holding Co Ltd Com CNY1.00 | 87,182 | 0.02 |
| | 化学 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 666,000 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd Com CNY1.00 | 349,887 | 0.06 |
| | 石炭 : 0.27% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 750,500 | China Shenhua Energy Co Ltd Com CNY1.00 | 1,554,864 | 0.27 |
| | コンピューター : 0.01% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 199,000 | BOE Technology Group Co Ltd Class B Com CNY1.00 | 57,725 | 0.01 |
| | 各種金融サービス : 0.50% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 781,000 | China Cinda Asset Management Co Ltd Com CNY1.00 | 281,422 | 0.05 |
| 166,000 | China Galaxy Securities Co Ltd Com CNY1.00 | 165,216 | 0.03 |
| 169,500 | CITIC Securities Co Ltd Com CNY1.00 | 397,492 | 0.07 |
| 94,200 | GF Securities Co Ltd Com CNY1.00 | 220,421 | 0.04 |

| | | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|--|-------------|--------------|
| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | | |
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 中国(つづき) : 3.24% (31 May 2016: 2.70%) | | |
| | 各種金融サービス(つづき) : 0.50% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 450,800 | Haitong Securities Co Ltd Com CNY1.00 | 870,606 | 0.15 |
| 402,600 | Huatai Securities Co Ltd Com CNY1.00 | 925,446 | 0.16 |
| | 電気 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | エンジニアリング・建設 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 156,000 | China Communications Services Corp Ltd Com CNY1.00 | 92,011 | 0.02 |
| | 保険 : 0.70% (31 May 2016: 0.90%) | | |
| 834,000 | China Pacific Insurance Group Co Ltd Com CNY1.00 | 3,244,435 | 0.57 |
| 62,300 | New China Life Insurance Co Ltd Com CNY1.00 | 315,048 | 0.06 |
| 926,000 | People's Insurance Co Group of China Ltd Com CNY1.00 | 389,780 | 0.07 |
| | 各種機械 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 40,000 | Shanghai Mechanical and Electrical Industry Co Ltd Com CNY1.00 | 88,760 | 0.02 |
| | 鉱業 : 0.06% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 203,000 | Jiangxi Copper Co Ltd Com CNY1.00 | 312,745 | 0.06 |
| | 各種製造業 : 0.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 78,000 | China Railway Signal & Communication Corp Ltd Com CNY1.00 | 62,548 | 0.01 |
| | 石油・ガス : 0.10% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 790,000 | China Petroleum & Chemical Corp Com CNY1.00 | 552,526 | 0.10 |
| | 不動産 : 0.05% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 225,200 | Guangzhou R&F Properties Co Ltd Com CNY0.25 | 287,138 | 0.05 |
| | 小売 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | ソフトウェア : 0.10% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 262,000 | TravelSky Technology Ltd Com CNY1.00 | 550,235 | 0.10 |
| | 通信 : 0.23% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 4,704 | China Telecom Corp Ltd ADR NPV | 229,720 | 0.04 |
| 1,374,000 | China Telecom Corp Ltd Com CNY1.00 | 663,383 | 0.12 |
| 257,880 | ZTE Corp Com CNY1.00 | 419,236 | 0.07 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 中国(つづき) : 3.24% (31 May 2016: 2.70%) | | |
| | 運輸 : 0.01% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 90,000 | Guangshen Railway Co Ltd Com CNY1.00 | 47,630 | 0.01 |
| | 中国合計 | 18,369,129 | 3.24 |
| | フィリピン : 2.01% (31 May 2016: 2.85%) | | |
| | 銀行 : 0.63% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| 2,370,991 | Metropolitan Bank & Trust Co Com PHP20.00 | 3,574,604 | 0.63 |
| | 電気 : 0.77% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 5,092,000 | Aboitiz Power Corp Com PHP1.00 | 4,395,216 | 0.77 |
| | 不動産 : 0.50% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| 4,297,500 | Ayala Land Inc Com PHP1.00 | 2,840,947 | 0.50 |
| | 通信 : 0.11% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 24,936 | PLDT Inc Com PHP5.00 | 635,810 | 0.11 |
| | フィリピン合計 | 11,446,577 | 2.01 |
| | ポーランド : 1.41% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| | 銀行 : 0.03% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| 6,059 | Bank Pekao SA Com PLN1.00 | 170,805 | 0.03 |
| | 食品 : 0.39% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 241,190 | Eurocash SA Com PLN1.00 | 2,225,745 | 0.39 |
| | 保険 : 0.69% (31 May 2016: 0.61%) | | |
| 552,600 | Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA Com PLN0.10 | 3,899,923 | 0.69 |
| | メディア : 0.20% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 196,603 | Cyfrowy Polsat SA Com PLN0.04 | 1,133,784 | 0.20 |
| | 鉱業 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 15,924 | KGHM Polska Miedz SA Com PLN10.00 | 332,208 | 0.06 |
| | 石油・ガス : 0.04% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| 194,774 | Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA Class I Com PLN1.00 | 230,455 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ポーランド(つづき) : 1.41% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| | 通信 : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | ポーランド合計 | 7,992,920 | 1.41 |
| | ポルトガル : 0.33% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | 食品 : 0.33% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 119,753 | Jeronimo Martins SGPS SA Com EUR1.00 | 1,891,218 | 0.33 |
| | ポルトガル合計 | 1,891,218 | 0.33 |
| | 韓国 : 14.21% (31 May 2016: 14.12%) | | |
| | 農業 : 0.63% (31 May 2016: 0.98%) | | |
| 39,570 | KT&G Corp Com KRW5000.00 | 3,562,502 | 0.63 |
| | 航空 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,396 | Korean Air Lines Co Ltd Com KRW5000.00 | 197,861 | 0.03 |
| | 自動車製造 : 0.14% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 241 | Hyundai Motor Co GDR NPV | 9,706 | - |
| 2,042 | Hyundai Motor Co Pref KRW5000.00 | 166,986 | 0.03 |
| 5,668 | Hyundai Motor Co 2nd Pref KRW5000.00 | 481,929 | 0.08 |
| 6,017 | Kia Motors Corp Com KRW5000.00 | 192,623 | 0.03 |
| | 自動車部品・装置 : 0.61% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| 306,170 | Nexen Tire Corp Com KRW500.00 | 3,443,938 | 0.61 |
| | 銀行 : 0.02% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 10,650 | Woori Bank Com KRW5000.00 | 109,547 | 0.02 |
| | 飲料 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 化学 : 0.34% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 5,925 | Hanwha Chemical Corp Com KRW5000.00 | 117,963 | 0.02 |
| 5,378 | LG Chem Ltd Com KRW5000.00 | 1,043,122 | 0.18 |
| 2,905 | Lotte Chemical Corp Com KRW5000.00 | 800,145 | 0.14 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.05% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| 1,539 | Amorepacific Corp Pref NPV | 255,721 | 0.04 |
| 199 | LG Household & Health Care Ltd Pref KRW5000.00 | 84,261 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 韓国(つづき) : 14.21% (31 May 2016: 14.12%) | | |
| | 販売/卸売 : 0.06% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 10,013 | Hanwha Corp Com KRW5000.00 | 302,133 | 0.05 |
| 2,587 | Hanwha Corp Pref KRW5000.00 | 37,619 | 0.01 |
| | 各種金融サービス : 1.14% (31 May 2016: 0.93%) | | |
| 90,304 | Hana Financial Group Inc Com KRW5000.00 | 2,485,378 | 0.44 |
| 61,872 | KB Financial Group Inc Com KRW5000.00 | 2,229,467 | 0.39 |
| 11,413 | Samsung Card Co Ltd Class C Com KRW5000.00 | 408,810 | 0.07 |
| 36,300 | Shinhan Financial Group Co Ltd Com KRW5000.00 | 1,370,119 | 0.24 |
| | 電気 : 0.16% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| 2,198 | Korea Electric Power Corp ADR NPV | 43,509 | 0.01 |
| 21,432 | Korea Electric Power Corp Com KRW5000.00 | 852,935 | 0.15 |
| | 電気部品・設備 : 0.27% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 37,694 | LG Electronics Inc Com KRW5000.00 | 1,449,335 | 0.26 |
| 3,097 | LG Electronics Inc Pref KRW5000.00 | 59,805 | 0.01 |
| | 電子 : 0.18% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 26,086 | LG Display Co Ltd ADR NPV | 309,641 | 0.06 |
| 28,538 | LG Display Co Ltd Com KRW5000.00 | 682,905 | 0.12 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 11,772 | Hyundai Development Co-Engineering & Construction Com KRW5000.00 | 416,131 | 0.07 |
| | 環境規制 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 食品 : 0.65% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 501 | CJ CheilJedang Corp Pref KRW5000.00 | 79,175 | 0.01 |
| 12,997 | NongShim Co Ltd Com KRW5000.00 | 3,627,109 | 0.64 |
| | ガス : 0.01% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 1,757 | Korea Gas Corp Com KRW5000.00 | 64,476 | 0.01 |
| | 保険 : 1.83% (31 May 2016: 1.93%) | | |
| 21,140 | Dongbu Insurance Co Ltd Com KRW500.00 | 1,319,159 | 0.23 |
| 36,135 | Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd Com KRW500.00 | 9,072,001 | 1.60 |
| | インターネット : 0.85% (31 May 2016: 1.05%) | | |
| 5,089 | NAVER Corp Com KRW500.00 | 3,471,603 | 0.61 |
| 5,958 | NCSOFT Corp Com KRW500.00 | 1,384,959 | 0.24 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 韓国(つづき) : 14.21% (31 May 2016: 14.12%) | | |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.75% (31 May 2016: 0.66%) | | |
| 4,850 | Hyundai Steel Co Class C Com KRW5000.00 | 207,122 | 0.04 |
| 1,700 | POSCO ADR NPV | 90,805 | 0.02 |
| 18,252 | POSCO Com KRW5000.00 | 3,899,266 | 0.69 |
| | 宿泊施設 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 金属加工/金属製品 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 鉱業 : 0.04% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 592 | Korea Zinc Co Ltd Com KRW5000.00 | 238,891 | 0.04 |
| | 各種製造業 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | 石油・ガス : 0.06% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 2,020 | SK Innovation Co Ltd Com KRW5000.00 | 263,937 | 0.05 |
| 811 | S-Oil Corp Com KRW2500.00 | 58,377 | 0.01 |
| | 医薬品 : 0.21% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 7,126 | Yuhan Corp Com KRW5000.00 | 1,202,347 | 0.21 |
| | 小売 : 0.00% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| | 半導体 : 5.74% (31 May 2016: 3.89%) | | |
| 13,827 | Samsung Electronics Co Ltd Com KRW5000.00 | 20,644,993 | 3.63 |
| 450 | Samsung Electronics Co Ltd GDR NPV | 330,525 | 0.06 |
| 2,513 | Samsung Electronics Co Ltd Pref KRW5000.00 | 2,915,944 | 0.51 |
| 238,840 | SK Hynix Inc Com KRW5000.00 | 8,774,798 | 1.54 |
| | 造船 : 0.37% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 17,134 | Hyundai Heavy Industries Co Ltd Com KRW5000.00 | 2,084,865 | 0.37 |
| | 韓国合計 | 80,844,443 | 14.21 |
| | ロシア連邦 : 3.05% (31 May 2016: 2.93%) | | |
| | 銀行 : 0.31% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 151,833 | Sberbank of Russia PJSC ADR NPV | 1,523,265 | 0.27 |
| 108,951 | VTB Bank PJSC GDR NPV | 228,579 | 0.04 |
| | 化学 : 0.00% (31 May 2016: 0.05%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | ロシア連邦(つづき) : 3.05% (31 May 2016: 2.93%) | | |
| | 電気 : 0.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 27,593 | RusHydro PJSC ADR | 39,527 | 0.01 |
| | 食品 : 0.00% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.09% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 32,005 | Severstal PAO GDR NPV | 483,596 | 0.09 |
| | 鉱業 : 0.54% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 184,331 | MMC Norilsk Nickel PJSC ADR NPV | 3,093,996 | 0.54 |
| | 石油・ガス : 2.06% (31 May 2016: 2.07%) | | |
| 538,759 | Gazprom PAO ADR NPV | 2,491,491 | 0.44 |
| 120,692 | Lukoil PJSC ADR RUB0.025 - England | 5,925,374 | 1.04 |
| 13,840 | Lukoil PJSC ADR RUB0.025 - United States of America | 681,689 | 0.12 |
| 444,739 | Rosneft OAO GDR NPV | 2,341,551 | 0.41 |
| 8,300 | Surgutneftegas OAO ADR NPV - United States of America | 39,798 | 0.01 |
| 6,134 | Surgutneftegas OAO ADR NPV - England | 27,904 | - |
| 6,872 | Tatneft PAO ADR NPV | 250,210 | 0.04 |
| | 通信 : 0.04% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 6,796 | MegaFon PJSC GDR NPV | 59,533 | 0.01 |
| 22,494 | Sistema PJSC FC GDR NPV | 186,250 | 0.03 |
| | ロシア連邦合計 | 17,372,763 | 3.05 |
| | シンガポール : 1.43% (31 May 2016: 1.42%) | | |
| | 販売/卸売 : 0.27% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 55,600 | Jardine Cycle & Carriage Ltd Com NPV | 1,555,550 | 0.27 |
| | 電子 : 0.56% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 80,375 | Flex Ltd Com NPV | 1,144,942 | 0.20 |
| 301,200 | Venture Corp Ltd Com NPV | 2,045,990 | 0.36 |
| | 食品 : 0.26% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 597,900 | Wilmar International Ltd Com NPV | 1,471,375 | 0.26 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.21%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | シンガポール(つづき) : 1.43% (31 May 2016: 1.42%) | | |
| | 通信 : 0.34% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 734,600 | Singapore Telecommunications Ltd Com NPV | 1,941,120 | 0.34 |
| | シンガポール合計 | 8,158,977 | 1.43 |
| | 南アフリカ : 2.89% (31 May 2016: 3.19%) | | |
| | 電子 : 0.00% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| | エンジニアリング・建設 : 0.07% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 767,200 | Aveng Ltd Com ZAR0.05 | 405,582 | 0.07 |
| | 食品サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| | 食品 : 1.09% (31 May 2016: 0.83%) | | |
| 25,291 | Bidvest Group Ltd Com ZAR0.05 | 293,025 | 0.05 |
| 13,608 | Pioneer Foods Group Ltd Com ZAR0.10 | 151,275 | 0.03 |
| 391,266 | Shoprite Holdings Ltd Com ZAR1.13 | 5,219,763 | 0.92 |
| 17,979 | Tiger Brands Ltd Com ZAR0.10 | 506,053 | 0.09 |
| | 林産品・紙製品 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,710 | Mondi Ltd Com NPV | 95,283 | 0.02 |
| 21,032 | Sappi Ltd Com ZAR1.00 | 124,884 | 0.02 |
| | 保険 : 0.81% (31 May 2016: 1.04%) | | |
| 31,152 | Liberty Holdings Ltd Com ZAR0.0833 | 246,840 | 0.04 |
| 991,346 | Sanlam Ltd Com ZAR0.01 | 4,361,534 | 0.77 |
| | 鉱業 : 0.27% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| 13,311 | Anglo American Platinum Ltd Com ZAR0.10 | 274,306 | 0.05 |
| 8,675 | AngloGold Ashanti Ltd ADR NPV | 94,861 | 0.02 |
| 45,726 | AngloGold Ashanti Ltd Com ZAR0.25 | 505,940 | 0.09 |
| 12,500 | Gold Fields Ltd ADR NPV | 38,312 | 0.01 |
| 113,006 | Gold Fields Ltd Com ZAR0.50 | 359,170 | 0.06 |
| 25,099 | Sibanye Gold Ltd ADR NPV | 208,447 | 0.04 |
| | 事務用機器 : 0.28% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 339,450 | Reunert Ltd Com ZAR0.10 | 1,589,162 | 0.28 |
| | 石油・ガス : 0.20% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 42,925 | Sasol Ltd Com NPV | 1,161,932 | 0.20 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 南アフリカ(つづき) : 2.89% (31 May 2016: 3.19%) | | |
| | 包装・容器 : 0.12% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 616,316 | Nampak Ltd Com ZAR0.05 | 695,134 | 0.12 |
| | 小売 : 0.01% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 14,975 | Pick n Pay Stores Ltd Com ZAR0.01 | 69,952 | 0.01 |
| | 南アフリカ合計 | 16,401,455 | 2.89 |
| | スイス : 0.30% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 飲料 : 0.30% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 79,561 | Coca-Cola HBC AG Com CHF6.70 | 1,688,866 | 0.30 |
| | スイス合計 | 1,688,866 | 0.30 |
| | 台湾 : 11.39% (31 May 2016: 10.79%) | | |
| | 航空 : 0.03% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 542,000 | China Airlines Ltd Com TWD10.00 | 162,908 | 0.03 |
| | アパレル : 0.91% (31 May 2016: 1.13%) | | |
| 4,138,000 | Pou Chen Corp Com TWD10.00 | 5,176,882 | 0.91 |
| | 自動車製造 : 0.00% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 建設資材 : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 170,000 | Asia Cement Corp Com TWD10.00 | 149,743 | 0.03 |
| 31,000 | Nien Made Enterprise Co Ltd Com TWD10.00 | 346,735 | 0.06 |
| | 化学 : 0.11% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 155,000 | Formosa Chemicals & Fibre Corp Com TWD10.00 | 484,603 | 0.08 |
| 130,000 | Taiwan Fertilizer Co Ltd Com TWD10.00 | 165,289 | 0.03 |
| | コンピューター : 0.66% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 3,024,000 | Compal Electronics Inc Com TWD10.00 | 1,719,637 | 0.30 |
| 2,574,061 | Innolux Corp Com TWD10.00 | 886,340 | 0.15 |
| 483,000 | Inventec Corp Com TWD10.00 | 326,945 | 0.06 |
| 415,061 | Lite-On Technology Corp Com TWD10.00 | 654,373 | 0.11 |
| 291,504 | Wistron Corp Com TWD10.00 | 208,296 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 台湾(つづき) : 11.39% (31 May 2016: 10.79%) | | |
| | 電気部品・設備 : 0.30% (31 May 2016: 0.31%) | | |
| 339,897 | Delta Electronics Inc Com TWD10.00 | 1,703,591 | 0.30 |
| | 電子 : 1.55% (31 May 2016: 1.45%) | | |
| 2,190,000 | AU Optronics Corp Com TWD10.00 | 788,449 | 0.14 |
| 29,000 | Cheng Uei Precision Industry Co Ltd Com TWD10.00 | 32,732 | 0.01 |
| 2,916,852 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd Com TWD10.00 | 7,508,791 | 1.32 |
| 45,000 | Simplo Technology Co Ltd Com TWD10.00 | 133,138 | 0.02 |
| 259,000 | WPG Holdings Ltd Com TWD10.00 | 320,368 | 0.06 |
| | 食品 : 0.15% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 497,000 | Uni-President Enterprises Corp Class C Com TWD10.00 | 851,385 | 0.15 |
| | 余暇 : 0.41% (31 May 2016: 0.45%) | | |
| 390,000 | Giant Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 2,321,793 | 0.41 |
| | 宿泊施設 : 0.24% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 259,243 | Formosa International Hotels Corp Com TWD10.00 | 1,384,750 | 0.24 |
| | 各種製造業 : 0.57% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 28,000 | Largan Precision Co Ltd Com TWD10.00 | 3,237,223 | 0.57 |
| | 石油・ガス : 0.14% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 245,000 | Formosa Petrochemical Corp Com TWD10.00 | 824,405 | 0.14 |
| | 小売 : 0.60% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 226,000 | Far Eastern Department Stores Ltd Com TWD10.00 | 114,691 | 0.02 |
| 436,000 | President Chain Store Corp Com TWD10.00 | 3,279,610 | 0.58 |
| | 半導体 : 5.36% (31 May 2016: 4.36%) | | |
| 8,670 | Advanced Semiconductor Engineering Inc ADR NPV | 46,515 | 0.01 |
| 183,000 | eMemory Technology Inc Com TWD10.00 | 1,794,230 | 0.31 |
| 88,000 | MediaTek Inc Com TWD10.00 | 612,242 | 0.11 |
| 126,000 | Powertech Technology Inc Com TWD10.00 | 324,359 | 0.06 |
| 55,000 | Realtek Semiconductor Corp Com TWD10.00 | 171,524 | 0.03 |
| 109,117 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR NPV | 3,238,047 | 0.57 |
| 3,719,000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 21,381,946 | 3.76 |
| 93,600 | United Microelectronics Corp ADR NPV | 169,884 | 0.03 |
| 491,000 | United Microelectronics Corp Com TWD10.00 | 173,690 | 0.03 |
| 156,000 | Vanguard International Semiconductor Corp Com TWD10.00 | 293,910 | 0.05 |
| 802,180 | Win Semiconductors Corp Com TWD10.00 | 2,281,480 | 0.40 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | 台湾(つづき) : 11.39% (31 May 2016: 10.79%) | | |
| | 通信 : 0.27% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 658,000 | Far EastOne Telecommunications Co Ltd Com TWD10.00 | 1,525,624 | 0.27 |
| | 繊維 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 台湾合計 | 64,796,128 | 11.39 |
| | タイ : 1.33% (31 May 2016: 1.75%) | | |
| | 銀行 : 0.76% (31 May 2016: 0.99%) | | |
| 367,100 | Bangkok Bank PCL NVDR THB10.00 | 1,607,628 | 0.28 |
| 576,200 | Kasikornbank PCL THB10.00 | 2,745,386 | 0.48 |
| | 建設資材 : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | 化学 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 49,100 | PTT Global Chemical PCL THB10.00 [†] | 86,181 | 0.02 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.08% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 42,000 | Airports of Thailand PCL THB10.00 | 474,390 | 0.08 |
| | ヘルスケア・サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | 各種持株会社 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 15,500 | Siam Cement PCL THB1.00 [†] | 207,220 | 0.04 |
| | 石油・ガス : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 207,100 | PTT Exploration & Production PCL THB1.00 | 479,593 | 0.09 |
| 8,200 | PTT PCL THB10.00 [†] | 80,323 | 0.01 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| | 小売 : 0.06% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| 1,219,800 | Home Product Center PCL THB1.00 [†] | 353,843 | 0.06 |
| | 通信 : 0.27% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 1,068,300 | Intouch Holdings PCL THB1.00 | 1,493,335 | 0.26 |
| 177,824 | Samart Corp PCL THB1.00 | 64,043 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | タイ(つづき) : 1.33% (31 May 2016: 1.75%) | | |
| | ワラント : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 286,960 | Samart Corp PCL | 5,107 | - |
| | タイ合計 | 7,597,049 | 1.33 |
| | トルコ : 2.53% (31 May 2016: 3.31%) | | |
| | 航空・防衛 : 0.00% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| | 銀行 : 0.31% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 638,500 | Akbank TAS Com TRY1.00 | 1,408,730 | 0.25 |
| 44,574 | Turkiye Is Bankasi Class C Com TRY1.00 | 62,789 | 0.01 |
| 303,525 | Yapi ve Kredi Bankasi AS Com TRY1.00 | 276,632 | 0.05 |
| | 化学 : 0.66% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| 1,347,471 | Aksa Akriklik Kimya Sanayii AS Com TRY1.00 | 3,529,016 | 0.62 |
| 208,022 | Petkim Petrokimya Holding AS Class A Com TRY1.00 | 221,139 | 0.04 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 食品 : 0.00% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | 各種持株会社 : 0.16% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 164,811 | Haci Omer Sabanci Holding AS Com TRY1.00 | 420,824 | 0.07 |
| 133,935 | KOC Holding AS Class A Com TRY1.00 | 487,296 | 0.09 |
| | 住宅家具 : 0.05% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 53,859 | Arcelik AS Class A Com TRY1.00 | 314,235 | 0.05 |
| | 家庭用品 : 0.03% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 152,922 | Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS Com TRY1.00 | 147,178 | 0.03 |
| | 保険 : 0.45% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| 1,882,222 | Anadolu Hayat Emeklilik AS Com TRY1.00 | 2,549,849 | 0.45 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 508,401 | Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS Com TRY1.00 | 699,111 | 0.12 |
| | 各種機械 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,564 | Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS Com TRY1.00 | 161,095 | 0.03 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 89.23% (31 May 2016: 90.92%) | | |
| | トルコ(つづき) : 2.53% (31 May 2016: 3.31%) | | |
| | 通信 : 0.72% (31 May 2016: 1.12%) | | |
| 2,551,575 | Turk Telekomunikasyon AS Class A Com TRY1.00 | 4,104,041 | 0.72 |
| | トルコ合計 | 14,381,935 | 2.53 |
| | アラブ首長国連邦 : 1.20% (31 May 2016: 1.17%) | | |
| | 銀行 : 1.20% (31 May 2016: 1.08%) | | |
| 318,544 | First Gulf Bank PJSC Com AED1.00 | 1,016,902 | 0.18 |
| 1,008,654 | National Bank of Abu Dhabi PJSC Com AED1.00 | 2,593,827 | 0.46 |
| 2,643,900 | Union National Bank PJSC Com AED1.00 | 3,203,331 | 0.56 |
| | 通信 : 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | アラブ首長国連邦合計 | 6,814,060 | 1.20 |
| | 英国 : 2.59% (31 May 2016: 1.22%) | | |
| | 銀行 : 1.54% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 857,116 | HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 6,748,836 | 1.19 |
| 246,750 | Standard Chartered PLC Com USD0.50 | 1,976,135 | 0.35 |
| | 鉱業 : 1.05% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| 327,495 | Antofagasta PLC Com GBPO.05 | 2,821,243 | 0.50 |
| 84,507 | Rio Tinto PLC Com GBPO.10 | 3,156,669 | 0.55 |
| | 英国合計 | 14,702,883 | 2.59 |
| | 米国 : 0.95% (31 May 2016: 0.81%) | | |
| | コンピューター : 0.90% (31 May 2016: 0.81%) | | |
| 92,479 | Cognizant Technology Solutions Corp Class A Com USD0.01 | 5,094,206 | 0.90 |
| | 小売 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 10,118 | Yum China Holdings Inc Com USD0.01 | 284,469 | 0.05 |
| | 米国合計 | 5,378,675 | 0.95 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|--------------------|--------------|
| | バージン諸島 : 0.30% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| | 各種機械 : 0.30% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 91,249 | Hollysys Automation Technologies Ltd Com USD0.0001 | 1,724,149 | 0.30 |
| | バージン諸島合計 | 1,724,149 | 0.30 |
| | 株式合計 | 507,395,457 | 89.23 |
| | 投資ファンド : 3.71% (31 May 2016: 3.24%) | | |
| | アイルランド : 2.53% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| 746,268 | iShares MSCI Eastern Europe Capped Fund | 14,393,047 | 2.53 |
| | ルクセンブルグ : 1.18% (31 May 2016: 1.37%) | | |
| 23,866 | Schroder International Selection Fund - Asian Smaller Companies Class I Acc | 6,710,472 | 1.18 |
| | 投資ファンド合計 | 21,103,519 | 3.71 |
| | 参加証券 : 0.44% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| | スイス : 0.44% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 700,659 | Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd 17/04/2017 | 2,542,903 | 0.44 |
| | スイス合計 | 2,542,903 | 0.44 |
| | 参加証券合計 | 2,542,903 | 0.44 |
| | 権利証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | ブラジル : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 5,284 | Marcopolo SA NPV | 23 | - |
| | ブラジル合計 | 23 | - |
| | 権利証券合計 | 23 | - |

| 契約数 | 先物契約** | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---|--------------------------------------|------------------|---------------|
| | : -0.12% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 505 | FTSE/JSE Top 40 Future December 2016 | (587,022) | (0.10) |
| 398 | MXS Future December 2016 | (111,587) | (0.02) |
| 未決済先物契約に係る評価損合計 | | (698,609) | (0.12) |
| 先物契約合計 | | (698,609) | (0.12) |
| 先渡為替契約: -0.59% (31 May 2016: -0.22%) | | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|------------|-----|-----------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | GBP | 2,101,100 | USD | 2,608,390 | 15/12/2016 | 17,739 | 0.01 |
| UBS | MXN | 81,660,171 | USD | 3,969,141 | 09/12/2016 | 17,210 | - |
| UBS | EUR | 4,437,400 | USD | 4,699,020 | 15/12/2016 | 11,228 | - |
| UBS | USD | 1,072,771 | EUR | 1,000,155 | 15/12/2016 | 11,118 | - |
| UBS | USD | 303,469 | EUR | 276,921 | 15/12/2016 | 9,521 | - |
| UBS | USD | 155,207 | EUR | 140,341 | 15/12/2016 | 6,237 | - |
| UBS | USD | 363,919 | EUR | 339,285 | 15/12/2016 | 3,772 | - |
| UBS | USD | 62,411 | EUR | 57,312 | 15/12/2016 | 1,575 | - |
| UBS | EUR | 432,900 | USD | 458,423 | 15/12/2016 | 1,095 | - |
| UBS | USD | 94,112 | EUR | 87,742 | 15/12/2016 | 975 | - |
| UBS | USD | 60,457 | EUR | 56,365 | 15/12/2016 | 626 | - |
| UBS | USD | 53,803 | EUR | 50,128 | 15/12/2016 | 592 | - |
| UBS | USD | 55,352 | EUR | 51,605 | 15/12/2016 | 574 | - |
| UBS | USD | 81,966 | EUR | 76,734 | 15/12/2016 | 514 | - |
| UBS | EUR | 49,090 | USD | 51,885 | 15/12/2016 | 224 | - |
| UBS | USD | 16,603 | EUR | 15,479 | 15/12/2016 | 172 | - |
| UBS | GBP | 30,900 | USD | 38,470 | 15/12/2016 | 151 | - |
| UBS | USD | 12,308 | EUR | 11,475 | 15/12/2016 | 128 | - |
| UBS | USD | 4,676 | EUR | 4,304 | 15/12/2016 | 108 | - |
| UBS | EUR | 8,601 | USD | 9,064 | 15/12/2016 | 66 | - |
| UBS | EUR | 27,975 | USD | 29,644 | 15/12/2016 | 51 | - |
| UBS | USD | 1,620 | EUR | 1,510 | 15/12/2016 | 17 | - |
| UBS | USD | 2,061 | EUR | 1,929 | 15/12/2016 | 13 | - |
| UBS | EUR | 6,318 | USD | 6,703 | 15/12/2016 | 3 | - |
| UBS | USD | 1,202 | EUR | 1,131 | 15/12/2016 | 1 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 83,710 | 0.01 |
| UBS | USD | 1,285 | EUR | 1,213 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | USD | 408 | EUR | 387 | 15/12/2016 | (3) | - |
| UBS | USD | 2,350 | GBP | 1,883 | 15/12/2016 | (4) | - |
| UBS | USD | 1,549 | GBP | 1,250 | 15/12/2016 | (13) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.59% (31 May 2016: -0.22%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 4,447 | EUR | 4,207 | 15/12/2016 | (19) | - |
| UBS | USD | 9,635 | GBP | 7,735 | 15/12/2016 | (32) | - |
| UBS | USD | 11,078 | GBP | 8,893 | 15/12/2016 | (37) | - |
| UBS | USD | 4,493 | GBP | 3,626 | 15/12/2016 | (39) | - |
| UBS | USD | 3,067 | GBP | 2,490 | 15/12/2016 | (46) | - |
| UBS | USD | 19,196 | EUR | 18,128 | 15/12/2016 | (47) | - |
| UBS | USD | 14,572 | GBP | 11,698 | 15/12/2016 | (48) | - |
| UBS | EUR | 32,300 | USD | 34,335 | 15/12/2016 | (49) | - |
| UBS | USD | 15,942 | EUR | 15,066 | 15/12/2016 | (50) | - |
| UBS | EUR | 1,838 | USD | 2,014 | 15/12/2016 | (63) | - |
| UBS | USD | 12,275 | GBP | 9,877 | 15/12/2016 | (70) | - |
| UBS | GBP | 69,041 | USD | 86,363 | 15/12/2016 | (70) | - |
| UBS | USD | 21,292 | GBP | 17,092 | 15/12/2016 | (71) | - |
| UBS | USD | 22,429 | GBP | 18,004 | 15/12/2016 | (74) | - |
| UBS | USD | 177,333 | EUR | 167,144 | 15/12/2016 | (89) | - |
| UBS | EUR | 80,886 | USD | 85,983 | 15/12/2016 | (123) | - |
| UBS | EUR | 10,500 | USD | 11,275 | 15/12/2016 | (129) | - |
| UBS | GBP | 147,710 | USD | 184,770 | 15/12/2016 | (150) | - |
| UBS | EUR | 211,050 | USD | 224,209 | 15/12/2016 | (182) | - |
| UBS | USD | 31,824 | GBP | 25,611 | 15/12/2016 | (187) | - |
| UBS | EUR | 9,398 | USD | 10,234 | 15/12/2016 | (259) | - |
| UBS | EUR | 27,900 | USD | 29,946 | 15/12/2016 | (330) | - |
| UBS | EUR | 16,493 | USD | 17,920 | 15/12/2016 | (413) | - |
| UBS | EUR | 553,739 | USD | 588,265 | 15/12/2016 | (477) | - |
| UBS | USD | 123,345 | GBP | 99,162 | 15/12/2016 | (596) | - |
| UBS | USD | 88,243 | GBP | 71,107 | 15/12/2016 | (633) | - |
| UBS | EUR | 51,741 | USD | 55,559 | 15/12/2016 | (637) | - |
| UBS | USD | 174,467 | GBP | 140,099 | 15/12/2016 | (640) | - |
| UBS | EUR | 847,000 | USD | 899,810 | 15/12/2016 | (730) | - |
| UBS | EUR | 19,338 | USD | 21,387 | 15/12/2016 | (860) | - |
| UBS | EUR | 42,245 | USD | 45,934 | 15/12/2016 | (1,091) | - |
| UBS | USD | 84,728 | GBP | 68,803 | 15/12/2016 | (1,267) | - |
| UBS | GBP | 182,688 | USD | 230,044 | 15/12/2016 | (1,706) | - |
| UBS | EUR | 267,696 | USD | 285,994 | 15/12/2016 | (1,838) | - |
| UBS | USD | 964,092 | GBP | 773,903 | 15/12/2016 | (3,195) | - |
| UBS | GBP | 227,043 | USD | 286,974 | 15/12/2016 | (3,197) | - |
| UBS | GBP | 271,231 | USD | 342,826 | 15/12/2016 | (3,819) | - |
| UBS | GBP | 338,714 | USD | 428,122 | 15/12/2016 | (4,769) | - |
| UBS | USD | 1,413,237 | GBP | 1,136,160 | 15/12/2016 | (6,830) | - |
| UBS | GBP | 508,299 | USD | 642,472 | 15/12/2016 | (7,157) | - |
| UBS | GBP | 518,752 | USD | 655,683 | 15/12/2016 | (7,304) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.59% (31 May 2016: -0.22%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| UBS | USD | 1,058,623 | GBP | 853,052 | 15/12/2016 | (7,593) | - |
| UBS | EUR | 337,953 | USD | 367,463 | 15/12/2016 | (8,730) | - |
| UBS | EUR | 450,677 | USD | 490,031 | 15/12/2016 | (11,642) | - |
| UBS | USD | 3,581,875 | GBP | 2,875,267 | 15/12/2016 | (11,872) | - |
| UBS | USD | 1,968,239 | GBP | 1,585,488 | 15/12/2016 | (13,435) | - |
| UBS | EUR | 1,474,001 | USD | 1,602,712 | 15/12/2016 | (38,077) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,662,388 | USD | 1,807,550 | 15/12/2016 | (42,944) | (0.01) |
| UBS | ZAR | 89,928,571 | USD | 6,468,198 | 09/12/2016 | (63,398) | (0.01) |
| UBS | EUR | 2,479,437 | USD | 2,695,944 | 15/12/2016 | (64,050) | (0.01) |
| UBS | MXN | 97,204,341 | USD | 5,008,324 | 09/12/2016 | (263,164) | (0.05) |
| UBS | EUR | 10,390,637 | USD | 11,297,958 | 15/12/2016 | (268,417) | (0.05) |
| UBS | ZAR | 132,134,774 | USD | 9,706,796 | 09/12/2016 | (296,029) | (0.05) |
| UBS | GBP | 23,227,937 | USD | 29,359,253 | 15/12/2016 | (327,060) | (0.06) |
| UBS | EUR | 29,270,649 | USD | 31,826,591 | 15/12/2016 | (756,138) | (0.13) |
| UBS | GBP | 87,823,034 | USD | 111,005,066 | 15/12/2016 | (1,236,587) | (0.22) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (3,458,481) | (0.60) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (3,374,771) | (0.59) |

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 526,968,522 | 92.67 |
| 現金および現金等価物 [*] | 29,321,841 | 5.16 |
| その他の純資産 | 12,334,669 | 2.17 |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>568,625,032</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 88.03 |
| 投資ファンドおよびAIF | 3.64 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.01 |
| その他の資産 | 8.32 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される2,833,828米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

† ファンドの純資産の0.30%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

** 先物契約の取引相手方は、ゴールドマン・サックスである。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

[次へ](#)

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券 : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | オーストラリア : 0.19% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| | 社債 : 0.19% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| 1,265,000 | BlueScope Steel Finance Ltd / BlueScope Steel Finance USA LLC 6.5% 15/05/2021 | 1,334,575 | 0.14 |
| 400,000 | Broadspectrum Ltd 8.375% 15/05/2020 | 425,500 | 0.05 |
| 95,290 | Midwest Vanadium Pty Ltd 11.5% 15/02/2018** | 3,812 | - |
| | オーストラリア合計 | 1,763,887 | 0.19 |
| | オーストリア : 0.06% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| | 社債 : 0.06% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 200,000 | JBS Investments GmbH 7.25% 03/04/2024 | 201,750 | 0.02 |
| 400,000 | JBS Investments GmbH 7.75% 28/10/2020 | 419,000 | 0.04 |
| | オーストリア合計 | 620,750 | 0.06 |
| | バミューダ : 0.85% (31 May 2016: 0.75%) | | |
| | 社債 : 0.85% (31 May 2016: 0.75%) | | |
| 250,000 | Aircastle Ltd 4.625% 15/12/2018 | 261,250 | 0.03 |
| 125,000 | Aircastle Ltd 5% 01/04/2023 | 126,094 | 0.01 |
| 475,000 | Aircastle Ltd 5.125% 15/03/2021 | 501,719 | 0.05 |
| 1,025,000 | Aircastle Ltd 6.25% 01/12/2019 | 1,109,562 | 0.12 |
| 1,175,000 | Digicel Group Ltd 8.25% 30/09/2020 | 989,937 | 0.11 |
| 800,000 | Digicel Ltd 6.75% 01/03/2023 | 692,000 | 0.07 |
| 500,000 | Fly Leasing Ltd 6.375% 15/10/2021 | 512,397 | 0.05 |
| 725,000 | NCL Corp Ltd 4.625% 15/11/2020 | 737,687 | 0.08 |
| 225,000 | Viking Cruises Ltd 6.25% 15/05/2025 | 204,187 | 0.02 |
| 375,000 | Viking Cruises Ltd 8.5% 15/10/2022 | 383,437 | 0.04 |
| 120,000 | Weatherford International Ltd 4.5% 15/04/2022 | 104,626 | 0.01 |
| 275,000 | Weatherford International Ltd 7% 15/03/2038 | 220,000 | 0.02 |
| 1,470,000 | Weatherford International Ltd 7.75% 15/06/2021 | 1,442,437 | 0.15 |
| 110,000 | Weatherford International Ltd 8.25% 15/06/2023 | 107,525 | 0.01 |
| 750,000 | Weatherford International Ltd 9.875% 15/02/2024 | 774,375 | 0.08 |
| | バミューダ合計 | 8,167,233 | 0.85 |
| | カナダ : 4.81% (31 May 2016: 4.78%) | | |
| | 社債 : 4.81% (31 May 2016: 4.78%) | | |
| 1,435,000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc 4.625% 15/01/2022 | 1,461,906 | 0.16 |
| 250,000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc 6% 01/04/2022 | 261,250 | 0.03 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | カナダ(つづき) : 4.81% (31 May 2016: 4.78%) | | |
| | 社債(つづき) : 4.81% (31 May 2016: 4.78%) | | |
| 325,000 | Air Canada 7.75% 15/04/2021 | 356,687 | 0.04 |
| 300,000 | Alamos Gold Inc 7.75% 01/04/2020 | 315,000 | 0.03 |
| 1,045,000 | Baytex Energy Corp 5.625% 01/06/2024 | 880,412 | 0.09 |
| 1,135,000 | Bombardier Inc 6% 15/10/2022 | 1,001,637 | 0.11 |
| 425,000 | Bombardier Inc 6.125% 15/01/2023 | 368,687 | 0.04 |
| 275,000 | Bombardier Inc 7.5% 15/03/2025 | 245,822 | 0.03 |
| 1,500,000 | Bombardier Inc 8.75% 01/12/2021 | 1,492,500 | 0.16 |
| 675,000 | Brookfield Residential Properties Inc 6.375% 15/05/2025 | 675,000 | 0.07 |
| 2,400,000 | Cascades Inc 5.5% 15/07/2022 | 2,445,000 | 0.26 |
| 1,185,000 | Cascades Inc 5.75% 15/07/2023 | 1,201,294 | 0.13 |
| 84,570 | Catalyst Paper Corp PIK 30/10/2017 [†] | 54,548 | 0.01 |
| 9,419 | Catalyst Paper Corp PIK 30/10/2017 ^{**} | 7,535 | - |
| 500,000 | Concordia International Corp 7% 15/04/2023 | 192,500 | 0.02 |
| 125,000 | Concordia International Corp 9.5% 21/10/2022 | 55,000 | 0.01 |
| 925,000 | Cott Corp 5.5% 01/07/2024 | 1,020,048 | 0.11 |
| 1,460,000 | Eldorado Gold Corp 6.125% 15/12/2020 | 1,478,250 | 0.16 |
| 1,000,000 | First Quantum Minerals Ltd 7.25% 15/10/2019 | 1,011,250 | 0.11 |
| 3,090,000 | First Quantum Minerals Ltd 7.25% 15/05/2022 | 3,012,750 | 0.32 |
| 1,175,000 | Garda World Security Corp 7.25% 15/11/2021 | 1,092,750 | 0.12 |
| 2,095,000 | HudBay Minerals Inc 9.5% 01/10/2020 | 2,206,297 | 0.23 |
| 500,000 | IAMGOLD Corp 6.75% 01/10/2020 | 490,000 | 0.05 |
| 700,000 | Kissner Holdings LP / Kissner Milling Co Ltd / BSC Holding Inc /Kissner USA 8.375% 01/12/2022 | 698,250 | 0.07 |
| 275,000 | LG FinanceCo Corp 5.875% 01/11/2024 | 275,000 | 0.03 |
| 175,000 | Mattamy Group Corp 6.5% 15/11/2020 | 175,000 | 0.02 |
| 300,000 | MDC Partners Inc 6.5% 01/05/2024 | 259,125 | 0.03 |
| 1,050,000 | MEG Energy Corp 6.375% 30/01/2023 | 931,875 | 0.10 |
| 75,000 | MEG Energy Corp 7% 31/03/2024 | 65,812 | 0.01 |
| 525,000 | Millar Western Forest Products Ltd 8.5% 01/04/2021 ^{**} | 309,750 | 0.02 |
| 450,000 | Novelis Inc 8.375% 15/12/2017 | 451,800 | 0.05 |
| 2,145,000 | Open Text Corp 5.625% 15/01/2023 | 2,193,262 | 0.23 |
| 995,000 | Open Text Corp 5.875% 01/06/2026 | 1,037,287 | 0.11 |
| 500,000 | Paramount Resources Ltd 6.875% 30/06/2023 | 528,750 | 0.06 |
| 300,000 | Precision Drilling Corp 5.25% 15/11/2024 | 268,500 | 0.03 |
| 1,430,000 | Precision Drilling Corp 6.5% 15/12/2021 | 1,422,850 | 0.15 |
| 26,000 | Precision Drilling Corp 6.625% 15/11/2020 | 26,260 | - |
| 500,000 | Precision Drilling Corp 7.75% 15/12/2023 | 508,750 | 0.05 |
| 675,000 | Quebecor Media Inc 5.75% 15/01/2023 | 696,094 | 0.07 |
| 500,000 | Sanjel Corp 7.5% 19/06/2019 ^{**} | 750 | - |
| 152,000 | Teck Resources Ltd 3% 01/03/2019 | 151,620 | 0.02 |
| 50,000 | Teck Resources Ltd 4.5% 15/01/2021 | 51,187 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | カナダ(つづき) : 4.81% (31 May 2016: 4.78%) | | |
| | 社債(つづき) : 4.81% (31 May 2016: 4.78%) | | |
| 600,000 | Teck Resources Ltd 4.75% 15/01/2022 | 610,500 | 0.06 |
| 300,000 | Teck Resources Ltd 6% 15/08/2040 | 292,500 | 0.03 |
| 2,250,000 | Teck Resources Ltd 6.125% 01/10/2035 | 2,261,700 | 0.24 |
| 725,000 | Teck Resources Ltd 6.25% 15/07/2041 | 730,474 | 0.08 |
| 960,000 | Teck Resources Ltd 8.5% 01/06/2024 | 1,123,200 | 0.12 |
| 1,860,000 | Valeant Pharmaceuticals International Inc 5.375% 15/03/2020 | 1,571,700 | 0.17 |
| 5,520,000 | Valeant Pharmaceuticals International Inc 5.625% 01/12/2021 | 4,278,000 | 0.45 |
| 205,000 | Valeant Pharmaceuticals International Inc 5.875% 15/05/2023 | 153,750 | 0.02 |
| 2,398,000 | Valeant Pharmaceuticals International Inc 6.125% 15/04/2025 | 1,780,515 | 0.18 |
| 525,000 | Valeant Pharmaceuticals International Inc 6.75% 15/08/2018 | 500,062 | 0.05 |
| 700,000 | Valeant Pharmaceuticals International Inc 7.5% 15/07/2021 | 594,125 | 0.06 |
| | カナダ合計 | 45,274,571 | 4.81 |
| | ケイマン諸島 : 0.42% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| | 社債 : 0.42% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 150,000 | BCP Singapore VI Cayman Financing Co Ltd 8% 15/04/2021 ** | 147,750 | 0.02 |
| 400,000 | Sable International Finance Ltd 6.875% 01/08/2022 | 417,000 | 0.04 |
| 350,000 | Transocean Inc 5.55% 15/10/2022 | 310,625 | 0.03 |
| 1,700,000 | Transocean Inc 6% 15/03/2018 | 1,719,125 | 0.18 |
| 275,000 | Transocean Inc 9% 15/07/2023 | 279,812 | 0.03 |
| 200,000 | UPCB Finance IV Ltd 5.375% 15/01/2025 | 198,124 | 0.02 |
| 900,000 | Wynn Macau Ltd 5.25% 15/10/2021 | 909,000 | 0.10 |
| | ケイマン諸島合計 | 3,981,436 | 0.42 |
| | フランス : 1.16% (31 May 2016: 1.38%) | | |
| | 社債 : 1.16% (31 May 2016: 1.38%) | | |
| 1,965,000 | HomeVi SAS 6.875% 15/08/2021 | 2,226,404 | 0.24 |
| 597,552 | Novasep Holding SAS FRN 31/05/2019 † | 530,085 | 0.06 |
| 1,015,000 | SFR Group SA 5.625% 15/05/2024 | 1,117,503 | 0.12 |
| 3,900,000 | SFR Group SA 6% 15/05/2022 '144A ' | 3,943,875 | 0.42 |
| 1,675,000 | SFR Group SA 6% 15/05/2022 'REGS' | 1,693,844 | 0.18 |
| 1,300,000 | SFR Group SA 7.375% 01/05/2026 | 1,301,625 | 0.14 |
| | フランス合計 | 10,813,336 | 1.16 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | ドイツ : 0.68% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| | 社債 : 0.68% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 600,000 | IHO Verwaltungs GmbH PIK 15/09/2021 | 607,500 | 0.06 |
| 200,000 | IHO Verwaltungs GmbH PIK 15/09/2023 '144A' | 195,500 | 0.02 |
| 2,090,000 | IHO Verwaltungs GmbH PIK 15/09/2023 'REGS' | 2,216,848 | 0.24 |
| 2,090,000 | Unitymedia GmbH 3.75% 15/01/2027 | 2,060,491 | 0.22 |
| 600,000 | Unitymedia GmbH 6.125% 15/01/2025 | 613,500 | 0.07 |
| 600,000 | Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.5% 15/01/2023 | 617,250 | 0.07 |
| | ドイツ合計 | 6,311,089 | 0.68 |
| | アイルランド : 0.97% (31 May 2016: 1.64%) | | |
| | 社債 : 0.97% (31 May 2016: 1.64%) | | |
| 450,000 | AerCap Ireland Capital Ltd / AerCap Global Aviation Trust 3.75% 15/05/2019 | 459,000 | 0.05 |
| 2,480,000 | Allegion PLC 5.875% 15/09/2023 | 2,644,300 | 0.29 |
| 200,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc FRN 15/12/2019 | 204,000 | 0.02 |
| 400,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 6% 30/06/2021 | 405,000 | 0.04 |
| 400,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 6.25% 31/01/2019 | 408,000 | 0.04 |
| 2,635,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/05/2024 | 2,929,224 | 0.31 |
| 200,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 7.25% 15/05/2024 | 209,750 | 0.02 |
| 600,000 | Endo Ltd / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc 6% 15/07/2023 | 537,000 | 0.06 |
| 813,000 | Endo Ltd / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc 6.5% 01/02/2025 | 698,164 | 0.07 |
| 600,000 | Grifols Worldwide Operations Ltd 5.25% 01/04/2022 | 621,000 | 0.07 |
| | アイルランド合計 | 9,115,438 | 0.97 |
| | イタリア : 0.00% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| | ジャージー : 0.40% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 社債 : 0.40% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 1,445,000 | AA Bond Co Ltd 5.5% 31/07/2022 | 1,818,698 | 0.19 |
| 200,000 | Adient Global Holdings Ltd 4.875% 15/08/2026 | 192,500 | 0.02 |
| 800,000 | CPUK Finance Ltd 7% 28/08/2020 | 1,062,070 | 0.11 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | ジャージー(つづき) : 0.40% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 社債(つづき) : 0.40% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 690,000 | Lincoln Finance Ltd 6.875% 15/04/2021 | 786,848 | 0.08 |
| | ジャージー合計 | 3,860,116 | 0.40 |
| | ルクセンブルグ : 4.22% (31 May 2016: 4.87%) | | |
| | 社債 : 4.22% (31 May 2016: 4.87%) | | |
| 1,755,000 | Altice Financing SA 7.5% 15/05/2026 | 1,783,519 | 0.19 |
| 1,155,000 | Altice Finco SA 7.625% 15/02/2025 | 1,139,119 | 0.12 |
| 200,000 | Altice Finco SA 9.875% 15/12/2020 | 210,750 | 0.02 |
| 410,000 | Altice Luxembourg SA 6.25% 15/02/2025 | 437,516 | 0.05 |
| 1,450,000 | Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022 | 1,641,632 | 0.17 |
| 2,530,000 | Altice Luxembourg SA 7.75% 15/05/2022 | 2,656,500 | 0.28 |
| 3,035,000 | ArcelorMittal 6.5% 01/03/2021 | 3,308,150 | 0.35 |
| 850,000 | ArcelorMittal 7.25% 25/02/2022 | 960,500 | 0.10 |
| 200,000 | ArcelorMittal 8% 15/10/2039 | 212,500 | 0.02 |
| 2,165,000 | ARD Finance SA PIK 15/09/2023 | 2,223,186 | 0.24 |
| 2,200,000 | ARD Finance SA PIK 15/09/2023 '144A' | 2,189,000 | 0.23 |
| 1,805,000 | Auris Luxembourg II SA 8% 15/01/2023 | 2,082,131 | 0.22 |
| 1,000,000 | Camelot Finance SA 7.875% 15/10/2024 | 1,025,000 | 0.11 |
| 1,444,000 | Capsugel SA PIK 15/05/2019 '144A' | 1,445,314 | 0.15 |
| 800,000 | Consolidated Energy Finance SA 6.75% 15/10/2019 | 796,000 | 0.08 |
| 1,365,000 | FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc 5.625% 15/08/2026 | 1,368,412 | 0.15 |
| 750,000 | Intelsat Jackson Holdings SA 7.25% 01/04/2019 | 592,500 | 0.06 |
| 2,334,000 | Intelsat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020 | 1,712,572 | 0.18 |
| 910,000 | Intelsat Jackson Holdings SA 7.5% 01/04/2021 | 663,727 | 0.07 |
| 1,720,000 | Intelsat Jackson Holdings SA 8% 15/02/2024 | 1,741,500 | 0.19 |
| 600,000 | Intelsat Luxembourg SA 6.75% 01/06/2018 | 438,000 | 0.05 |
| 625,000 | Intelsat Luxembourg SA 7.75% 01/06/2021 | 219,531 | 0.02 |
| 525,000 | Intelsat Luxembourg SA 8.125% 01/06/2023 | 182,437 | 0.02 |
| 540,000 | Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC 4.875% 15/04/2020 | 531,900 | 0.06 |
| 375,000 | Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC 5.5% 15/04/2025 | 320,625 | 0.03 |
| 1,240,000 | Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC 5.625% 15/10/2023 | 1,128,400 | 0.12 |
| 1,600,000 | Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC 5.75% 01/08/2022 | 1,500,000 | 0.16 |
| 855,000 | Matterhorn Telecom SA 3.875% 01/05/2022 | 914,739 | 0.09 |
| 1,320,000 | SIG Combibloc Holdings SCA 7.75% 15/02/2023 | 1,481,002 | 0.16 |
| 1,235,000 | Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/07/2027 | 1,347,098 | 0.14 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | ルクセンブルグ(つづき) : 4.22% (31 May 2016: 4.87%) | | |
| | 社債(つづき) : 4.22% (31 May 2016: 4.87%) | | |
| 600,000 | Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc 6.75% 01/05/2022 | 627,000 | 0.07 |
| 295,000 | Wind Acquisition Finance SA 7% 23/04/2021 | 324,084 | 0.03 |
| 2,670,000 | Wind Acquisition Finance SA 7.375% 23/04/2021 | 2,730,075 | 0.29 |
| | ルクセンブルグ合計 | 39,934,419 | 4.22 |
| | マーシャル諸島 : 0.26% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| | 社債 : 0.26% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| 150,000 | Drill Rigs Holdings Inc 6.5% 01/10/2017 | 63,750 | 0.01 |
| 200,000 | Global Ship Lease Inc 10% 01/04/2019 | 179,500 | 0.02 |
| 625,000 | Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc 8.125% 15/11/2021 | 517,187 | 0.05 |
| 2,210,400 | Seaspan Corp 6.375% 30/04/2019 | 553,232 | 0.06 |
| 1,300,000 | Teekay Offshore Partners LP/Teekay Offshore Finance Corp 6% 30/07/2019 | 1,101,750 | 0.12 |
| | マーシャル諸島合計 | 2,415,419 | 0.26 |
| | メキシコ : 0.11% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| | 社債 : 0.11% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 600,000 | Cemex SAB de CV 5.7% 11/01/2025 | 585,000 | 0.06 |
| 400,000 | Cemex SAB de CV 7.75% 16/04/2026 | 430,000 | 0.05 |
| | メキシコ合計 | 1,015,000 | 0.11 |
| | オランダ : 1.18% (31 May 2016: 1.40%) | | |
| | 社債 : 1.18% (31 May 2016: 1.40%) | | |
| 2,340,000 | Alcoa Nederland Holding BV 6.75% 30/09/2024 | 2,515,500 | 0.27 |
| 1,245,000 | Alcoa Nederland Holding BV 7% 30/09/2026 | 1,322,812 | 0.14 |
| 250,000 | Constellium NV 5.75% 15/05/2024 | 233,750 | 0.02 |
| 200,000 | GTH Finance BV 6.25% 26/04/2020 | 208,110 | 0.02 |
| 400,000 | LBC Tank Terminals Holding Netherlands BV 6.875% 15/05/2023** | 402,000 | 0.04 |
| 890,000 | LGE HoldCo VI BV 7.125% 15/05/2024 | 1,064,581 | 0.11 |
| 200,000 | Marfrig Holdings Europe BV 6.875% 24/06/2019 | 204,000 | 0.02 |
| 200,000 | NXP BV / NXP Funding LLC 3.875% 01/09/2022 | 205,500 | 0.02 |
| 200,000 | NXP BV / NXP Funding LLC 4.125% 01/06/2021 | 209,000 | 0.02 |
| 1,330,000 | PortAventura Entertainment Barcelona BV 7.25% 01/12/2020 | 1,467,630 | 0.16 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | オランダ(つづき) : 1.18% (31 May 2016: 1.40%) | | |
| | 社債(つづき) : 1.18% (31 May 2016: 1.40%) | | |
| 500,000 | Ziggo Bond Finance BV 4.625% 15/01/2025 | 531,245 | 0.06 |
| 400,000 | Ziggo Bond Finance BV 5.875% 15/01/2025 | 395,000 | 0.04 |
| 600,000 | Ziggo Bond Finance BV 6% 15/01/2027 | 577,500 | 0.06 |
| 1,695,000 | Ziggo Secured Finance BV 4.25% 15/01/2027 | 1,777,356 | 0.20 |
| | オランダ合計 | 11,113,984 | 1.18 |
| | スイス : 0.02% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 社債 : 0.02% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 200,000 | Credit Suisse Group AG FRN Perpetual | 188,718 | 0.02 |
| | スイス合計 | 188,718 | 0.02 |
| | 英国 : 1.97% (31 May 2016: 3.06%) | | |
| | 社債 : 1.97% (31 May 2016: 3.06%) | | |
| 250,000 | Anglo American Capital PLC 1.5% 01/04/2020 | 264,014 | 0.03 |
| 250,000 | Anglo American Capital PLC 3.25% 03/04/2023 | 272,544 | 0.03 |
| 990,000 | Anglo American Capital PLC 3.5% 28/03/2022 | 1,104,499 | 0.12 |
| 200,000 | Anglo American Capital PLC 4.125% 15/04/2021 | 201,500 | 0.02 |
| 400,000 | Anglo American Capital PLC 4.125% 27/09/2022 | 403,000 | 0.04 |
| 400,000 | Anglo American Capital PLC 4.875% 14/05/2025 | 408,000 | 0.04 |
| 1,175,000 | Boparan Finance PLC 5.5% 15/07/2021 | 1,383,632 | 0.15 |
| 175,000 | Ensco PLC 5.75% 01/10/2044 | 115,500 | 0.01 |
| 2,110,000 | Inmarsat Finance PLC 6.5% 01/10/2024 | 2,120,550 | 0.23 |
| 1,050,000 | Inovyn Finance PLC 6.25% 15/05/2021 | 1,173,664 | 0.12 |
| 1,800,000 | Iron Mountain Europe PLC 6.125% 15/09/2022 | 2,389,478 | 0.25 |
| 1,300,000 | Royal Bank of Scotland Group PLC Series 'U' FRN Perpetual | 1,201,720 | 0.13 |
| 400,000 | Royal Bank of Scotland Group PLC 8.625%-FRN Perpetual | 394,500 | 0.04 |
| 400,000 | Royal Bank of Scotland Group PLC 7.5%-FRN Perpetual | 362,000 | 0.04 |
| 600,000 | Tullow Oil PLC 6% 01/11/2020 '144A' | 549,750 | 0.06 |
| 1,440,000 | Tullow Oil PLC 6% 01/11/2020 'REGS' | 1,319,400 | 0.14 |
| 400,000 | Tullow Oil PLC 6.25% 15/04/2022 | 358,000 | 0.04 |
| 500,000 | Virgin Media Finance Plc 4.875% 15/02/2022 ** | 453,750 | 0.05 |
| 1,550,000 | Virgin Media Finance PLC 5.75% 15/01/2025 | 1,540,312 | 0.16 |
| 920,000 | Virgin Media Finance PLC 6.375% 15/10/2024 | 1,189,322 | 0.13 |
| 110,000 | Virgin Media Finance PLC 7% 15/04/2023 | 146,566 | 0.02 |
| 870,000 | Vue International Bidco PLC 7.875% 15/07/2020 | 1,135,784 | 0.12 |
| | 英国合計 | 18,487,485 | 1.97 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国 : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 400,000 | 99 Cents Only Stores 11% 15/12/2019 | 239,000 | 0.03 |
| 375,000 | A Schulman Inc 6.875% 01/06/2023 | 384,375 | 0.04 |
| 1,335,000 | Acadia Healthcare Co Inc 5.125% 01/07/2022 | 1,298,287 | 0.14 |
| 1,980,000 | Acadia Healthcare Co Inc 5.625% 15/02/2023 | 1,960,200 | 0.21 |
| 920,000 | ACCO Brands Corp 6.75% 30/04/2020 | 961,400 | 0.10 |
| 1,025,000 | Acosta Inc 7.75% 01/10/2022 | 853,312 | 0.09 |
| 204,000 | Advanced Micro Devices Inc 7% 01/07/2024 | 207,060 | 0.02 |
| 289,000 | Advanced Micro Devices Inc 7.5% 15/08/2022 | 310,675 | 0.03 |
| 1,530,000 | AECOM 5.75% 15/10/2022 | 1,610,325 | 0.17 |
| 2,300,000 | AES Corp 6% 15/05/2026 | 2,271,250 | 0.24 |
| 153,000 | AES Corp FRN 01/06/2019 | 152,235 | 0.02 |
| 125,000 | Affinion Investments LLC 13.5% 15/08/2018** | 63,281 | 0.01 |
| 600,000 | Ahern Rentals Inc 7.375% 15/05/2023 | 479,940 | 0.05 |
| 700,000 | AK Steel Corp 7.625% 15/05/2020 | 721,000 | 0.08 |
| 2,695,000 | Albertsons Cos LLC / Safeway Inc / New Albertson's Inc / Albertson's LLC 5.75% 15/03/2025 | 2,651,341 | 0.28 |
| 1,870,000 | Albertsons Cos LLC / Safeway Inc / New Albertson's Inc / Albertson's LLC 6.625% 15/06/2024 | 1,937,507 | 0.21 |
| 800,000 | Alcatel-Lucent USA Inc 6.5% 15/01/2028 | 840,000 | 0.09 |
| 750,000 | Alere Inc 6.5% 15/06/2020 | 750,000 | 0.08 |
| 500,000 | Aleris International Inc 7.875% 01/11/2020 | 492,950 | 0.05 |
| 400,000 | Aleris International Inc 9.5% 01/04/2021 | 430,000 | 0.05 |
| 1,235,000 | Allegion US Holding Co Inc 5.75% 01/10/2021 | 1,287,487 | 0.14 |
| 1,475,000 | Alliance Data Systems Corp 5.375% 01/08/2022 | 1,412,312 | 0.15 |
| 325,000 | Alliance Data Systems Corp 6.375% 01/04/2020 | 326,219 | 0.03 |
| 2,080,000 | Allison Transmission Inc 5% 01/10/2024 | 2,100,800 | 0.22 |
| 1,200,000 | Ally Financial Inc 3.25% 05/11/2018 | 1,200,750 | 0.13 |
| 925,000 | Ally Financial Inc 3.5% 27/01/2019 | 927,312 | 0.10 |
| 1,600,000 | Ally Financial Inc 4.625% 19/05/2022 | 1,598,400 | 0.17 |
| 200,000 | Ally Financial Inc 4.75% 10/09/2018 | 206,020 | 0.02 |
| 500,000 | Ally Financial Inc 5.125% 30/09/2024 | 501,250 | 0.05 |
| 700,000 | Ally Financial Inc 8% 31/12/2018 | 763,000 | 0.08 |
| 1,350,000 | Ally Financial Inc 8% 01/11/2031 | 1,539,000 | 0.16 |
| 1,750,000 | Alta Mesa Holdings LP / Alta Mesa Finance Services Corp 9.625% 15/10/2018** | 1,741,250 | 0.19 |
| | - American Airlines 2011-2 Class A Pass Through Trust 8.625% 15/10/2023** | - | - |
| 675,000 | American Airlines Group Inc 4.625% 01/03/2020 | 673,312 | 0.07 |
| 450,000 | American Airlines Group Inc 6.125% 01/06/2018 | 467,437 | 0.05 |
| 600,000 | American Builders & Contractors Supply Co Inc 5.625% 15/04/2021 | 622,500 | 0.07 |
| 1,787,000 | American Builders & Contractors Supply Co Inc 5.75% 15/12/2023 | 1,836,142 | 0.20 |
| 3,020,000 | AmeriGas Finance LLC / AmeriGas Finance Corp 7% 20/05/2022 | 3,186,100 | 0.34 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 1,025,000 | AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.625% 20/05/2024 | 1,017,312 | 0.11 |
| 300,000 | Amkor Technology Inc 6.375% 01/10/2022 | 309,750 | 0.03 |
| 450,000 | Amkor Technology Inc 6.625% 01/06/2021 | 461,812 | 0.05 |
| 2,205,000 | Amsurg Corp 5.625% 15/07/2022 | 2,260,125 | 0.24 |
| 1,035,000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp 5.375% 15/09/2024 | 1,058,287 | 0.11 |
| 685,000 | Antero Resources Corp 5.125% 01/12/2022 | 698,700 | 0.07 |
| 1,240,000 | Antero Resources Corp 5.375% 01/11/2021 | 1,278,750 | 0.14 |
| 175,000 | Antero Resources Corp 5.625% 01/06/2023 | 179,156 | 0.02 |
| 966,000 | Antero Resources Corp 6% 01/12/2020 | 997,395 | 0.11 |
| 2,755,000 | Apex Tool Group LLC 7% 01/02/2021 | 2,493,275 | 0.26 |
| 1,025,000 | Appvion Inc 9% 01/06/2020** | 630,375 | 0.07 |
| 200,000 | Aramark Services Inc 4.75% 01/06/2026 | 194,250 | 0.02 |
| 625,000 | Aramark Services Inc 5.125% 15/01/2024 | 643,231 | 0.07 |
| 650,000 | Artesyn Embedded Technologies Inc 9.75% 15/10/2020 | 582,562 | 0.06 |
| 625,000 | Asbury Automotive Group Inc 6% 15/12/2024 | 632,812 | 0.07 |
| 4,165,000 | Ashtead Capital Inc 5.625% 01/10/2024 | 4,352,425 | 0.46 |
| 625,000 | AV Homes Inc 8.5% 01/07/2019** | 646,875 | 0.07 |
| 575,000 | Avaya Inc 7% 01/04/2019 | 503,844 | 0.05 |
| 525,000 | Avaya Inc 9% 01/04/2019 | 467,250 | 0.05 |
| 524,000 | Aventine Renew Energy FRN 01/04/2017** | 83,840 | 0.01 |
| 1,620,000 | Axalta Coating Systems LLC 4.25% 15/08/2024 | 1,754,799 | 0.19 |
| 210,000 | B&G Foods Inc 4.625% 01/06/2021 | 215,250 | 0.02 |
| 550,000 | Ball Corp 4.375% 15/12/2020 | 581,625 | 0.06 |
| 1,000,000 | Bank of America Corp Series 'K' FRN Perpetual | 1,016,250 | 0.11 |
| 525,000 | Bank of America Corp Series 'X' FRN Perpetual | 523,036 | 0.06 |
| 925,000 | Bank of America Corp Series 'Z' FRN Perpetual | 963,804 | 0.10 |
| 250,000 | Bank of America Corp Series 'DD' FRN Perpetual | 261,250 | 0.03 |
| 600,000 | Bankrate Inc 6.125% 15/08/2018 | 605,250 | 0.06 |
| 325,000 | BCD Acquisition Inc 9.625% 15/09/2023 | 340,437 | 0.04 |
| 375,000 | Beacon Roofing Supply Inc 6.375% 01/10/2023 | 400,312 | 0.04 |
| 2,225,000 | Beazer Homes USA Inc 5.75% 15/06/2019 | 2,302,875 | 0.24 |
| 125,000 | Beazer Homes USA Inc 8.75% 15/03/2022 | 133,125 | 0.01 |
| 2,220,000 | Berry Plastics Corp 5.5% 15/05/2022 | 2,319,900 | 0.25 |
| 600,000 | Berry Plastics Corp 6% 15/10/2022 | 633,750 | 0.07 |
| 25,000 | Bill Barrett Corp 7% 15/10/2022 | 21,937 | - |
| 275,000 | Bill Barrett Corp 7.625% 01/10/2019 | 251,625 | 0.03 |
| 550,000 | BioScrip Inc 8.875% 15/02/2021 | 424,875 | 0.05 |
| 450,000 | Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp 6.125% 15/11/2022 | 441,000 | 0.05 |
| 3,240,000 | BlueLine Rental Finance Corp 7% 01/02/2019 | 3,126,600 | 0.33 |
| 350,000 | BMC East LLC 5.5% 01/10/2024 | 350,000 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 1,025,000 | BMC Software Finance Inc 8.125% 15/07/2021 | 927,625 | 0.10 |
| 375,000 | Bonanza Creek Energy Inc 5.75% 01/02/2023 | 196,875 | 0.02 |
| 350,000 | Bonanza Creek Energy Inc 6.75% 15/04/2021 | 183,750 | 0.02 |
| 2,420,000 | Boyd Gaming Corp 6.375% 01/04/2026 | 2,534,950 | 0.27 |
| 3,300,000 | Boyd Gaming Corp 6.875% 15/05/2023 | 3,518,625 | 0.37 |
| 237,922 | Buffalo Thunder Development Authority 0.00% 15/11/2029 ** | 119 | - |
| 708,924 | Buffalo Thunder Development Authority 11% 09/12/2022 ** | 372,185 | 0.04 |
| 1,200,000 | Builders FirstSource Inc 10.75% 15/08/2023 | 1,380,000 | 0.15 |
| 125,000 | Builders FirstSource Inc 5.625% 01/09/2024 | 126,094 | 0.01 |
| 425,000 | Cablevision Systems Corp 5.875% 15/09/2022 | 397,375 | 0.04 |
| 475,000 | Cablevision Systems Corp 7.75% 15/04/2018 | 500,531 | 0.05 |
| 1,025,000 | Cablevision Systems Corp 8.625% 15/09/2017 | 1,067,281 | 0.11 |
| 300,000 | CalAtlantic Group Inc 5.375% 01/10/2022 | 307,530 | 0.03 |
| 550,000 | CalAtlantic Group Inc 8.375% 15/05/2018 | 599,500 | 0.06 |
| 425,000 | CalAtlantic Group Inc 8.375% 15/01/2021 | 496,187 | 0.05 |
| 525,000 | California Resources Corp 8% 15/12/2022 | 422,625 | 0.04 |
| 450,000 | Callon Petroleum Co 6.125% 01/10/2024 | 463,500 | 0.05 |
| 1,200,000 | Calpine Corp 5.375% 15/01/2023 | 1,164,492 | 0.12 |
| 725,000 | Calpine Corp 5.5% 01/02/2024 | 696,000 | 0.07 |
| 597,000 | Calpine Corp 7.875% 15/01/2023 | 624,611 | 0.07 |
| 600,000 | Carlson Travel Holdings Inc PIK 15/08/2019 '144A' | 594,000 | 0.06 |
| 1,680,000 | Carlson Travel Holdings Inc PIK 15/08/2019 'REGS' | 1,663,200 | 0.18 |
| 1,180,000 | Carrizo Oil & Gas Inc 6.25% 15/04/2023 | 1,209,500 | 0.13 |
| 275,000 | Carrizo Oil & Gas Inc 7.5% 15/09/2020 | 285,312 | 0.03 |
| 400,000 | CBS Radio Inc 7.25% 01/11/2024 | 421,248 | 0.04 |
| 1,000,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/09/2022 | 1,040,000 | 0.11 |
| 625,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.375% 01/05/2025 | 636,719 | 0.07 |
| 500,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.5% 01/05/2026 | 506,250 | 0.05 |
| 375,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.75% 01/09/2023 | 394,219 | 0.04 |
| 2,275,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.75% 15/02/2026 | 2,343,250 | 0.25 |
| 1,300,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.875% 01/04/2024 | 1,379,625 | 0.15 |
| 200,000 | CDW LLC / CDW Finance Corp 6% 15/08/2022 | 212,750 | 0.02 |
| 575,000 | CEB Inc 5.625% 15/06/2023 | 559,187 | 0.06 |
| 2,500,000 | Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp 5.375% 01/06/2024 | 2,612,500 | 0.28 |
| 175,000 | Centene Corp 4.75% 15/01/2025 | 168,000 | 0.02 |
| 585,000 | Centene Corp 4.75% 15/05/2022 | 579,150 | 0.06 |
| 1,180,000 | Centene Corp 5.625% 15/02/2021 | 1,218,350 | 0.13 |
| 830,000 | Centene Corp 6.125% 15/02/2024 | 845,438 | 0.09 |
| 975,000 | Central Garden & Pet Co 6.125% 15/11/2023 | 1,021,312 | 0.11 |
| 550,000 | Century Communities Inc 6.875% 15/05/2022 | 559,625 | 0.06 |
| 2,460,000 | CenturyLink Inc 5.625% 01/04/2025 | 2,307,787 | 0.25 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 2,275,000 | CenturyLink Inc 6.75% 01/12/2023 | 2,283,531 | 0.24 |
| 1,700,000 | CenturyLink Inc 7.6% 15/09/2039 | 1,449,250 | 0.15 |
| 1,024,000 | Cequel Communications Holdings I LLC / Cequel Capital Corp 5.125% 15/12/2021 '144A' | 1,013,760 | 0.11 |
| 200,000 | Cequel Communications Holdings I LLC / Cequel Capital Corp 5.125% 15/12/2021 '144A' 'SEP' | 198,250 | 0.02 |
| 625,000 | Cequel Communications Holdings I LLC / Cequel Capital Corp 6.375% 15/09/2020 | 639,844 | 0.07 |
| 400,000 | Cequel Communications Holdings I LLC / Cequel Capital Corp 7.75% 15/07/2025 | 430,000 | 0.05 |
| 375,000 | CF Industries Inc 5.375% 15/03/2044 | 303,750 | 0.03 |
| 500,000 | Change Healthcare Holdings Inc 6% 15/02/2021 | 522,550 | 0.06 |
| 1,250,000 | Chaparral Energy Inc 8.25% 01/09/2021 | 1,043,750 | 0.11 |
| 2,060,000 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/06/2024 | 2,204,200 | 0.23 |
| 1,525,000 | Chesapeake Energy Corp 4.875% 15/04/2022 | 1,307,687 | 0.14 |
| 800,000 | Chesapeake Energy Corp 5.375% 15/06/2021 | 696,000 | 0.07 |
| 100,000 | Chesapeake Energy Corp 5.5% 15/09/2026 | 106,250 | 0.01 |
| 1,025,000 | Chesapeake Energy Corp 6.5% 15/08/2017 | 1,057,672 | 0.11 |
| 700,000 | Chesapeake Energy Corp 6.875% 15/11/2020 | 658,000 | 0.07 |
| 550,000 | Chesapeake Energy Corp 8% 15/12/2022 | 570,625 | 0.06 |
| 6,715,000 | Community Health Systems Inc 6.875% 01/02/2022 | 4,511,641 | 0.48 |
| 504,000 | Community Health Systems Inc 7.125% 15/07/2020 | 357,840 | 0.04 |
| 475,000 | Community Health Systems Inc 8% 15/11/2019 | 376,437 | 0.04 |
| 2,710,000 | Churchill Downs Inc 5.375% 15/12/2021 | 2,818,400 | 0.30 |
| 1,470,000 | Churchill Downs Inc 5.375% 15/12/2021 '144A' | 1,528,800 | 0.16 |
| 375,000 | Cinemark USA Inc 5.125% 15/12/2022 | 387,187 | 0.04 |
| 1,275,000 | CIT Group Inc 3.875% 19/02/2019 | 1,300,500 | 0.14 |
| 200,000 | CIT Group Inc 4.25% 15/08/2017 | 203,306 | 0.02 |
| 700,000 | CIT Group Inc 5% 01/08/2023 | 722,750 | 0.08 |
| 350,000 | CIT Group Inc 5.25% 15/03/2018 | 362,852 | 0.04 |
| 2,475,000 | CITGO Holding Inc 10.75% 15/02/2020 | 2,587,922 | 0.28 |
| 2,907,000 | CITGO Petroleum Corp 6.25% 15/08/2022 | 2,965,140 | 0.32 |
| 850,000 | Citigroup Inc FRN Series 'D' Perpetual | 800,062 | 0.09 |
| 250,000 | Citigroup Inc FRN Series 'Q' Perpetual | 251,719 | 0.03 |
| 200,000 | Citigroup Inc FRN Series 'T' Perpetual | 205,750 | 0.02 |
| 125,000 | Claire's Stores Inc 8.875% 15/03/2019 | 20,000 | - |
| 1,365,000 | Clean Harbors Inc 5.125% 01/06/2021 | 1,395,712 | 0.15 |
| 450,000 | Clear Channel Worldwide Holdings Inc 6.5% 15/11/2022 | 443,250 | 0.05 |
| 550,000 | Clear Channel Worldwide Holdings Inc 7.625% 15/03/2020 | 544,500 | 0.06 |
| 1,895,000 | Cliffs Natural Resources Inc 8.25% 31/03/2020 | 2,089,237 | 0.22 |
| 450,000 | Cloud Crane LLC 10.125% 01/08/2024 | 478,125 | 0.05 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 650,000 | Cloud Peak Energy Resources LLC / Cloud Peak Energy Finance Corp 6.375% 15/03/2024 | 461,500 | 0.05 |
| 1,000,000 | Cloud Peak Energy Resources LLC / Cloud Peak Energy Finance Corp 8.5% 15/12/2019 | 925,000 | 0.10 |
| 200,000 | Cloud Peak Energy Resources LLC / Cloud Peak Energy Finance Corp 12% 01/11/2021 | 206,500 | 0.02 |
| 350,000 | CNG Holdings Inc 9.375% 15/05/2020 | 280,875 | 0.03 |
| 1,845,000 | CNH Industrial Capital LLC 4.375% 06/11/2020 | 1,880,055 | 0.20 |
| 807,000 | Coeur Mining Inc 7.875% 01/02/2021 | 841,297 | 0.09 |
| 225,000 | Cogent Communications Group Inc 5.375% 01/03/2022 | 228,656 | 0.02 |
| 375,000 | Commercial Metals Co 4.875% 15/05/2023 | 377,437 | 0.04 |
| 1,155,000 | CommScope Inc 5% 15/06/2021 | 1,173,769 | 0.12 |
| 1,350,000 | CommScope Inc 5.5% 15/06/2024 | 1,386,922 | 0.15 |
| 900,000 | CommScope Technologies Finance LLC 6% 15/06/2025 | 942,750 | 0.10 |
| 150,000 | Communications Sales & Leasing Inc / CSL Capital LLC 6% 15/04/2023 | 156,000 | 0.02 |
| 425,000 | Communications Sales & Leasing Inc / CSL Capital LLC 8.25% | 448,375 | 0.05 |
| 825,000 | Community Choice Financial Inc 10.75% 01/05/2019 | 622,875 | 0.07 |
| 600,000 | Concho Resources Inc 5.5% 01/04/2023 | 619,890 | 0.07 |
| 150,000 | Conduent Finance Inc / Xerox Business Services LLC 10.5% 15/12/2024 | 156,375 | 0.02 |
| 250,000 | CONSOL Energy Inc 5.875% 15/04/2022 | 241,250 | 0.03 |
| 1,675,000 | Continental Resources Inc 5% 15/09/2022 | 1,677,094 | 0.18 |
| 275,000 | Contura Energy Inc 10% 01/08/2021 | 290,125 | 0.03 |
| 400,000 | Cooper-Standard Automotive Inc 5.625% 15/11/2026 | 390,000 | 0.04 |
| 2,160,000 | CoreCivic Inc 4.625% 01/05/2023 | 2,111,400 | 0.22 |
| 15,000 | CoreCivic Inc 5% 15/10/2022 ** | 14,887 | - |
| 400,000 | Cortes NP Acquisition Corp 9.25% 15/10/2024 | 405,250 | 0.04 |
| 750,000 | Cott Beverages Inc 6.75% 01/01/2020 | 777,656 | 0.08 |
| 1,180,000 | Covanta Holding Corp 5.875% 01/03/2024 | 1,153,450 | 0.12 |
| 2,625,000 | Covanta Holding Corp 6.375% 01/10/2022 | 2,618,437 | 0.28 |
| 650,000 | CPG Merger Sub LLC 8% 01/10/2021 | 672,750 | 0.07 |
| 600,000 | Crescent Communities LLC/Crescent Ventures Inc 8.875% 15/10/2021 | 597,000 | 0.06 |
| 1,425,000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 6% 15/12/2020 | 1,457,062 | 0.15 |
| 350,000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 6.125% 01/03/2022 | 355,250 | 0.04 |
| 275,000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 6.25% 01/04/2023 | 280,500 | 0.03 |
| 1,875,000 | CSC Holdings LLC 5.25% 01/06/2024 | 1,762,312 | 0.19 |
| 985,000 | CSC Holdings LLC 5.5% 15/04/2027 | 974,534 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 2,200,000 | CSC Holdings LLC 10.125% 15/01/2023 | 2,541,000 | 0.27 |
| 425,000 | CSI Compressco LP / Compressco Finance Inc 7.25% 15/08/2022 ** | 393,125 | 0.04 |
| 200,000 | CTP Transportation Products LLC / CTP Finance Inc 8.25% 15/12/2019 ** | 159,000 | 0.02 |
| 325,000 | CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp 9.25% 15/06/2023 | 322,969 | 0.03 |
| 750,000 | Dana Inc 6% 15/09/2023 | 783,750 | 0.08 |
| 2,640,000 | DaVita Inc 5.125% 15/07/2024 | 2,611,950 | 0.28 |
| 2,710,000 | DBP Holding Corp 7.75% 15/10/2020 | 1,666,650 | 0.18 |
| 2,090,000 | Denbury Resources Inc 5.5% 01/05/2022 | 1,719,025 | 0.18 |
| 1,140,000 | Denbury Resources Inc 9% 15/05/2021 | 1,188,450 | 0.13 |
| 875,000 | Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 5.45% 15/06/2023 | 913,899 | 0.10 |
| 1,200,000 | Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 5.875% 15/06/2021 | 1,264,347 | 0.13 |
| 1,340,000 | Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 6.02% 15/06/2026 | 1,412,213 | 0.15 |
| 725,000 | Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 7.125% 15/06/2024 | 792,659 | 0.08 |
| 225,000 | Diamond Resorts International Inc 7.75% 01/09/2023 | 226,125 | 0.02 |
| 175,000 | Diamond Resorts International Inc 10.75% 01/09/2024 | 164,937 | 0.02 |
| 875,000 | Diamondback Energy Inc 4.75% 01/11/2024 | 877,187 | 0.09 |
| 175,000 | Diebold Inc 8.5% 15/04/2024 | 183,619 | 0.02 |
| 155,964 | Directbuy Holdings 12.00% 31/10/2019 ** | 82,661 | 0.01 |
| 550,000 | DISH DBS Corp 4.25% 01/04/2018 | 562,375 | 0.06 |
| 635,000 | DISH DBS Corp 5% 15/03/2023 | 628,650 | 0.07 |
| 825,000 | DISH DBS Corp 5.125% 01/05/2020 | 849,750 | 0.09 |
| 1,035,000 | DISH DBS Corp 5.875% 15/07/2022 | 1,073,812 | 0.11 |
| 905,000 | DISH DBS Corp 5.875% 15/11/2024 | 920,837 | 0.10 |
| 795,000 | DISH DBS Corp 7.75% 01/07/2026 | 879,469 | 0.09 |
| 500,000 | DJO Finco Inc / DJO Finance LLC / DJO Finance Corp 8.125% 15/06/2021 | 438,750 | 0.05 |
| 675,000 | Donnelley Financial Solutions Inc 8.25% 15/10/2024 | 688,500 | 0.07 |
| 400,000 | DR Horton Inc 3.75% 01/03/2019 | 410,000 | 0.04 |
| 150,000 | DriveTime Automotive Group Inc / Bridgecrest Acceptance Corp 8% 01/06/2021 | 144,000 | 0.02 |
| 55,000 | Dynergy Inc 5.875% 01/06/2023 | 48,262 | 0.01 |
| 1,510,000 | Dynergy Inc 6.75% 01/11/2019 | 1,532,650 | 0.16 |
| 1,150,000 | Dynergy Inc 7.375% 01/11/2022 | 1,098,250 | 0.12 |
| 725,000 | Dynergy Inc 7.625% 01/11/2024 | 670,625 | 0.07 |
| 575,000 | Dynergy Inc 8% 15/01/2025 | 530,437 | 0.06 |
| 392,000 | EarthLink Holdings Corp 8.875% 15/05/2019 | 401,800 | 0.04 |
| 100,000 | Eclipse Resources Corp 8.875% 15/07/2023 | 101,500 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 550,000 | Eco Services Operations LLC / Eco Finance Corp 8.5% 01/11/2022 | 583,000 | 0.06 |
| 450,000 | Eldorado Resorts Inc 7% 01/08/2023 | 478,125 | 0.05 |
| 400,000 | Embarq Corp 7.995% 01/06/2036 | 385,040 | 0.04 |
| 600,000 | EMC Corp 1.875% 01/06/2018 | 591,441 | 0.06 |
| 2,310,000 | Endo Finance LLC / Endo Finco Inc 5.375% 15/01/2023 | 2,027,025 | 0.22 |
| 150,000 | Endo Finance LLC / Endo Finco Inc 7.25% 15/01/2022 | 144,187 | 0.02 |
| 150,000 | Endo Finance LLC 5.75% 15/01/2022 | 135,937 | 0.01 |
| 1,820,000 | Energizer Holdings Inc 5.5% 15/06/2025 | 1,824,550 | 0.19 |
| 840,000 | Energy Transfer Equity LP 5.875% 15/01/2024 | 865,200 | 0.09 |
| 1,325,000 | Energy Transfer Equity LP 7.5% 15/10/2020 | 1,487,312 | 0.16 |
| 200,000 | Engility Corp 8.875% 01/09/2024 | 206,250 | 0.02 |
| 279,000 | EnLink Midstream Partners LP / EnLink Midstream Finance Corp 7.125% 01/06/2022 | 293,352 | 0.03 |
| 650,000 | EnLink Midstream Partners LP 5.05% 01/04/2045 | 551,956 | 0.06 |
| 2,880,000 | Envision Healthcare Corp 5.125% 01/07/2022 | 2,851,200 | 0.30 |
| 675,000 | EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance Inc 6.375% 15/06/2023 | 475,875 | 0.05 |
| 2,100,000 | EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance Inc 9.375% 01/05/2020 | 1,769,880 | 0.19 |
| 474,000 | Equinix Inc 5.375% 01/04/2023 | 488,812 | 0.05 |
| 350,000 | Midstates Petroleum 9.25% 01/06/2021** | - | - |
| 1,625,000 | Midstates Petroleum 10.75% 01/10/2020** | - | - |
| 475,000 | Quicksilver 9.125% 15/08/2019** | - | - |
| 2,590,000 | ESH Hospitality Inc 5.25% 01/05/2025 | 2,512,300 | 0.27 |
| 241,378 | Exide Technologies PIK 30/04/2025**† | 129,137 | 0.01 |
| 2,440,000 | Extraction Oil & Gas Holdings LLC / Extraction Finance Corp 7.875% 15/07/2021 | 2,580,300 | 0.27 |
| 1,205,000 | FBM Finance Inc 8.25% 15/08/2021 | 1,253,200 | 0.13 |
| 2,425,000 | FelCor Lodging LP 6% 01/06/2025 | 2,479,562 | 0.26 |
| 1,025,000 | Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 6.75% 15/01/2022 | 971,187 | 0.10 |
| 650,000 | Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 6.75% 15/06/2023 | 607,750 | 0.06 |
| 529,000 | Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 8.625% 15/06/2020 | 519,742 | 0.06 |
| 490,000 | First Data Corp 5% 15/01/2024 | 496,125 | 0.05 |
| 2,665,000 | First Data Corp 5.75% 15/01/2024 | 2,708,306 | 0.29 |
| 5,095,000 | First Data Corp 7% 01/12/2023 | 5,346,591 | 0.57 |
| 2,945,000 | First Quality Finance Co Inc 4.625% 15/05/2021 | 2,911,869 | 0.31 |
| 275,000 | FirstCash Inc 6.75% 01/04/2021 | 286,000 | 0.03 |
| 2,560,000 | Flexi-Van Leasing Inc 7.875% 15/08/2018 | 2,355,200 | 0.25 |
| 850,000 | Forbes Energy Services Ltd 9% 15/06/2019 | 213,405 | 0.02 |
| 425,000 | Freeport-McMoRan Inc 2.3% 14/11/2017 | 426,062 | 0.05 |
| 650,000 | Freeport-McMoRan Inc 2.375% 15/03/2018 | 648,375 | 0.07 |
| 100,000 | Freeport-McMoRan Inc 3.875% 15/03/2023 | 94,500 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 100,000 | Freeport-McMoRan Inc 5.4% 14/11/2034 | 88,000 | 0.01 |
| 825,000 | Freeport-McMoran Oil & Gas LLC / FCX Oil & Gas Inc 6.5% 15/11/2020 | 853,462 | 0.09 |
| 800,000 | Freeport-McMoran Oil & Gas LLC / FCX Oil & Gas Inc 6.625% 01/05/2021 | 821,392 | 0.09 |
| 1,000,000 | Freeport-McMoran Oil & Gas LLC / FCX Oil & Gas Inc 6.75% 01/02/2022 | 1,041,875 | 0.11 |
| 820,000 | Frontier Communications Corp 7.125% 15/01/2023 | 715,450 | 0.08 |
| 2,285,000 | Frontier Communications Corp 7.625% 15/04/2024 | 1,982,237 | 0.21 |
| 1,700,000 | Frontier Communications Corp 10.5% 15/09/2022 | 1,761,625 | 0.19 |
| 2,150,000 | Frontier Communications Corp 11% 15/09/2025 | 2,163,437 | 0.23 |
| 750,000 | GCI Inc 6.75% 01/06/2021 | 773,437 | 0.08 |
| 525,000 | General Motors Financial Co Inc 4.25% 15/05/2023 | 528,200 | 0.06 |
| 450,000 | GenOn Energy Inc 7.875% 15/06/2017 | 325,125 | 0.03 |
| 400,000 | GenOn Energy Inc 9.5% 15/10/2018 | 281,000 | 0.03 |
| 3,130,000 | GEO Group Inc 5.125% 01/04/2023 | 2,973,500 | 0.32 |
| 430,000 | GEO Group Inc 6% 15/04/2026 | 414,950 | 0.04 |
| 250,000 | Gibraltar Industries Inc 6.25% 01/02/2021 | 257,500 | 0.03 |
| 7,193 | Global Aviation Holdings 2nd Lien Term GTD Sr PIK 31/07/2017 ** | 72 | - |
| 300,000 | Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.25% 15/07/2022 | 285,000 | 0.03 |
| 1,100,000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15/04/2026 | 1,127,500 | 0.12 |
| 425,000 | GM Corp 8.375% Sr Debs due 15/07/2033 ** | - | - |
| 925,000 | Golden Nugget Escrow Inc 8.5% 01/12/2021 | 973,562 | 0.10 |
| 550,000 | Goldman Sachs Group Inc FRN Series 'L' Perpetual | 555,500 | 0.06 |
| 200,000 | Goldman Sachs Group Inc FRN Series 'M' Perpetual | 198,000 | 0.02 |
| 1,425,000 | Goodyear Tire & Rubber Co 5% 31/05/2026 | 1,417,875 | 0.15 |
| 395,000 | Goodyear Tire & Rubber Co 5.125% 15/11/2023 | 405,369 | 0.04 |
| 125,000 | Goodyear Tire & Rubber Co 7% 15/05/2022 | 131,406 | 0.01 |
| 425,000 | GrafTech International Ltd 6.375% 15/11/2020 | 337,875 | 0.04 |
| 275,000 | Graphic Packaging International Inc 4.125% 15/08/2024 | 266,750 | 0.03 |
| 175,000 | Gray Television Inc 5.125% 15/10/2024 | 164,062 | 0.02 |
| 750,000 | Gray Television Inc 5.875% 15/07/2026 | 717,892 | 0.08 |
| 930,000 | Greif Inc 7.75% 01/08/2019 | 1,031,137 | 0.11 |
| 550,000 | Greystar Real Estate Partners LLC 8.25% 01/12/2022 | 598,125 | 0.06 |
| 1,025,000 | Griffon Corp 5.25% 01/03/2022 | 1,023,719 | 0.11 |
| 1,770,000 | Group 1 Automotive Inc 5.25% 15/12/2023 ** | 1,739,025 | 0.18 |
| 1,055,000 | Gulfport Energy Corp 6% 15/10/2024 | 1,074,781 | 0.11 |
| 1,540,000 | Gulfport Energy Corp 6.625% 01/05/2023 | 1,617,000 | 0.17 |
| 650,000 | Halcon Resources Corp 8.625% 01/02/2020 | 669,825 | 0.07 |
| 800,000 | Harland Clarke Holdings Corp 6.875% 01/03/2020 ** | 762,000 | 0.08 |
| 925,000 | Harland Clarke Holdings Corp 9.25% 01/03/2021 | 788,562 | 0.08 |
| 325,000 | Harland Clarke Holdings Corp 9.75% 01/08/2018 | 332,719 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 200,000 | Hawker Beechcraft Acquisition Co LLC / Hawker Beechcraft Notes Co FRN 01/04/2017 ** | - | - |
| 7,520,000 | HCA Holdings Inc 6.25% 15/02/2021 | 7,911,040 | 0.84 |
| 575,000 | HCA Inc 5.375% 01/02/2025 | 563,500 | 0.06 |
| 2,100,000 | HCA Inc 5.875% 15/03/2022 | 2,260,125 | 0.24 |
| 280,000 | HCA Inc 5.875% 01/05/2023 | 288,400 | 0.03 |
| 750,000 | HCA Inc 5.875% 15/02/2026 | 749,062 | 0.08 |
| 1,550,000 | HCA Inc 7.5% 15/02/2022 | 1,728,250 | 0.18 |
| 550,000 | HCA Inc 7.69% 15/06/2025 | 606,375 | 0.06 |
| 275,000 | HCA Inc 8% 01/10/2018 | 299,062 | 0.03 |
| 2,935,000 | HD Supply Inc 5.75% 15/04/2024 | 3,008,375 | 0.32 |
| 2,585,000 | HealthSouth Corp 5.125% 15/03/2023 | 2,559,150 | 0.27 |
| 1,070,000 | HealthSouth Corp 5.75% 01/11/2024 | 1,078,025 | 0.11 |
| 400,000 | Hearthside Group Holdings LLC / Hearthside Finance Co 6.5% 01/05/2022 | 394,000 | 0.04 |
| 300,000 | Hecla Mining Co 6.875% 01/05/2021 | 307,125 | 0.03 |
| 575,000 | Herc Rentals Inc 7.5% 01/06/2022 | 595,844 | 0.06 |
| 175,000 | Herc Rentals Inc 7.75% 01/06/2024 | 180,687 | 0.02 |
| 1,800,000 | Hexion Inc / Hexion Nova Scotia Finance ULC 9% 15/11/2020 | 1,336,500 | 0.14 |
| 300,000 | Hillman Group Inc 6.375% 15/07/2022 | 282,000 | 0.03 |
| 1,475,000 | Hilton Domestic Operating Co Inc 4.25% 01/09/2024 | 1,452,875 | 0.15 |
| 148 | Holdco Member Int Sorenson Plan Of Reorg 31/12/2049 ** | 148 | - |
| 200,000 | Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp 6% 01/08/2024 | 209,000 | 0.02 |
| 950,000 | HRG Group Inc 7.75% 15/01/2022 | 990,375 | 0.11 |
| 275,000 | HRG Group Inc 7.875% 15/07/2019 | 287,031 | 0.03 |
| 546,000 | Hub Holdings LLC / Hub Holdings Finance Inc PIK 15/07/2019 ** | 543,270 | 0.06 |
| 2,555,000 | HUB International Ltd 7.875% 01/10/2021 | 2,615,681 | 0.28 |
| 440,000 | Hughes Satellite Systems Corp 5.25% 01/08/2026 | 417,450 | 0.04 |
| 1,010,000 | Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01/08/2026 | 974,650 | 0.10 |
| 250,000 | Hunt Cos Inc 9.625% 01/03/2021 | 258,750 | 0.03 |
| 2,260,000 | Huntington Ingalls Industries Inc 5% 15/12/2021 | 2,358,875 | 0.25 |
| 325,000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.875% 15/03/2019 | 329,062 | 0.03 |
| 1,125,000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.875% 01/02/2022 | 1,088,437 | 0.12 |
| 300,000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6% 01/08/2020 | 300,159 | 0.03 |
| 725,000 | iHeartCommunications Inc 9% 15/12/2019 | 573,656 | 0.06 |
| 250,000 | iHeartCommunications Inc 10% 15/01/2018 | 183,125 | 0.02 |
| 604,750 | iHeartCommunications Inc PIK 01/02/2021 | 243,412 | 0.03 |
| 300,000 | ILFC E-Capital Trust I FRN 21/12/2065 | 261,750 | 0.03 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 400,000 | Infor Software Parent LLC / Infor Software Parent Inc PIK 01/05/2021 | 403,000 | 0.04 |
| 1,050,000 | Illinois Power Generating Co 7% 15/04/2018 | 367,500 | 0.04 |
| 1,100,000 | Inception Merger Sub Inc / Rackspace Hosting Inc 8.625% | 1,102,750 | 0.12 |
| 1,800,000 | Infor US Inc 6.5% 15/05/2022 | 1,858,500 | 0.20 |
| 1,000,000 | Informatica LLC 7.125% 15/07/2023 [†] | 950,000 | 0.10 |
| 2,735,000 | Ingles Markets Inc 5.75% 15/06/2023 | 2,811,088 | 0.30 |
| 574,497 | Inn of the Mountain Gods Resort & Casino FRN 30/11/2020 | 519,920 | 0.06 |
| 875,000 | International Lease Finance Corp 5.875% 01/04/2019 | 934,062 | 0.10 |
| 1,225,000 | International Lease Finance Corp 8.625% 15/01/2022 | 1,480,437 | 0.16 |
| 350,000 | International Lease Finance Corp 8.875% 01/09/2017 | 367,937 | 0.04 |
| 2,455,000 | Intrepid Aviation Group Holdings LLC / Intrepid Finance Co 6.875% 15/02/2019 | 2,224,844 | 0.24 |
| 650,000 | inVentiv Group Holdings Inc/inVentiv Health Inc/inVentiv Health Clinical Inc 7.5% 01/10/2024 | 661,375 | 0.07 |
| 225,000 | inVentiv Health Inc 9% 15/01/2018 | 226,845 | 0.02 |
| 606,645 | iPayment Inc 9.5% 15/12/2019 | 624,086 | 0.07 |
| 275,000 | Isle of Capri Casinos Inc 5.875% 15/03/2021 | 286,344 | 0.03 |
| 647,208 | Jack Cooper Enterprises Inc PIK 15/03/2019 | 74,429 | 0.01 |
| 375,000 | Jack Cooper Holdings Corp 9.25% 01/06/2020 | 132,187 | 0.01 |
| 325,000 | Jack Ohio Finance LLC / Jack Ohio Finance 1 Corp 10.25% 15/11/2022 | 322,562 | 0.03 |
| 1,865,000 | Jaguar Holding Co II / Pharmaceutical Product Development LLC 6.375% 01/08/2023 | 1,925,762 | 0.20 |
| 1,500,000 | JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc 5.875% 15/07/2024 | 1,500,000 | 0.16 |
| 1,985,000 | JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc 7.25% 01/06/2021 | 2,054,475 | 0.22 |
| 550,000 | JC Penney Corp Inc 5.65% 01/06/2020 | 550,000 | 0.06 |
| 375,000 | JC Penney Corp Inc 5.875% 01/07/2023 | 385,312 | 0.04 |
| 250,000 | JC Penney Corp Inc 6.375% 15/10/2036 | 205,000 | 0.02 |
| 800,000 | Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp 7.375% 01/04/2020 | 786,000 | 0.08 |
| 575,000 | Jefferson Smurfit 8.25% 01/10/2012 ^{**} | 575 | - |
| 1,865,000 | Jones Energy Holdings LLC / Jones Energy Finance Corp 6.75% 01/04/2022 | 1,697,150 | 0.18 |
| 325,000 | Jones Energy Holdings LLC / Jones Energy Finance Corp 9.25% 15/03/2023 ^{**} | 322,156 | 0.03 |
| 925,000 | JPMorgan Chase & Co FRN Series 'S' Perpetual | 995,531 | 0.11 |
| 775,000 | JPMorgan Chase & Co FRN Series 'Q' Perpetual | 751,750 | 0.08 |
| 1,050,000 | JPMorgan Chase & Co FRN Series 'R' Perpetual | 1,047,900 | 0.11 |
| 1,350,000 | JPMorgan Chase & Co FRN Series 'V' Perpetual | 1,314,562 | 0.14 |
| 250,000 | K Hovnanian Enterprises Inc 7% 15/01/2019 | 201,250 | 0.02 |
| 400,000 | K Hovnanian Enterprises Inc 8% 01/11/2019 | 284,000 | 0.03 |
| 75,000 | KB Home 4.75% 15/05/2019 | 76,312 | 0.01 |
| 900,000 | KB Home 7% 15/12/2021 | 959,850 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 125,000 | KB Home 9.1% 15/09/2017 | 131,562 | 0.01 |
| 550,000 | KCG Holdings Inc 6.875% 15/03/2020 | 544,500 | 0.06 |
| 250,000 | KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp 7.625% 15/08/2021 | 249,375 | 0.03 |
| 2,645,000 | Kennedy-Wilson Inc 5.875% 01/04/2024 | 2,674,756 | 0.28 |
| 1,940,000 | KFC Holding Co / Pizza Hut Holdings LLC / Taco Bell of America LLC 5% 01/06/2024 | 1,964,250 | 0.21 |
| 325,000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 5.4% 01/09/2044 | 311,706 | 0.03 |
| 900,000 | Kindred Healthcare Inc 6.375% 15/04/2022 | 770,625 | 0.08 |
| 450,000 | Kinetic Concepts Inc / KCI USA Inc 9.625% 01/10/2021 | 423,562 | 0.05 |
| 1,070,000 | Kloeckner Pentaplast of America Inc 7.125% 01/11/2020 | 1,196,712 | 0.13 |
| 300,000 | L Brands Inc 5.625% 15/02/2022 | 318,375 | 0.03 |
| 375,000 | L Brands Inc 6.75% 01/07/2036 | 372,188 | 0.04 |
| 250,000 | L Brands Inc 6.875% 01/11/2035 | 251,250 | 0.03 |
| 550,000 | L Brands Inc 7% 01/05/2020 | 620,125 | 0.07 |
| 434,000 | L Brands Inc 8.5% 15/06/2019 | 500,728 | 0.05 |
| 675,000 | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp 7.375% 01/10/2017 | 677,531 | 0.07 |
| 1,410,000 | Lamar Media Corp 5% 01/05/2023 | 1,441,725 | 0.15 |
| 140,000 | Lamar Media Corp 5.75% 01/02/2026 | 148,323 | 0.02 |
| 275,000 | Lamb Weston Holdings Inc 4.625% 01/11/2024 | 274,484 | 0.03 |
| 200,000 | Lamb Weston Holdings Inc 4.875% 01/11/2026 | 199,500 | 0.02 |
| 1,250,000 | Landry's Inc 6.75% 15/10/2024 | 1,253,125 | 0.13 |
| 1,255,000 | Laredo Petroleum Inc 5.625% 15/01/2022 | 1,258,138 | 0.13 |
| 445,000 | Laredo Petroleum Inc 6.25% 15/03/2023 | 455,013 | 0.05 |
| 700,000 | Laredo Petroleum Inc 7.375% 01/05/2022 | 731,500 | 0.08 |
| 625,000 | Lear Corp 5.375% 15/03/2024 | 656,250 | 0.07 |
| 1,025,000 | Lennar Corp 4.75% 15/11/2022 | 1,048,063 | 0.11 |
| 325,000 | Lennar Corp 4.875% 15/12/2023 | 321,750 | 0.03 |
| 250,000 | Lennar Corp 12.25% 01/06/2017 | 263,750 | 0.03 |
| 1,700,000 | Level 3 Financing Inc 5.125% 01/05/2023 | 1,702,125 | 0.18 |
| 1,655,000 | Level 3 Financing Inc 5.375% 15/08/2022 | 1,688,100 | 0.18 |
| 875,000 | Level 3 Financing Inc 5.375% 15/01/2024 | 881,563 | 0.09 |
| 600,000 | Level 3 Financing Inc 6.125% 15/01/2021 | 621,750 | 0.07 |
| 1,720,000 | LifePoint Health Inc 5.375% 01/05/2024 | 1,654,425 | 0.18 |
| 1,375,000 | LifePoint Health Inc 5.5% 01/12/2021 | 1,406,797 | 0.15 |
| 425,000 | LIN Television Corp 6.375% 15/01/2021 | 441,469 | 0.05 |
| 275,000 | Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp FRN 15/05/2019 | 88,688 | 0.01 |
| 600,000 | Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp FRN 01/11/2019 | 201,000 | 0.02 |
| 1,925,000 | Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp FRN 15/04/2020 | 640,063 | 0.07 |
| 1,477,000 | Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp FRN 15/12/2020 | 1,000,668 | 0.11 |
| 2,285,000 | Live Nation Entertainment Inc 4.875% 01/11/2024 | 2,279,288 | 0.24 |
| 225,000 | Lonestar Resources America Inc 8.75% 15/04/2019 | 172,125 | 0.02 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 2,200,000 | LTF Merger Sub Inc 8.5% 15/06/2023 | 2,255,000 | 0.24 |
| 425,000 | Manitowoc Foodservice Inc 9.5% 15/02/2024 | 486,625 | 0.05 |
| 750,000 | Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp 7.25% 15/02/2021 ** | 731,250 | 0.08 |
| 675,000 | Match Group Inc 6.375% 01/06/2024 | 715,500 | 0.08 |
| 275,000 | MBIA Inc 7.15% 15/07/2027 | 297,000 | 0.03 |
| 675,000 | MBIA Insurance Corp FRN 15/01/2033 | 327,356 | 0.03 |
| 1,810,000 | Mediacom Broadband LLC / Mediacom Broadband Corp 5.5% 15/04/2021 | 1,871,088 | 0.20 |
| 1,250,000 | Mediacom Broadband LLC / Mediacom Broadband Corp 6.375% 01/04/2023 | 1,318,750 | 0.14 |
| 475,000 | Mediacom LLC / Mediacom Capital Corp 7.25% 15/02/2022 | 493,406 | 0.05 |
| 2,220,000 | MEDNAX Inc 5.25% 01/12/2023 | 2,258,850 | 0.24 |
| 425,000 | Mercer International Inc 7% 01/12/2019 | 438,281 | 0.05 |
| 400,000 | Meritage Homes Corp 6% 01/06/2025 | 412,000 | 0.04 |
| 1,025,000 | Meritage Homes Corp 7% 01/04/2022 | 1,119,813 | 0.12 |
| 375,000 | Meritage Homes Corp 7.15% 15/04/2020 | 408,750 | 0.04 |
| 975,000 | Meritor Inc FRN 15/02/2027 | 999,375 | 0.11 |
| 425,000 | MGIC Investment Corp 5.75% 15/08/2023 | 442,000 | 0.05 |
| 1,705,000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 01/05/2024 | 1,790,250 | 0.19 |
| 250,000 | MGM Resorts International 6.625% 15/12/2021 | 273,750 | 0.03 |
| 2,000,000 | MGM Resorts International 7.75% 15/03/2022 | 2,290,000 | 0.24 |
| 431,000 | MGM Resorts International 11.375% 01/03/2018 | 478,949 | 0.05 |
| 308,410 | Michael Baker Holdings LLC / Micahel Baker Finance Corp PIK 15/04/2019 ** | 277,569 | 0.03 |
| 2,225,000 | Micron Technology Inc 5.25% 15/01/2024 | 2,186,307 | 0.23 |
| 425,000 | Micron Technology Inc 5.625% 15/01/2026 | 416,500 | 0.04 |
| 950,000 | Midas Intermediate Holdco II LLC / Midas Intermediate Holdco II Finance Inc 7.875% 01/10/2022 | 959,500 | 0.10 |
| 175,000 | Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp 6.25% 01/08/2021 | 183,531 | 0.02 |
| 500,000 | Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp 6.875% 15/08/2023 ** | 528,125 | 0.06 |
| 2,455,000 | Milacron LLC / Mcron Finance Corp 7.75% 15/02/2021 | 2,510,238 | 0.27 |
| 850,000 | Mohegan Tribal Gaming Authority 7.875% 15/10/2024 | 854,250 | 0.09 |
| 975,000 | MPH Acquisition Holdings LLC 7.125% 01/06/2024 | 1,027,406 | 0.11 |
| 100,000 | MPLX LP 4.875% 01/06/2025 | 100,761 | 0.01 |
| 100,000 | MPLX LP 5.5% 15/02/2023 | 103,727 | 0.01 |
| 450,000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.5% 01/05/2024 | 443,250 | 0.05 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 500,000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 6.375% 15/02/2022 | 513,750 | 0.05 |
| 1,880,000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 6.375% 01/03/2024 | 1,936,400 | 0.21 |
| 275,000 | MSCI Inc 4.75% 01/08/2026 | 269,500 | 0.03 |
| 500,000 | Multi-Color Corp 6.125% 01/12/2022 ** | 523,750 | 0.06 |
| 1,275,000 | Murphy Oil Corp 4.7% 01/12/2022 | 1,227,188 | 0.13 |
| 775,000 | Murphy Oil Corp 6.875% 15/08/2024 | 817,625 | 0.09 |
| 1,825,000 | Murray Energy Corp 11.25% 15/04/2021 | 1,304,875 | 0.14 |
| 125,000 | Nabors Industries Inc 4.625% 15/09/2021 | 122,500 | 0.01 |
| 350,000 | Nabors Industries Inc 5% 15/09/2020 | 352,625 | 0.04 |
| 875,000 | Nathan's Famous Inc 10% 15/03/2020 | 958,125 | 0.10 |
| 125,000 | National CineMedia LLC 5.75% 15/08/2026 | 128,750 | 0.01 |
| 1,050,000 | National CineMedia LLC 6% 15/04/2022 | 1,086,750 | 0.12 |
| 450,000 | National Financial Partners Corp 9% 15/07/2021 | 467,438 | 0.05 |
| 2,035,000 | Natural Resource Partners LP / NRP Finance Corp 9.125% 01/10/2018 | 1,984,125 | 0.21 |
| 650,000 | Nature's Bounty Co 7.625% 15/05/2021 | 642,688 | 0.07 |
| 480,000 | Navient Corp 4.875% 17/06/2019 | 494,400 | 0.05 |
| 4,375,000 | Navient Corp 5.5% 15/01/2019 | 4,526,375 | 0.48 |
| 925,000 | Navient Corp 5.875% 25/10/2024 | 860,250 | 0.09 |
| 375,000 | Navient Corp 6.125% 25/03/2024 | 356,719 | 0.04 |
| 250,000 | Navient Corp 6.625% 26/07/2021 | 261,563 | 0.03 |
| 200,000 | Navient Corp 7.25% 25/09/2023 | 203,000 | 0.02 |
| 1,055,000 | Navient Corp 8% 25/03/2020 | 1,161,819 | 0.12 |
| 175,000 | Navistar International Corp 8.25% 01/11/2021 | 175,438 | 0.02 |
| 2,835,000 | NCR Corp 5.875% 15/12/2021 | 2,969,663 | 0.32 |
| 1,000,000 | NCR Corp 6.375% 15/12/2023 | 1,055,000 | 0.11 |
| 2,465,000 | Neiman Marcus Group LTD LLC PIK 15/10/2021 | 1,873,400 | 0.20 |
| 1,500,000 | New Enterprise Stone & Lime Co Inc 11% 01/09/2018 | 1,498,125 | 0.16 |
| 560,000 | Newfield Exploration Co 5.625% 01/07/2024 | 580,300 | 0.06 |
| 300,000 | Newfield Exploration Co 5.75% 30/01/2022 | 312,000 | 0.03 |
| 525,000 | Nexstar Escrow Corp 5.625% 01/08/2024 | 521,063 | 0.06 |
| 325,000 | NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 5.125% | 318,500 | 0.03 |
| 1,050,000 | Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co 5% 15/04/2022 | 1,074,938 | 0.11 |
| 450,000 | Noranda Aluminum Acquisition Corp FRN 01/06/2019 ** | 90 | - |
| 275,000 | Northern Oil and Gas Inc 8% 01/06/2020 | 202,125 | 0.02 |
| 1,880,000 | Novelis Corp 5.875% 30/09/2026 | 1,882,350 | 0.20 |
| 1,150,000 | Novelis Corp 6.25% 15/08/2024 | 1,193,125 | 0.13 |
| 575,000 | NPC International Inc / NPC Quality Burgers Inc / NPC Operating Co B Inc 10.5% 15/01/2020 | 596,275 | 0.06 |
| 935,000 | NRG Energy Inc 6.25% 15/07/2022 | 942,013 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 1,865,000 | NRG Energy Inc 6.625% 15/03/2023 | 1,865,000 | 0.20 |
| 1,150,000 | NRG Energy Inc 6.625% 15/01/2027 | 1,069,500 | 0.11 |
| 375,000 | NRG Energy Inc 7.25% 15/05/2026 | 368,438 | 0.04 |
| 2,935,000 | NRG Yield Operating LLC 5% 15/09/2026 | 2,788,251 | 0.30 |
| 800,000 | NWH Escrow Corp 7.5% 01/08/2021 | 626,000 | 0.07 |
| 1,270,000 | Oasis Petroleum Inc 6.5% 01/11/2021 | 1,289,050 | 0.14 |
| 885,000 | Oasis Petroleum Inc 6.875% 15/01/2023 | 911,550 | 0.10 |
| 1,038,000 | Oppenheimer Holdings Inc 8.75% 15/04/2018 | 1,053,570 | 0.11 |
| 650,000 | Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA 6.625% 15/05/2022 | 544,375 | 0.06 |
| 350,000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 5.25% 15/02/2022 | 364,438 | 0.04 |
| 200,000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 5.625% 15/02/2024 | 206,250 | 0.02 |
| 900,000 | Owens-Brockway Glass Container Inc 5.375% 15/01/2025 | 904,500 | 0.10 |
| 325,000 | Owens-Brockway Glass Container Inc 6.375% 15/08/2025 | 343,891 | 0.04 |
| 400,000 | Owens-Illinois Inc 7.8% 15/05/2018 | 429,000 | 0.05 |
| 325,000 | Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp 6.25% 01/06/2024 | 338,000 | 0.04 |
| 2,560,000 | Party City Holdings Inc 6.125% 15/08/2023 | 2,668,800 | 0.28 |
| 625,000 | PBF Logistics LP / PBF Logistics Finance Corp 6.875% 15/05/2023 | 617,188 | 0.07 |
| 500,000 | PDC Energy Inc 6.125% 15/09/2024 | 513,750 | 0.05 |
| 425,000 | Peabody Energy Corp FRN 15/11/2021 | 272,000 | 0.03 |
| 950,000 | Peabody Energy Corp FRN 15/03/2022 | 821,750 | 0.09 |
| 325,000 | Peabody Energy Corp FRN 15/12/2041 | 67,641 | 0.01 |
| 625,000 | Penn National Gaming Inc 5.875% 01/11/2021 | 651,563 | 0.07 |
| 475,000 | Penske Automotive Group Inc 5.5% 15/05/2026 | 459,007 | 0.05 |
| 950,000 | Penske Automotive Group Inc 5.75% 01/10/2022 | 976,125 | 0.10 |
| 355,000 | Performance Food Group Inc 5.5% 01/06/2024 | 356,775 | 0.04 |
| 1,765,000 | PetSmart Inc 7.125% 15/03/2023 | 1,811,331 | 0.19 |
| 2,095,000 | PHI Inc 5.25% 15/03/2019 | 1,974,538 | 0.21 |
| 2,485,000 | Pilgrim's Pride Corp 5.75% 15/03/2025 | 2,491,213 | 0.26 |
| 2,970,000 | Pinnacle Foods Finance LLC / Pinnacle Foods Finance Corp 4.875% 01/05/2021 | 3,051,675 | 0.32 |
| 925,000 | Pinnacle Foods Finance LLC / Pinnacle Foods Finance Corp 5.875% 15/01/2024 | 978,188 | 0.10 |
| 2,655,000 | Plantronics Inc 5.5% 31/05/2023 | 2,668,275 | 0.28 |
| 2,800,000 | Plastipak Holdings Inc 6.5% 01/10/2021 | 2,940,000 | 0.31 |
| 375,000 | Platform Specialty Products Corp 6.5% 01/02/2022 | 371,250 | 0.04 |
| 125,000 | Platform Specialty Products Corp 10.375% 01/05/2021 | 136,875 | 0.01 |
| 1,200,000 | Post Holdings Inc 5% 15/08/2026 | 1,138,500 | 0.12 |
| 900,000 | Post Holdings Inc 6.75% 01/12/2021 | 962,100 | 0.10 |
| 2,495,000 | Post Holdings Inc 7.75% 15/03/2024 | 2,763,213 | 0.29 |
| 3,290,000 | Prestige Brands Inc 5.375% 15/12/2021 | 3,396,925 | 0.36 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 350,000 | Prestige Brands Inc 6.375% 01/03/2024 | 367,500 | 0.04 |
| 600,000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc 9.25% 15/05/2023 | 646,500 | 0.07 |
| 1,150,000 | PriSo Acquisition Corp 9% 15/05/2023** | 1,109,750 | 0.12 |
| 2,305,000 | PSPC Escrow Corp 6% 01/02/2023 | 2,392,011 | 0.25 |
| 625,000 | Qorvo Inc 7% 01/12/2025 | 681,250 | 0.07 |
| 3,200,000 | Quintiles IMS Inc 3.5% 15/10/2024 | 3,446,602 | 0.37 |
| 1,350,000 | Radian Group Inc 5.25% 15/06/2020 | 1,393,875 | 0.15 |
| 400,000 | Radian Group Inc 7% 15/03/2021 | 436,880 | 0.05 |
| 625,000 | Radio Systems Corp 8.375% 01/11/2019** | 648,828 | 0.08 |
| 1,045,000 | Range Resources Corp 4.875% 15/05/2025 | 992,750 | 0.11 |
| 805,000 | Range Resources Corp 5% 15/08/2022 | 776,825 | 0.08 |
| 650,000 | Range Resources Corp 5% 15/03/2023 | 625,625 | 0.07 |
| 825,000 | Range Resources Corp 5.875% 01/07/2022 | 833,250 | 0.09 |
| 1,050,000 | RCN Telecom Services LLC / RCN Capital Corp 8.5% 15/08/2020** | 1,114,313 | 0.12 |
| 500,000 | Regal Entertainment Group 5.75% 15/06/2023 | 510,000 | 0.05 |
| 1,775,000 | Rent-A-Center Inc 4.75% 01/05/2021 | 1,455,500 | 0.15 |
| 1,025,000 | Rent-A-Center Inc 6.625% 15/11/2020 | 953,250 | 0.10 |
| 700,000 | Resolute Energy Corp 8.5% 01/05/2020 | 705,250 | 0.07 |
| 600,000 | Resolute Forest Products Inc 5.875% 15/05/2023 | 468,000 | 0.05 |
| 225,000 | Revlon Consumer Products Corp 5.75% 15/02/2021 | 224,719 | 0.02 |
| 675,000 | Revlon Consumer Products Corp 6.25% 01/08/2024 | 668,250 | 0.07 |
| 1,610,000 | Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.125% 15/07/2023 | 1,628,113 | 0.17 |
| 2,180,000 | Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020 | 2,245,400 | 0.24 |
| 1,715,000 | Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 7% 15/07/2024 | 1,813,613 | 0.19 |
| 913,801 | Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 8.25% 15/02/2021 | 943,965 | 0.10 |
| 1,780,000 | RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 5% 15/04/2023 | 1,811,150 | 0.19 |
| 525,000 | Rice Energy Inc 6.25% 01/05/2022 | 539,438 | 0.06 |
| 800,000 | Rice Energy Inc 7.25% 01/05/2023 | 844,000 | 0.09 |
| 1,410,000 | Rite Aid Corp 6.125% 01/04/2023 | 1,512,437 | 0.16 |
| 450,000 | Rite Aid Corp 6.75% 15/06/2021 | 474,413 | 0.05 |
| 300,000 | Rite Aid Corp 7.7% 15/02/2027 | 372,000 | 0.04 |
| 1,225,000 | Rose Rock Midstream LP / Rose Rock Finance Corp 5.625% 15/07/2022 | 1,182,125 | 0.13 |
| 725,000 | RP Crown Parent LLC 7.375% 15/10/2024 | 745,844 | 0.08 |
| 425,000 | RR Donnelley & Sons Co 6% 01/04/2024 | 385,688 | 0.04 |
| 31,000 | RR Donnelley & Sons Co 7% 15/02/2022 | 30,070 | - |
| 1,100,000 | RSI Home Products Inc 6.5% 15/03/2023 | 1,152,250 | 0.12 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 150,000 | RSP Permian Inc 6.625% 01/10/2022 | 158,250 | 0.02 |
| 1,125,000 | rue21 inc 9% 15/10/2021 | 286,875 | 0.03 |
| 775,000 | Sabine Oil & Gas Corp FRN 15/02/2017** | 4,650 | - |
| 1,600,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5% 15/03/2027 | 1,584,000 | 0.17 |
| 1,609,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01/02/2021 | 1,713,585 | 0.18 |
| 1,275,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/04/2023 | 1,338,750 | 0.14 |
| 775,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01/03/2025 | 810,844 | 0.09 |
| 550,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/05/2024 | 583,000 | 0.06 |
| 1,230,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 6.25% 15/03/2022 | 1,331,475 | 0.14 |
| 425,000 | Sabra Health Care LP / Sabra Capital Corp 5.5% 01/02/2021 | 437,219 | 0.05 |
| 1,105,000 | Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01/12/2025 | 1,151,963 | 0.12 |
| 275,000 | Sanchez Energy Corp 6.125% 15/01/2023 | 242,000 | 0.03 |
| 10,000 | SBA Communications Corp 4.875% 15/07/2022 | 10,033 | - |
| 3,920,000 | SBA Communications Corp 4.875% 01/09/2024 | 3,787,700 | 0.40 |
| 200,000 | Scientific Games Corp 8.125% 15/09/2018 | 201,500 | 0.02 |
| 1,350,000 | Scientific Games International Inc 7% 01/01/2022 | 1,431,000 | 0.15 |
| 1,775,000 | Scientific Games International Inc 10% 01/12/2022 | 1,672,938 | 0.18 |
| 1,930,000 | Scotts Miracle-Gro Co 6% 15/10/2023 | 2,050,625 | 0.22 |
| 200,000 | Sealed Air Corp 5.125% 01/12/2024 | 204,000 | 0.02 |
| 300,000 | Select Medical Corp 6.375% 01/06/2021 | 289,311 | 0.03 |
| 700,000 | Service Corp International/US 5.375% 15/01/2022 | 728,000 | 0.08 |
| 275,000 | Seventy Seven Ener 6.50% 15/07/2022** | 16,844 | - |
| 275,000 | Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 5.875% 01/04/2023 | 268,813 | 0.03 |
| 275,000 | Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 6.125% 01/04/2025 | 268,125 | 0.03 |
| 450,000 | Sidewinder Drilling Inc 9.75% 15/11/2019 | 31,500 | - |
| 475,000 | Sinclair Television Group Inc 5.125% 15/02/2027 | 442,938 | 0.05 |
| 246,000 | Sinclair Television Group Inc 5.375% 01/04/2021 | 253,995 | 0.03 |
| 300,000 | Sinclair Television Group Inc 5.875% 15/03/2026 | 298,500 | 0.03 |
| 1,100,000 | Sirius XM Radio Inc 6% 15/07/2024 | 1,146,750 | 0.12 |
| 2,170,000 | Six Flags Entertainment Corp 4.875% 31/07/2024 | 2,110,325 | 0.22 |
| 225,000 | SM Energy Co 5% 15/01/2024 | 213,188 | 0.02 |
| 550,000 | SM Energy Co 6.125% 15/11/2022 | 554,125 | 0.06 |
| 75,000 | SM Energy Co 6.5% 15/11/2021 | 76,031 | 0.01 |
| 1,125,000 | SM Energy Co 6.75% 15/09/2026 | 1,158,047 | 0.12 |
| 2,360,000 | Smithfield Foods Inc 6.625% 15/08/2022 | 2,498,650 | 0.27 |
| 1,900,000 | Sonic Automotive Inc 7% 15/07/2022 | 1,990,250 | 0.21 |
| 63,775 | Sorenson Communications Inc PIK 31/10/2020** | 56,760 | 0.01 |
| 37,394 | Sorenson Holdings LLC / Sorenson Finance Corp PIK 31/10/2021** | 35,197 | - |
| 400,000 | Southern Graphics Inc 8.375% 15/10/2020** | 407,000 | 0.04 |
| 1,415,000 | Southwestern Energy Co 4.1% 15/03/2022 | 1,308,875 | 0.14 |
| 1,535,000 | Southwestern Energy Co 4.95% 23/01/2025 | 1,527,325 | 0.16 |
| 425,000 | Southwestern Energy Co 5.8% 23/01/2020 | 435,625 | 0.05 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 228,000 | Southwestern Energy Co 7.5% 01/02/2018 | 239,400 | 0.03 |
| 1,225,000 | Spectrum Brands Inc 4% 01/10/2026 [†] | 1,310,862 | 0.14 |
| 2,445,000 | Spectrum Brands Inc 5.75% 15/07/2025 | 2,548,913 | 0.27 |
| 550,000 | Springleaf Finance Corp 6% 01/06/2020 | 541,063 | 0.06 |
| 275,000 | Springleaf Finance Corp 8.25% 01/10/2023 | 276,375 | 0.03 |
| 375,000 | Sprint Capital Corp 6.9% 01/05/2019 | 391,875 | 0.04 |
| 3,325,000 | Sprint Capital Corp 8.75% 15/03/2032 | 3,499,563 | 0.37 |
| 675,000 | Sprint Communications Inc 6% 01/12/2016 | 675,000 | 0.07 |
| 8,559,000 | Sprint Communications Inc 6% 15/11/2022 | 8,276,981 | 0.88 |
| 150,000 | Sprint Communications Inc 7% 15/08/2020 | 156,000 | 0.02 |
| 250,000 | Sprint Communications Inc 8.375% 15/08/2017 | 260,391 | 0.03 |
| 700,000 | Sprint Communications Inc 9% 15/11/2018 | 770,875 | 0.08 |
| 435,000 | Sprint Corp 7.25% 15/09/2021 | 446,963 | 0.05 |
| 2,625,000 | Sprint Corp 7.875% 15/09/2023 | 2,716,875 | 0.29 |
| 275,000 | SPX FLOW Inc 5.625% 15/08/2024 | 270,875 | 0.03 |
| 275,000 | SPX FLOW Inc 5.875% 15/08/2026 | 269,500 | 0.03 |
| 1,080,000 | SS&C Technologies Holdings Inc 5.875% 15/07/2023 | 1,107,000 | 0.12 |
| 175,000 | Standard Industries Inc 5.125% 15/02/2021 | 182,875 | 0.02 |
| 2,510,000 | Standard Industries Inc 5.375% 15/11/2024 | 2,566,475 | 0.27 |
| 815,000 | Standard Industries Inc 5.5% 15/02/2023 | 841,488 | 0.09 |
| 1,340,000 | Standard Industries Inc 6% 15/10/2025 | 1,400,300 | 0.15 |
| 300,000 | StandardAero Aviation Holdings Inc 10% 15/07/2023 | 318,375 | 0.03 |
| 325,000 | Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026 | 327,438 | 0.03 |
| 1,625,000 | Steel Dynamics Inc 5.125% 01/10/2021 | 1,702,188 | 0.18 |
| 10,000 | Steel Dynamics Inc 5.5% 01/10/2024 | 10,600 | - |
| 2,490,000 | Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.5% 01/06/2024 | 2,508,675 | 0.27 |
| 1,225,000 | Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 7.375% 01/08/2021 | 1,268,641 | 0.13 |
| 3,850,000 | Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6.125% 15/07/2023 | 3,927,000 | 0.42 |
| 100,000 | Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 8.5% 15/04/2022 | 110,625 | 0.01 |
| 625,000 | Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.5% 15/08/2022 | 614,063 | 0.07 |
| 1,000,000 | Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 7.5% 01/07/2021 | 1,052,500 | 0.11 |
| 2,300,000 | SunCoke Energy Partners LP / SunCoke Energy Partners Finance Corp 7.375% 01/02/2020 | 2,288,500 | 0.24 |
| 275,000 | SunCoke Energy Partners LP / SunCoke Energy Partners Finance Corp 7.375% 01/02/2020 '144A' | 273,625 | 0.03 |
| 275,000 | Sungard Availability Services Capital Inc 8.75% 01/04/2022 | 191,813 | 0.02 |
| 725,000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.5% 01/08/2020 | 729,531 | 0.08 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 1,850,000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.25% 15/04/2021 | 1,874,273 | 0.20 |
| 325,000 | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp 5.5% 15/09/2024 | 322,563 | 0.03 |
| 1,500,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.125% 15/11/2019 | 1,522,500 | 0.16 |
| 790,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.125% 01/02/2025 | 781,610 | 0.08 |
| 2,095,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.75% 15/03/2024 | 2,231,175 | 0.24 |
| 175,000 | TEGNA Inc 4.875% 15/09/2021 | 180,469 | 0.02 |
| 250,000 | TEGNA Inc 6.375% 15/10/2023 | 263,908 | 0.03 |
| 3,625,000 | Tempur Sealy International Inc 5.5% 15/06/2026 | 3,615,938 | 0.38 |
| 95,000 | Tempur Sealy International Inc 5.625% 15/10/2023 | 97,375 | 0.01 |
| 1,625,000 | Tenet Healthcare Corp 4.375% 01/10/2021 | 1,555,938 | 0.17 |
| 130,000 | Tenet Healthcare Corp 4.5% 01/04/2021 | 126,750 | 0.01 |
| 660,000 | Tenet Healthcare Corp 4.75% 01/06/2020 | 655,875 | 0.07 |
| 3,295,000 | Tenet Healthcare Corp 6.75% 15/06/2023 | 2,825,463 | 0.30 |
| 1,090,000 | Tenet Healthcare Corp 7.5% 01/01/2022 | 1,123,381 | 0.12 |
| 325,000 | Tenet Healthcare Corp 8.125% 01/04/2022 | 437,000 | 0.05 |
| 710,000 | Tenneco Inc 5.375% 15/12/2024 | 734,850 | 0.08 |
| 600,000 | Terraform Global Operating LLC 9.75% 15/08/2022 | 643,500 | 0.07 |
| 2,895,000 | TerraForm Power Operating LLC 5.875% 01/02/2023 | 2,975,481 | 0.32 |
| 450,000 | TerraForm Power Operating LLC 6.125% 15/06/2025 | 469,125 | 0.05 |
| 125,000 | Tesoro Corp 5.125% 01/04/2024 | 130,000 | 0.01 |
| 925,000 | Tesoro Corp 5.375% 01/10/2022 | 965,469 | 0.10 |
| 200,000 | Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.25% 15/01/2025 | 203,000 | 0.02 |
| 200,000 | Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.5% 15/10/2019 | 213,250 | 0.02 |
| 118,000 | Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.875% 01/10/2020 | 121,971 | 0.01 |
| 3,240,000 | Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.125% 15/10/2021 | 3,391,875 | 0.36 |
| 400,000 | Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.375% 01/05/2024 | 433,000 | 0.05 |
| 575,000 | Texas Competitive 11.50% 01/10/2020 ** | - | - |
| 425,000 | Time Inc 5.75% 15/04/2022 | 431,375 | 0.05 |
| 450,000 | Titan International Inc 6.875% 01/10/2020 | 438,750 | 0.05 |
| 2,535,000 | T-Mobile USA Inc 6% 01/03/2023 | 2,661,750 | 0.28 |
| 1,650,000 | T-Mobile USA Inc 6% 15/04/2024 | 1,736,625 | 0.18 |
| 925,000 | T-Mobile USA Inc 6.125% 15/01/2022 | 970,862 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 2,485,000 | T-Mobile USA Inc 6.25% 01/04/2021 | 2,596,825 | 0.28 |
| 550,000 | T-Mobile USA Inc 6.375% 01/03/2025 | 589,188 | 0.06 |
| 150,000 | T-Mobile USA Inc 6.464% 28/04/2019 | 152,625 | 0.02 |
| 125,000 | T-Mobile USA Inc 6.5% 15/01/2024 | 133,866 | 0.01 |
| 950,000 | T-Mobile USA Inc 6.625% 01/04/2023 | 1,007,000 | 0.11 |
| 450,000 | T-Mobile USA Inc 6.633% 28/04/2021 | 470,813 | 0.06 |
| 700,000 | T-Mobile USA Inc 6.731% 28/04/2022 | 733,145 | 0.09 |
| 675,000 | T-Mobile USA Inc 6.836% 28/04/2023 | 718,031 | 0.08 |
| 2,400,000 | TMS International Corp 7.625% 15/10/2021 | 1,974,000 | 0.21 |
| 550,000 | ToII Brothers Finance Corp 5.625% 15/01/2024 | 569,250 | 0.06 |
| 774,000 | Tops Holding II Corp 8.75% 15/06/2018 | 688,860 | 0.07 |
| 150,000 | Tops Holding LLC / Tops Markets II Corp 8% 15/06/2022 | 130,125 | 0.01 |
| 750,000 | Townsquare Media Inc 6.5% 01/04/2023 | 711,563 | 0.08 |
| 1,750,000 | TPC Group Inc 8.75% 15/12/2020 ** | 1,426,250 | 0.16 |
| 208,000 | TRAC Intermodal LLC / TRAC Intermodal Corp 11% 15/08/2019 | 219,570 | 0.02 |
| 1,775,000 | TransDigm Inc 6% 15/07/2022 | 1,837,125 | 0.20 |
| 725,000 | TransDigm Inc 6.375% 15/06/2026 | 741,313 | 0.08 |
| 2,080,000 | TreeHouse Foods Inc 6% 15/02/2024 | 2,168,400 | 0.23 |
| 475,000 | TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc 4.375% 15/06/2019 | 484,500 | 0.05 |
| 425,000 | TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc 5.875% 15/06/2024 | 432,969 | 0.05 |
| 275,000 | Triangle USA Petroleum Corp 6.75% 15/07/2022 ** | 68,750 | 0.01 |
| 700,000 | Triumph Group Inc 4.875% 01/04/2021 | 644,000 | 0.08 |
| 525,000 | Triumph Group Inc 5.25% 01/06/2022 | 477,750 | 0.05 |
| 2,840,000 | Tronox Finance LLC 6.375% 15/08/2020 | 2,602,150 | 0.28 |
| 330,000 | United Rentals North America Inc 5.5% 15/05/2027 | 330,347 | 0.04 |
| 330,000 | United Rentals North America Inc 5.875% 15/09/2026 | 338,250 | 0.04 |
| 618,000 | United Rentals North America Inc 7.625% 15/04/2022 | 656,625 | 0.07 |
| 990,000 | Universal Hospital Services Inc 7.625% 15/08/2020 | 947,430 | 0.10 |
| 3,044,000 | Univision Communications Inc 5.125% 15/05/2023 | 2,945,070 | 0.31 |
| 750,000 | Univision Communications Inc 5.125% 15/02/2025 | 713,438 | 0.08 |
| 650,000 | Univision Communications Inc 6.75% 15/09/2022 | 676,000 | 0.07 |
| 127,145 | US Airways 2012-2 Class B Pass Through Trust 6.75% 03/06/2021 ** | 136,840 | 0.01 |
| 400,000 | US Concrete Inc 6.375% 01/06/2024 | 418,000 | 0.04 |
| 215,000 | USG Corp 5.5% 01/03/2025 | 221,472 | 0.02 |
| 950,000 | USI Inc 7.75% 15/01/2021 | 969,000 | 0.10 |
| 1,200,000 | Valeant Pharmaceuticals International 6.375% 15/10/2020 | 1,026,000 | 0.11 |
| 490,000 | Valeant Pharmaceuticals International 6.75% 15/08/2021 | 406,700 | 0.04 |
| 25,000 | Valeant Pharmaceuticals International 7% 01/10/2020 | 21,750 | - |
| 100,000 | Valeant Pharmaceuticals International 7.25% 15/07/2022 | 82,500 | 0.01 |
| 325,000 | Valvoline Inc 5.5% 15/07/2024 | 337,594 | 0.04 |
| 263,125 | Vander Intermediate Holding II Corp PIK 01/02/2019 | 173,005 | 0.02 |
| 200,000 | Versum Materials Inc 5.5% 30/09/2024 | 204,500 | 0.02 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 850,000 | ViaSat Inc 6.875% 15/06/2020 | 875,326 | 0.09 |
| 1,815,000 | VWR Funding Inc 4.625% 15/04/2022 | 1,997,553 | 0.21 |
| 1,210,000 | Walter Investment Management Corp 7.875% 15/12/2021 | 928,675 | 0.10 |
| 500,000 | Washington Mutual Bank FRN 01/05/2009 | 106,875 | 0.01 |
| 2,010,000 | Watco Cos LLC / Watco Finance Corp 6.375% 01/04/2023 | 2,070,300 | 0.22 |
| 436,810 | Wave Holdco LLC / Wave Holdco Corp PIK 15/07/2019 ** | 442,270 | 0.05 |
| 250,000 | WaveDivision Escrow LLC / WaveDivision Escrow Corp 8.125% 01/09/2020 | 259,063 | 0.03 |
| 275,000 | Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6% 01/02/2023 | 251,625 | 0.03 |
| 500,000 | WellCare Health Plans Inc 5.75% 15/11/2020 | 512,813 | 0.05 |
| 425,000 | Wells Fargo & Co FRN Series 'S' Perpetual | 427,763 | 0.05 |
| 225,000 | Wells Fargo & Co FRN Series 'U' Perpetual | 232,277 | 0.02 |
| 250,000 | Western Digital Corp 7.375% 01/04/2023 | 270,625 | 0.03 |
| 825,000 | Western Digital Corp 10.5% 01/04/2024 | 957,000 | 0.10 |
| 300,000 | Whiting Petroleum Corp 5% 15/03/2019 | 297,750 | 0.03 |
| 475,000 | Whiting Petroleum Corp 5.75% 15/03/2021 | 470,250 | 0.05 |
| 200,000 | William Lyon Homes Inc 5.75% 15/04/2019 | 203,000 | 0.02 |
| 250,000 | William Lyon Homes Inc 7% 15/08/2022 | 260,625 | 0.03 |
| 925,000 | William Lyon Homes Inc 8.5% 15/11/2020 | 966,625 | 0.10 |
| 400,000 | Williams Cos Inc 3.7% 15/01/2023 | 379,000 | 0.05 |
| 750,000 | Williams Cos Inc 4.55% 24/06/2024 | 735,000 | 0.08 |
| 50,000 | Williams Cos Inc 7.5% 15/01/2031 | 55,375 | 0.01 |
| 600,000 | Williams Partners LP / ACMP Finance Corp 4.875% 15/05/2023 | 607,792 | 0.06 |
| 375,000 | Williams Partners LP / ACMP Finance Corp 4.875% 15/03/2024 | 378,438 | 0.05 |
| 475,000 | Williams Partners LP / ACMP Finance Corp 6.125% 15/07/2022 | 487,779 | 0.05 |
| 575,000 | Windstream Holding of the Midwest Inc 6.75% 01/04/2028 ** | 485,875 | 0.05 |
| 900,000 | Windstream Services LLC 7.5% 01/06/2022 | 854,721 | 0.09 |
| 150,000 | Windstream Services LLC 7.75% 15/10/2020 | 153,375 | 0.02 |
| 425,000 | Wise Metals Group LLC / Wise Alloys Finance Corp 8.75% 15/12/2018 | 443,063 | 0.05 |
| 421,000 | Wise Metals Intermediate Holdings LLC / Wise Holdings Finance Corp PIK 15/06/2019 | 441,524 | 0.05 |
| 670,000 | WMG Acquisition Corp 4.125% 01/11/2024 | 727,200 | 0.09 |
| 75,000 | WMG Acquisition Corp 4.875% 01/11/2024 | 74,625 | 0.01 |
| 175,000 | WMG Acquisition Corp 5% 01/08/2023 | 175,438 | 0.02 |
| 275,000 | Woodside Homes Co LLC / Woodside Homes Finance Inc 6.75% 15/12/2021 ** | 262,625 | 0.03 |
| 500,000 | WPX Energy Inc 6% 15/01/2022 | 514,845 | 0.05 |
| 325,000 | WPX Energy Inc 7.5% 01/08/2020 | 344,500 | 0.04 |
| 600,000 | WR Grace & Co-Conn 5.125% 01/10/2021 | 631,500 | 0.07 |
| 325,000 | XPO Logistics Inc 6.125% 01/09/2023 | 333,125 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|--------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.88% (31 May 2016: 90.34%) | | |
| | 米国(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| | 社債(つづき) : 73.58% (31 May 2016: 70.60%) | | |
| 2,150,000 | Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 01/04/2023 | 2,252,125 | 0.24 |
| 125,000 | Zekelman Industries Inc 9.875% 15/06/2023 | 134,375 | 0.01 |
| 1,050,000 | ZF North America Capital Inc 4.5% 29/04/2022 | 1,088,064 | 0.12 |
| | 米国合計 | 691,996,429 | 73.58 |
| | 債券合計 | 855,059,310 | 90.88 |
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る未収収益 : | | |
| | 1.50% (1.54%) | 14,102,404 | 1.50 |
| | 株式 : 0.65% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| | カナダ : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | 林産品・紙製品 : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 17,863 | Catalyst Paper Corp Com NPV ** | 8,213 | - |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,840 | Beech Holdings LLC USD1.00 ** | 22,364 | - |
| | カナダ合計 | 30,577 | - |
| | フランス : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | ワラント : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 189,900 | Novasep Holding SAS NPV ** | - | - |
| | フランス合計 | - | - |
| | ルクセンブルグ : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 化学 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class A ** | 35,661 | 0.01 |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class B ** | 35,661 | 0.01 |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class C ** | 35,661 | 0.01 |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class D ** | 35,661 | 0.01 |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class E ** | 35,661 | - |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class F ** | 35,661 | - |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class G ** | 35,661 | - |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class H ** | 35,661 | - |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class I ** | 35,661 | - |
| 13,356 | Novasep Holding Alphabet Share Class J ** | 35,661 | - |
| | ルクセンブルグ合計 | 356,610 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 0.65% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| | マーシャル諸島 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 運輸 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 米国 : 0.61% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 5,185 | Exide Technologies USD0.01 ** | 15,555 | - |
| | 銀行 : 0.20% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 16,068 | Citigroup Inc Class K Pref USD25.00 | 429,657 | 0.05 |
| 57,100 | GMAC Capital 8.125% Pref 15/02/2040 USD25.00 | 1,435,780 | 0.15 |
| | 建設資材 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 商業サービス : 0.02% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 52,593 | iPayment Holdings Inc Com USD0.01 ** | 184,075 | 0.02 |
| | 普通株式 : 0.03% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 9,842,533 | Education Management Corp USD0.01 ** | 310,490 | 0.03 |
| 2,835 | Exide Technologies USD1.00 ** | 5,315 | - |
| | 各種金融サービス : 0.02% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 7,619 | Cowen Group Inc 8.25% Senior Notes Due 2021 Pref USD25.00 | 196,760 | 0.02 |
| 1,233,863 | EME Reorganization Trust Com NPV | 5,676 | - |
| | 電気 : 0.02% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 4,980 | NRG Energy Inc Com USD0.01 | 56,498 | 0.01 |
| 9,847 | Vistra Energy † | 137,365 | 0.01 |
| | 代替エネルギー資源 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 10,809 | Colt Holdings Inc Rest Class B Units USD1.00 ** | 10,809 | - |
| | 外貨 : 0.11% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 8,193 | Allen Group USD1.00 ** | 233,500 | 0.02 |
| 31,200 | UC Holdings Inc USD1.00 ** | 873,600 | 0.09 |
| | インターネット : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 23,922 | Bluestem Group Inc Com USD0.001 † | 23,922 | - |
| | 金属加工/金属製品 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 14 | Atrium Companies NPV ** | - | - |
| | 石油・ガス : 0.17% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 90,596 | Denbury Resources Inc Com USD0.001 | 342,906 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 0.65% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| | 米国(つづき) : 0.61% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| | 石油・ガス(つづき) : 0.17% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 111,597 | Halcon Resources Corp Com USD0.0001 | 1,061,845 | 0.12 |
| 30,980 | Hercules Offshore Inc Com USD0.01 [†] | 37,176 | 0.01 |
| 915 | Midstates Petroleum Co Inc Com NPV | 18,780 | - |
| 436 | Seventy Seven Energy Inc Com NPV | 10,621 | - |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,078 | Directbuy Holdings Inc USD1.00 ^{**} | 22 | - |
| | 公衆衛生サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 340 | Aquilex Holdings LLC Class A NPV ^{**} | - | - |
| 534 | Aquilex Holdings LLC Class B NPV ^{**} | - | - |
| | トラック輸送・リース : 0.04% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 12,209 | General Finance Co 8.125% Senior Notes Due 2021 Pref USD25.00 | 297,839 | 0.04 |
| | ワラント : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 1,352 | Affinion Group Holdings Class C 10/07/2016 USD1.00 ^{**} | 2,704 | - |
| 1,423 | Affinion Group Holdings Class D 10/07/2016 USD1.00 ^{**} | 2,135 | - |
| 1,277 | Aventine Renewable Energy Holdings 24/09/2017 USD1.00 ^{**} | 20,432 | - |
| 6,043,358 | Education Management Corp 05/01/2022 USD1.00 ^{**} | - | - |
| 1,652 | General Motors Co 10/07/2019 NPV | 26,878 | - |
| 216,718 | iPayment Holdings Inc 29/12/2022 NPV ^{**} | 32,508 | - |
| 2,372 | Seventy Seven Energy Inc NPV [†] | 17,731 | - |
| 6,488 | Midstates Petroleum USD1.00 ^{**} | 7,590 | - |
| | 米国合計 | 5,798,169 | 0.61 |
| | 株式合計 | 6,185,356 | 0.65 |
| | 先渡為替契約 : -0.82% (31 May 2016: 0.31%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|----------------|-----|------------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| Northern Trust | USD | 43,504,101 | EUR | 39,217,615 | 06/12/2016 | 1,897,147 | 0.20 |
| Northern Trust | USD | 2,026,491 | EUR | 1,834,621 | 06/12/2016 | 80,096 | 0.01 |
| Northern Trust | USD | 409,616 | EUR | 376,579 | 06/12/2016 | 10,094 | - |
| UBS | GBP | 4,682,048 | USD | 5,801,806 | 15/12/2016 | 50,204 | 0.01 |
| UBS | USD | 597,280 | EUR | 540,091 | 15/12/2016 | 23,980 | 0.01 |
| UBS | USD | 664,870 | EUR | 606,723 | 15/12/2016 | 20,841 | - |
| UBS | USD | 918,469 | EUR | 855,215 | 15/12/2016 | 10,668 | - |
| UBS | USD | 916,503 | EUR | 853,385 | 15/12/2016 | 10,645 | - |
| UBS | USD | 178,889 | EUR | 161,761 | 15/12/2016 | 7,182 | - |
| UBS | GBP | 366,642 | USD | 451,517 | 15/12/2016 | 6,743 | - |
| UBS | GBP | 1,374,694 | USD | 1,713,053 | 15/12/2016 | 5,153 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.82% (31 May 2016: 0.31%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|---------|-----|---------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 464,607 | EUR | 432,877 | 15/12/2016 | 5,113 | - |
| UBS | USD | 166,862 | EUR | 153,234 | 15/12/2016 | 4,206 | - |
| UBS | USD | 349,382 | EUR | 325,321 | 15/12/2016 | 4,058 | - |
| UBS | USD | 326,941 | EUR | 304,425 | 15/12/2016 | 3,797 | - |
| UBS | GBP | 485,646 | USD | 603,470 | 15/12/2016 | 3,529 | - |
| UBS | GBP | 392,000 | USD | 486,644 | 15/12/2016 | 3,309 | - |
| UBS | GBP | 469,127 | USD | 583,050 | 15/12/2016 | 3,303 | - |
| UBS | USD | 261,359 | EUR | 243,359 | 15/12/2016 | 3,036 | - |
| UBS | GBP | 267,333 | USD | 331,552 | 15/12/2016 | 2,584 | - |
| UBS | USD | 385,473 | EUR | 360,821 | 15/12/2016 | 2,466 | - |
| UBS | USD | 77,370 | EUR | 71,051 | 15/12/2016 | 1,950 | - |
| UBS | USD | 159,846 | EUR | 148,838 | 15/12/2016 | 1,857 | - |
| UBS | USD | 161,969 | EUR | 150,843 | 15/12/2016 | 1,851 | - |
| UBS | USD | 146,263 | EUR | 136,275 | 15/12/2016 | 1,610 | - |
| UBS | USD | 128,024 | EUR | 119,230 | 15/12/2016 | 1,463 | - |
| UBS | GBP | 294,252 | USD | 366,339 | 15/12/2016 | 1,441 | - |
| UBS | GBP | 705,739 | USD | 880,663 | 15/12/2016 | 1,428 | - |
| UBS | USD | 123,677 | EUR | 115,230 | 15/12/2016 | 1,361 | - |
| UBS | USD | 41,716 | EUR | 38,068 | 15/12/2016 | 1,308 | - |
| UBS | USD | 107,688 | EUR | 100,271 | 15/12/2016 | 1,251 | - |
| UBS | USD | 100,078 | EUR | 93,186 | 15/12/2016 | 1,162 | - |
| UBS | USD | 25,942 | EUR | 23,458 | 15/12/2016 | 1,042 | - |
| UBS | EUR | 398,524 | USD | 422,020 | 15/12/2016 | 1,008 | - |
| UBS | USD | 83,630 | EUR | 77,870 | 15/12/2016 | 971 | - |
| UBS | GBP | 124,904 | USD | 155,208 | 15/12/2016 | 908 | - |
| UBS | GBP | 178,915 | USD | 222,809 | 15/12/2016 | 813 | - |
| UBS | USD | 20,192 | EUR | 18,259 | 15/12/2016 | 811 | - |
| UBS | EUR | 185,116 | USD | 195,888 | 15/12/2016 | 611 | - |
| UBS | USD | 45,204 | EUR | 42,090 | 15/12/2016 | 525 | - |
| UBS | EUR | 59,934 | USD | 63,157 | 15/12/2016 | 462 | - |
| UBS | USD | 61,068 | EUR | 57,162 | 15/12/2016 | 391 | - |
| UBS | EUR | 120,935 | USD | 128,065 | 15/12/2016 | 306 | - |
| UBS | EUR | 90,183 | USD | 95,430 | 15/12/2016 | 297 | - |
| UBS | USD | 370,849 | EUR | 349,094 | 15/12/2016 | 289 | - |
| UBS | EUR | 533,125 | USD | 565,635 | 15/12/2016 | 271 | - |
| UBS | EUR | 403,069 | USD | 427,648 | 15/12/2016 | 205 | - |
| UBS | GBP | 175,036 | USD | 218,602 | 15/12/2016 | 172 | - |
| UBS | USD | 26,994 | EUR | 25,271 | 15/12/2016 | 169 | - |
| UBS | USD | 3,203 | EUR | 2,942 | 15/12/2016 | 81 | - |
| UBS | EUR | 38,529 | USD | 40,826 | 15/12/2016 | 72 | - |
| UBS | EUR | 40,343 | USD | 42,757 | 15/12/2016 | 67 | - |
| UBS | EUR | 15,369 | USD | 16,263 | 15/12/2016 | 51 | - |
| UBS | EUR | 16,544 | USD | 17,519 | 15/12/2016 | 42 | - |
| UBS | USD | 3,066 | EUR | 2,857 | 15/12/2016 | 34 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.82% (31 May 2016: 0.31%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 16,562 | EUR | 15,582 | 15/12/2016 | 22 | - |
| UBS | USD | 12,727 | EUR | 11,974 | 15/12/2016 | 17 | - |
| UBS | USD | 16,632 | EUR | 15,656 | 15/12/2016 | 13 | - |
| UBS | GBP | 200 | USD | 248 | 15/12/2016 | 2 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 2,184,488 | 0.23 |
| Barclays^ | USD | 3,226 | GBP | 2,594 | 15/12/2016 | (16) | - |
| Barclays^ | USD | 20,642 | GBP | 16,598 | 15/12/2016 | (103) | - |
| Barclays^ | USD | 26,845 | GBP | 21,586 | 15/12/2016 | (134) | - |
| Barclays^ | USD | 61,162 | GBP | 49,179 | 15/12/2016 | (306) | - |
| Barclays^ | USD | 71,593 | GBP | 57,566 | 15/12/2016 | (358) | - |
| Barclays^ | USD | 86,502 | GBP | 69,554 | 15/12/2016 | (433) | - |
| Barclays^ | USD | 120,773 | GBP | 97,111 | 15/12/2016 | (604) | - |
| Barclays^ | USD | 587,718 | GBP | 472,571 | 15/12/2016 | (2,940) | - |
| Barclays^ | USD | 9,505,297 | GBP | 7,643,000 | 15/12/2016 | (47,556) | (0.01) |
| Northern Trust | GBP | 26,273 | USD | 33,166 | 06/12/2016 | (338) | - |
| Northern Trust | USD | 624,261 | GBP | 500,952 | 06/12/2016 | (1,672) | - |
| Northern Trust | USD | 8,442,066 | GBP | 6,862,854 | 06/12/2016 | (132,986) | (0.01) |
| UBS | USD | 2,097 | EUR | 1,976 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 275 | GBP | 221 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | EUR | 10,098 | USD | 10,727 | 15/12/2016 | (9) | - |
| UBS | USD | 54,831 | EUR | 51,681 | 15/12/2016 | (27) | - |
| UBS | EUR | 47,189 | USD | 50,131 | 15/12/2016 | (41) | - |
| UBS | EUR | 14,292 | USD | 15,266 | 15/12/2016 | (96) | - |
| UBS | USD | 32,295 | EUR | 30,519 | 15/12/2016 | (101) | - |
| UBS | EUR | 97,104 | USD | 103,212 | 15/12/2016 | (138) | - |
| UBS | EUR | 23,666 | USD | 25,280 | 15/12/2016 | (159) | - |
| UBS | EUR | 28,574 | USD | 30,527 | 15/12/2016 | (196) | - |
| UBS | USD | 402,889 | EUR | 379,741 | 15/12/2016 | (201) | - |
| UBS | USD | 25,280 | GBP | 20,402 | 15/12/2016 | (220) | - |
| UBS | EUR | 59,897 | USD | 63,991 | 15/12/2016 | (411) | - |
| UBS | USD | 200,980 | EUR | 189,931 | 15/12/2016 | (630) | - |
| UBS | USD | 86,559 | EUR | 82,143 | 15/12/2016 | (635) | - |
| UBS | USD | 97,643 | EUR | 92,661 | 15/12/2016 | (716) | - |
| UBS | EUR | 26,316 | USD | 28,657 | 15/12/2016 | (723) | - |
| UBS | USD | 113,567 | EUR | 107,773 | 15/12/2016 | (833) | - |
| UBS | USD | 380,022 | GBP | 305,161 | 15/12/2016 | (1,394) | - |
| UBS | EUR | 122,161 | USD | 131,176 | 15/12/2016 | (1,503) | - |
| UBS | EUR | 130,639 | USD | 140,279 | 15/12/2016 | (1,607) | - |
| UBS | EUR | 36,642 | USD | 40,523 | 15/12/2016 | (1,628) | - |
| UBS | GBP | 131,096 | USD | 165,701 | 15/12/2016 | (1,846) | - |
| UBS | GBP | 2,033,351 | USD | 2,543,519 | 15/12/2016 | (2,069) | - |
| UBS | USD | 327,276 | GBP | 263,633 | 15/12/2016 | (2,234) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.82% (31 May 2016: 0.31%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| UBS | USD | 919,150 | GBP | 737,621 | 15/12/2016 | (2,789) | - |
| UBS | USD | 594,656 | GBP | 479,188 | 15/12/2016 | (4,272) | - |
| UBS | EUR | 144,817 | USD | 158,700 | 15/12/2016 | (4,979) | - |
| UBS | USD | 503,251 | GBP | 408,660 | 15/12/2016 | (7,526) | - |
| UBS | USD | 3,178,026 | EUR | 3,001,207 | 15/12/2016 | (7,720) | - |
| UBS | GBP | 827,250 | USD | 1,045,613 | 15/12/2016 | (11,648) | - |
| UBS | GBP | 1,055,652 | USD | 1,334,305 | 15/12/2016 | (14,864) | - |
| UBS | USD | 3,156,637 | GBP | 2,537,753 | 15/12/2016 | (15,256) | - |
| UBS | GBP | 2,385,603 | USD | 3,015,314 | 15/12/2016 | (33,590) | - |
| UBS | GBP | 2,968,970 | USD | 3,752,668 | 15/12/2016 | (41,804) | - |
| UBS | EUR | 1,925,628 | USD | 2,093,776 | 15/12/2016 | (49,744) | (0.01) |
| UBS | GBP | 3,692,546 | USD | 4,667,242 | 15/12/2016 | (51,993) | (0.01) |
| UBS | GBP | 4,867,014 | USD | 6,151,726 | 15/12/2016 | (68,530) | (0.01) |
| UBS | EUR | 3,797,429 | USD | 4,129,024 | 15/12/2016 | (98,098) | (0.01) |
| UBS | EUR | 4,313,565 | USD | 4,690,230 | 15/12/2016 | (111,431) | (0.01) |
| UBS | EUR | 4,755,869 | USD | 5,171,156 | 15/12/2016 | (122,857) | (0.02) |
| UBS | EUR | 7,102,730 | USD | 7,722,948 | 15/12/2016 | (183,482) | (0.02) |
| UBS | EUR | 11,622,979 | USD | 12,637,909 | 15/12/2016 | (300,252) | (0.03) |
| UBS | GBP | 24,525,851 | USD | 30,999,768 | 15/12/2016 | (345,335) | (0.04) |
| UBS | EUR | 14,539,367 | USD | 15,808,959 | 15/12/2016 | (375,590) | (0.04) |
| UBS | EUR | 16,016,506 | USD | 17,415,083 | 15/12/2016 | (413,748) | (0.04) |
| UBS | EUR | 39,693,039 | USD | 43,159,075 | 15/12/2016 | (1,025,376) | (0.11) |
| UBS | EUR | 42,312,800 | USD | 46,007,596 | 15/12/2016 | (1,093,051) | (0.12) |
| UBS | GBP | 374,064,830 | USD | 472,804,105 | 15/12/2016 | (5,266,995) | (0.56) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (9,855,796) | (1.05) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (7,671,308) | (0.82) |
| 投資総額 | | | | | | 867,675,762 | 92.21 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 76,222,778 | 8.10 |
| その他の純負債 | | | | | | (2,920,043) | (0.31) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 940,978,497 | 100.00 |

総資産の分析**総資産
比率(%)**

| | |
|---|--------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 90.70 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.23 |
| その他の資産 | 9.07 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** スティール・プライス（取引が頻繁でなく流動性が低いため長期間変動していない価格）で評価される。

† ファンドの純資産の0.34%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク（「ICB」）は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券 : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | アルゼンチン : 0.45% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.45% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,125,000 | Argentine Republic International Bond 6.625% 06/07/2028 | 1,049,062 | 0.30 |
| 575,000 | Argentine Republic International Bond 7.125% 06/07/2036 | 530,725 | 0.15 |
| | アルゼンチン合計 | 1,579,787 | 0.45 |
| | オーストラリア : 1.46% (31 May 2016: 2.91%) | | |
| | 社債 : 1.46% (31 May 2016: 2.91%) | | |
| 1,000,000 | Asciano Finance Ltd 4.625% 23/09/2020 | 1,030,387 | 0.30 |
| 800,000 | Goodman Funding Pty Ltd 6.00% 22/03/2022 | 904,752 | 0.26 |
| 42,000 | Macquarie Bank Ltd 6.625% 07/04/2021 [†] | 47,508 | 0.01 |
| 900,000 | Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 3.90% 22/03/2023 | 925,881 | 0.27 |
| 800,000 | Telstra Corp Ltd 1.125% 14/04/2026 | 862,664 | 0.25 |
| 900,000 | Transurban Finance Co Pty Ltd 2% 28/08/2025 | 1,002,126 | 0.29 |
| 300,000 | Woodside Finance Ltd 3.65% 05/03/2025 | 290,764 | 0.08 |
| | オーストラリア合計 | 5,064,082 | 1.46 |
| | ベルギー : 0.41% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| | 社債 : 0.41% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 300,000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.50% 17/03/2025 | 328,705 | 0.09 |
| 455,000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.00% 17/03/2028 | 504,568 | 0.15 |
| 500,000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.75% 17/03/2036 | 576,796 | 0.17 |
| | ベルギー合計 | 1,410,069 | 0.41 |
| | バミューダ : 0.06% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 社債 : 0.06% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 200,000 | Ooredoo International Finance Ltd 4.75% 16/02/2021 | 215,525 | 0.06 |
| | バミューダ合計 | 215,525 | 0.06 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | ブラジル : 0.00% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| | カナダ : 1.54% (31 May 2016: 3.54%) | | |
| | 社債 : 0.74% (31 May 2016: 1.01%) | | |
| 128,538 | Air Canada 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.125% 15/05/2025 | 134,395 | 0.04 |
| 800,000 | Air Canada 2015-2 Class AA Pass Through Trust 3.75% 15/06/2029 ** | 839,000 | 0.24 |
| 440,000 | Fortis Inc/Canada 3.055% 04/10/2026 | 413,527 | 0.12 |
| 300,000 | Goldcorp Inc 3.625% 09/06/2021 | 306,070 | 0.09 |
| 400,000 | Great-West Lifeco Inc 1.75% 07/12/2026 | 423,412 | 0.12 |
| 470,000 | St Marys Cement Inc Canada 5.75% 28/01/2027 † | 453,103 | 0.13 |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 2.53%) | | |
| | 州債 : 0.80% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,800,000 | Province of Ontario Canada 2.60% 02/06/2025 | 1,370,241 | 0.40 |
| 1,800,000 | Province of Quebec Canada 2.75% 01/09/2025 | 1,383,601 | 0.40 |
| | カナダ合計 | 5,323,349 | 1.54 |
| | ケイマン諸島 : 0.76% (31 May 2016: 0.63%) | | |
| | 社債 : 0.76% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 600,000 | Amber Circle Funding Ltd 3.25% 04/12/2022 | 605,896 | 0.17 |
| 800,000 | CK Hutchison Finance 16 Ltd 2% 06/04/2028 | 849,543 | 0.25 |
| 325,000 | Hutchison Whampoa International 14 Ltd 3.625% 31/10/2024 | 328,631 | 0.09 |
| 609,630 | Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd 6.625% 01/10/2022 | 146,311 | 0.04 |
| 200,000 | Transocean Inc 9% 15/07/2023 | 203,500 | 0.06 |
| 500,000 | Wynn Macau Ltd 5.25% 15/10/2021 | 505,000 | 0.15 |
| | その他資産担保証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | ケイマン諸島合計 | 2,638,881 | 0.76 |
| | チリ : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 200,000 | Enersis Americas SA 4% 25/10/2026 | 192,142 | 0.06 |
| | チリ合計 | 192,142 | 0.06 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | キプロス : 0.09% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 社債 : 0.09% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 300,000 | ATF Netherlands BV 1.5% 03/05/2022 | 317,394 | 0.09 |
| | キプロス合計 | 317,394 | 0.09 |
| | デンマーク : 0.65% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.65% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 275,000 | Danske Bank A/S 0.5% 06/05/2021 | 294,937 | 0.09 |
| 900,000 | Danske Bank A/S 2% 08/09/2021 | 877,622 | 0.25 |
| 600,000 | Danske Bank A/S FRN 04/10/2023 | 676,263 | 0.19 |
| 400,000 | Nykredit Realkredit A/S 0.75% 14/07/2021 | 426,996 | 0.12 |
| | デンマーク合計 | 2,275,818 | 0.65 |
| | フランス : 3.01% (31 May 2016: 3.44%) | | |
| | 社債 : 3.01% (31 May 2016: 3.44%) | | |
| 400,000 | Air Liquide Finance SA 2.5% 27/09/2026 [†] | 376,290 | 0.11 |
| 200,000 | APRR SA 1.875% 15/01/2025 | 226,017 | 0.07 |
| 800,000 | AXA SA FRN 06/07/2047 | 845,320 | 0.25 |
| 700,000 | BNP Paribas Cardif SA FRN Perpetual | 725,506 | 0.21 |
| 375,000 | BNP Paribas SA 1.125% 16/08/2022 | 453,078 | 0.13 |
| 300,000 | BNP Paribas SA FRN Perpetual | 298,875 | 0.09 |
| 300,000 | BPCE SA 1% 05/10/2028 | 303,746 | 0.09 |
| 400,000 | Bureau Veritas SA 1.25% 07/09/2023 | 421,233 | 0.12 |
| 500,000 | Credit Agricole Assurances SA FRN Perpetual | 508,463 | 0.15 |
| 150,000 | Credit Agricole SA 2.625% 17/03/2027 | 158,961 | 0.05 |
| 200,000 | Credit Agricole SA 7.5% 'REGS' Perpetual | 245,204 | 0.07 |
| 200,000 | Credit Agricole SA/London 2.375% 20/05/2024 | 235,065 | 0.07 |
| 800,000 | Credit Agricole SA/London FRN 01/07/2021 | 809,605 | 0.23 |
| 400,000 | Danone SA 0.709% 03/11/2024 | 416,088 | 0.12 |
| 300,000 | Danone SA 1.208% 03/11/2028 | 309,928 | 0.09 |
| 650,000 | Danone SA 2.947% 02/11/2026 | 620,557 | 0.18 |
| 50,000 | Electricite de France SA 6.00% 22/01/2114 | 49,045 | 0.01 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | フランス(つづき) : 3.01% (31 May 2016: 3.44%) | | |
| | 社債(つづき) : 3.01% (31 May 2016: 3.44%) | | |
| 425,000 | Orange SA 5.625% 23/01/2034 | 694,079 | 0.20 |
| 300,000 | SCOR SE FRN 27/05/2048 | 323,220 | 0.09 |
| 100,000 | SEB SA 2.375% 25/11/2022 | 112,770 | 0.03 |
| 700,000 | Societe Generale SA 2.5% 08/04/2021 | 696,949 | 0.20 |
| 300,000 | Societe Generale SA FRN 16/09/2026 | 322,535 | 0.09 |
| 300,000 | TDF Infrastructure SAS 2.5% 07/04/2026 | 324,781 | 0.09 |
| 500,000 | TOTAL SA Series '111' FRN Perpetual | 558,352 | 0.16 |
| 280,000 | TOTAL SA Series '115' FRN Perpetual | 285,886 | 0.08 |
| 100,000 | Valeo SA 1.625% 18/03/2026 | 108,534 | 0.03 |
| | フランス合計 | 10,430,087 | 3.01 |
| | ドイツ : 0.20% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| | 社債 : 0.17% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 550,000 | HeidelbergCement AG 1.5% 07/02/2025 | 575,793 | 0.17 |
| | 国債 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 100,000 | Deutsche Bank AG 1.35% 30/05/2017 | 99,579 | 0.03 |
| | ドイツ合計 | 675,372 | 0.20 |
| | ギリシャ : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | ガーンジー : 0.18% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| | 社債 : 0.18% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 600,000 | Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd FRN 16/04/2021 | 622,304 | 0.18 |
| | ガーンジー合計 | 622,304 | 0.18 |
| | インド : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 425,000 | Bharti Airtel Ltd 4.375% 10/06/2025 [†] | 418,534 | 0.12 |
| | インド合計 | 418,534 | 0.12 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | アイルランド : 1.86% (31 May 2016: 1.28%) | | |
| | 社債 : 1.86% (31 May 2016: 1.28%) | | |
| 350,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/05/2023 | 382,435 | 0.11 |
| 205,000 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 4.625% 15/05/2023 | 203,078 | 0.06 |
| 600,000 | ESB Finance Ltd 2.125% 08/06/2027 | 684,269 | 0.20 |
| 725,000 | FCA Capital Ireland PLC 1.375% 17/04/2020 | 779,872 | 0.23 |
| 1,270,000 | GE Capital International Funding Co Unlimited 2.342% 15/11/2020 | 1,270,399 | 0.37 |
| 1,500,000 | GE Capital International Funding Co Unlimited 3.373% 15/11/2025 | 1,519,928 | 0.44 |
| 1,482,000 | GE Capital International Funding Co Unlimited 4.418% 15/11/2035 | 1,545,706 | 0.45 |
| | アイルランド合計 | 6,385,687 | 1.86 |
| | イタリア : 1.94% (31 May 2016: 3.39%) | | |
| | 社債 : 0.50% (31 May 2016: 1.66%) | | |
| 115,000 | Enel SpA 5.75% 22/06/2037 | 181,719 | 0.05 |
| 1,100,000 | Intesa Sanpaolo SpA 3.875% 16/01/2018 | 1,117,172 | 0.32 |
| 300,000 | Intesa Sanpaolo SpA 5.017% 26/06/2024 | 267,262 | 0.08 |
| 150,000 | LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 01/04/2024 | 165,844 | 0.05 |
| | 国債 : 1.44% (31 May 2016: 1.73%) | | |
| 2,500,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/09/2021 [†] | 3,147,679 | 0.91 |
| 1,765,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.6% 01/06/2026 | 1,823,965 | 0.53 |
| | イタリア合計 | 6,703,641 | 1.94 |
| | 日本 : 1.09% (31 May 2016: 1.74%) | | |
| | 社債 : 1.09% (31 May 2016: 1.74%) | | |
| 1,400,000 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ 2.757% 13/09/2026 | 1,323,540 | 0.38 |
| 950,000 | みずほ銀行 1.55% 17/10/2017 | 948,879 | 0.27 |
| 200,000 | みずほフィナンシャルグループ FRN 13/09/2021 | 200,539 | 0.06 |
| 1,300,000 | 三井住友フィナンシャルグループ FRN 19/10/2021 | 1,305,812 | 0.38 |
| | 日本合計 | 3,778,770 | 1.09 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | ジャージー : 0.77% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| | 社債 : 0.77% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| 450,000 | AA Bond Co Ltd 3.781% 31/07/2019 | 589,198 | 0.18 |
| 500,000 | Atrium European Real Estate Ltd 3.625% 17/10/2022 | 575,285 | 0.17 |
| 205,000 | Delphi Automotive PLC 1.6% 15/09/2028 | 204,270 | 0.06 |
| 450,000 | Heathrow Funding Ltd 2.75% 09/09/2051 | 510,232 | 0.15 |
| 150,000 | Petrofac Ltd 3.4% 10/10/2018 | 150,555 | 0.04 |
| 300,000 | UBS Group Funding Jersey Ltd 1.5% 30/11/2024 | 317,847 | 0.09 |
| 275,000 | UBS Group Funding Jersey Ltd 4.125% 24/09/2025 | 277,771 | 0.08 |
| | ジャージー合計 | 2,625,158 | 0.77 |
| | リベリア : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 400,000 | Royal Caribbean Cruises Ltd 7.5% 15/10/2027 | 476,000 | 0.14 |
| | リベリア合計 | 476,000 | 0.14 |
| | ルクセンブルグ : 0.81% (31 May 2016: 1.93%) | | |
| | 社債 : 0.81% (31 May 2016: 1.93%) | | |
| 1,475,000 | Actavis Funding SCS FRN 12/03/2020 | 1,497,122 | 0.43 |
| 125,000 | Actavis Funding SCS 3.45% 15/03/2022 | 126,951 | 0.04 |
| 300,000 | Actavis Funding SCS 3.8% 15/03/2025 | 302,877 | 0.09 |
| 100,000 | Actavis Funding SCS 4.55% 15/03/2035 | 98,856 | 0.03 |
| 150,000 | Actavis Funding SCS 4.75% 15/03/2045 | 148,975 | 0.04 |
| 375,000 | Glencore Finance Europe SA 1.25% 17/03/2021 | 393,176 | 0.11 |
| 100,000 | Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC 5.75% 01/08/2022 | 93,750 | 0.03 |
| 125,000 | SES SA FRN Perpetual | 132,467 | 0.04 |
| | ルクセンブルグ合計 | 2,794,174 | 0.81 |
| | メキシコ : 0.67% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| | 社債 : 0.67% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| 600,000 | BBVA Bancomer SA/Texas 6.5% 10/03/2021 | 636,300 | 0.18 |
| 525,000 | Cemex SAB de CV 7.75% 16/04/2026 | 564,375 | 0.16 |
| 200,000 | Grupo Televisa SAB 6.125% 31/01/2046 | 197,497 | 0.06 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | メキシコ(つづき) : 0.67% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| | 社債(つづき) : 0.67% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| 50,000 | Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025 | 44,370 | 0.01 |
| 900,000 | Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027 | 807,817 | 0.23 |
| 125,000 | Petroleos Mexicanos 6.375% 23/01/2045 | 106,725 | 0.03 |
| | メキシコ合計 | 2,357,084 | 0.67 |
| | オランダ : 4.71% (31 May 2016: 4.49%) | | |
| | 社債 : 4.71% (31 May 2016: 4.49%) | | |
| 325,000 | ABN AMRO Bank NV FRN 30/06/2025 | 361,691 | 0.10 |
| 450,000 | Achmea Bank NV 2.75% 18/02/2021 | 523,521 | 0.15 |
| 175,000 | Achmea BV FRN Perpetual | 171,426 | 0.05 |
| 650,000 | Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 23/03/2026 | 703,155 | 0.20 |
| 350,000 | Cooperatieve Rabobank UA 3.875% 25/07/2023 | 425,213 | 0.12 |
| 625,000 | Cooperatieve Rabobank UA FRN 26/05/2026 | 686,187 | 0.20 |
| 1,000,000 | Cooperatieve Rabobank UA FRN Perpetual | 1,111,216 | 0.32 |
| 200,000 | CRH Funding BV 1.875% 09/01/2024 | 224,943 | 0.06 |
| 200,000 | Deutsche Telekom International Finance BV 0.625% 03/04/2023 | 212,860 | 0.06 |
| 275,000 | Deutsche Telekom International Finance BV 1.5% 03/04/2028 | 294,501 | 0.08 |
| 235,000 | EDP Finance BV 1.125% 12/02/2024 | 234,399 | 0.07 |
| 1,500,000 | ING Bank NV 5.8% 25/09/2023 | 1,641,139 | 0.47 |
| 1,250,000 | ING Bank NV FRN 21/11/2023 | 1,399,989 | 0.40 |
| 200,000 | Innogy Finance BV 6.125% 06/07/2039 | 341,591 | 0.10 |
| 900,000 | JAB Holdings BV 2.125% 16/09/2022 | 1,020,355 | 0.29 |
| 100,000 | Koninklijke KPN NV 1.125% 11/09/2028 | 99,799 | 0.03 |
| 150,000 | Koninklijke KPN NV 5.75% 17/09/2029 | 233,127 | 0.07 |
| 400,000 | LeasePlan Corp NV 1% 08/04/2020 | 432,304 | 0.12 |
| 900,000 | LeasePlan Corp NV 1% 24/05/2021 | 967,373 | 0.28 |
| 350,000 | Mylan NV 2.25% 22/11/2024 | 374,660 | 0.11 |
| 155,000 | Mylan NV 3.125% 22/11/2028 | 165,907 | 0.05 |
| 300,000 | NN Group NV FRN 08/04/2044 | 323,852 | 0.09 |
| 500,000 | NXP BV / NXP Funding LLC 3.875% 01/09/2022 | 513,750 | 0.15 |
| 400,000 | Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/01/2021 | 390,400 | 0.11 |
| 600,000 | Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/05/2021 | 645,000 | 0.19 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | オランダ(つづき) : 4.71% (31 May 2016: 4.49%) | | |
| | 社債(つづき) : 4.71% (31 May 2016: 4.49%) | | |
| 700,000 | Redexis Gas Finance BV 2.75% 08/04/2021 | 809,362 | 0.23 |
| 200,000 | Royal Bank of Scotland NV 4.65% 04/06/2018 | 203,974 | 0.06 |
| 100,000 | Shell International Finance BV 2.5% 12/09/2026 | 93,268 | 0.03 |
| 675,000 | Shell International Finance BV 3.25% 11/05/2025 | 673,967 | 0.19 |
| 25,000 | Stichting AK Rabobank Certificaten 6.5% Perpetual | 29,836 | 0.01 |
| 141,000 | Volkswagen Financial Services NV 1.75% 17/04/2020 | 177,451 | 0.05 |
| 184,000 | Volkswagen Financial Services NV 2.75% 02/10/2020 | 239,112 | 0.07 |
| 700,000 | Vonovia Finance BV 3.2% 02/10/2017 | 707,726 | 0.20 |
| | オランダ合計 | 16,433,054 | 4.71 |
| | ノルウェー : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 325,000 | Statoil ASA 3.25% 10/11/2024 | 329,745 | 0.10 |
| | ノルウェー合計 | 329,745 | 0.10 |
| | ポーランド : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,000,000 | Poland Government Bond 2.5% 25/07/2026 | 216,860 | 0.06 |
| 200,000 | Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025 | 46,608 | 0.01 |
| | ポーランド合計 | 263,468 | 0.07 |
| | カタール : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 200,000 | Qatar Government International Bond 4.625% 02/06/2046 | 199,634 | 0.06 |
| | カタール合計 | 199,634 | 0.06 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | サウジアラビア : 0.25% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.25% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 700,000 | Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026 | 662,821 | 0.19 |
| 225,000 | Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026 | 213,050 | 0.06 |
| | サウジアラビア合計 | 875,871 | 0.25 |
| | シンガポール : 0.20% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 社債 : 0.20% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 725,000 | ONGC Videsh Vankorneft Pte Ltd 2.875% 27/01/2022 | 704,293 | 0.20 |
| | シンガポール合計 | 704,293 | 0.20 |
| | スロベニア : 0.06% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| | 国債 : 0.06% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 200,000 | Slovenia Government International Bond 5.25% 18/02/2024 | 222,502 | 0.06 |
| | スロベニア合計 | 222,502 | 0.06 |
| | 南アフリカ : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 100,000 | South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026 | 7,818 | - |
| | 南アフリカ合計 | 7,818 | - |
| | スペイン : 1.15% (31 May 2016: 0.84%) | | |
| | 社債 : 1.15% (31 May 2016: 0.84%) | | |
| 600,000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN Perpetual | 670,691 | 0.19 |
| 400,000 | Banco Popular Espanol SA FRN Perpetual | 368,530 | 0.11 |
| 500,000 | Banco Santander SA FRN Perpetual | 478,655 | 0.14 |
| 300,000 | Iberdrola Finanzas SA 1% 07/03/2024 | 317,826 | 0.09 |
| 300,000 | Inmobiliaria Colonial SA 1.863% 05/06/2019 | 329,074 | 0.09 |
| 700,000 | Merlin Properties Socimi SA 2.225% 25/04/2023 | 757,868 | 0.22 |
| 900,000 | Telefonica Emisiones SAU 4.693% 11/11/2019 | 1,076,852 | 0.31 |
| | スペイン合計 | 3,999,496 | 1.15 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | スウェーデン : 0.03% (31 May 2016: 0.85%) | | |
| | 社債 : 0.03% (31 May 2016: 0.85%) | | |
| 100,000 | MoInlycke Holding AB 1.75% 28/02/2024 | 109,106 | 0.03 |
| | スウェーデン合計 | 109,106 | 0.03 |
| | スイス : 1.27% (31 May 2016: 3.49%) | | |
| | 社債 : 1.27% (31 May 2016: 3.49%) | | |
| 250,000 | Credit Suisse AG 6.5% 08/08/2023 | 265,469 | 0.08 |
| 950,000 | Credit Suisse AG 6.5% 08/08/2023 '144A' | 1,008,781 | 0.29 |
| 400,000 | Credit Suisse AG/New York NY 3.625% 09/09/2024 | 402,622 | 0.12 |
| 700,000 | UBS AG 5.125% 15/05/2024 | 699,562 | 0.20 |
| 425,000 | UBS AG FRN 22/05/2023 | 430,312 | 0.12 |
| 582,000 | UBS AG/Stamford CT 5.875% 20/12/2017 | 607,816 | 0.18 |
| 850,000 | UBS AG/Stamford CT 7.625% 17/08/2022 | 963,687 | 0.28 |
| | スイス合計 | 4,378,249 | 1.27 |
| | 英国 : 7.92% (31 May 2016: 12.37%) | | |
| | 社債 : 7.60% (31 May 2016: 10.78%) | | |
| 925,000 | Aon PLC 3.875% 15/12/2025 | 948,027 | 0.27 |
| 425,000 | Aon PLC 4.75% 15/05/2045 | 428,475 | 0.12 |
| 400,000 | AstraZeneca PLC 3.375% 16/11/2025 | 398,796 | 0.12 |
| 200,000 | Aviva PLC FRN 12/09/2049 | 230,118 | 0.07 |
| 1,200,000 | Barclays Bank PLC 7.625% 21/11/2022 | 1,319,550 | 0.38 |
| 650,000 | BAT International Finance PLC 1% 23/05/2022 | 703,591 | 0.20 |
| 935,000 | BAT International Finance PLC 1.75% 05/07/2021 | 1,173,428 | 0.34 |
| 580,000 | BAT International Finance PLC 2.25% 09/09/2052 | 574,408 | 0.17 |
| 625,000 | BAT International Finance PLC 2.75% 25/03/2025 | 750,937 | 0.22 |
| 475,000 | BAT International Finance PLC 3.95% 15/06/2025 | 491,262 | 0.14 |
| 100,000 | BAT International Finance PLC 7.25% 12/03/2024 | 165,901 | 0.05 |
| 250,000 | BP Capital Markets PLC 1.373% 03/03/2022 | 276,061 | 0.08 |
| 525,000 | BP Capital Markets PLC 1.953% 03/03/2025 | 591,151 | 0.17 |
| 950,000 | BP Capital Markets PLC 2.75% 10/05/2023 | 928,943 | 0.27 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 英国(つづき) : 7.92% (31 May 2016: 12.37%) | | |
| | 社債(つづき) : 7.60% (31 May 2016: 10.78%) | | |
| 550,000 | British Telecommunications PLC 1.125% 10/03/2023 | 590,214 | 0.17 |
| 200,000 | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd FRN 08/07/2026 | 297,961 | 0.09 |
| 200,000 | Eastern Power Networks PLC 5.75% 08/03/2024 | 310,704 | 0.09 |
| 250,000 | Enterprise Inns PLC 6% 06/10/2023 | 319,715 | 0.09 |
| 1,900,000 | FCE Bank PLC 1.615% 11/05/2023 | 2,050,360 | 0.59 |
| 300,000 | G4S International Finance PLC 1.5% 09/01/2023 | 318,038 | 0.09 |
| 200,000 | GlaxoSmithKline Capital PLC 5.25% 19/12/2033 | 339,150 | 0.10 |
| 300,000 | Hammerson PLC 3.5% 27/10/2025 | 394,448 | 0.11 |
| 350,000 | HSBC Holdings PLC 0.875% 06/09/2024 | 360,479 | 0.10 |
| 450,000 | HSBC Holdings PLC 1.5% 15/03/2022 | 495,573 | 0.14 |
| 500,000 | HSBC Holdings PLC 2.625% 16/08/2028 | 585,643 | 0.17 |
| 775,000 | HSBC Holdings PLC 3.6% 25/05/2023 | 778,641 | 0.22 |
| 900,000 | HSBC Holdings PLC 4% 30/03/2022 | 932,091 | 0.27 |
| 400,000 | HSBC Holdings PLC FRN Perpetual | 431,607 | 0.12 |
| 1,675,000 | Imperial Brands Finance PLC 3.75% 21/07/2022 | 1,717,439 | 0.50 |
| 375,000 | Imperial Brands Finance PLC 4.25% 21/07/2025 | 386,662 | 0.11 |
| 400,000 | InterContinental Hotels Group PLC 3.75% 14/08/2025 | 539,251 | 0.16 |
| 200,000 | ITV PLC 2.125% 21/09/2022 | 218,156 | 0.06 |
| 100,000 | Kelda Finance No 3 PLC 5.75% 17/02/2020 | 137,016 | 0.04 |
| 300,000 | National Grid Gas Finance PLC 2.125% 22/09/2028 | 358,562 | 0.10 |
| 900,000 | Nationwide Building Society 4.125% 20/03/2023 | 992,934 | 0.29 |
| 3,300 | Nationwide Building Society FRN Perpetual | 536,710 | 0.15 |
| 225,000 | Next PLC 3.625% 18/05/2028 | 286,750 | 0.08 |
| 600,000 | Pearson Funding Five PLC 3.25% 08/05/2023 | 565,177 | 0.16 |
| 200,000 | RAC Bond Co PLC 4.565% 06/05/2023 | 269,785 | 0.08 |
| 160,000 | Santander UK Group Holdings PLC 1.125% 08/09/2023 | 167,346 | 0.05 |
| 200,000 | Santander UK Group Holdings PLC FRN Perpetual | 245,882 | 0.07 |
| 450,000 | Sensata Technologies UK Financing Co plc 6.25% 15/02/2026 | 473,625 | 0.14 |
| 100,000 | Society of Lloyd's 4.75% 30/10/2024 | 131,132 | 0.04 |
| 600,000 | Tesco PLC 6.125% 24/02/2022 | 844,081 | 0.24 |
| 190,000 | Vodafone Group PLC 3% 12/08/2056 | 193,385 | 0.06 |
| 200,000 | Western Power Distribution West Midlands PLC 5.75% 16/04/2032 | 339,563 | 0.10 |
| 200,000 | Wm Morrison Supermarkets PLC 3.5% 27/07/2026 | 254,143 | 0.07 |
| 225,000 | Worldpay Finance PLC 3.75% 15/11/2022 | 255,388 | 0.07 |
| 240,000 | WPP Finance 2013 2.875% 14/09/2046 | 260,209 | 0.08 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 英国(つづき) : 7.92% (31 May 2016: 12.37%) | | |
| | 国債 : 0.29% (31 May 2016: 1.54%) | | |
| 800,000 | United Kingdom Gilt 1.5% 22/07/2026 | 1,007,916 | 0.29 |
| | ホールローンCMO : 0.03% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| 89,129 | Tenterden Funding PLC FRN 21/03/2044 | 111,699 | 0.03 |
| | 英国合計 | 27,478,083 | 7.92 |
| | 米国 : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 商業MBS: 2.37% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 220,000 | Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 A-4 3.705% 17/09/20148 | 231,181 | 0.07 |
| 66,174 | Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007- PWR16 FRN 11/06/2040 | 66,865 | 0.02 |
| 173,956 | Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007- PWR17 FRN 11/06/2050 | 177,347 | 0.05 |
| 184,397 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2008-C7 Class A-4 FRN 10/12/2049 | 188,560 | 0.05 |
| 165,000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2012-GC8 3.024% 10/09/2045 | 169,793 | 0.05 |
| 150,000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23 Class A-4 3.622% 10/07/2047 | 156,362 | 0.05 |
| 35,000 | COMM 2012-CCRE2 Mortgage Trust Class A-4 3.147% 17/08/2045 | 36,331 | 0.01 |
| 175,091 | COMM 2012-CCRE4 Mortgage Trust Class A-3 2.853% 17/10/2045 | 177,968 | 0.05 |
| 225,000 | COMM 2012-CR3 Mortgage Trust Class A-3 2.822% 15/10/2045 | 228,954 | 0.07 |
| 165,000 | COMM 2013-CCRE10 Mortgage Trust Class A-4 4.21% 10/08/2046 | 179,007 | 0.05 |
| 295,000 | COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust Class A-4 3.101% 12/03/2046 | 301,511 | 0.09 |
| 160,000 | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class A-5 3.612% 12/06/2046 | 168,525 | 0.05 |
| 70,000 | COMM 2013-CCRE9 Mortgage Trust Class A-4 4.37423% 12/07/2045 | 76,303 | 0.02 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 商業MBS(つづき) : 2.37% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 180,000 | COMM 2014-CR19 Mortgage Trust Class A-5 3.796% 12/08/2047 | 189,268 | 0.05 |
| 130,000 | COMM 2014-UBS4 Mortgage Trust Class A-5 3.694% 12/08/2047 | 135,080 | 0.04 |
| 190,000 | COMM 2015-DC1 Mortgage Trust 2015-DC1 Class A-5 3.35% 02/10/2048 | 193,022 | 0.06 |
| 190,000 | COMM 2015-LC19 Mortgage Trust Class A-4 3.183% 12/02/2048 | 192,260 | 0.06 |
| 185,000 | COMM 2015-PC1 Mortgage Trust Class A-4 3.62% 12/07/2050 | 191,151 | 0.06 |
| 175,563 | Commercial Mortgage Loan Trust 2008-LS1 Class A-4B FRN 10/12/2049 | 179,532 | 0.05 |
| 49,414 | Countrywide Asset-Backed Certificates 2005-AB4 Class 2-A-4 FRN 25/03/2036 | 40,014 | 0.01 |
| 2,757,227 | CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust Class X-A FRN 15/04/2050 | 153,645 | 0.04 |
| 165,000 | CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust Class A-4 3.718% 17/08/2048 | 172,511 | 0.05 |
| 160,000 | GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ9 Class A-3 2.773% 10/11/2045 | 163,068 | 0.05 |
| 130,000 | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class A-4 4.074% 12/04/2047 | 139,104 | 0.04 |
| 145,000 | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 Class D FRN 12/04/2047 | 101,258 | 0.03 |
| 145,000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp 2.84% 15/12/2047 | 147,544 | 0.04 |
| 314,147 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2008-C2 Class A-4 6.068% 12/02/2051 | 320,728 | 0.09 |
| 368,001 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2008-C2 Class A-4FL FRN 12/02/2051 | 351,022 | 0.10 |
| 210,000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28 Class A-3 2.9124% 19/10/2048 | 207,806 | 0.06 |
| 100,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2012-C6 Class A-4 2.858% 17/11/2045 | 102,145 | 0.03 |
| 235,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 Class A-4 FRN 17/07/2046 | 254,004 | 0.07 |
| 135,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C12 Class A-4 4.259% 17/10/2046 | 146,995 | 0.04 |
| 145,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 Class A-3 3.766% 19/11/2046 | 152,529 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 商業MBS(つづき) : 2.37% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 190,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 Class A-4 3.249% 18/02/2048 | 192,681 | 0.06 |
| 180,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 Class A-5 3.102% 18/11/2049 | 178,222 | 0.05 |
| 155,000 | UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2013-C6 Class A-4 3.244% 10/04/2046 | 159,207 | 0.05 |
| 145,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2012-LC5 2.918% 15/10/2045 | 148,180 | 0.04 |
| 130,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 Class A-4 3.548% 15/08/2050 | 134,717 | 0.04 |
| 117,015 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC18 3.405% Class A-5 15/12/2047 | 119,785 | 0.03 |
| 170,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C29 Class A-4 3.637% 15/06/2048 | 176,453 | 0.05 |
| 170,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C30 Class A-3 3.411% 15/09/2058 | 174,359 | 0.05 |
| 200,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20 Class A-5 3.184% 15/04/2050 | 201,319 | 0.06 |
| 170,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C10 Class A-3 2.875% 15/12/2045 | 173,210 | 0.05 |
| 80,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C7 Class A-2 3.431% 16/06/2045 | 83,986 | 0.02 |
| 40,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C9 Class A-3 2.87% 17/11/2045 | 40,749 | 0.01 |
| 30,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C12 Class D FRN 17/03/2048 | 27,691 | 0.01 |
| 85,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C16 Class A-4 4.136% 17/09/2046 | 91,584 | 0.03 |
| 180,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C19 Class A-5 4.101% 15/03/2047 | 193,075 | 0.06 |
| 180,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C20 Class A-5 3.995% 17/05/2047 | 191,943 | 0.06 |
| 95,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 Class A-5 3.607% 18/11/2047 | 98,415 | 0.03 |
| 105,000 | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14 Class A-5 4.045% 15/03/2047 | 112,123 | 0.03 |
| | 社債 : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 100,000 | Abbott Laboratories 3.4% 30/11/2023 | 99,372 | 0.03 |
| 1,300,000 | AbbVie Inc 2.85% 14/05/2023 | 1,262,477 | 0.36 |
| 600,000 | AbbVie Inc 3.6% 14/05/2025 | 593,890 | 0.17 |
| 100,000 | Activision Blizzard Inc 2.3% 15/09/2021 | 97,602 | 0.03 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 725,000 | Aetna Inc 2.8% 15/06/2023 | 709,681 | 0.20 |
| 700,000 | Aetna Inc 3.2% 15/06/2026 | 686,384 | 0.20 |
| 400,000 | Aetna Inc 4.25% 15/06/2036 | 398,624 | 0.12 |
| 425,000 | Aetna Inc 4.375% 15/06/2046 | 420,629 | 0.12 |
| 800,000 | Aflac Inc 3.625% 15/11/2024 | 823,799 | 0.24 |
| 200,000 | AIG Global Funding 1.9% 06/10/2021 | 193,575 | 0.06 |
| 400,000 | Air Lease Corp 3% 15/09/2023 | 382,716 | 0.11 |
| 525,000 | Allstate Corp FRN 15/08/2053 | 551,578 | 0.16 |
| 100,000 | Ally Financial Inc 8% 01/11/2031 | 114,000 | 0.03 |
| 555,000 | Altria Group Inc 2.85% 09/08/2022 | 555,054 | 0.16 |
| 875,000 | Altria Group Inc 4.25% 09/08/2042 | 860,949 | 0.25 |
| 1,171,616 | American Airlines 2015-2 Class AA Pass Through Trust 3.6% 22/03/2029 ** | 1,176,009 | 0.34 |
| 400,000 | American Electric Power Co Inc 2.95% 15/12/2022 | 404,865 | 0.12 |
| 400,000 | American Express Credit Corp 0.625% 22/11/2021 † | 425,370 | 0.12 |
| 375,000 | American Honda Finance Corp 3.875% 21/09/2020 | 396,206 | 0.11 |
| 950,000 | American Honda Finance Corp FRN 14/07/2017 | 950,598 | 0.27 |
| 275,000 | American International Group Inc 4.875% 01/06/2022 | 299,954 | 0.09 |
| 900,000 | American Tower Corp 3.375% 15/10/2026 | 853,928 | 0.25 |
| 100,000 | American Tower Corp 4% 01/06/2025 | 101,132 | 0.03 |
| 700,000 | Amgen Inc 2% 25/02/2026 | 787,381 | 0.23 |
| 400,000 | Amgen Inc 2.6% 19/08/2026 | 370,820 | 0.11 |
| 285,000 | Amgen Inc 4.4% 01/05/2045 | 273,214 | 0.08 |
| 1,045,000 | Anadarko Petroleum Corp 4.85% 15/03/2021 | 1,113,680 | 0.32 |
| 725,000 | Anadarko Petroleum Corp 5.55% 15/03/2026 | 794,310 | 0.23 |
| 85,000 | Anadarko Petroleum Corp 6.45% 15/09/2036 | 95,981 | 0.03 |
| 800,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 1.9% 01/02/2019 | 800,410 | 0.23 |
| 300,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.625% 17/01/2023 | 293,598 | 0.08 |
| 250,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.3% 01/02/2023 | 252,907 | 0.07 |
| 2,975,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.65% 01/02/2026 | 3,003,920 | 0.87 |
| 275,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 4.7% 01/02/2036 | 289,298 | 0.08 |
| 425,000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 4.9% 01/02/2046 | 456,517 | 0.13 |
| 920,000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 1.375% 15/07/2017 | 920,708 | 0.27 |
| 625,000 | Anthem Inc 5.1% 15/01/2044 | 657,837 | 0.19 |
| 175,000 | Anthem Inc 5.85% 15/01/2036 | 198,817 | 0.06 |
| 450,000 | Apache Corp 3.625% 01/02/2021 | 463,066 | 0.13 |
| 225,000 | Apache Corp 4.25% 15/01/2044 | 207,475 | 0.06 |
| 35,000 | Apache Corp 4.75% 15/04/2043 | 34,760 | 0.01 |
| 120,000 | Apache Corp 5.1% 01/09/2040 | 121,026 | 0.03 |
| 400,000 | Appalachian Power Co 6.7% 15/08/2037 | 510,418 | 0.15 |
| 850,000 | Apple Inc 3.85% 04/08/2046 | 797,163 | 0.23 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 1,725,000 | AT&T Inc 1.75% 15/01/2018 | 1,724,486 | 0.50 |
| 775,000 | AT&T Inc 3.6% 17/02/2023 | 777,162 | 0.22 |
| 1,000,000 | AT&T Inc 4.125% 17/02/2026 | 1,009,149 | 0.29 |
| 215,000 | AT&T Inc 4.75% 15/05/2046 | 201,585 | 0.06 |
| 2,650,000 | AT&T Inc 4.8% 15/06/2044 | 2,492,803 | 0.72 |
| 275,000 | AvalonBay Communities Inc 2.95% 15/09/2022 | 274,877 | 0.08 |
| 650,000 | Aviation Capital Group Corp 7.125% 15/10/2020** | 757,211 | 0.22 |
| 275,000 | Baltimore Gas & Electric Co 2.8% 15/08/2022 | 277,163 | 0.08 |
| 525,000 | Bank of America Corp 1.95% 12/05/2018 | 525,902 | 0.15 |
| 900,000 | Bank of America Corp 2.625% 19/10/2020 | 900,814 | 0.26 |
| 420,000 | Bank of America Corp 3.248% 21/10/2027 | 401,156 | 0.12 |
| 2,625,000 | Bank of America Corp 3.5% 19/04/2026 | 2,596,973 | 0.75 |
| 660,000 | Bank of America Corp 4.183% 25/11/2027 | 659,987 | 0.19 |
| 1,250,000 | Bank of America Corp 4.45% 03/03/2026 | 1,286,805 | 0.37 |
| 800,000 | Bank of America Corp 5% 13/05/2021 | 870,169 | 0.25 |
| 300,000 | Bank of America Corp 7.625% 01/06/2019 | 337,990 | 0.10 |
| 800,000 | Bank of America NA 2.05% 07/12/2018 | 804,251 | 0.23 |
| 400,000 | Bank of America NA FRN 15/06/2017 | 399,968 | 0.12 |
| 900,000 | Bank of New York Mellon Corp 2.2% 16/08/2023 | 858,095 | 0.25 |
| 900,000 | Baxalta Inc 4% 23/06/2025 | 910,183 | 0.26 |
| 300,000 | Baxter International Inc 2.6% 15/08/2026 | 277,441 | 0.08 |
| 300,000 | Becton Dickinson and Co 3.734% 15/12/2024 | 307,809 | 0.09 |
| 400,000 | Berkshire Hathaway Energy Co 5.15% 15/11/2043 | 447,103 | 0.13 |
| 800,000 | Berkshire Hathaway Finance Corp 1.45% 07/03/2018 | 801,173 | 0.23 |
| 300,000 | Berkshire Hathaway Inc 3.125% 15/03/2026 | 298,003 | 0.09 |
| 350,000 | BMW US Capital LLC 2.8% 11/04/2026 | 338,671 | 0.10 |
| 970,000 | Boston Scientific Corp 3.375% 15/05/2022 | 988,045 | 0.29 |
| 800,000 | Brixmor Operating Partnership LP 3.85% 01/02/2025 | 785,766 | 0.23 |
| 275,000 | Burlington Northern Santa Fe LLC 4.375% 01/09/2042 | 280,816 | 0.08 |
| 100,000 | Caesars Entertainment Operating Co Inc FRN 01/06/2017 | 101,000 | 0.03 |
| 750,000 | Capital One Financial Corp 4.2% 29/10/2025 | 752,514 | 0.22 |
| 250,000 | CBS Corp 3.375% 01/03/2022 | 255,351 | 0.07 |
| 500,000 | CBS Corp 4.6% 15/01/2045 | 477,735 | 0.14 |
| 400,000 | CF Industries Inc 4.5% 01/12/2026 | 393,510 | 0.11 |
| 1,975,000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/07/2025 | 2,065,148 | 0.60 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 225,000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.384% 23/10/2035 | 251,802 | 0.07 |
| 800,000 | Chevron Corp 1.79% 16/11/2018 | 803,402 | 0.23 |
| 125,000 | Chevron Corp 2.954% 16/05/2026 | 122,422 | 0.04 |
| 600,000 | Chubb INA Holdings Inc 3.35% 03/05/2026 | 604,579 | 0.17 |
| 900,000 | Cimarex Energy Co 4.375% 01/06/2024 | 924,528 | 0.27 |
| 1,025,000 | Citigroup Inc 3.4% 01/05/2026 | 998,914 | 0.29 |
| 1,575,000 | Citigroup Inc 5.5% 13/09/2025 | 1,724,799 | 0.50 |
| 400,000 | Citigroup Inc FRN 01/09/2023 | 402,113 | 0.12 |
| 700,000 | Citigroup Inc FRN 02/08/2021 | 707,274 | 0.20 |
| 1,200,000 | Citigroup Inc FRN 07/06/2019 | 1,210,776 | 0.35 |
| 230,000 | Citizens Financial Group Inc 4.3% 03/12/2025 | 233,057 | 0.07 |
| 550,000 | Cleco Corporate Holdings LLC 3.743% 01/05/2026 | 541,677 | 0.16 |
| 700,000 | CME Group Inc 3% 15/03/2025 | 702,849 | 0.20 |
| 375,000 | CNA Financial Corp 4.5% 01/03/2026 | 388,116 | 0.11 |
| 625,000 | CNA Financial Corp 5.75% 15/08/2021 | 699,427 | 0.20 |
| 400,000 | Columbia Property Trust Operating Partnership LP 4.15% 01/04/2025 | 399,902 | 0.12 |
| 700,000 | Comcast Corp 2.75% 01/03/2023 | 695,275 | 0.20 |
| 850,000 | Comcast Corp 3.15% 01/03/2026 | 845,574 | 0.24 |
| 700,000 | Commonwealth Edison Co 6.15% 15/09/2017 | 725,975 | 0.21 |
| 175,000 | ConocoPhillips Co 4.3% 15/11/2044 | 168,864 | 0.05 |
| 500,000 | Cox Communications Inc 3.25% 15/12/2022 | 487,444 | 0.14 |
| 200,000 | Crown Castle International Corp 4.875% 15/04/2022 | 216,068 | 0.06 |
| 500,000 | Crown Castle International Corp 5.25% 15/01/2023 | 545,405 | 0.16 |
| 200,000 | Crown Castle Towers LLC 6.113% 15/01/2040 | 219,745 | 0.06 |
| 400,000 | CubeSmart LP 3.125% 01/09/2026 | 379,003 | 0.11 |
| 350,431 | CVS Pass-Through Trust 5.926% 10/01/2034 | 403,628 | 0.12 |
| 925,000 | Daimler Finance North America LLC 1.125% 10/03/2017 | 924,731 | 0.27 |
| 750,000 | Daimler Finance North America LLC FRN 10/03/2017 | 750,525 | 0.22 |
| 975,000 | Devon Energy Corp 3.25% 15/05/2022 | 947,059 | 0.27 |
| 525,000 | Devon Energy Corp 5.6% 15/07/2041 | 510,327 | 0.15 |
| 1,300,000 | Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 4.42% 15/06/2021 | 1,339,035 | 0.39 |
| 350,000 | Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 4.42% 15/06/2021 | 360,509 | 0.10 |
| 400,000 | Digital Realty Trust LP 3.95% 01/07/2022 | 413,855 | 0.12 |
| 300,000 | Digital Realty Trust LP 4.75% 01/10/2025 | 313,704 | 0.09 |
| 265,000 | Discover Bank/Greenwood DE 3.45% 27/07/2026 | 255,010 | 0.07 |
| 650,000 | Discover Financial Services 3.75% 04/03/2025 | 632,284 | 0.18 |
| 152,000 | DISH Network Corp 3.375% 15/08/2026 | 170,620 | 0.05 |
| 675,000 | Dominion Resources Inc/VA 4.45% 15/03/2021 | 724,512 | 0.21 |
| 100,000 | Dominion Resources Inc/VA 4.9% 01/08/2041 | 103,666 | 0.03 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 1,890,000 | Duke Energy Corp 2.65% 01/09/2026 | 1,757,928 | 0.51 |
| 550,000 | Duke Energy Corp 3.05% 15/08/2022 | 556,974 | 0.16 |
| 260,000 | Duke Energy Corp 3.75% 01/09/2046 | 233,448 | 0.07 |
| 900,000 | Duke Energy Corp 3.75% 15/04/2024 | 923,855 | 0.27 |
| 400,000 | Duquesne Light Holdings Inc 6.4% 15/09/2020 | 448,688 | 0.13 |
| 400,000 | EMD Finance LLC 3.25% 19/03/2025 | 393,099 | 0.11 |
| 150,000 | Emera US Finance LP 2.7% 15/06/2021 | 149,290 | 0.04 |
| 250,000 | Emera US Finance LP 3.55% 15/06/2026 | 245,805 | 0.07 |
| 105,000 | Energy Transfer Partners LP 5.95% 01/10/2043 | 103,819 | 0.03 |
| 160,000 | Energy Transfer Partners LP 6.05% 01/06/2041 | 158,672 | 0.05 |
| 700,000 | Entergy Corp 4% 15/07/2022 | 735,335 | 0.21 |
| 400,000 | Enterprise Products Operating LLC 3.9% 15/02/2024 | 409,227 | 0.12 |
| 450,000 | Enterprise Products Operating LLC 3.95% 15/02/2027 | 452,099 | 0.13 |
| 400,000 | Enterprise Products Operating LLC 4.05% 15/02/2022 | 420,482 | 0.12 |
| 400,000 | Enterprise Products Operating LLC 4.95% 15/10/2054 | 369,384 | 0.11 |
| 75,000 | Enterprise Products Operating LLC 5.95% 01/02/2041 | 81,977 | 0.02 |
| 200,000 | EPR Properties 4.5% 01/04/2025 | 195,896 | 0.06 |
| 400,000 | EQT Midstream Partners LP 4% 01/08/2024 | 388,592 | 0.11 |
| 900,000 | Essex Portfolio LP 3.5% 01/04/2025 | 889,434 | 0.26 |
| 575,000 | Exelon Corp 3.4% 15/04/2026 | 565,571 | 0.16 |
| 800,000 | Exxon Mobil Corp 1.439% 01/03/2018 | 800,187 | 0.23 |
| 65,000 | FBM Finance Inc 8.25% 15/08/2021 | 67,600 | 0.02 |
| 95,000 | FedEx Corp 4.55% 01/04/2046 | 95,077 | 0.03 |
| 80,000 | FedEx Corp 4.75% 15/11/2045 | 82,061 | 0.02 |
| 400,000 | Fidelity National Financial Inc 6.6% 15/05/2017 | 407,967 | 0.12 |
| 590,000 | Fidelity National Information Services Inc 3% 15/08/2026 | 551,032 | 0.16 |
| 675,000 | Fidelity National Information Services Inc 3.5% 15/04/2023 | 683,718 | 0.20 |
| 300,000 | Fifth Third Bancorp 3.5% 15/03/2022 | 309,166 | 0.09 |
| 575,000 | Fifth Third Bank/Cincinnati OH 3.85% 15/03/2026 | 580,822 | 0.17 |
| 425,000 | First American Financial Corp 4.3% 01/02/2023 | 422,314 | 0.12 |
| 800,000 | First Data Corp 5.75% 15/01/2024 | 813,000 | 0.23 |
| 200,000 | FirstEnergy Corp 4.25% 15/03/2023 | 207,614 | 0.06 |
| 320,000 | FirstEnergy Corp 7.375% 15/11/2031 | 400,984 | 0.12 |
| 1,000,000 | Florida Gas Transmission Co LLC 7.9% 15/05/2019 | 1,121,570 | 0.32 |
| 625,000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.875% 02/08/2021 | 690,991 | 0.20 |
| 500,000 | Fortune Brands Home & Security Inc 3% 15/06/2020 | 505,561 | 0.15 |
| 100,000 | GATX Corp 3.25% 15/09/2026 | 94,387 | 0.03 |
| 200,000 | General Electric Co 4.125% 09/10/2042 | 200,488 | 0.06 |
| 400,000 | General Electric Co 6.875% 10/01/2039 | 559,067 | 0.16 |
| 800,000 | General Motors Financial Co Inc 3.15% 15/01/2020 | 804,295 | 0.23 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 365,000 | General Motors Financial Co Inc 3.7% 09/05/2023 | 359,494 | 0.10 |
| 900,000 | General Motors Financial Co Inc 4.2% 01/03/2021 | 926,043 | 0.27 |
| 225,000 | Georgia Power Co 4.3% 15/03/2042 | 225,620 | 0.07 |
| 250,000 | Goldman Sachs Group Inc 1.625% 27/07/2026 | 259,984 | 0.08 |
| 2,600,000 | Goldman Sachs Group Inc 3.5% 23/01/2025 | 2,593,418 | 0.75 |
| 1,700,000 | Goldman Sachs Group Inc 3.75% 22/05/2025 | 1,714,470 | 0.49 |
| 1,500,000 | Goldman Sachs Group Inc 5.25% 27/07/2021 | 1,652,908 | 0.48 |
| 200,000 | Goldman Sachs Group Inc 5.75% 24/01/2022 | 226,126 | 0.07 |
| 750,000 | Goldman Sachs Group Inc 5.95% 15/01/2027 | 851,783 | 0.25 |
| 600,000 | Goldman Sachs Group Inc 6.25% 01/02/2041 | 740,239 | 0.21 |
| 100,000 | Goldman Sachs Group Inc FRN 28/10/2027 | 101,039 | 0.03 |
| 215,000 | Gray Television Inc 5.125% 15/10/2024 | 201,562 | 0.06 |
| 700,000 | Hartford Financial Services Group Inc 5.125% 15/04/2022 | 773,620 | 0.22 |
| 600,000 | HCA Inc 5.875% 15/02/2026 | 599,250 | 0.17 |
| 500,000 | HCA Inc 5.875% 15/03/2022 | 538,125 | 0.16 |
| 375,000 | HD Supply Inc 5.75% 15/04/2024 | 384,375 | 0.11 |
| 130,000 | Hess Corp 4.3% 01/04/2027 | 123,601 | 0.04 |
| 100,000 | Hess Corp 5.8% 01/04/2047 | 96,995 | 0.03 |
| 475,000 | Hess Corp 6% 15/01/2040 | 458,048 | 0.13 |
| 350,000 | Host Hotels & Resorts LP 4% 15/06/2025 | 345,099 | 0.10 |
| 1,800,000 | HSBC Finance Corp 6.676% 15/01/2021 | 2,024,147 | 0.58 |
| 375,000 | Intel Corp 2.6% 19/05/2026 | 363,575 | 0.10 |
| 1,200,000 | International Lease Finance Corp 8.25% 15/12/2020 | 1,407,000 | 0.41 |
| 375,000 | Interpublic Group of Cos Inc 4.2% 15/04/2024 | 387,473 | 0.11 |
| 300,000 | Jackson National Life Global Funding 1.875% 15/10/2018 | 300,857 | 0.09 |
| 400,000 | Jersey Central Power & Light Co 4.7% 01/04/2024 | 422,491 | 0.12 |
| 900,000 | JPMorgan Chase & Co 2.75% 23/06/2020 | 908,633 | 0.26 |
| 2,000,000 | JPMorgan Chase & Co 3.2% 15/06/2026 | 1,950,469 | 0.56 |
| 900,000 | JPMorgan Chase & Co 3.3% 01/04/2026 | 886,095 | 0.26 |
| 700,000 | JPMorgan Chase & Co 3.9% 15/07/2025 | 723,046 | 0.21 |
| 225,000 | JPMorgan Chase & Co 4.25% 01/10/2027 | 231,709 | 0.07 |
| 100,000 | JPMorgan Chase & Co FRN 30/05/2017 | 124,940 | 0.04 |
| 1,700,000 | JPMorgan Chase Bank NA 6% 01/10/2017 | 1,761,509 | 0.51 |
| 575,000 | Kaiser Foundation Hospitals 3.5% 01/04/2022 | 594,548 | 0.17 |
| 650,000 | Kennedy-Wilson Inc 5.875% 01/04/2024 | 657,312 | 0.19 |
| 1,000,000 | Kilroy Realty LP 4.375% 01/10/2025 | 1,028,966 | 0.30 |
| 500,000 | Kimco Realty Corp 2.8% 01/10/2026 | 467,416 | 0.13 |
| 500,000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 3.45% 15/02/2023 | 488,435 | 0.14 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 500,000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 4.3% 01/05/2024 | 504,210 | 0.15 |
| 150,000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 6.375% 01/03/2041 | 154,505 | 0.04 |
| 1,100,000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 6.85% 15/02/2020 | 1,225,964 | 0.35 |
| 680,000 | Kraft Heinz Foods Co 2.25% 25/05/2028 | 737,342 | 0.21 |
| 525,000 | Kraft Heinz Foods Co 3% 01/06/2026 | 497,099 | 0.14 |
| 250,000 | Kraft Heinz Foods Co 4.125% 01/07/2027 | 344,386 | 0.10 |
| 225,000 | LafargeHolcim Finance US LLC 4.75% 22/09/2046 | 212,345 | 0.06 |
| 100,000 | Lazard Group LLC 4.25% 14/11/2020 | 104,964 | 0.03 |
| 475,000 | Lennar Corp 4.875% 15/12/2023 | 470,250 | 0.14 |
| 625,000 | Level 3 Financing Inc 5.375% 15/01/2024 | 629,687 | 0.18 |
| 550,000 | Lockheed Martin Corp 3.55% 15/01/2026 | 563,871 | 0.16 |
| 200,000 | Lockheed Martin Corp 4.7% 15/05/2046 | 216,864 | 0.06 |
| 285,000 | Marathon Oil Corp 2.7% 01/06/2020 | 278,415 | 0.08 |
| 405,000 | Marathon Oil Corp 5.2% 01/06/2045 | 355,459 | 0.10 |
| 300,000 | Marsh & McLennan Cos Inc 3.5% 03/06/2024 | 306,969 | 0.09 |
| 700,000 | Masco Corp 5.95% 15/03/2022 | 781,830 | 0.23 |
| 775,000 | Match Group Inc 6.375% 01/06/2024 | 821,500 | 0.24 |
| 275,000 | MetLife Inc 4.6% 13/05/2046 | 286,352 | 0.08 |
| 57,000 | Micron Technology Inc 3% 15/11/2043 | 52,547 | 0.02 |
| 150,000 | Micron Technology Inc 7.5% 15/09/2023 | 166,125 | 0.05 |
| 620,000 | Microsoft Corp 2.4% 08/08/2026 | 589,476 | 0.17 |
| 750,000 | Microsoft Corp 3.45% 08/08/2036 | 709,285 | 0.20 |
| 550,000 | Microsoft Corp 3.7% 08/08/2046 | 513,227 | 0.15 |
| 450,000 | Molson Coors Brewing Co 1.25% 15/07/2024 | 476,024 | 0.14 |
| 830,000 | Molson Coors Brewing Co 3% 15/07/2026 | 783,553 | 0.23 |
| 175,000 | Morgan Stanley 1.375% 27/10/2026 | 178,833 | 0.05 |
| 150,000 | Morgan Stanley 1.75% 30/01/2025 | 162,859 | 0.05 |
| 1,400,000 | Morgan Stanley 3.875% 29/04/2024 | 1,436,465 | 0.41 |
| 2,500,000 | Morgan Stanley 4% 23/07/2025 | 2,565,826 | 0.74 |
| 825,000 | Morgan Stanley 4.35% 08/09/2026 | 845,290 | 0.24 |
| 500,000 | Motorola Solutions Inc 4% 01/09/2024 | 491,995 | 0.14 |
| 475,000 | MPH Acquisition Holdings LLC 7.125% 01/06/2024 | 500,531 | 0.14 |
| 900,000 | MUFG Union Bank NA 2.625% 26/09/2018 | 910,586 | 0.26 |
| 200,000 | Nasdaq Inc 3.85% 30/06/2026 | 198,178 | 0.06 |
| 400,000 | National Fuel Gas Co 3.75% 01/03/2023 | 385,737 | 0.11 |
| 175,000 | Netflix Inc 4.375% 15/11/2026 | 170,627 | 0.05 |
| 700,000 | Noble Energy Inc 4.15% 15/12/2021 | 725,244 | 0.21 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 175,000 | Noble Energy Inc 6% 01/03/2041 | 184,342 | 0.05 |
| 200,000 | Occidental Petroleum Corp 3% 15/02/2027 | 193,494 | 0.06 |
| 350,000 | Occidental Petroleum Corp 3.4% 15/04/2026 | 350,137 | 0.10 |
| 150,000 | Occidental Petroleum Corp 4.4% 15/04/2046 | 149,189 | 0.04 |
| 400,000 | Ohio National Financial Services Inc 6.375% 30/04/2020 | 442,036 | 0.13 |
| 500,000 | ONEOK Partners LP 6.85% 15/10/2037 | 557,559 | 0.16 |
| 570,000 | PDC Energy Inc 6.125% 15/09/2024 | 585,675 | 0.17 |
| 450,000 | Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 4.25% 17/01/2023 | 468,819 | 0.14 |
| 545,000 | PepsiCo Inc 3.45% 06/10/2046 | 487,534 | 0.14 |
| 300,000 | PHH Corp 6.375% 15/08/2021 | 293,250 | 0.08 |
| 375,000 | Philip Morris International Inc 2.625% 06/03/2023 | 369,761 | 0.11 |
| 400,000 | Philip Morris International Inc 2.875% 30/05/2024 | 489,025 | 0.14 |
| 300,000 | Philip Morris International Inc 4.125% 04/03/2043 | 289,941 | 0.08 |
| 680,000 | Philip Morris International Inc 4.25% 10/11/2044 | 671,818 | 0.19 |
| 975,000 | Philip Morris International Inc 5.65% 16/05/2018 | 1,031,672 | 0.30 |
| 500,000 | Pinnacle Entertainment Inc 5.625% 01/05/2024 | 500,000 | 0.14 |
| 1,075,000 | Pioneer Natural Resources Co 3.45% 15/01/2021 | 1,095,775 | 0.32 |
| 375,000 | Pioneer Natural Resources Co 4.45% 15/01/2026 | 394,260 | 0.11 |
| 300,000 | Pioneer Natural Resources Co 6.875% 01/05/2018 | 319,324 | 0.09 |
| 700,000 | Pioneer Natural Resources Co 7.5% 15/01/2020 | 796,049 | 0.23 |
| 800,000 | Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 3.85% 15/10/2023 | 782,361 | 0.23 |
| 305,000 | Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 4.5% 15/12/2026 | 301,794 | 0.09 |
| 450,000 | PNC Financial Services Group Inc 3.3% 08/03/2022 | 465,229 | 0.13 |
| 1,100,000 | PNC Financial Services Group Inc 3.9% 29/04/2024 | 1,131,252 | 0.33 |
| 175,000 | PPL Capital Funding Inc 3.1% 15/05/2026 | 168,738 | 0.05 |
| 250,000 | Principal Financial Group Inc 3.125% 15/05/2023 | 246,774 | 0.07 |
| 275,000 | Principal Financial Group Inc 3.3% 15/09/2022 | 279,964 | 0.08 |
| 150,000 | Principal Financial Group Inc 4.35% 15/05/2043 | 147,977 | 0.04 |
| 500,000 | Prologis LP 3% 02/06/2026 | 600,431 | 0.17 |
| 200,000 | Protective Life Global Funding 1.999% 14/09/2021 | 193,921 | 0.06 |
| 800,000 | QVC Inc 4.375% 15/03/2023 | 782,254 | 0.23 |
| 100,000 | Realty Income Corp 3% 15/01/2027 | 94,374 | 0.03 |
| 325,000 | Regency Energy Partners LP / Regency Energy Finance Corp 4.5% 01/11/2023 | 328,974 | 0.09 |
| 275,000 | Regency Energy Partners LP / Regency Energy Finance Corp 5% 01/10/2022 | 291,293 | 0.08 |
| 100,000 | Regency Energy Partners LP / Regency Energy Finance Corp 5.75% 01/09/2020 | 108,357 | 0.03 |
| 500,000 | Regency Energy Partners LP / Regency Energy Finance Corp 5.875% 01/03/2022 | 553,409 | 0.16 |
| 500,000 | Reinsurance Group of America Inc 5% 01/06/2021 | 532,508 | 0.15 |
| 900,000 | Republic Services Inc 4.75% 15/05/2023 | 983,243 | 0.28 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 925,000 | Reynolds American Inc 2.3% 21/08/2017 | 930,481 | 0.27 |
| 1,025,000 | Reynolds American Inc 4.45% 12/06/2025 | 1,087,766 | 0.31 |
| 469,313 | Rio Oil Finance Trust Series 2014-3 6.75% 06/01/2027 | 436,461 | 0.13 |
| 500,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/05/2024 | 530,000 | 0.15 |
| 300,000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30/06/2026 | 318,000 | 0.09 |
| 500,000 | SABMiller Holdings Inc 3.75% 15/01/2022 | 523,009 | 0.15 |
| 1,400,000 | Santander Bank NA FRN 12/01/2018 | 1,400,693 | 0.40 |
| 300,000 | SBA Tower Trust 2.877% 15/07/2021 | 298,737 | 0.09 |
| 775,000 | Sinclair Television Group Inc 5.125% 15/02/2027 | 722,687 | 0.21 |
| 375,000 | Sirius XM Radio Inc 6% 15/07/2024 | 390,937 | 0.11 |
| 1,000,000 | SL Green Realty Corp 5% 15/08/2018 | 1,038,718 | 0.30 |
| 800,000 | Southern Co 1.55% 01/07/2018 | 797,599 | 0.23 |
| 600,000 | Southern Co 2.95% 01/07/2023 | 595,002 | 0.17 |
| 825,000 | Southern Co 3.25% 01/07/2026 | 805,547 | 0.23 |
| 325,000 | Southern Co Gas Capital Corp 3.95% 01/10/2046 | 299,721 | 0.09 |
| 600,000 | Spectra Energy Partners LP 4.5% 15/03/2045 | 549,224 | 0.16 |
| 700,000 | Sprint Capital Corp 6.9% 01/05/2019 | 731,500 | 0.21 |
| 230,000 | Sunoco Logistics Partners Operations LP 3.9% 15/07/2026 | 219,443 | 0.06 |
| 610,000 | Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.3% 01/04/2044 | 571,480 | 0.16 |
| 525,000 | Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.95% 01/12/2025 | 581,015 | 0.17 |
| 300,000 | Synchrony Financial 4.5% 23/07/2025 | 307,720 | 0.09 |
| 800,000 | Tanger Properties LP 3.75% 01/12/2024 | 803,071 | 0.23 |
| 400,000 | Tenet Healthcare Corp FRN 15/06/2020 | 402,000 | 0.12 |
| 475,000 | Tesoro Corp 5.125% 01/04/2024 | 494,000 | 0.14 |
| 90,000 | Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.25% 15/01/2025 | 91,350 | 0.03 |
| 500,000 | Thermo Fisher Scientific Inc 0.75% 12/09/2024 | 513,812 | 0.15 |
| 100,000 | Thermo Fisher Scientific Inc 5.3% 01/02/2044 | 111,270 | 0.03 |
| 500,000 | Time Warner Cable Inc 8.75% 14/02/2019 | 566,515 | 0.16 |
| 100,000 | Time Warner Cable LLC 5% 01/02/2020 | 106,130 | 0.03 |
| 75,000 | Time Warner Cable LLC 6.75% 15/06/2039 | 84,993 | 0.02 |
| 225,000 | Time Warner Cable LLC 7.3% 01/07/2038 | 269,082 | 0.08 |
| 800,000 | Time Warner Cable LLC 8.25% 01/04/2019 | 903,402 | 0.26 |
| 225,000 | Time Warner Entertainment Co LP 8.375% 15/07/2033 | 290,113 | 0.08 |
| 500,000 | Time Warner Inc 3.8% 15/02/2027 | 498,642 | 0.14 |
| 1,600,000 | Toyota Motor Credit Corp 1.2% 06/04/2018 | 1,594,021 | 0.46 |
| 850,000 | Toyota Motor Credit Corp 2.05% 12/01/2017 | 850,971 | 0.25 |
| 200,000 | UDR Inc 2.95% 01/09/2026 | 188,560 | 0.05 |
| 753,858 | United Airlines 2014-2 Class A Pass Through Trust 3.75% 03/09/2026 | 769,878 | 0.22 |
| 500,000 | United Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.1% 07/10/2028 [†] | 483,437 | 0.14 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | 社債(つづき) : 59.50% (31 May 2016: 53.15%) | | |
| 1,550,000 | UnitedHealth Group Inc 3.1% 15/03/2026 | 1,538,585 | 0.44 |
| 800,000 | UnitedHealth Group Inc 3.75% 15/07/2025 | 832,056 | 0.24 |
| 675,000 | UnitedHealth Group Inc 4.75% 15/07/2045 | 743,850 | 0.21 |
| 525,000 | Universal Health Services Inc 5% 01/06/2026 | 521,062 | 0.15 |
| 350,000 | Unum Group 4% 15/03/2024 | 347,868 | 0.10 |
| 150,000 | Unum Group 5.75% 15/08/2042 | 159,086 | 0.05 |
| 900,000 | US Bancorp 2.375% 22/07/2026 | 837,913 | 0.24 |
| 100,000 | Verizon Communications Inc 2.625% 15/08/2026 | 92,443 | 0.03 |
| 750,000 | Verizon Communications Inc 3.5% 01/11/2021 | 774,117 | 0.22 |
| 2,650,000 | Verizon Communications Inc 3.5% 01/11/2024 | 2,670,357 | 0.77 |
| 275,000 | Verizon Communications Inc 4.125% 15/08/2046 | 246,296 | 0.07 |
| 825,000 | Verizon Communications Inc 4.4% 01/11/2034 | 806,021 | 0.23 |
| 550,000 | Verizon Communications Inc 5.15% 15/09/2023 | 609,807 | 0.18 |
| 100,000 | Viacom Inc 3.45% 04/10/2026 | 95,764 | 0.03 |
| 700,000 | Viacom Inc 5.85% 01/09/2043 | 747,148 | 0.22 |
| 375,000 | Virginia Electric & Power Co 3.15% 15/01/2026 373,697 0 | 373,697 | 0.11 |
| 475,000 | Voya Financial Inc 3.65% 15/06/2026 | 459,631 | 0.13 |
| 200,000 | VW Credit Inc 2.25% 23/03/2018 | 200,486 | 0.06 |
| 300,000 | Walgreens Boots Alliance Inc 3.1% 01/06/2023 | 296,641 | 0.09 |
| 500,000 | WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance PLC 2.7% 17/09/2019 | 506,128 | 0.15 |
| 400,000 | Wells Fargo & Co 1.625% 02/06/2025 | 436,876 | 0.13 |
| 100,000 | Wells Fargo & Co 2.5% 04/03/2021 | 99,773 | 0.03 |
| 500,000 | Wells Fargo & Co 2.55% 07/12/2020 | 501,252 | 0.14 |
| 100,000 | Wells Fargo & Co 3% 22/04/2026 | 96,067 | 0.03 |
| 310,000 | Wells Fargo & Co 3% 23/10/2026 | 297,008 | 0.09 |
| 2,100,000 | Wells Fargo & Co 3.55% 29/09/2025 | 2,107,380 | 0.61 |
| 550,000 | Wells Fargo & Co 3.9% 01/05/2045 | 518,316 | 0.15 |
| 1,190,000 | Wells Fargo & Co 4.3% 22/07/2027 | 1,231,857 | 0.36 |
| 850,000 | Wells Fargo & Co 4.48% 16/01/2024 | 894,718 | 0.26 |
| 475,000 | Wells Fargo & Co 4.9% 17/11/2045 | 492,412 | 0.14 |
| 800,000 | Wells Fargo Bank NA 1.65% 22/01/2018 | 800,876 | 0.23 |
| 700,000 | Welltower Inc 4.25% 01/04/2026 | 724,417 | 0.21 |
| 600,000 | Western Gas Partners LP 4% 01/07/2022 | 599,749 | 0.17 |
| 400,000 | Weyerhaeuser Co 7.375% 15/03/2032 | 505,838 | 0.15 |
| 300,000 | Weyerhaeuser Co 8.5% 15/01/2025 | 389,819 | 0.11 |
| 155,000 | Williams Partners LP 3.6% 15/03/2022 | 153,390 | 0.04 |
| 20,000 | Williams Partners LP 4.5% 15/11/2023 | 20,296 | 0.01 |
| 130,000 | Williams Partners LP 4.9% 15/01/2045 | 114,117 | 0.03 |
| 25,000 | Williams Partners LP 5.1% 15/09/2045 | 22,775 | 0.01 |
| 175,000 | Williams Partners LP 5.25% 15/03/2020 | 186,306 | 0.05 |
| 850,000 | Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp 5.5% 01/03/2025 | 840,438 | 0.24 |
| 1,000,000 | Zimmer Biomet Holdings Inc 3.55% 01/04/2025 | 978,996 | 0.28 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|--------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 99.20% (31 May 2016: 104.42%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.84% (31 May 2016: 59.63%) | | |
| | FGLMC 担保証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| | FNMA 担保証券 : 1.39% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,700,000 | Fannie Mae Pool 3.50% 15/02/2046 | 4,811,075 | 1.39 |
| | 国債 : 2.56% (31 May 2016: 4.92%) | | |
| 1,300,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/01/2025 | 1,307,056 | 0.38 |
| 2,000,000 | United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/08/2026 | 1,847,267 | 0.53 |
| 1,440,000 | United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/08/2046 | 1,218,657 | 0.34 |
| 3,580,000 | United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/05/2046 | 3,203,962 | 0.91 |
| 3,150,000 | United States Treasury Strip Principal 0% 15/05/2043 | 1,390,256 | 0.40 |
| | 地方債 : 0.62% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 225,000 | New Jersey State 7.102% 01/01/2041 [†] | 315,722 | 0.09 |
| 375,000 | North Texas Tollw 6.718% 01/01/2049 | 525,244 | 0.15 |
| 480,000 | State of California 7.50% 01/04/2034 | 677,330 | 0.20 |
| 475,000 | University of California 6.583% 15/05/2049 [†] | 626,140 | 0.18 |
| | その他資産担保証券 : 0.19% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| 439,927 | Ameriquest Mortgage Securities Inc FRN 25/10/2035 | 437,222 | 0.13 |
| 300,794 | Ownit Mortgage Loan Trust Series '5 M1' FRN 25/10/2036 | 257,737 | 0.06 |
| | ホールローンCMO : 0.21% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 464,572 | Banc of America Alternative Loan Trust 2005-10 Class 4-A-1 5.75% 25/11/2035 | 434,517 | 0.13 |
| 8,754 | Bear Stearns ARM Trust 2005-10 Class A-2 FRN 25/10/2035 | 8,789 | - |
| 191,797 | Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-10 FRN 25/09/2037 | 155,505 | 0.04 |
| 148,968 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass Through Trust FRN 25/07/2057 | 142,348 | 0.04 |
| | 米国合計 | 231,658,334 | 66.84 |
| | バージン諸島 : 0.27% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| | 社債 : 0.27% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 400,000 | CNOOC Finance 2011 Ltd 4.25% 26/01/2021 '144A' | 419,892 | 0.12 |
| 375,000 | Global Switch Holdings Ltd 4.375% 13/12/2022 | 515,400 | 0.15 |
| | バージン諸島合計 | 935,292 | 0.27 |
| | 債券合計 | 343,878,803 | 99.20 |
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る未収収益 : 0.96% (1.06%) | 3,327,006 | 0.96 |

| 契約数 | | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--|---|------------------|---------------|
| 先物契約*** : 0.06% (31 May 2016: -0.03%) | | | |
| (3) | Euro-BUXL 30 Yr Bond EUX Future December 2016 | 9,844 | - |
| (17) | Euro-Bund EUX Future December 2016 | 955 | - |
| 23 | Euro-SCHATZ EUX Future December 2016 | 5,982 | - |
| (689) | US 10 Yr Future CBT March 2017 | 258,591 | 0.07 |
| 18 | Euro-Bund EUX Future March 2017 | 11,838 | - |
| 34 | US 2 Year Note CBT Future March 2017 | 2,641 | - |
| 29 | Canada 10 Yr MSE Future March 2017 | 216 | - |
| 未決済先物契約に係る評価益合計 | | 290,067 | 0.07 |
| 5 | Australia 10 Yr SFE Future December 2016 | (25,400) | (0.01) |
| 67 | Euro-BOBL EUX Future December 2016 | (6,715) | - |
| (5) | US 5 Year Note CBT Future March 2017 | (11,765) | - |
| 13 | US Long Bond CBT Future March 2017 | (11,498) | - |
| 48 | US Ultra CBT Future March 2017 | (8,742) | - |
| (11) | Long Gilt ICE Future March 2017 | (7,559) | - |
| 未決済先物契約に係る評価損合計 | | (71,679) | (0.01) |
| 先物契約合計 | | 218,388 | 0.06 |
| 先渡為替契約 : -0.54% (31 May 2016: 0.63%) | | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------------|-----|---------------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| Bank of New York Mellon | IDR | 2,415,700,000 | USD | 170,000 | 16-May-2017 | 1,573 | - |
| BNP Paribas | USD | 25,759,461 | EUR | 23,550,000 | 02-Dec-2016 | 777,622 | 0.23 |
| Chase Manhattan | USD | 3,028,226 | CAD | 4,054,000 | 02-Dec-2016 | 13,203 | - |
| Chase Manhattan | RUB | 30,096,528 | USD | 454,167 | 22-Feb-2017 | 4,063 | - |
| Chase Manhattan | USD | 433,664 | EUR | 405,000 | 05-Dec-2016 | 4,015 | - |
| Chase Manhattan | RUB | 30,096,528 | USD | 461,926 | 15-Dec-2016 | 2,783 | - |
| Chase Manhattan | USD | 409,047 | EUR | 385,000 | 02-Dec-2016 | 639 | - |
| Citibank | USD | 940,422 | JPY | 97,100,000 | 05-Dec-2016 | 88,200 | 0.03 |
| Citibank | USD | 915,520 | JPY | 96,050,000 | 05-Dec-2016 | 72,514 | 0.03 |
| Citibank | USD | 848,992 | JPY | 95,450,000 | 10-Jan-2017 | 9,365 | - |
| Citibank | GBP | 230,000 | USD | 285,724 | 02-Dec-2016 | 1,638 | - |
| Citibank | EUR | 297,531 | USD | 314,209 | 07-Dec-2016 | 1,467 | - |
| Citibank | USD | 44,613 | EUR | 41,000 | 02-Dec-2016 | 1,120 | - |
| Citibank | GBP | 409,000 | USD | 510,359 | 02-Dec-2016 | 645 | - |
| Citibank | EUR | 32,000 | USD | 33,791 | 05-Dec-2016 | 157 | - |
| Credit Suisse First Boston | EUR | 246,323 | USD | 260,523 | 07-Dec-2016 | 822 | - |
| Credit Suisse First Boston | USD | 262,384 | EUR | 247,000 | 05-Dec-2016 | 351 | - |
| Credit Suisse First Boston | EUR | 279,000 | USD | 296,276 | 09-Jan-2017 | 297 | - |
| Credit Suisse First Boston | EUR | 48,000 | USD | 50,868 | 09-Jan-2017 | 155 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.54% (31 May 2016: 0.63%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|-----|------------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| Deutsche | USD | 301,116 | PLN | 1,178,000 | 07-Feb-2017 | 20,345 | 0.01 |
| Goldman Sachs | USD | 909,945 | JPY | 95,400,000 | 02-Dec-2016 | 72,699 | 0.02 |
| Goldman Sachs | GBP | 1,251,000 | USD | 1,553,031 | 02-Dec-2016 | 9,968 | - |
| Morgan Stanley | USD | 369,585 | BRL | 1,244,022 | 02-Dec-2016 | 1,803 | - |
| Morgan Stanley | USD | 248,642 | EUR | 234,000 | 05-Dec-2016 | 401 | - |
| Royal Bank of Canada | GBP | 335,000 | USD | 409,276 | 05-Dec-2016 | 9,287 | - |
| Royal Bank of Canada | USD | 7,473 | CAD | 10,000 | 05-Dec-2016 | 35 | - |
| Royal Bank of Canada | USD | 7,456 | CAD | 10,000 | 10-Jan-2017 | 16 | - |
| Standard Chartered | USD | 834,572 | SGD | 1,190,000 | 17-Jan-2017 | 3,743 | - |
| State Street | USD | 24,887,419 | EUR | 22,697,000 | 05-Dec-2016 | 809,022 | 0.24 |
| State Street | EUR | 110,000 | USD | 116,921 | 10-Jan-2017 | 13 | - |
| UBS | USD | 547,317 | EUR | 500,000 | 05-Dec-2016 | 16,885 | - |
| UBS | USD | 698,022 | EUR | 651,000 | 05-Dec-2016 | 7,400 | - |
| UBS | USD | 467,340 | EUR | 435,155 | 15-Dec-2016 | 5,428 | - |
| UBS | GBP | 301,354 | USD | 374,466 | 15-Dec-2016 | 2,190 | - |
| UBS | GBP | 95,370 | USD | 117,447 | 15-Dec-2016 | 1,754 | - |
| UBS | USD | 136,484 | EUR | 127,084 | 15-Dec-2016 | 1,585 | - |
| UBS | GBP | 145,181 | USD | 180,057 | 15-Dec-2016 | 1,403 | - |
| UBS | GBP | 192,896 | USD | 239,739 | 15-Dec-2016 | 1,358 | - |
| UBS | GBP | 349,364 | USD | 435,355 | 15-Dec-2016 | 1,310 | - |
| UBS | USD | 38,065 | EUR | 34,956 | 15-Dec-2016 | 960 | - |
| UBS | GBP | 123,175 | USD | 153,394 | 15-Dec-2016 | 560 | - |
| UBS | EUR | 125,000 | USD | 132,151 | 05-Dec-2016 | 457 | - |
| UBS | USD | 63,641 | EUR | 59,571 | 15-Dec-2016 | 407 | - |
| UBS | USD | 110,954 | EUR | 104,000 | 09-Jan-2017 | 403 | - |
| UBS | USD | 12,430 | EUR | 11,342 | 15-Dec-2016 | 390 | - |
| UBS | USD | 25,015 | EUR | 23,292 | 15-Dec-2016 | 291 | - |
| UBS | EUR | 104,310 | USD | 110,460 | 15-Dec-2016 | 264 | - |
| UBS | EUR | 17,809 | USD | 18,767 | 15-Dec-2016 | 137 | - |
| UBS | EUR | 41,047 | USD | 43,435 | 15-Dec-2016 | 135 | - |
| UBS | GBP | 65,241 | USD | 81,412 | 15-Dec-2016 | 132 | - |
| UBS | USD | 15,001 | EUR | 14,044 | 15-Dec-2016 | 94 | - |
| UBS | USD | 54,949 | EUR | 51,698 | 15-Dec-2016 | 72 | - |
| UBS | GBP | 73,462 | USD | 91,746 | 15-Dec-2016 | 72 | - |
| UBS | USD | 1,169 | EUR | 1,089 | 15-Dec-2016 | 14 | - |
| UBS | USD | 7,252 | EUR | 6,826 | 15-Dec-2016 | 6 | - |
| UBS | EUR | 2,880 | USD | 3,056 | 15-Dec-2016 | 1 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 1,951,669 | 0.56 |

先渡為替契約(つづき) : -0.54% (31 May 2016: 0.63%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| Bank of America | USD | 832,000 | KRW | 978,182,400 | 17-Jan-2017 | (802) | - |
| Barclays^ | USD | 5,295,008 | GBP | 4,257,600 | 15-Dec-2016 | (26,491) | (0.01) |
| Barclays^ | EUR | 104,000 | USD | 113,578 | 05-Dec-2016 | (3,248) | - |
| Barclays^ | USD | 15,792 | GBP | 12,698 | 15-Dec-2016 | (79) | - |
| Barclays^ | USD | 6,367 | GBP | 5,119 | 15-Dec-2016 | (32) | - |
| Barclays^ | USD | 5,797 | GBP | 4,661 | 15-Dec-2016 | (29) | - |
| Barclays^ | USD | 2,647 | GBP | 2,128 | 15-Dec-2016 | (13) | - |
| Barclays^ | USD | 1,856 | GBP | 1,493 | 15-Dec-2016 | (9) | - |
| Barclays^ | USD | 668 | GBP | 537 | 15-Dec-2016 | (3) | - |
| BNP Paribas | BRL | 1,244,022 | USD | 395,216 | 02-Dec-2016 | (27,434) | (0.01) |
| BNP Paribas | USD | 24,007,586 | EUR | 22,635,000 | 06-Jan-2017 | (49,739) | (0.01) |
| BNP Paribas | USD | 9,162,047 | GBP | 7,327,000 | 06-Jan-2017 | (2,645) | - |
| Chase Manhattan | JPY | 97,700,000 | USD | 930,458 | 05-Dec-2016 | (72,970) | (0.02) |
| Chase Manhattan | EUR | 384,000 | USD | 419,594 | 02-Dec-2016 | (12,247) | - |
| Chase Manhattan | USD | 460,826 | RUB | 30,096,528 | 15-Dec-2016 | (3,882) | - |
| Chase Manhattan | USD | 315,447 | EUR | 299,000 | 05-Dec-2016 | (1,751) | - |
| Chase Manhattan | EUR | 251,000 | USD | 266,564 | 05-Dec-2016 | (288) | - |
| Chase Manhattan | EUR | 360,000 | USD | 382,724 | 09-Jan-2017 | (50) | - |
| Citibank | EUR | 721,000 | USD | 798,735 | 02-Dec-2016 | (33,899) | (0.01) |
| Citibank | EUR | 236,000 | USD | 262,185 | 02-Dec-2016 | (11,836) | - |
| Citibank | USD | 314,677 | EUR | 298,000 | 05-Dec-2016 | (1,460) | - |
| Citibank | USD | 437,069 | EUR | 412,000 | 05-Dec-2016 | (7) | - |
| Credit Suisse | | | | | | | |
| First Boston | USD | 260,701 | EUR | 246,000 | 09-Jan-2017 | (793) | - |
| Deutsche | MXN | 17,044,279 | USD | 888,440 | 13-Feb-2017 | (63,199) | (0.02) |
| Deutsche | USD | 83,239 | GBP | 68,000 | 05-Dec-2016 | (1,723) | - |
| Goldman Sachs | USD | 6,056,994 | GBP | 4,852,000 | 09-Jan-2017 | (12,312) | - |
| Goldman Sachs | INR | 31,488,530 | USD | 465,566 | 17-Jan-2017 | (8,125) | - |
| Morgan Stanley | EUR | 108,000 | USD | 118,223 | 05-Dec-2016 | (3,650) | - |
| Morgan Stanley | BRL | 1,244,022 | USD | 366,088 | 04-Jan-2017 | (1,705) | - |
| Morgan Stanley | EUR | 175,000 | USD | 185,951 | 05-Dec-2016 | (300) | - |
| Royal Bank of Canada | EUR | 265,000 | USD | 290,884 | 05-Dec-2016 | (9,756) | - |
| Standard Chartered | USD | 3,005,189 | CAD | 4,054,000 | 05-Dec-2016 | (11,006) | - |
| State Street | USD | 6,234,097 | GBP | 5,119,000 | 05-Dec-2016 | (161,806) | (0.05) |
| State Street | EUR | 920,000 | USD | 1,008,786 | 05-Dec-2016 | (32,793) | (0.01) |
| State Street | USD | 25,413,474 | EUR | 23,909,000 | 09-Jan-2017 | (1,401) | - |
| UBS | GBP | 168,251,389 | USD | 212,663,530 | 15-Dec-2016 | (2,369,053) | (0.68) |
| UBS | EUR | 17,049,615 | USD | 18,538,404 | 15-Dec-2016 | (440,436) | (0.13) |
| UBS | EUR | 6,174,541 | USD | 6,713,708 | 15-Dec-2016 | (159,505) | (0.05) |
| UBS | USD | 3,969,151 | GBP | 3,197,296 | 15-Dec-2016 | (27,092) | (0.01) |
| UBS | USD | 2,625,133 | GBP | 2,118,615 | 15-Dec-2016 | (22,886) | (0.01) |
| UBS | EUR | 819,025 | USD | 890,544 | 15-Dec-2016 | (21,158) | (0.01) |

先渡為替契約(つづき) : -0.54% (31 May 2016: 0.63%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|---------------|-----|-----------|----------------|---------------------|---------------|
| UBS | IDR | 6,115,165,000 | USD | 461,035 | 17-Jan-2017 | (14,242) | - |
| UBS | USD | 2,801,806 | GBP | 2,252,489 | 15-Dec-2016 | (13,541) | - |
| UBS | USD | 1,484,486 | GBP | 1,196,233 | 15-Dec-2016 | (10,665) | - |
| UBS | GBP | 525,460 | USD | 664,162 | 15-Dec-2016 | (7,399) | - |
| UBS | GBP | 244,578 | USD | 309,137 | 15-Dec-2016 | (3,444) | - |
| UBS | EUR | 71,000 | USD | 78,346 | 05-Dec-2016 | (3,025) | - |
| UBS | GBP | 186,951 | USD | 236,299 | 15-Dec-2016 | (2,632) | - |
| UBS | EUR | 150,000 | USD | 160,855 | 05-Dec-2016 | (1,725) | - |
| UBS | EUR | 33,670 | USD | 37,236 | 15-Dec-2016 | (1,496) | - |
| UBS | GBP | 93,307 | USD | 117,936 | 15-Dec-2016 | (1,314) | - |
| UBS | EUR | 49,036 | USD | 53,318 | 15-Dec-2016 | (1,267) | - |
| UBS | GBP | 88,519 | USD | 111,884 | 15-Dec-2016 | (1,246) | - |
| UBS | EUR | 180,000 | USD | 191,842 | 05-Dec-2016 | (887) | - |
| UBS | USD | 213,897 | GBP | 171,810 | 15-Dec-2016 | (845) | - |
| UBS | USD | 206,725 | EUR | 195,000 | 09-Jan-2017 | (556) | - |
| UBS | GBP | 38,393 | USD | 48,528 | 15-Dec-2016 | (541) | - |
| UBS | EUR | 39,191 | USD | 42,065 | 15-Dec-2016 | (464) | - |
| UBS | GBP | 183,253 | USD | 229,232 | 15-Dec-2016 | (186) | - |
| UBS | USD | 429,486 | EUR | 405,000 | 05-Dec-2016 | (163) | - |
| UBS | USD | 33,794 | EUR | 32,000 | 05-Dec-2016 | (154) | - |
| UBS | USD | 71,402 | EUR | 67,385 | 15-Dec-2016 | (127) | - |
| UBS | USD | 11,984 | GBP | 9,672 | 15-Dec-2016 | (104) | - |
| UBS | EUR | 509 | GBP | 547 | 15-Dec-2016 | (6) | - |
| Societe Generale | USD | 11,271,008 | GBP | 9,217,000 | 02-Dec-2016 | (244,711) | (0.07) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (3,908,353) | (1.10) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (1,956,684) | (0.54) |
| 投資総額 | | | | | | 345,467,513 | 99.68 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 20,247,906 | 5.84 |
| その他の純負債 | | | | | | (19,139,574) | (5.52) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 346,575,845 | 100.00 |

| 総資産の分析 | 総資産 比率(%) |
|---|--------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 89.31 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.58 |
| その他の資産 | 10.11 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるパークレイズ・キャピタル、モルガン・スタンレーおよびソシエテ・ジェネラルにより、それぞれ担保として保有される498,806米ドル、648,362米ドルおよび270,000米ドルならびに先渡契約の担保として保有される現金920,000米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** スティール・プライス（取引が頻繁でなく流動性が低いため長期間変動していない価格）で評価される。

† ファンドの純資産の1.81%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク（「ICB」）は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

[次へ](#)

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|--|------------------|--------------|
| | 債券 : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | オーストラリア : 0.33% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | インデックス連動国債 : 0.33% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 100,000 | Australia Government Bond 1.25% 21/02/2022 | 83,596 | 0.06 |
| 400,000 | Australia Government Bond 3% 20/09/2025 | 412,611 | 0.27 |
| | オーストラリア合計 | 496,207 | 0.33 |
| | ベルギー : 0.00% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| | カナダ : 3.44% (31 May 2016: 1.98%) | | |
| | 社債 : 0.26% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 400,000 | Toronto-Dominion Bank 2.25% 15/03/2021 | 399,408 | 0.26 |
| | インデックス連動国債 : 3.18% (31 May 2016: 1.98%) | | |
| 2,670,000 | Canadian Government Real Return Bond 1.25% 01/12/2047 | 2,618,188 | 1.74 |
| 440,000 | Canadian Government Real Return Bond 1.5% 01/12/2044 | 475,361 | 0.32 |
| 1,200,000 | Canadian Government Real Return Bond 4.25% 01/12/2021 | 1,693,976 | 1.12 |
| | カナダ合計 | 5,186,933 | 3.44 |
| | デンマーク : 2.28% (31 May 2016: 3.18%) | | |
| | 社債 : 0.36% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 1,800,000 | Realkredit Danmark A/S 1% 01/01/2017 | 257,107 | 0.17 |
| 500,000 | Realkredit Danmark A/S 1% 01/04/2017 | 71,626 | 0.05 |
| 1,500,000 | Realkredit Danmark A/S 2% 01/04/2017 | 215,595 | 0.14 |
| | インデックス連動国債 : 1.92% (31 May 2016: 2.70%) | | |
| 18,250,000 | Denmark Government Inflation Linked Bond 0.1% 15/11/2023 | 2,897,956 | 1.92 |
| | デンマーク合計 | 3,442,284 | 2.28 |
| | フランス : 9.31% (31 May 2016: 13.75%) | | |
| | 譲渡性預金 : 0.73% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,100,000 | Natixis SAFRN 25/09/2017 | 1,100,000 | 0.73 |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 1.01%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | フランス(つづき) : 9.31% (31 May 2016: 13.75%) | | |
| | インデックス連動国債 : 8.58% (31 May 2016: 12.74%) | | |
| 1,850,000 | France Government Bond OAT 0.1% 25/07/2021 [†] | 2,122,933 | 1.41 |
| 200,000 | France Government Bond OAT 0.1% 25/07/2047 [†] | 213,841 | 0.14 |
| 3,900,000 | France Government Bond OAT 0.25% 25/07/2018 [†] | 4,456,886 | 2.95 |
| 2,900,000 | France Government Bond OAT 0.7% 25/07/2030 [†] | 3,544,176 | 2.35 |
| 600,000 | France Government Bond OAT 1.1% 25/07/2022 [†] | 782,208 | 0.52 |
| 120,000 | France Government Bond OAT 1.75% 25/05/2066 | 123,585 | 0.08 |
| 1,200,000 | France Government Bond OAT 1.85% 25/07/2027 [†] | 1,711,052 | 1.13 |
| | フランス合計 | 14,054,681 | 9.31 |
| | ドイツ : 2.50% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| | 社債 : 1.07% (31 May 2016: 0.45%) | | |
| 1,000,000 | Deutsche Bank AG 4.25% 14/10/2021 | 985,825 | 0.65 |
| 600,000 | Volkswagen Bank GmbH FRN 27/11/2017 | 635,110 | 0.42 |
| | インデックス連動国債 : 1.43% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 580,000 | Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/04/2026 [†] | 684,992 | 0.46 |
| 600,000 | Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/04/2046 [†] | 778,614 | 0.52 |
| 540,000 | Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.5% 15/04/2030 [†] | 677,053 | 0.45 |
| | ドイツ合計 | 3,761,594 | 2.50 |
| | ガーンジー : 0.00% (31 May 2016: 1.04%) | | |
| | ホールローンCMO : 0.00% (31 May 2016: 1.04%) | | |
| | アイルランド : 0.07% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 社債 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 100,000 | AerCap Ireland Capital Ltd / AerCap Global Aviation Trust 4.625% 30/10/2020 | 104,375 | 0.07 |
| | ホールローンCMO : 0.00% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | アイルランド合計 | 104,375 | 0.07 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | イタリア : 6.79% (31 May 2016: 7.69%) | | |
| | 社債 : 0.20% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 300,000 | Intesa Sanpaolo SpA 2.375% 13/01/2017 | 300,217 | 0.20 |
| | インデックス連動国債 : 6.59% (31 May 2016: 7.49%) | | |
| 1,320,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.1% 15/05/2022 [†] | 1,392,799 | 0.92 |
| 410,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 15/09/2032 [†] | 436,630 | 0.29 |
| 1,130,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 15/09/2019 [†] | 1,428,763 | 0.95 |
| 4,590,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 15/09/2024 [†] | 5,476,742 | 3.62 |
| 890,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.55% 15/09/2041 [†] | 1,220,640 | 0.81 |
| | ホールローンCMO : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| - | Marche Mutui 4 Srl FRN 25/02/2055 | - | - |
| | イタリア合計 | 10,255,791 | 6.79 |
| | 日本 : 8.11% (31 May 2016: 1.95%) | | |
| | インデックス連動国債 : 8.11% (31 May 2016: 1.95%) | | |
| 400,000,000 | 国庫短期証券 0% 10/01/2017 | 3,511,215 | 2.33 |
| 220,000,000 | 国庫短期証券 0% 06/02/2017 | 1,931,590 | 1.28 |
| 150,000,000 | 国庫短期証券 0% 19/12/2016 | 1,316,457 | 0.87 |
| 80,000,000 | 物価連動国債 0.1% 10/03/2024 [†] | 752,322 | 0.50 |
| 210,000,000 | 物価連動国債 0.1% 10/03/2025 [†] | 1,944,383 | 1.29 |
| 300,000,000 | 物価連動国債 0.1% 10/03/2026 [†] | 2,782,162 | 1.84 |
| | 日本合計 | 12,238,129 | 8.11 |
| | ジャージー : 0.14% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 社債 : 0.14% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 200,000 | UBS Group Funding Jersey Ltd FRN 14/04/2021 | 206,964 | 0.14 |
| | ジャージー合計 | 206,964 | 0.14 |
| | ルクセンブルグ : 0.07% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| | 社債 : 0.07% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 100,000 | Actavis Funding SCS 3.8% 15/03/2025 | 100,959 | 0.07 |
| | ルクセンブルグ合計 | 100,959 | 0.07 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | メキシコ : 0.19% (31 May 2016: 1.16%) | | |
| | 国債 : 0.19% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 5,969,000 | Mexican Bonos 4.75% 14/06/2018 | 284,861 | 0.19 |
| | インデックス連動国債 : 0.00% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| | メキシコ合計 | <u>284,861</u> | <u>0.19</u> |
| | オランダ : 0.00% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| | ニュージーランド : 2.59% (31 May 2016: 1.65%) | | |
| | インデックス連動国債 : 2.59% (31 May 2016: 1.65%) | | |
| 3,970,000 | New Zealand Government Bond 2% 20/09/2025 | 2,944,368 | 1.95 |
| 700,000 | New Zealand Government Bond 2.5% 20/09/2035 | 522,036 | 0.35 |
| 600,000 | New Zealand Government Bond 3% 15/04/2020 | 434,468 | 0.29 |
| | ニュージーランド合計 | <u>3,900,872</u> | <u>2.59</u> |
| | スペイン : 1.28% (31 May 2016: 1.21%) | | |
| | インデックス連動国債 : 1.28% (31 May 2016: 1.21%) | | |
| 200,000 | Spain Government Inflation Linked Bond 0.3% 30/11/2021 [†] | 218,164 | 0.13 |
| 930,000 | Spain Government Inflation Linked Bond 0.55% 30/11/2019 [†] | 1,020,078 | 0.68 |
| 600,000 | Spain Government Inflation Linked Bond 1.8% 30/11/2024 [†] | 710,738 | 0.47 |
| | スペイン合計 | <u>1,948,980</u> | <u>1.28</u> |
| | スウェーデン : 0.28% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| | インデックス連動国債 : 0.28% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 500,000 | Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 01/06/2026 [†] | 62,163 | 0.04 |
| 600,000 | Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 01/06/2032 [†] | 73,718 | 0.05 |
| 2,300,000 | Sweden Inflation Linked Bond 0.25% 01/06/2022 [†] | 283,338 | 0.19 |
| | スウェーデン合計 | <u>419,219</u> | <u>0.28</u> |
| | スイス : 0.00% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.59%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|--|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | タイ : 0.00% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| | インデックス連動国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| | 英国 : 27.50% (31 May 2016: 30.99%) | | |
| | 社債 : 0.84% (31 May 2016: 2.43%) | | |
| 500,000 | BG Energy Capital PLC FRN 30/11/2072 | 651,230 | 0.43 |
| 600,000 | Royal Bank of Scotland PLC FRN 16/03/2022 | 612,673 | 0.41 |
| | 国債 : 4.58% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 3,500,000 | United Kingdom Gilt 2% 07/09/2025 | 4,637,460 | 3.07 |
| 1,390,000 | United Kingdom Gilt 3.5% 22/01/2045 | 2,280,763 | 1.51 |
| | インデックス連動国債 : 22.08% (31 May 2016: 27.04%) | | |
| 1,040,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2024 | 1,648,323 | 1.09 |
| 670,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2026 | 1,018,049 | 0.67 |
| 1,710,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2029 | 2,943,454 | 1.95 |
| 2,610,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2044 | 5,421,899 | 3.59 |
| 1,380,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2046 | 2,766,903 | 1.83 |
| 460,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2058 | 1,144,536 | 0.76 |
| 750,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/11/2065 | 2,094,768 | 1.39 |
| 900,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2068 | 2,747,620 | 1.82 |
| 910,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.25% 22/03/2052^^ | 2,227,639 | 1.48 |
| 620,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 22/11/2042 | 1,608,357 | 1.07 |
| 2,020,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.75% 22/03/2034 | 4,159,051 | 2.76 |
| 250,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.75% 22/11/2047^^^ | 740,215 | 0.49 |
| 1,450,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.25% 22/11/2027 | 3,338,109 | 2.21 |
| 350,000 | United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.25% 22/11/2055^^^ | 1,468,888 | 0.97 |
| | ホールローンCMO : 0.00% (31 May 2016: 1.52%) | | |
| - | - Paragon Mortgages No 13 PLC FRN 15/01/2039 | - | - |
| | 英国合計 | 41,509,937 | 27.50 |
| | 米国 : 66.07% (31 May 2016: 60.91%) | | |
| | 社債 : 5.83% (31 May 2016: 4.37%) | | |
| 400,000 | Bank of America Corp 4.125% 22/01/2024 | 417,651 | 0.28 |
| 12,000,000 | Bank of America Corp FRN 21/10/2025 ** | 653,592 | 0.43 |
| 2,300,000 | Bank of America NA FRN 08/05/2017 | 2,302,763 | 1.53 |
| 1,200,000 | Ford Motor Credit Co LLC 6.625% 15/08/2017 | 1,241,689 | 0.82 |
| 400,000 | Goldman Sachs Group Inc 3.5% 23/01/2025 | 398,987 | 0.26 |
| 2,830,000 | JPMorgan Chase & Co FRN 25/04/2018 | 2,837,672 | 1.88 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.07% (31 May 2016: 60.91%) | | |
| | 社債(つづき) : 5.83% (31 May 2016: 4.37%) | | |
| 440,517 | Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16 Class A-4 5.809% 12/12/2049 | 449,715 | 0.30 |
| 406,498 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-6AR Class 1-A-1 FRN 25/11/2035 | 399,230 | 0.26 |
| 100,000 | Synchrony Financial FRN 09/11/2017 | 100,788 | 0.07 |
| | FGLMC 担保証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.68%) | | |
| | FNMA 担保証券 : 8.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,000,000 | Fannie Mae Pool 3% 15/12/2046 | 5,977,032 | 3.96 |
| 6,000,000 | Fannie Mae Pool 3.5% 15/02/2046 | 6,141,798 | 4.07 |
| | インデックス連動国債 : 43.39% (31 May 2016: 49.21%) | | |
| 8,556,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2018 | 8,998,908 | 5.97 |
| 1,230,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2019 | 1,280,734 | 0.85 |
| 5,200,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2020 | 5,410,428 | 3.59 |
| 190,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/01/2022 | 203,212 | 0.13 |
| 980,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/07/2022 | 1,033,180 | 0.68 |
| 1,200,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/01/2023 | 1,248,200 | 0.83 |
| 980,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/01/2025 | 985,319 | 0.65 |
| 100,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/02/2043 | 97,963 | 0.06 |
| 2,170,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1% 15/02/2046 | 2,264,389 | 1.50 |
| 4,130,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.25% 15/07/2020 | 4,825,867 | 3.20 |
| 1,340,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15/07/2018 | 1,554,745 | 1.04 |
| 11,620,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15/02/2044 | 13,348,029 | 8.85 |
| 200,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.625% 15/01/2018 | 236,357 | 0.16 |
| 60,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.75% 15/01/2028 | 77,794 | 0.05 |
| 800,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15/07/2019 | 962,542 | 0.64 |
| 2,170,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15/02/2040 | 3,045,903 | 2.02 |
| 10,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15/02/2041 | 13,944 | 0.01 |
| 8,890,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15/01/2025 | 13,136,615 | 8.71 |
| 1,610,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.5% 15/01/2029 | 2,202,301 | 1.46 |
| 120,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.625% 15/04/2028 | 237,496 | 0.16 |

| | | | |
|--|---|-----------|------|
| 1,790,000 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.875% 15/04/2029 | 3,627,333 | 2.40 |
| 450,000 | United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/02/2046 | 402,917 | 0.27 |
| 270,000 | United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/05/2046 | 241,640 | 0.16 |
| ホーム・エクイティABS : 0.00% (31 May 2016: 0.20%) | | | |
| 地方債 : 0.14% (31 May 2016: 0.09%) | | | |
| 200,000 | Florida Street 5.25% 01/07/2037 | 207,038 | 0.14 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|--------------------|---------------|
| | 債券(つづき) : 130.95% (31 May 2016: 130.26%) | | |
| | 米国(つづき) : 66.07% (31 May 2016: 60.91%) | | |
| | その他資産担保証券 : 3.25% (31 May 2016: 2.60%) | | |
| 196,329 | Bayview Opportunity Master Fund IVb Trust 2016-RN4 FRN 28/10/2031 ** | 196,329 | 0.13 |
| 476,640 | GCAT 2015-3 LLC FRN 25/10/2019 † | 480,125 | 0.33 |
| 927,964 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2005-B Class A-1 FRN 25/07/2030 | 851,914 | 0.56 |
| 196,814 | US Residential Opportunity Fund II Trust 2016-3 FRN 27/10/2036 † | 196,792 | 0.13 |
| 46,874 | VOLT XIX LLC FRN 25/04/2055 † | 47,218 | 0.03 |
| 249,369 | VOLT XL LLC FRN 27/11/2045 | 251,971 | 0.17 |
| 943,854 | VOLT XLII LLC FRN 26/03/2046 † | 953,157 | 0.63 |
| 553,156 | VOLT XXIX LLC FRN 25/10/2054 † | 554,861 | 0.37 |
| 838,981 | VOLT XXV LLC FRN 26/06/2045 | 840,128 | 0.56 |
| 380,893 | VOLT XXX LLC FRN 25/10/2057 | 381,901 | 0.25 |
| 137,842 | VOLT XXXIX LLC FRN 25/10/2045 † | 139,070 | 0.09 |
| | 学生ローン資産担保証券 : 0.38% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 158,683 | Massachusetts Educational Financing Authority FRN 25/04/2038 | 157,036 | 0.10 |
| 400,000 | Navient Student Loan Trust 2016-7 Class A FRN 25/03/2066 † | 404,023 | 0.28 |
| | ホールローンCMO : 5.05% (31 May 2016: 3.69%) | | |
| - | Alternative Loan Trust 6.25% 2006-30T1 Class 1A3 25/11/2036 | - | - |
| 240,890 | Banc of America Commercial Mortgage Trust 2007-1 Class A-1A 5.428% 15/01/2049 | 241,014 | 0.16 |
| 2,601,530 | CDGJ Commercial Mortgage Trust 2014-BXCH FRN 15/12/2027 | 2,610,923 | 1.73 |
| 160,571 | CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-HYB5 Class 2-A-1 FRN 20/04/2035 | 159,856 | 0.11 |
| 2,900,000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SHP2 Class A FRN 15/07/2027 | 2,924,508 | 1.94 |
| 225,024 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP10 Class A-3 5.42% 15/01/2049 | 225,668 | 0.15 |
| - | MRFC Mortgage Pass-Through Trust 2002-TBC2 FRN 15/08/2032 | - | - |
| - | New York Mortgage Trust 2006-1 Class 2-A-3 FRN 25/05/2036 | - | - |
| 227,770 | Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2005-AR5 Class A2 FRN 19/07/2035 | 221,958 | 0.15 |
| 128,587 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2003-AR1 Class A-5 Trust FRN 25/03/2033 | 128,773 | 0.09 |
| - | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR14 Trust FRN 25/11/2036 | - | - |
| 1,148,843 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR15 Class 1-A-1 Trust FRN 25/11/2045 | 1,080,017 | 0.72 |
| | 米国合計 | 99,611,013 | 66.07 |
| | 債券合計 | 197,522,799 | 130.95 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|---|------------------|---------------|
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る未収収益： 0.29% (31 May 2016: 0.46%) | 423,786 | 0.29 |
| 契約数 | 先物契約 ^{***} : 0.08% (31 May 2016: -0.04%) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
| (117) | US Long Bond CBT Future March 2017 | 63,985 | 0.04 |
| (5) | Euro-BTP EUX Future December 2016 | 41,530 | 0.03 |
| (3) | Japan 10 Yr Bond OSE Future December 2016 | 28,961 | 0.02 |
| (226) | US 2 Year Note CBT Future March 2017 | 28,250 | 0.02 |
| (22) | Euro-Bund EUX Future December 2016 | 11,340 | 0.01 |
| (1) | Euro-BUXL 30 Yr Bond EUX Future December 2016 | 5,431 | - |
| 14 | Euro-Bund EUX Future March 2017 | 4,604 | - |
| (37) | 90 Day EuroDollar CME Future December 2016 | 3,529 | - |
| (6) | Long Gilt ICE Future March 2017 | 2,886 | - |
| | 未決済先物契約に係る評価益合計 | 190,516 | 0.12 |
| 161 | US 10 Year Note CBT Future March 2017 | (57,914) | (0.04) |
| | 未決済先物契約に係る評価損合計 | (57,914) | (0.04) |
| | 先物契約合計 | 132,602 | 0.08 |
| | 先渡為替契約 : -0.34% (31 May 2016: 0.96%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------------------------------|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| Bank of America Merill Lynch | USD | 3,673,053 | DKK | 24,300,000 | 03/01/2017 | 201,985 | 0.13 |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 6,671,077 | JPY | 749,388,738 | 06/01/2017 | 80,215 | 0.06 |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 153,780 | DKK | 1,013,100 | 03/04/2017 | 8,410 | 0.02 |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 154,716 | DKK | 1,021,900 | 03/04/2017 | 8,084 | 0.01 |
| Bank of America Merill Lynch | USD | 10,000 | CNH | 69,025 | 06/01/2017 | 42 | - |
| Barclays^ | USD | 3,298,939 | CNH | 22,456,208 | 15/02/2017 | 70,716 | 0.05 |
| Barclays^ | GBP | 367,000 | USD | 455,851 | 02/12/2016 | 2,679 | - |
| BNP Paribas | USD | 25,379,905 | EUR | 23,203,000 | 02/12/2016 | 766,164 | 0.51 |
| BNP Paribas | USD | 477,514 | JPY | 50,000,000 | 06/02/2017 | 37,175 | 0.02 |
| BNP Paribas | USD | 278,290 | DKK | 1,818,000 | 03/01/2017 | 18,603 | 0.01 |
| BNP Paribas | USD | 241,674 | INR | 16,337,162 | 17/01/2017 | 4,340 | - |
| BNP Paribas | GBP | 3,108,000 | USD | 3,881,062 | 02/12/2016 | 2,073 | - |
| Chase Manhattan | USD | 7,146,695 | JPY | 749,388,738 | 02/12/2016 | 569,937 | 0.38 |

先渡為替契約：-0.34% (31 May 2016: 0.96%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| Chase Manhattan | USD | 1,775,082 | MXN | 33,333,000 | 13/02/2017 | 161,182 | 0.11 |
| Chase Manhattan | USD | 4,991,678 | CAD | 6,682,548 | 02/12/2016 | 21,763 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 631,772 | CNH | 4,312,350 | 06/01/2017 | 9,644 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 372,000 | RUB | 23,752,200 | 15/12/2016 | 5,252 | - |
| Chase Manhattan | USD | 152,000 | RUB | 9,749,280 | 15/12/2016 | 1,465 | - |
| Chase Manhattan | USD | 105,000 | INR | 7,181,265 | 17/01/2017 | 676 | - |
| Chase Manhattan | USD | 90,437 | MXN | 1,856,000 | 13/02/2017 | 574 | - |
| Chase Manhattan | DKK | 840,000 | USD | 119,817 | 03/01/2017 | 170 | - |
| Citibank | BRL | 24,500,000 | USD | 5,550,144 | 04/01/2017 | 1,626,084 | 1.09 |
| Citibank | USD | 1,358,791 | JPY | 140,000,000 | 10/01/2017 | 127,279 | 0.08 |
| Citibank | USD | 954,212 | JPY | 100,000,000 | 06/02/2017 | 73,534 | 0.05 |
| Citibank | USD | 572,743 | JPY | 60,000,000 | 06/02/2017 | 44,336 | 0.03 |
| Citibank | USD | 641,456 | EUR | 580,000 | 02/12/2016 | 26,192 | 0.02 |
| Citibank | USD | 4,986,976 | CAD | 6,682,548 | 06/01/2017 | 15,130 | 0.01 |
| Citibank | USD | 95,482 | JPY | 10,000,000 | 06/02/2017 | 7,414 | - |
| Deutsche | USD | 2,569,614 | JPY | 260,000,000 | 10/01/2017 | 282,521 | 0.19 |
| Deutsche | USD | 122,312 | INR | 8,269,881 | 17/01/2017 | 2,173 | - |
| Deutsche | USD | 644,000 | CNH | 4,457,768 | 06/01/2017 | 893 | - |
| Deutsche | USD | 37,850 | INR | 2,558,660 | 17/01/2017 | 680 | - |
| Marine Midland Bank | USD | 1,693,417 | AUD | 2,209,000 | 02/12/2016 | 61,298 | 0.04 |
| Marine Midland Bank | USD | 522,039 | SGD | 737,484 | 17/01/2017 | 7,145 | - |
| Marine Midland Bank | CNH | 741,497 | USD | 106,000 | 15/02/2017 | 595 | - |
| UBS | USD | 1,473,094 | JPY | 150,000,000 | 19/12/2016 | 155,359 | 0.10 |
| UBS | USD | 3,628,087 | NZD | 5,062,000 | 02/12/2016 | 40,142 | 0.03 |
| UBS | GBP | 2,517,000 | USD | 3,125,316 | 02/12/2016 | 19,424 | 0.01 |
| UBS | USD | 2,747,014 | GBP | 2,184,601 | 15/12/2016 | 16,519 | 0.01 |
| UBS | USD | 728,630 | EUR | 678,869 | 15/12/2016 | 8,019 | 0.01 |
| UBS | USD | 223,237 | SEK | 2,000,000 | 02/12/2016 | 6,599 | - |
| UBS | USD | 274,350 | EUR | 252,593 | 15/12/2016 | 6,225 | - |
| UBS | USD | 396,000 | CNH | 2,716,758 | 15/02/2017 | 5,449 | - |
| UBS | USD | 88,809 | EUR | 81,766 | 15/12/2016 | 2,015 | - |
| UBS | USD | 267,022 | GBP | 212,353 | 15/12/2016 | 1,606 | - |
| UBS | GBP | 150,000 | USD | 186,392 | 15/12/2016 | 1,090 | - |
| UBS | GBP | 143,403 | USD | 178,228 | 15/12/2016 | 1,010 | - |
| UBS | USD | 40,849 | EUR | 37,609 | 15/12/2016 | 927 | - |
| UBS | USD | 83,949 | EUR | 78,215 | 15/12/2016 | 924 | - |
| UBS | USD | 25,301 | EUR | 23,295 | 15/12/2016 | 574 | - |
| UBS | USD | 11,501 | EUR | 10,589 | 15/12/2016 | 261 | - |
| UBS | USD | 29,863 | GBP | 23,749 | 15/12/2016 | 180 | - |
| UBS | USD | 28,615 | GBP | 22,757 | 15/12/2016 | 172 | - |
| UBS | USD | 26,883 | GBP | 21,379 | 15/12/2016 | 162 | - |
| UBS | USD | 6,986 | EUR | 6,432 | 15/12/2016 | 159 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.34% (31 May 2016: 0.96%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|--------|-----|---------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | EUR | 35,079 | USD | 37,120 | 15/12/2016 | 116 | - |
| UBS | EUR | 28,372 | USD | 30,023 | 15/12/2016 | 94 | - |
| UBS | GBP | 42,240 | USD | 52,709 | 15/12/2016 | 85 | - |
| UBS | USD | 2,918 | EUR | 2,687 | 15/12/2016 | 66 | - |
| UBS | USD | 83,578 | EUR | 78,675 | 15/12/2016 | 65 | - |
| UBS | USD | 4,433 | EUR | 4,128 | 15/12/2016 | 51 | - |
| UBS | EUR | 98,542 | USD | 104,552 | 15/12/2016 | 50 | - |
| UBS | EUR | 19,746 | USD | 20,910 | 15/12/2016 | 50 | - |
| UBS | USD | 7,925 | GBP | 6,303 | 15/12/2016 | 48 | - |
| UBS | USD | 4,708 | EUR | 4,407 | 15/12/2016 | 30 | - |
| UBS | USD | 949 | EUR | 874 | 15/12/2016 | 22 | - |
| UBS | USD | 1,466 | GBP | 1,165 | 15/12/2016 | 9 | - |
| UBS | USD | 325 | GBP | 258 | 15/12/2016 | 2 | - |

先渡為替契約に係る評価益合計

4,513,927

2.99

| | | | | | | | |
|------------------------|-----|-------------|-----|-------------|------------|-------------|--------|
| Bank of America | | | | | | | |
| Merill Lynch | USD | 3,583,268 | NZD | 5,062,000 | 06/01/2017 | (371) | - |
| Bank of America | | | | | | | |
| Merill Lynch | USD | 3,250,230 | EUR | 3,064,043 | 06/01/2017 | (6,350) | - |
| Bank of America | | | | | | | |
| Merill Lynch | USD | 40,954,427 | GBP | 33,594,343 | 02/12/2016 | (1,018,344) | (0.68) |
| Barclays^ | DKK | 73,716 | USD | 11,000 | 03/01/2017 | (470) | - |
| Barclays^ | COP | 109,927,000 | USD | 37,000 | 24/01/2017 | (1,373) | - |
| BNP Paribas | GBP | 183,000 | USD | 230,818 | 02/12/2016 | (2,178) | - |
| BNP Paribas | USD | 245,724 | COP | 784,106,287 | 24/01/2017 | (8,398) | (0.01) |
| BNP Paribas | USD | 31,796,872 | GBP | 25,428,343 | 06/01/2017 | (9,179) | (0.02) |
| BNP Paribas | EUR | 215,000 | USD | 238,819 | 02/12/2016 | (10,747) | (0.01) |
| BNP Paribas | EUR | 1,537,000 | USD | 1,650,552 | 02/12/2016 | (20,102) | (0.01) |
| BNP Paribas | USD | 15,946,676 | EUR | 15,034,957 | 06/01/2017 | (33,039) | (0.02) |
| Chase Manhattan | RUB | 33,785,970 | USD | 527,000 | 15/12/2016 | (5,325) | - |
| Chase Manhattan | USD | 615,090 | GBP | 499,000 | 02/12/2016 | (8,361) | (0.01) |
| Chase Manhattan | GBP | 2,490,000 | USD | 3,125,438 | 02/12/2016 | (14,432) | (0.01) |
| Chase Manhattan | CNH | 8,839,143 | USD | 1,311,446 | 06/01/2017 | (36,253) | (0.02) |
| Chase Manhattan | USD | 2,987,532 | BRL | 12,700,000 | 04/01/2017 | (732,390) | (0.49) |
| Citibank | EUR | 193,000 | USD | 205,132 | 02/12/2016 | (398) | - |
| Citibank | CNH | 3,468,428 | USD | 501,000 | 15/02/2017 | (2,391) | - |
| Citibank | EUR | 288,000 | USD | 308,356 | 02/12/2016 | (2,846) | - |
| Citibank | DKK | 2,910,000 | USD | 422,490 | 03/01/2017 | (6,819) | - |
| Citibank | EUR | 323,000 | USD | 351,465 | 02/12/2016 | (8,827) | (0.02) |
| Deutsche | USD | 2,798,530 | BRL | 11,800,000 | 04/01/2017 | (657,776) | (0.44) |
| Marine Midland Bank | EUR | 102,000 | USD | 108,363 | 02/12/2016 | (161) | - |
| Marine Midland Bank | CNH | 2,755,000 | USD | 401,503 | 15/02/2017 | (5,454) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.34% (31 May 2016: 0.96%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| Marine Midland Bank | EUR | 2,928,000 | USD | 3,159,350 | 02/12/2016 | (53,328) | (0.04) |
| Marine Midland Bank | MXN | 25,136,753 | USD | 1,312,042 | 13/02/2017 | (94,984) | (0.06) |
| UBS | EUR | 2,820 | USD | 3,027 | 15/12/2016 | (33) | - |
| UBS | GBP | 54,821 | USD | 68,576 | 15/12/2016 | (56) | - |
| UBS | USD | 91,262 | GBP | 73,075 | 15/12/2016 | (74) | - |
| UBS | USD | 11,880 | GBP | 9,588 | 15/12/2016 | (104) | - |
| UBS | GBP | 10,610 | USD | 13,411 | 15/12/2016 | (149) | - |
| UBS | USD | 37,953 | GBP | 30,485 | 15/12/2016 | (150) | - |
| UBS | EUR | 6,119 | USD | 6,663 | 15/12/2016 | (168) | - |
| UBS | USD | 536,585 | EUR | 505,755 | 15/12/2016 | (268) | - |
| UBS | USD | 118,355 | GBP | 94,980 | 15/12/2016 | (359) | - |
| UBS | USD | 36,129 | GBP | 29,338 | 15/12/2016 | (540) | - |
| UBS | GBP | 41,292 | USD | 52,191 | 15/12/2016 | (581) | - |
| UBS | USD | 102,043 | GBP | 82,122 | 15/12/2016 | (600) | - |
| UBS | USD | 129,619 | GBP | 104,413 | 15/12/2016 | (885) | - |
| UBS | EUR | 34,958 | USD | 38,011 | 15/12/2016 | (903) | - |
| UBS | THB | 2,908,206 | USD | 82,461 | 17/01/2017 | (976) | - |
| UBS | USD | 270,402 | GBP | 218,032 | 15/12/2016 | (2,112) | - |
| UBS | USD | 712,248 | GBP | 571,942 | 15/12/2016 | (2,612) | - |
| UBS | EUR | 104,372 | USD | 113,486 | 15/12/2016 | (2,696) | - |
| UBS | GBP | 231,566 | USD | 292,691 | 15/12/2016 | (3,261) | - |
| UBS | EUR | 98,000 | USD | 108,780 | 02/12/2016 | (4,822) | - |
| UBS | EUR | 241,195 | USD | 262,256 | 15/12/2016 | (6,231) | - |
| UBS | USD | 1,345,052 | EUR | 1,276,427 | 15/12/2016 | (9,860) | (0.01) |
| UBS | EUR | 395,848 | USD | 430,414 | 15/12/2016 | (10,226) | (0.01) |
| UBS | GBP | 886,160 | USD | 1,120,074 | 15/12/2016 | (12,477) | (0.01) |
| UBS | GBP | 931,906 | USD | 1,177,895 | 15/12/2016 | (13,122) | (0.01) |
| UBS | GBP | 961,756 | USD | 1,215,624 | 15/12/2016 | (13,542) | (0.01) |
| UBS | USD | 3,818,872 | GBP | 3,070,151 | 15/12/2016 | (18,456) | (0.01) |
| UBS | AUD | 1,018,000 | USD | 771,199 | 02/12/2016 | (19,050) | (0.01) |
| UBS | INR | 74,134,640 | USD | 1,098,193 | 17/01/2017 | (21,223) | (0.01) |
| UBS | EUR | 885,166 | USD | 962,459 | 15/12/2016 | (22,866) | (0.02) |
| UBS | USD | 10,704,335 | GBP | 8,590,263 | 15/12/2016 | (32,485) | (0.02) |
| UBS | EUR | 1,468,733 | USD | 1,596,984 | 15/12/2016 | (37,941) | (0.03) |
| UBS | EUR | 3,162,832 | USD | 3,439,013 | 15/12/2016 | (81,704) | (0.05) |
| UBS | GBP | 9,049,493 | USD | 11,438,224 | 15/12/2016 | (127,421) | (0.08) |
| UBS | USD | 21,064,950 | GBP | 16,974,625 | 15/12/2016 | (151,338) | (0.10) |
| UBS | EUR | 9,659,553 | USD | 10,503,035 | 15/12/2016 | (249,532) | (0.17) |
| UBS | GBP | 100,705,668 | USD | 127,288,238 | 15/12/2016 | (1,417,980) | (0.94) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (5,007,099) | (3.33) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (493,172) | (0.34) |

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 197,586,015 | 130.98 |
| 現金および現金等価物 [*] | 9,853,346 | 6.53 |
| その他の純負債 | (56,588,205) | (37.51) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>150,851,156</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 67.96 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 1.62 |
| その他の資産 | 30.42 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるパークレイズ・キャピタル、バンク・オブ・アメリカ、ドイツ銀行、モルガン・スタンレー、トロント・ドミニオンおよびスタンダード・チャータードにより担保として保有される599,907米ドル、750,000米ドル、420,000米ドル、260,000米ドル、330,000米ドルおよび260,000米ドルならびに先渡契約の担保として供される現金2,884,200米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** スティール・プライス（取引が頻繁でなく流動性が低いため長期間変動していない価格）で評価される。

*** 先物契約の取引相手方は、パークレイズ・キャピタルである。

^ 関係会社。

^^ 受益証券910,000口のうち190,000口が担保として差し入れられている。

^^^ 受益証券250,000口のうち71,000口が担保として差し入れられている。

^^^^ 受益証券350,000口のうち71,000口が担保として差し入れられている。

† ファンドの純資産の25.5%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク（「ICB」）は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券 : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | アンゴラ : 0.65% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| | 国債 : 0.65% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 1,980,000 | Angolan Government International Bond 9.5% 12/11/2025 | 1,846,548 | 0.65 |
| | アンゴラ合計 | 1,846,548 | 0.65 |
| | アルゼンチン : 5.84% (31 May 2016: 5.73%) | | |
| | 社債 : 0.31% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 840,000 | YPF SA 8.75% 04/04/2024 | 871,500 | 0.31 |
| | 国債 : 4.25% (31 May 2016: 5.35%) | | |
| 1,700,000 | Argentina Bonar Bonds 7% 17/04/2017 | 1,741,801 | 0.61 |
| 25,000 | Argentina Bonar Bonds 8.75% 07/05/2024 | 28,285 | 0.01 |
| 275,000 | Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/04/2019 | 288,475 | 0.10 |
| 100,000 | Argentine Republic Government International Bond 6.625% 06/07/2028 [†] | 93,250 | 0.03 |
| 1,770,000 | Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/04/2021 | 1,849,650 | 0.65 |
| 3,670,000 | Argentine Republic Government International Bond 7.5% 22/04/2026 | 3,715,875 | 1.30 |
| 215,000 | Argentine Republic Government International Bond 7.625% 22/04/2046 | 205,325 | 0.07 |
| 460,995 | Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033 | 483,399 | 0.17 |
| 1,999,306 | Argentine Republic Government International Bond 8.28% 31/12/2033 - Berlin | 2,054,287 | 0.72 |
| 529,970 | Argentine Republic Government International Bond 8.28% 31/12/2033 - MAE | 528,645 | 0.19 |
| 1,901,000 | Argentine Republic Government International Bond FRN 31/12/2038 | 1,140,600 | 0.40 |
| | 地方債 : 0.45% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 621,000 | City of Buenos Aires Argentina 7.5% 01/06/2027 | 622,553 | 0.22 |
| 590,000 | City of Buenos Aires Argentina 8.95% 19/02/2021 | 647,525 | 0.23 |
| | 州債 : 0.83% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 220,000 | Province of Salta Argentina 9.125% 07/07/2024 | 224,950 | 0.08 |
| 440,000 | Provincia de Buenos Aires 7.875% 15/06/2027 | 432,300 | 0.15 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | アルゼンチン(つづき) : 5.84% (31 May 2016: 5.73%) | | |
| | 州債(つづき) : 0.83% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 401,000 | Provincia de Buenos Aires/Argentina 9.125% 16/03/2024 | 425,060 | 0.15 |
| 445,000 | Provincia de Buenos Aires/Argentina 9.95% 09/06/2021 | 491,725 | 0.18 |
| 345,000 | Provincia de Cordoba 7.125% 10/06/2021 | 347,588 | 0.12 |
| 450,000 | Provincia del Chubut Argentina 7.75% 26/07/2026 | 433,125 | 0.15 |
| | アルゼンチン合計 | 16,625,918 | 5.84 |
| | アルメニア : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 125,000 | Republic of Armenia International Bond 7.15% 26/03/2025 | 128,488 | 0.05 |
| | アルメニア合計 | 128,488 | 0.05 |
| | アゼルバイジャン : 1.48% (31 May 2016: 1.22%) | | |
| | 社債 : 0.25% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 660,000 | Southern Gas Corridor CJSC 6.875% 24/03/2026 | 702,900 | 0.25 |
| | 国債 : 1.23% (31 May 2016: 1.00%) | | |
| 1,840,000 | Republic of Azerbaijan International Bond 4.75% 18/03/2024 | 1,825,906 | 0.64 |
| 1,680,000 | Republic of Azerbaijan International Bond 4.75% 18/03/2024 - Ireland | 1,667,131 | 0.59 |
| | アゼルバイジャン合計 | 4,195,937 | 1.48 |
| | バーレーン : 0.32% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.32% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 430,000 | Bahrain Government International Bond 5.875% 26/01/2021 | 448,509 | 0.16 |
| 450,000 | Bahrain Government International Bond 7% 12/10/2028 | 455,013 | 0.16 |
| | バーレーン合計 | 903,522 | 0.32 |
| | ベラルーシ : 0.13% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| | 国債 : 0.13% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 355,000 | Belarus International Bond 8.95% 26/01/2018 | 372,195 | 0.13 |
| | ベラルーシ合計 | 372,195 | 0.13 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ペリーズ : 0.05% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 国債 : 0.05% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 343,000 | Belize Government International Bond FRN 20/02/2038 | 133,770 | 0.05 |
| | ペリーズ合計 | 133,770 | 0.05 |
| | バミューダ : 0.08% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.08% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 240,000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd 4% 15/08/2026 [†] | 223,800 | 0.08 |
| | バミューダ合計 | 223,800 | 0.08 |
| | ブラジル : 2.00% (31 May 2016: 1.51%) | | |
| | 社債 : 0.16% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 455,000 | Centrais Eletricas Brasileiras SA 5.75% 27/10/2021 | 450,450 | 0.16 |
| | 国債 : 1.84% (31 May 2016: 1.34%) | | |
| 48,400 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series B 6% 15/08/2050 | 408,644 | 0.14 |
| 405,000 | Brazilian Government International Bond 2.625% 05/01/2023 | 360,450 | 0.13 |
| 140,000 | Brazilian Government International Bond 4.25% 07/01/2025 | 131,775 | 0.05 |
| 545,000 | Brazilian Government International Bond 5% 27/01/2045 | 434,910 | 0.15 |
| 235,000 | Brazilian Government International Bond 5.625% 21/02/2047 | 203,863 | 0.07 |
| 2,275,000 | Brazilian Government International Bond 6% 07/04/2026 | 2,384,200 | 0.84 |
| 307,000 | Brazilian Government International Bond 7.125% 20/01/2037 | 322,350 | 0.11 |
| 855,000 | Brazilian Government International Bond 8.25% 20/01/2034 | 999,837 | 0.35 |
| | ブラジル合計 | 5,696,479 | 2.00 |
| | ブルガリア : 1.20% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| | 社債 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 175,000 | Bulgarian Energy Holding EAD 4.875% 02/08/2021 | 191,335 | 0.07 |
| | 国債 : 1.13% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| 650,000 | Bulgaria Government International Bond 1.875% 21/03/2023 | 707,878 | 0.25 |
| 400,000 | Bulgaria Government International Bond 2.95% 03/09/2024 | 456,630 | 0.16 |
| 500,000 | Bulgaria Government International Bond 3% 21/03/2028 | 557,098 | 0.20 |
| 1,440,000 | Bulgaria Government International Bond 3.125% 26/03/2035 | 1,489,087 | 0.52 |
| | ブルガリア合計 | 3,402,028 | 1.20 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | カメルーン : 0.38% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 国債 : 0.38% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 1,036,000 | Republic of Cameroon International Bond 9.5% 19/11/2025 | 1,087,562 | 0.38 |
| | カメルーン合計 | 1,087,562 | 0.38 |
| | ケイマン諸島 : 0.58% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| | 社債 : 0.21% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 220,000 | Comcel Trust via Comunicaciones Celulares SA 6.875% 06/02/2024 | 220,550 | 0.08 |
| 400,000 | Lamar Funding Ltd 3.958% 07/05/2025 | 370,750 | 0.13 |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| | 地方債 : 0.37% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,115,000 | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 5.333% 15/02/2028 [†] | 1,048,100 | 0.37 |
| | ケイマン諸島合計 | 1,639,400 | 0.58 |
| | チリ : 0.00% (31 May 2016: 0.86%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.86%) | | |
| | コロンビア : 2.58% (31 May 2016: 1.76%) | | |
| | 社債 : 0.34% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 740,000 | Ecopetrol SA 5.875% 18/09/2023 | 766,640 | 0.27 |
| 200,000 | Transportadora de Gas Internacional SA ESP 5.70% 20/03/2022 | 205,000 | 0.07 |
| | 国債 : 2.24% (31 May 2016: 1.76%) | | |
| 370,000 | Colombia Government International Bond 2.625% 15/03/2023 | 345,950 | 0.12 |
| 1,050,000 | Colombia Government International Bond 4% 26/02/2024 | 1,047,375 | 0.37 |
| 406,000 | Colombia Government International Bond 4% 26/02/2024 - Luxembourg | 404,985 | 0.14 |
| 440,000 | Colombia Government International Bond 4.5% 28/01/2026 | 450,450 | 0.16 |
| 500,000 | Colombia Government International Bond 5% 15/06/2045 | 463,750 | 0.16 |
| 690,000 | Colombia Government International Bond 5.625% 26/02/2044 | 691,725 | 0.24 |
| 803,000 | Colombia Government International Bond 6.125% 18/01/2041 | 847,165 | 0.30 |
| 635,000 | Colombia Government International Bond 7.375% 18/09/2037 | 757,238 | 0.27 |
| 809,000,000 | Colombia Government International Bond 7.75% 14/04/2021 | 277,228 | 0.10 |
| 750,000 | Colombia Government International Bond 10.375% 28/01/2033 | 1,092,188 | 0.38 |
| | コロンビア合計 | 7,349,694 | 2.58 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | コスタリカ : 0.47% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| | 社債 : 0.18% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 160,000 | Banco Nacional de Costa Rica 5.875% 25/04/2021 | 160,320 | 0.06 |
| 325,000 | Instituto Costarricense de Electricidad 6.95% 10/11/2021 [†] | 337,633 | 0.12 |
| | 国債 : 0.29% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 280,000 | Costa Rica Government International Bond 4.375% 30/04/2025 | 249,082 | 0.09 |
| 280,000 | Costa Rica Government International Bond 7% 04/04/2044 | 258,810 | 0.09 |
| 340,000 | Costa Rica Government International Bond 7.158% 12/03/2045 | 317,254 | 0.11 |
| | コスタリカ合計 | 1,323,099 | 0.47 |
| | クロアチア : 1.24% (31 May 2016: 1.39%) | | |
| | 国債 : 1.24% (31 May 2016: 1.39%) | | |
| 285,000 | Croatia Government International Bond 3% 11/03/2025 | 302,174 | 0.11 |
| 1,130,000 | Croatia Government International Bond 5.5% 04/04/2023 | 1,191,331 | 0.42 |
| 200,000 | Croatia Government International Bond 6% 26/01/2024 | 216,904 | 0.08 |
| 1,175,000 | Croatia Government International Bond 6.375% 24/03/2021 | 1,280,750 | 0.45 |
| 480,000 | Croatia Government International Bond 6.75% 05/11/2019 | 521,510 | 0.18 |
| | クロアチア合計 | 3,512,669 | 1.24 |
| | ドミニカ共和国 : 4.17% (31 May 2016: 5.55%) | | |
| | 国債 : 4.17% (31 May 2016: 5.55%) | | |
| 1,400,000 | Dominican Republic International Bond 5.5% 27/01/2025 | 1,350,776 | 0.48 |
| 1,847,000 | Dominican Republic International Bond 5.875% 18/04/2024 | 1,851,137 | 0.65 |
| 630,000 | Dominican Republic International Bond 6.6% 28/01/2024 | 661,500 | 0.23 |
| 1,140,000 | Dominican Republic International Bond 6.85% 27/01/2045 | 1,088,700 | 0.38 |
| 1,707,000 | Dominican Republic International Bond 6.875% 29/01/2026 | 1,772,412 | 0.62 |
| 1,235,000 | Dominican Republic International Bond 7.45% 30/04/2044 | 1,253,525 | 0.44 |
| 3,445,000 | Dominican Republic International Bond 7.5% 06/05/2021 | 3,743,682 | 1.32 |
| 139,354 | Dominican Republic International Bond 9.04% 23/01/2018 | 144,707 | 0.05 |
| | ドミニカ共和国合計 | 11,866,439 | 4.17 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | エクアドル : 1.47% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| | 国債 : 1.47% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 990,000 | Ecuador Government International Bond 7.95% 20/06/2024 | 915,750 | 0.32 |
| 275,000 | Ecuador Government International Bond 10.5% 24/03/2020 | 288,750 | 0.10 |
| 2,830,000 | Ecuador Government International Bond 10.75% 28/03/2022 | 2,978,575 | 1.05 |
| | エクアドル合計 | 4,183,075 | 1.47 |
| | エジプト : 0.28% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 国債 : 0.28% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 865,000 | Egypt Government International Bond 5.875% 11/06/2025 [†] | 795,800 | 0.28 |
| | エジプト合計 | 795,800 | 0.28 |
| | エルサルバドル : 1.46% (31 May 2016: 1.06%) | | |
| | 国債 : 1.46% (31 May 2016: 1.06%) | | |
| 1,326,000 | El Salvador Government International Bond 5.875% 30/01/2025 | 1,166,880 | 0.41 |
| 54,000 | El Salvador Government International Bond 6.375% 18/01/2027 - Luxembourg | 47,655 | 0.02 |
| 1,150,000 | El Salvador Government International Bond 6.375% 18/01/2027 - United States of America | 1,014,875 | 0.36 |
| 20,000 | El Salvador Government International Bond 8.25% 10/04/2032 | 19,100 | 0.01 |
| 190,000 | El Salvador Government International Bond 7.625% 21/09/2034 | 189,525 | 0.07 |
| 260,000 | El Salvador Government International Bond 7.625% 01/02/2041 - Germany | 222,261 | 0.08 |
| 30,000 | El Salvador Government International Bond 7.625% 01/02/2041 - Luxembourg | 25,646 | 0.01 |
| 15,000 | El Salvador Government International Bond 7.65% 15/06/2035 | 13,010 | - |
| 1,422,000 | El Salvador Government International Bond 7.75% 24/01/2023 | 1,418,446 | 0.50 |
| | エルサルバドル合計 | 4,117,398 | 1.46 |
| | エチオピア : 1.46% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 1.46% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 325,000 | Ethiopia International Bond 6.625% 11/12/2024 [†] | 290,401 | 0.10 |
| | エチオピア合計 | 290,401 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ガボン : 0.24% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| | 国債 : 0.24% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 785,000 | Gabon Government International Bond 6.375% 12/12/2024 | 690,364 | 0.24 |
| | ガボン合計 | 690,364 | 0.24 |
| | ジョージア : 0.20% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 社債 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 200,000 | BGEO Group JSC 6% 26/07/2023 | 199,380 | 0.07 |
| | 国債 : 0.13% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 350,000 | Georgia Government International Bond 6.875% 12/04/2021 | 379,776 | 0.13 |
| | ジョージア合計 | 579,156 | 0.20 |
| | ガーナ : 1.11% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| | 国債 : 1.11% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| 640,000 | Ghana Government International Bond 7.875% 07/08/2023 | 594,374 | 0.21 |
| 675,000 | Ghana Government International Bond 8.125% 18/01/2026 | 626,093 | 0.22 |
| 410,000 | Ghana Government International Bond 9.25% 15/09/2022 | 418,454 | 0.15 |
| 1,350,000 | Ghana Government International Bond 10.75% 14/10/2030 | 1,520,573 | 0.53 |
| | ガーナ合計 | 3,159,494 | 1.11 |
| | グアテマラ : 0.17% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| | 国債 : 0.17% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 235,000 | Guatemala Government Bond 4.5% 03/05/2026 [†] | 220,510 | 0.08 |
| 275,000 | Guatemala Government Bond 4.875% 13/02/2028 | 262,064 | 0.09 |
| | グアテマラ合計 | 482,574 | 0.17 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ホンジュラス : 0.11% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 国債 : 0.11% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 295,000 | Honduras Government International Bond 7.5% 15/03/2024 | 308,275 | 0.11 |
| | ホンジュラス合計 | 308,275 | 0.11 |
| | ハンガリー : 6.44% (31 May 2016: 7.06%) | | |
| | 国債 : 6.44% (31 May 2016: 7.06%) | | |
| 1,938,000 | Hungary Government International Bond 5.375% 21/02/2023 | 2,112,302 | 0.74 |
| 644,000 | Hungary Government International Bond 5.375% 21/02/2023 - England | 701,921 | 0.25 |
| 426,000 | Hungary Government International Bond 5.375% 21/02/2023 - Germany | 464,314 | 0.16 |
| 1,662,000 | Hungary Government International Bond 5.75% 22/11/2023 - England | 1,857,743 | 0.65 |
| 84,000 | Hungary Government International Bond 5.75% 22/11/2023 - Germany | 93,893 | 0.03 |
| 2,645,000 | Hungary Government International Bond 6.25% 29/01/2020 | 2,908,918 | 1.02 |
| 1,792,000 | Hungary Government International Bond 6.375% 29/03/2021 - England | 2,017,267 | 0.71 |
| 6,222,000 | Hungary Government International Bond 6.375% 29/03/2021 - United States of America | 7,004,149 | 2.46 |
| 1,090,000 | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.25% 21/10/2020 [†] | 1,207,039 | 0.42 |
| | ハンガリー合計 | 18,367,546 | 6.44 |
| | アイスランド : 0.36% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| | 国債 : 0.36% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| 892,000 | Iceland Government International Bond 5.875% 11/05/2022 | 1,023,557 | 0.36 |
| | アイスランド合計 | 1,023,557 | 0.36 |
| | インド : 0.08% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.08% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 215,000 | Export-Import Bank of India 4% 14/01/2023 | 219,599 | 0.08 |
| | インド合計 | 219,599 | 0.08 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | インドネシア : 3.83% (31 May 2016: 4.27%) | | |
| | 社債 : 0.54% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 120,000 | Pertamina Persero PT 4.3% 20/05/2023 - Germany [†] | 120,918 | 0.04 |
| 385,000 | Pertamina Persero PT 4.3% 20/05/2023 - Singapore | 387,945 | 0.14 |
| 420,000 | Pertamina Persero PT 5.25% 23/05/2021 | 442,603 | 0.16 |
| 295,000 | Pertamina Persero PT 5.625% 20/05/2043 | 279,543 | 0.10 |
| 270,000 | Pertamina Persero PT 6.45% 30/05/2044 | 279,500 | 0.10 |
| | 国債 : 3.29% (31 May 2016: 3.88%) | | |
| 1,845,000 | Indonesia Government International Bond 2.875% 08/07/2021 | 2,046,237 | 0.72 |
| 1,305,000 | Indonesia Government International Bond 3.75% 14/06/2028 | 1,416,686 | 0.50 |
| 410,000 | Indonesia Government International Bond 3.75% 25/04/2022 | 413,166 | 0.14 |
| 285,000 | Indonesia Government International Bond 4.125% 15/01/2025 [†] | 288,690 | 0.10 |
| 770,000 | Indonesia Government International Bond 4.75% 08/01/2026 | 811,969 | 0.29 |
| 205,000 | Indonesia Government International Bond 4.875% 05/05/2021 | 218,339 | 0.07 |
| 260,000 | Indonesia Government International Bond 5.25% 17/01/2042 | 270,157 | 0.09 |
| 690,000 | Indonesia Government International Bond 5.375% 17/10/2023 | 758,390 | 0.27 |
| 395,000 | Indonesia Government International Bond 5.875% 13/03/2020 | 433,039 | 0.15 |
| 1,255,000 | Indonesia Government International Bond 5.875% 15/01/2024 | 1,413,638 | 0.49 |
| 19,000 | Indonesia Government International Bond 6.625% 17/02/2037 | 22,847 | 0.01 |
| 155,000 | Indonesia Government International Bond 7.75% 17/01/2038 | 206,170 | 0.07 |
| 747,000 | Indonesia Government International Bond 8.5% 12/10/2035 | 1,047,673 | 0.37 |
| 50,000 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.55% 29/03/2026 | 50,750 | 0.02 |
| | インドネシア合計 | 10,908,260 | 3.83 |
| | イラク : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 505,000 | Iraq International Bond 5.8% 15/01/2028 | 402,738 | 0.14 |
| | イラク合計 | 402,738 | 0.14 |
| | イスラエル : 0.44% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | 社債 : 0.27% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 745,000 | Israel Electric Corp Ltd 5% 12/11/2024 | 767,141 | 0.27 |
| | 国債 : 0.17% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 490,000 | Israel Government International Bond 4.5% 30/01/2043 | 493,891 | 0.17 |
| | イスラエル合計 | 1,261,032 | 0.44 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | コートジボワール : 3.40% (31 May 2016: 2.80%) | | |
| | 国債 : 3.40% (31 May 2016: 2.80%) | | |
| 4,055,000 | Ivory Coast Government International Bond 5.375% 23/07/2024 | 3,904,316 | 1.37 |
| 305,000 | Ivory Coast Government International Bond 6.375% 03/03/2028 | 297,064 | 0.10 |
| 5,933,070 | Ivory Coast Government International Bond FRN 31/12/2032 | 5,495,655 | 1.93 |
| | コートジボワール合計 | 9,697,035 | 3.40 |
| | ジャマイカ : 0.78% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| | 国債 : 0.78% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| 855,000 | Jamaica Government International Bond 6.75% 28/04/2028 | 912,713 | 0.32 |
| 705,000 | Jamaica Government International Bond 7.625% 09/07/2025 | 790,354 | 0.28 |
| 270,000 | Jamaica Government International Bond 7.875% 28/07/2045 | 286,284 | 0.10 |
| 215,000 | Jamaica Government International Bond 8% 15/03/2039 | 234,845 | 0.08 |
| | ジャマイカ合計 | 2,224,196 | 0.78 |
| | ヨルダン : 0.26% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 国債 : 0.26% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 320,000 | Jordan Government International Bond 6.125% 29/01/2026 | 324,877 | 0.11 |
| 440,000 | Jordan Government International Bond 5.75% 31/01/2027 | 414,973 | 0.15 |
| | ヨルダン合計 | 739,850 | 0.26 |
| | カザフスタン : 1.55% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| | 国債 : 1.55% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| 900,000 | Development Bank of Kazakhstan JSC 4.125% 10/12/2022 | 855,234 | 0.30 |
| 290,000 | KazAgro National Management Holding JSC 4.625% 24/05/2023 | 262,697 | 0.09 |
| 770,000 | Kazakhstan Government International Bond 4.875% 14/10/2044 | 710,100 | 0.25 |
| 1,205,000 | Kazakhstan Government International Bond 5.125% 21/07/2025 | 1,279,252 | 0.45 |
| 200,000 | KazMunayGas National Co JSC 6.375% 09/04/2021 | 213,062 | 0.07 |
| 1,020,000 | KazMunayGas National Co JSC 7% 05/05/2020 | 1,105,011 | 0.39 |
| | カザフスタン合計 | 4,425,356 | 1.55 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ケニア : 0.38% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| | 国債 : 0.38% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| 1,125,000 | Kenya Government International Bond 6.875% 24/06/2024 | 1,074,094 | 0.38 |
| | ケニア合計 | 1,074,094 | 0.38 |
| | レバノン : 1.33% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 1.33% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,215,000 | Lebanon Government International Bond 5.15% 12/11/2018 | 1,197,310 | 0.42 |
| 755,000 | Lebanon Government International Bond 5.45% 28/11/2019 | 739,424 | 0.26 |
| 550,000 | Lebanon Government International Bond 6% 27/01/2023 | 521,538 | 0.18 |
| 240,000 | Lebanon Government International Bond 6.1% 04/10/2022 | 230,189 | 0.08 |
| 680,000 | Lebanon Government International Bond 6.6% 27/11/2026 | 633,923 | 0.22 |
| 485,000 | Lebanon Government International Bond 6.65% 03/11/2028 | 448,368 | 0.16 |
| 40,000 | Lebanon Government International Bond 8.25% 12/04/2021 | 42,100 | 0.01 |
| | レバノン合計 | 3,812,852 | 1.33 |
| | リトアニア : 0.66% (31 May 2016: 1.97%) | | |
| | 国債 : 0.66% (31 May 2016: 1.97%) | | |
| 1,645,000 | Lithuania Government International Bond 7.375% 11/02/2020 | 1,885,993 | 0.66 |
| | リトアニア合計 | 1,885,993 | 0.66 |
| | ルクセンブルグ : 0.96% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| | 社債 : 0.96% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 380,000 | Gazprom Neft OAO Via GPN Capital SA 6% 27/11/2023 - Ireland | 399,068 | 0.14 |
| 30,000 | Gazprom Neft OAO Via GPN Capital SA 6% 27/11/2023 - Germany | 31,505 | 0.01 |
| 1,155,000 | Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 9.25% 23/04/2019 - Luxembourg | 1,302,133 | 0.46 |
| 405,000 | Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 9.25% 23/04/2019 - Germany | 456,592 | 0.16 |
| 250,000 | Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 5.999% 23/01/2021 | 266,121 | 0.09 |
| 305,000 | Minerva Luxembourg SA 6.50% 20/09/2026 [†] | 287,844 | 0.10 |
| | ルクセンブルグ合計 | 2,743,263 | 0.96 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | メキシコ : 2.43% (31 May 2016: 5.98%) | | |
| | 社債 : 1.45% (31 May 2016: 4.53%) | | |
| 170,000 | Banco Nacional de Comercio Exterior SNC 3.8% 11/08/2026 [†] | 158,908 | 0.06 |
| 210,000 | Cemex SAB de CV 7.25% 15/01/2021 [†] | 225,225 | 0.08 |
| 130,000 | Comision Federal de Electricidad 4.75% 23/02/2027 | 121,225 | 0.04 |
| 240,000 | Mexichem SAB de CV 5.875% 17/09/2044 [†] | 208,800 | 0.07 |
| 110,000 | Petroleos Mexicanos 4.5% 23/01/2026 | 97,812 | 0.03 |
| 90,000 | Petroleos Mexicanos 5.625% 23/01/2046 | 70,295 | 0.02 |
| 3,504,000 | Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047 [†] | 3,082,189 | 1.08 |
| 210,000 | Petroleos Mexicanos FRN 18/07/2018 | 211,785 | 0.07 |
| | 国債 : 0.98% (31 May 2016: 1.45%) | | |
| 255,000 | Mexico Government International Bond 3% 06/03/2045 | 232,541 | 0.08 |
| 310,000 | Mexico Government International Bond 3.375% 23/02/2031 | 330,223 | 0.12 |
| 1,005,000 | Mexico Government International Bond 3.6% 30/01/2025 | 965,805 | 0.34 |
| 400,000 | Mexico Government International Bond 4.35% 15/01/2047 | 334,000 | 0.12 |
| 560,000 | Mexico Government International Bond 4.6% 23/01/2046 | 487,900 | 0.17 |
| 246,000 | Mexico Government International Bond 4.75% 08/03/2044 | 218,940 | 0.08 |
| 206,000 | Mexico Government International Bond 5.75% 12/10/2110 | 185,915 | 0.07 |
| | メキシコ合計 | 6,931,563 | 2.43 |
| | モンゴル : 0.96% (31 May 2016: 0.66%) | | |
| | 国債 : 0.96% (31 May 2016: 0.66%) | | |
| 920,000 | Mongolia Government International Bond 4.125% 05/01/2018 | 862,500 | 0.30 |
| 705,000 | Mongolia Government International Bond 5.125% 05/12/2022 | 578,135 | 0.20 |
| 1,310,000 | Mongolia Government International Bond 10.875% 06/04/2021 [†] | 1,321,839 | 0.46 |
| | モンゴル合計 | 2,762,474 | 0.96 |
| | モロッコ : 1.48% (31 May 2016: 2.01%) | | |
| | 社債 : 0.76% (31 May 2016: 0.90%) | | |
| 630,000 | OCP SA 4.5% 22/10/2025 | 598,816 | 0.21 |
| 400,000 | OCP SA 5.625% 25/04/2024 | 413,556 | 0.15 |
| 1,155,000 | OCP SA 6.875% 25/04/2044 | 1,145,187 | 0.40 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | モロッコ(つづき) : 1.48% (31 May 2016: 2.01%) | | |
| | 国債 : 0.72% (31 May 2016: 1.11%) | | |
| 1,260,000 | Morocco Government International Bond 3.5% 19/06/2024 | 1,392,365 | 0.49 |
| 375,000 | Morocco Government International Bond 4.25% 11/12/2022 | 380,970 | 0.13 |
| 285,000 | Morocco Government International Bond 5.5% 11/12/2042 | 290,277 | 0.10 |
| | モロッコ合計 | 4,221,171 | 1.48 |
| | モザンビーク : 0.18% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.18% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 807,000 | Mozambique International Bond 10.5% 18/01/2023 | 522,767 | 0.18 |
| | モザンビーク合計 | 522,767 | 0.18 |
| | ナミビア : 0.05% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 国債 : 0.05% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 130,000 | Namibia International Bonds 5.25% 29/10/2025 | 128,190 | 0.05 |
| | ナミビア合計 | 128,190 | 0.05 |
| | オランダ : 2.30% (31 May 2016: 1.39%) | | |
| | 社債 : 2.26% (31 May 2016: 1.33%) | | |
| 200,000 | GTH Finance BV 7.25% 26/04/2023 | 213,184 | 0.07 |
| 495,000 | Lukoil International Finance BV 4.75% 02/11/2026 | 487,982 | 0.17 |
| 120,000 | Majapahit Holding BV 7.75% 20/01/2020 | 135,863 | 0.05 |
| 135,000 | Majapahit Holding BV 7.875% 29/06/2037 | 164,363 | 0.05 |
| 430,000 | Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/01/2021 | 419,680 | 0.15 |
| 335,000 | Petrobras Global Finance BV 5.75% 20/01/2020 | 336,675 | 0.12 |
| 850,000 | Petrobras Global Finance BV 6.25% 17/03/2024 | 818,125 | 0.29 |
| 655,000 | Petrobras Global Finance BV 6.75% 27/01/2041 | 539,360 | 0.19 |
| 135,000 | Petrobras Global Finance BV 6.875% 20/01/2040 | 112,894 | 0.04 |
| 2,565,000 | Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/05/2021 | 2,757,375 | 0.97 |
| 215,000 | Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026 | 231,233 | 0.08 |
| 215,000 | VTR Finance BV 6.875% 15/01/2024 | 218,763 | 0.08 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | オランダ(つづき) : 2.30% (31 May 2016: 1.39%) | | |
| | 国債 : 0.04% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 113,438 | Republic of Angola Via Northern Lights III BV 7% 16/08/2019 | 113,605 | 0.04 |
| | オランダ合計 | 6,549,102 | 2.30 |
| | ナイジェリア : 0.37% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| | 国債 : 0.37% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 470,000 | Nigeria Government International Bond 5.125% 12/07/2018 | 470,508 | 0.17 |
| 350,000 | Nigeria Government International Bond 6.375% 12/07/2023 | 326,459 | 0.11 |
| 275,000 | Nigeria Government International Bond 6.75% 28/01/2021 | 268,546 | 0.09 |
| | ナイジェリア合計 | 1,065,513 | 0.37 |
| | オマーン : 1.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 1.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,260,000 | Oman Government International Bond 3.625% 15/06/2021 | 2,262,497 | 0.79 |
| 640,000 | Oman Government International Bond 4.75% 15/06/2026 | 621,048 | 0.22 |
| | オマーン合計 | 2,883,545 | 1.01 |
| | パキスタン : 0.73% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| | 国債 : 0.73% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| 535,000 | Pakistan Government International Bond 7.25% 15/04/2019 | 562,100 | 0.20 |
| 1,385,000 | Pakistan Government International Bond 8.25% 15/04/2024 | 1,504,398 | 0.53 |
| | パキスタン合計 | 2,066,498 | 0.73 |
| | パナマ : 2.29% (31 May 2016: 2.12%) | | |
| | 国債 : 2.29% (31 May 2016: 2.12%) | | |
| 645,000 | Panama Government International Bond 3.75% 16/03/2025 | 645,806 | 0.23 |
| 90,000 | Panama Government International Bond 3.875% 17/03/2028 | 88,650 | 0.03 |
| 405,000 | Panama Government International Bond 4% 22/09/2024 | 415,631 | 0.15 |
| 400,000 | Panama Government International Bond 6.7% 26/01/2036 | 493,000 | 0.17 |
| 123,000 | Panama Government International Bond 7.125% 29/01/2026 | 153,596 | 0.05 |
| 1,630,000 | Panama Government International Bond 8.875% 30/09/2027 | 2,253,474 | 0.79 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | パナマ(つづき) : 2.29% (31 May 2016: 2.12%) | | |
| | 国債(つづき) : 2.29% (31 May 2016: 2.12%) | | |
| 1,644,000 | Panama Government International Bond 9.375% 01/04/2029 - Germany | 2,340,645 | 0.82 |
| 103,000 | Panama Government International Bond 9.375% 01/04/2029 - Luxembourg | 146,646 | 0.05 |
| | パナマ合計 | 6,537,448 | 2.29 |
| | パラグアイ : 0.73% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| | 国債 : 0.73% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 605,000 | Paraguay Government International Bond 4.625% 25/01/2023 | 605,369 | 0.21 |
| 350,000 | Paraguay Government International Bond 5% 15/04/2026 [†] | 350,875 | 0.12 |
| 1,135,000 | Paraguay Government International Bond 6.1% 11/08/2044 [†] | 1,132,162 | 0.40 |
| | パラグアイ合計 | 2,088,406 | 0.73 |
| | 中国 : 0.17% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| | 社債 : 0.17% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 485,000 | Bank of China Ltd/Hong Kong 3.875% 30/06/2025 | 493,985 | 0.17 |
| | 中国合計 | 493,985 | 0.17 |
| | ペルー : 1.41% (31 May 2016: 1.61%) | | |
| | 社債 : 0.13% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 110,000 | Consorcio Transmantaro SA 4.375% 07/05/2023 [†] | 110,000 | 0.04 |
| 250,000 | Corp Financiera de Desarrollo SA 4.75% 15/07/2025 | 258,125 | 0.09 |
| | 国債 : 1.28% (31 May 2016: 1.55%) | | |
| 2,925,000 | Peru Government Bond 6.95% 12/08/2031 | 885,187 | 0.31 |
| 507,000 | Peruvian Government International Bond 4.125% 25/08/2027 | 531,716 | 0.19 |
| 367,000 | Peruvian Government International Bond 6.55% 14/03/2037 | 466,090 | 0.16 |
| 760,000 | Peruvian Government International Bond 7.35% 21/07/2025 | 983,250 | 0.35 |
| 520,000 | Peruvian Government International Bond 8.75% 21/11/2033 | 767,000 | 0.27 |
| | ペルー合計 | 4,001,368 | 1.41 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | フィリピン : 0.94% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| | 国債 : 0.94% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 200,000 | Philippine Government International Bond 3.95% 20/01/2040 | 202,739 | 0.07 |
| 315,000 | Philippine Government International Bond 4% 15/01/2021 | 337,226 | 0.12 |
| 115,000 | Philippine Government International Bond 6.375% 15/01/2032 | 148,483 | 0.05 |
| 100,000 | Philippine Government International Bond 6.375% 23/10/2034 | 131,752 | 0.05 |
| 1,180,000 | Philippine Government International Bond 7.75% 14/01/2031 | 1,681,639 | 0.59 |
| 115,000 | Philippine Government International Bond 9.5% 02/02/2030 | 182,007 | 0.06 |
| | フィリピン合計 | 2,683,846 | 0.94 |
| | ポーランド : 0.22% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| | 国債 : 0.22% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 635,000 | Poland Government Bond 3.25% 06/04/2026 | 616,036 | 0.22 |
| | ポーランド合計 | 616,036 | 0.22 |
| | カタール : 0.51% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| | 国債 : 0.51% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| 1,050,000 | Qatar Government International Bond 2.375% 02/06/2021 | 1,036,875 | 0.36 |
| 435,000 | Qatar Government International Bond 4.625% 02/06/2046 | 434,204 | 0.15 |
| | カタール合計 | 1,471,079 | 0.51 |
| | ルーマニア : 2.55% (31 May 2016: 3.14%) | | |
| | 国債 : 2.55% (31 May 2016: 3.14%) | | |
| 560,000 | Romanian Government International Bond 2.75% 29/10/2025 | 617,593 | 0.22 |
| 565,000 | Romanian Government International Bond 2.875% 26/05/2028 | 612,559 | 0.22 |
| 1,575,000 | Romanian Government International Bond 3.625% 24/04/2024 | 1,862,563 | 0.65 |
| 2,888,000 | Romanian Government International Bond 3.875% 29/10/2035 | 3,209,294 | 1.13 |
| 270,000 | Romanian Government International Bond 4.375% 22/08/2023 | 279,279 | 0.10 |
| 282,000 | Romanian Government International Bond 4.875% 22/01/2024 | 300,644 | 0.10 |
| 142,000 | Romanian Government International Bond 6.125% 22/01/2044 | 169,491 | 0.06 |
| 176,000 | Romanian Government International Bond 6.75% 07/02/2022 | 201,742 | 0.07 |
| | ルーマニア合計 | 7,253,165 | 2.55 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ロシア連邦 : 4.13% (31 May 2016: 2.88%) | | |
| | 国債 : 4.13% (31 May 2016: 2.88%) | | |
| 50,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 11% 24/07/2018 | 56,912 | 0.02 |
| 2,060,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 12.75% 24/06/028 | 3,475,158 | 1.22 |
| 600,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 4.5% 04/04/2022 [†] | 621,750 | 0.22 |
| 2,000,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/09/2023 - England | 2,107,548 | 0.74 |
| 2,200,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/09/2023 - United States of America | 2,318,302 | 0.81 |
| 2,200,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 5% 29/04/2020 | 2,320,833 | 0.81 |
| 600,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 5.875% 16/09/2043 - London | 655,425 | 0.23 |
| 200,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 5.875% 16/09/2043 - United States of America | 218,475 | 0.08 |
| | ロシア連邦合計 | 11,774,403 | 4.13 |
| | ルワンダ : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | サウジアラビア : 0.86% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.86% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,645,000 | Saudi Government International Bond 2.375% 26/10/2021 | 1,604,401 | 0.56 |
| 905,000 | Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026 | 856,933 | 0.30 |
| | サウジアラビア合計 | 2,461,334 | 0.86 |
| | セネガル : 0.77% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| | 国債 : 0.77% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 1,435,000 | Senegal Government International Bond 6.25% 30/07/2024 | 1,430,896 | 0.50 |
| 695,000 | Senegal Government International Bond 8.75% 13/05/2021 | 773,858 | 0.27 |
| | セネガル合計 | 2,204,754 | 0.77 |
| | セルビア : 0.47% (31 May 2016: 0.80%) | | |
| | 国債 : 0.47% (31 May 2016: 0.80%) | | |
| 1,055,000 | Serbia International Bond 5.25% 21/11/2017 | 1,082,725 | 0.38 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | セルビア(つづき) : 0.47% (31 May 2016: 0.80%) | | |
| | 国債(つづき) : 0.47% (31 May 2016: 0.80%) | | |
| 200,000 | Serbia International Bond 5.875% 03/12/2018 | 209,882 | 0.07 |
| 69,941 | Serbia International Bond FRN 01/11/2024 | 71,200 | 0.02 |
| | セルビア合計 | 1,363,807 | 0.47 |
| | スロベニア : 0.00% (31 May 2016: 4.37%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 4.37%) | | |
| | 南アフリカ : 1.28% (31 May 2016: 2.88%) | | |
| | 社債 : 0.66% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 990,000 | Eskom Holdings SOC Ltd 5.75% 26/01/2021 | 973,991 | 0.34 |
| 911,000 | Eskom Holdings SOC Ltd 6.75% 06/08/2023 | 898,428 | 0.32 |
| | 国債 : 0.62% (31 May 2016: 2.60%) | | |
| 385,000 | South Africa Government International Bond 4.3% 12/10/2028 | 357,680 | 0.13 |
| 205,000 | South Africa Government International Bond 4.665% 17/01/2024 | 206,989 | 0.07 |
| 188,000 | South Africa Government International Bond 5.375% 24/07/2044 | 184,029 | 0.06 |
| 605,000 | South Africa Government International Bond 5.875% 16/09/2025 | 649,670 | 0.23 |
| 225,000 | South Africa Government International Bond 5.875% 30/05/2022 | 246,375 | 0.09 |
| 95,000 | South Africa Government International Bond 6.25% 08/03/2041 | 104,215 | 0.04 |
| | 南アフリカ合計 | 3,621,377 | 1.28 |
| | スリランカ : 2.39% (31 May 2016: 2.08%) | | |
| | 国債 : 2.39% (31 May 2016: 2.08%) | | |
| 670,000 | Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/01/2022 [†] | 670,038 | 0.24 |
| 665,000 | Sri Lanka Government International Bond 5.875% 25/07/2022 | 666,720 | 0.23 |
| 1,345,000 | Sri Lanka Government International Bond 6% 14/01/2019 | 1,398,348 | 0.49 |
| 1,536,000 | Sri Lanka Government International Bond 6.25% 04/10/2020 | 1,599,439 | 0.56 |
| 80,000 | Sri Lanka Government International Bond 6.25% 27/07/2021 | 82,500 | 0.03 |
| 665,000 | Sri Lanka Government International Bond 6.85% 03/11/2025 - Germany [†] | 670,915 | 0.24 |
| 1,695,000 | Sri Lanka Government International Bond 6.85% 03/11/2025 - Singapore | 1,710,076 | 0.60 |
| | スリランカ合計 | 6,798,036 | 2.39 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | スリナム : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 250,000 | Republic of Suriname 9.25% 26/10/2026 | 252,500 | 0.09 |
| | スリナム合計 | 252,500 | 0.09 |
| | チュニジア : 0.29% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| | 国債 : 0.29% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 890,000 | Banque Centrale de Tunisie International Bond 5.75% 30/01/2025 | 818,800 | 0.29 |
| | チュニジア合計 | 818,800 | 0.29 |
| | トルコ : 4.27% (31 May 2016: 3.96%) | | |
| | 社債 : 0.15% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 225,000 | Turkiye Garanti Bankasi AS 4.75% 17/10/2019 | 224,044 | 0.08 |
| 200,000 | Turkiye Is Bankasi 5.5% 21/04/2019 | 201,163 | 0.07 |
| | 国債 : 4.12% (31 May 2016: 3.96%) | | |
| 585,000 | Export Credit Bank of Turkey 5.375% 08/02/2021 | 575,267 | 0.20 |
| 675,000 | Turkey Government International Bond 3.25% 23/03/2023 | 601,121 | 0.21 |
| 360,000 | Turkey Government International Bond 4.25% 14/04/2026 | 322,644 | 0.11 |
| 685,000 | Turkey Government International Bond 4.875% 09/10/2026 | 637,819 | 0.22 |
| 200,000 | Turkey Government International Bond 4.875% 16/04/2043 | 159,628 | 0.06 |
| 320,000 | Turkey Government International Bond 5.125% 25/03/2022 - Germany | 319,200 | 0.11 |
| 810,000 | Turkey Government International Bond 5.125% 25/03/2022 - Luxembourg | 807,976 | 0.28 |
| 845,000 | Turkey Government International Bond 5.625% 30/03/2021 | 868,236 | 0.31 |
| 975,000 | Turkey Government International Bond 5.75% 22/03/2024 | 983,715 | 0.35 |
| 793,000 | Turkey Government International Bond 6% 14/01/2041 | 732,712 | 0.26 |
| 335,000 | Turkey Government International Bond 6.25% 26/09/2022 | 350,385 | 0.12 |
| 1,180,000 | Turkey Government International Bond 6.625% 17/02/2045 | 1,170,325 | 0.41 |
| 269,000 | Turkey Government International Bond 6.875% 17/03/2036 | 276,285 | 0.10 |
| 325,000 | Turkey Government International Bond 7% 11/03/2019 | 346,577 | 0.12 |
| 2,385,000 | Turkey Government International Bond 7% 05/06/2020 | 2,566,712 | 0.90 |
| 920,000 | Turkey Government International Bond 7.375% 05/02/2025 | 1,013,591 | 0.36 |
| | トルコ合計 | 12,157,400 | 4.27 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ウクライナ : 2.64% (31 May 2016: 2.42%) | | |
| | 国債 : 2.64% (31 May 2016: 2.42%) | | |
| 628,000 | Ukraine Government International Bond 0% 31/05/2040 | 185,608 | 0.07 |
| 2,256,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2019 | 2,190,067 | 0.77 |
| 941,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2020 | 897,742 | 0.32 |
| 946,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2021 | 889,855 | 0.31 |
| 556,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2022 | 517,372 | 0.18 |
| 541,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2023 | 496,368 | 0.17 |
| 575,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2024 | 522,802 | 0.18 |
| 545,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2025 | 490,560 | 0.17 |
| 665,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2026 | 596,778 | 0.21 |
| 825,000 | Ukraine Government International Bond 7.75% 01/09/2027 | 734,217 | 0.26 |
| | ウクライナ合計 | 7,521,369 | 2.64 |
| | アラブ首長国連邦 : 0.20% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.20% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 570,000 | Abu Dhabi National Energy Co PJSC 3.625% 22/06/2021 | 576,721 | 0.20 |
| | アラブ首長国連邦合計 | 576,721 | 0.20 |
| | 英国 : 0.49% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | 社債 : 0.49% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 670,000 | Oschadbank Via SSB #1 PLC FRN 20/03/2025 | 611,496 | 0.21 |
| 150,000 | Ukreximbank Via Biz Finance PLC 9.625% 27/04/2022 | 141,000 | 0.05 |
| 715,000 | Ukreximbank Via Biz Finance PLC 9.75% 22/01/2025 | 652,230 | 0.23 |
| | 英国合計 | 1,404,726 | 0.49 |
| | タンザニア : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 米国 : 0.00% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.14%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ウルグアイ : 1.22% (31 May 2016: 1.02%) | | |
| | 国債 : 1.22% (31 May 2016: 1.02%) | | |
| 345,000 | Uruguay Government Bond PIK 15/01/2033 | 441,600 | 0.16 |
| 100,000 | Uruguay Government International Bond 4.125% 20/11/2045 | 83,125 | 0.03 |
| 225,000 | Uruguay Government International Bond 4.5% 14/08/2024 | 234,900 | 0.08 |
| 2,916,247 | Uruguay Government International Bond 5.1% 18/06/2050 | 2,617,331 | 0.92 |
| 75,000 | Uruguay Government International Bond 7.625% 21/03/2036 | 94,815 | 0.03 |
| | ウルグアイ合計 | 3,471,771 | 1.22 |
| | ベネズエラ : 2.13% (31 May 2016: 1.79%) | | |
| | 社債 : 1.18% (31 May 2016: 1.07%) | | |
| 545,000 | Petroleos de Venezuela SA 5.25% 12/04/2017 | 460,525 | 0.16 |
| 197,000 | Petroleos de Venezuela SA 5.375% 12/04/2027 | 71,249 | 0.03 |
| 300,100 | Petroleos de Venezuela SA 5.5% 12/04/2037 | 105,935 | 0.04 |
| 4,386,000 | Petroleos de Venezuela SA 6% 15/11/2026 | 1,623,697 | 0.57 |
| 495,000 | Petroleos de Venezuela SA 6% 16/05/2024 | 186,293 | 0.07 |
| 317,333 | Petroleos de Venezuela SA 8.5% 02/11/2017 | 237,207 | 0.08 |
| 503,000 | Petroleos de Venezuela SA 8.5% 27/10/2020 | 359,645 | 0.13 |
| 174,000 | Petroleos de Venezuela SA 9% 17/11/2021 | 85,260 | 0.03 |
| 200,000 | Petroleos de Venezuela SA 9.75% 17/05/2035 | 91,250 | 0.03 |
| 206,000 | Petroleos de Venezuela SA 12.75% 17/02/2022 | 119,614 | 0.04 |
| | 国債 : 0.95% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 126,000 | Venezuela Government International Bond 6% 09/12/2020 | 56,914 | 0.02 |
| 110,000 | Venezuela Government International Bond 7% 01/12/2018 | 64,900 | 0.02 |
| 20,000 | Venezuela Government International Bond 7% 31/03/2038 - Germany | 8,274 | - |
| 109,000 | Venezuela Government International Bond 7% 31/03/2038 - Luxembourg | 45,093 | 0.02 |
| 163,000 | Venezuela Government International Bond 7.65% 21/04/2025 | 69,275 | 0.02 |
| 161,000 | Venezuela Government International Bond 7.75% 13/10/2019 | 81,305 | 0.03 |
| 1,989,000 | Venezuela Government International Bond 8.25% 13/10/2024 | 862,232 | 0.30 |
| 1,478,400 | Venezuela Government International Bond 9% 07/05/2023 | 666,018 | 0.23 |
| 80,000 | Venezuela Government International Bond 9.25% 15/09/2027 - Luxembourg | 39,200 | 0.02 |
| 186,000 | Venezuela Government International Bond 9.25% 15/09/2027 - United States of America | 91,140 | 0.03 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|--------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 87.52% (31 May 2016: 88.85%) | | |
| | ベネズエラ(つづき) : 2.13% (31 May 2016: 1.79%) | | |
| | 国債(つづき) : 0.95% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 635,000 | Venezuela Government International Bond 9.25% 07/05/2028 | 279,559 | 0.10 |
| 71,000 | Venezuela Government International Bond 9.375% 13/01/2034 | 31,347 | 0.01 |
| 206,000 | Venezuela Government International Bond 11.75% 21/10/2026 | 110,210 | 0.04 |
| 246,000 | Venezuela Government International Bond 11.95% 05/08/2031 [†] | 131,733 | 0.05 |
| 206,000 | Venezuela Government International Bond 12.75% 23/08/2022 | 119,830 | 0.04 |
| 77,000 | Venezuela Government International Bond 13.625% 15/08/2018 | 61,023 | 0.02 |
| | ベネズエラ合計 | 6,058,728 | 2.13 |
| | ベトナム : 0.29% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| | 国債 : 0.29% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 553,000 | Vietnam Government International Bond 4.8% 19/11/2024 [†] | 552,263 | 0.19 |
| 70,000 | Vietnam Government International Bond 6.75% 29/01/2020 - Germany | 76,796 | 0.03 |
| 180,000 | Vietnam Government International Bond 6.75% 29/01/2020 - Singapore | 197,475 | 0.07 |
| | ベトナム合計 | 826,534 | 0.29 |
| | バージン諸島 : 0.31% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| | 国債 : 0.31% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 900,000 | Sinopec Group Overseas Development 2016 Ltd 3.5% 03/05/2026 | 878,730 | 0.31 |
| | バージン諸島合計 | 878,730 | 0.31 |
| | ザンビア : 0.39% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.39% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,185,000 | Zambia Government International Bond 8.5% 14/04/2024 | 1,116,251 | 0.39 |
| | ザンビア合計 | 1,116,251 | 0.39 |
| | 債券合計 | 249,282,853 | 87.52 |
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る未収収益 : 1.34% (31 May 2016: 1.21%) | 3,821,182 | 1.34 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|------------------|---------------|
| | 投資ファンド：1.66% (31 May 2016: 3.18%) | | |
| | アイルランド：1.66% (31 May 2016: 3.18%) | | |
| 43,780 | iShares JP Morgan Emerging Markets Bond NPV UCITS ETF | 4,735,643 | 1.66 |
| | 投資ファンド合計 | 4,735,643 | 1.66 |
| 契約数 | 先物契約** | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
| | 先物契約**：0.12% (31 May 2016: -0.07%) | | |
| (13) | Euro-BUXL 30 Yr Bond EUX Future December 2016 | 225,675 | 0.08 |
| (56) | Euro-Bund EUX Future December 2016 | 214,535 | 0.08 |
| (24) | Euro-BOBL EUX Future December 2016 | 10,184 | - |
| | 未決済先物契約に係る評価益合計 | 450,394 | 0.16 |
| (25) | US 5 Year Note CBT Future March 2017 | (391) | - |
| 121 | US 10 Year Note CBT Future March 2017 | (52,993) | (0.02) |
| 76 | US Long Bond CBT Future March 2017 | (66,626) | (0.02) |
| | 未決済先物契約に係る評価損合計 | (120,010) | (0.04) |
| | 先物契約合計 | 330,384 | 0.12 |
| | 先渡為替契約：-0.79% (31 May 2016: 0.15%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------------------------------|-----|-----------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| Chase Manhattan Commonwealth | USD | 39,204 | EUR | 35,000 | 21/12/2016 | 2,038 | - |
| Bank | USD | 4,146,146 | EUR | 3,680,000 | 21/12/2016 | 238,486 | 0.09 |
| Credit Suisse | USD | 4,146,311 | EUR | 3,680,000 | 21/12/2016 | 238,651 | 0.08 |
| Goldman Sachs | USD | 126,551 | EUR | 116,000 | 21/12/2016 | 3,375 | - |
| HSBC | USD | 252,281 | EUR | 225,000 | 21/12/2016 | 13,362 | 0.01 |
| Morgan Stanley | USD | 690,071 | EUR | 613,000 | 21/12/2016 | 39,148 | 0.01 |
| Royal Bank of Canada | USD | 4,144,666 | EUR | 3,680,000 | 21/12/2016 | 237,006 | 0.09 |
| State Street | USD | 4,146,462 | EUR | 3,681,000 | 21/12/2016 | 237,741 | 0.09 |
| State Street | USD | 280,538 | COP | 848,558,000 | 21/12/2016 | 3,796 | - |
| UBS | USD | 3,800,132 | GBP | 3,022,108 | 15/12/2016 | 22,852 | 0.01 |
| UBS | USD | 306,059 | EUR | 281,787 | 15/12/2016 | 6,945 | - |
| UBS | USD | 259,247 | EUR | 238,688 | 15/12/2016 | 5,883 | - |
| UBS | USD | 392,646 | EUR | 365,605 | 15/12/2016 | 4,561 | - |
| UBS | USD | 338,899 | EUR | 315,559 | 15/12/2016 | 3,936 | - |
| UBS | USD | 112,488 | EUR | 102,647 | 15/12/2016 | 3,529 | - |
| UBS | USD | 153,215 | EUR | 141,065 | 15/12/2016 | 3,477 | - |
| UBS | USD | 160,430 | EUR | 149,382 | 15/12/2016 | 1,863 | - |
| UBS | GBP | 216,706 | USD | 269,282 | 15/12/2016 | 1,575 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.79% (31 May 2016: 0.15%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|---------|-----|---------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 66,612 | EUR | 61,329 | 15/12/2016 | 1,511 | - |
| UBS | USD | 197,047 | GBP | 156,704 | 15/12/2016 | 1,185 | - |
| UBS | USD | 29,133 | EUR | 26,343 | 15/12/2016 | 1,171 | - |
| UBS | GBP | 117,806 | USD | 146,107 | 15/12/2016 | 1,137 | - |
| UBS | USD | 71,640 | EUR | 66,706 | 15/12/2016 | 832 | - |
| UBS | USD | 72,578 | EUR | 67,593 | 15/12/2016 | 829 | - |
| UBS | USD | 19,108 | EUR | 17,437 | 15/12/2016 | 600 | - |
| UBS | GBP | 80,908 | USD | 100,557 | 15/12/2016 | 569 | - |
| UBS | USD | 12,046 | EUR | 10,892 | 15/12/2016 | 484 | - |
| UBS | GBP | 219,352 | USD | 273,730 | 15/12/2016 | 434 | - |
| UBS | EUR | 129,034 | USD | 136,542 | 15/12/2016 | 426 | - |
| UBS | GBP | 135,263 | USD | 168,652 | 15/12/2016 | 411 | - |
| UBS | USD | 16,113 | EUR | 14,797 | 15/12/2016 | 407 | - |
| UBS | USD | 51,213 | GBP | 40,728 | 15/12/2016 | 308 | - |
| UBS | GBP | 51,310 | USD | 63,898 | 15/12/2016 | 233 | - |
| UBS | EUR | 44,046 | USD | 46,553 | 15/12/2016 | 201 | - |
| UBS | GBP | 200,809 | USD | 250,793 | 15/12/2016 | 195 | - |
| UBS | EUR | 20,986 | USD | 22,116 | 15/12/2016 | 161 | - |
| UBS | USD | 6,903 | EUR | 6,355 | 15/12/2016 | 157 | - |
| UBS | USD | 6,461 | EUR | 5,949 | 15/12/2016 | 147 | - |
| UBS | GBP | 15,018 | USD | 18,626 | 15/12/2016 | 145 | - |
| UBS | GBP | 38,551 | USD | 48,039 | 15/12/2016 | 145 | - |
| UBS | USD | 97,788 | EUR | 91,993 | 15/12/2016 | 138 | - |
| UBS | EUR | 25,092 | USD | 26,520 | 15/12/2016 | 114 | - |
| UBS | GBP | 107,028 | USD | 133,668 | 15/12/2016 | 104 | - |
| UBS | USD | 121,787 | EUR | 114,643 | 15/12/2016 | 95 | - |
| UBS | USD | 7,963 | EUR | 7,414 | 15/12/2016 | 92 | - |
| UBS | EUR | 34,332 | USD | 36,357 | 15/12/2016 | 87 | - |
| UBS | USD | 13,396 | EUR | 12,539 | 15/12/2016 | 86 | - |
| UBS | USD | 7,019 | EUR | 6,536 | 15/12/2016 | 82 | - |
| UBS | USD | 1,909 | EUR | 1,727 | 15/12/2016 | 77 | - |
| UBS | USD | 3,223 | EUR | 2,968 | 15/12/2016 | 73 | - |
| UBS | EUR | 121,351 | USD | 128,751 | 15/12/2016 | 62 | - |
| UBS | GBP | 12,962 | USD | 16,152 | 15/12/2016 | 49 | - |
| UBS | USD | 7,941 | GBP | 6,315 | 15/12/2016 | 48 | - |
| UBS | EUR | 12,533 | USD | 13,262 | 15/12/2016 | 41 | - |
| UBS | USD | 1,805 | EUR | 1,662 | 15/12/2016 | 41 | - |
| UBS | USD | 3,448 | EUR | 3,211 | 15/12/2016 | 40 | - |
| UBS | EUR | 10,895 | USD | 11,538 | 15/12/2016 | 28 | - |
| UBS | USD | 1,202 | EUR | 1,107 | 15/12/2016 | 27 | - |
| UBS | USD | 2,012 | EUR | 1,873 | 15/12/2016 | 23 | - |
| UBS | USD | 1,987 | EUR | 1,850 | 15/12/2016 | 23 | - |
| UBS | USD | 1,401 | EUR | 1,305 | 15/12/2016 | 16 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.79% (31 May 2016: 0.15%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|-------|-----|-------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 2,642 | GBP | 2,101 | 15/12/2016 | 16 | - |
| UBS | USD | 7,909 | EUR | 7,440 | 15/12/2016 | 11 | - |
| UBS | USD | 1,756 | GBP | 1,397 | 15/12/2016 | 11 | - |
| UBS | GBP | 1,699 | USD | 2,113 | 15/12/2016 | 10 | - |
| UBS | USD | 1,492 | GBP | 1,187 | 15/12/2016 | 9 | - |
| UBS | USD | 703 | EUR | 655 | 15/12/2016 | 8 | - |
| UBS | GBP | 1,000 | USD | 1,244 | 15/12/2016 | 6 | - |
| UBS | USD | 885 | GBP | 704 | 15/12/2016 | 5 | - |

先渡為替契約に係る評価益合計

1,081,334

0.38

| | | | | | | | |
|--------------------|-----|-----------|-----|-----------|------------|----------|--------|
| Bank of America | EUR | 398,000 | USD | 434,314 | 21/12/2016 | (11,692) | (0.01) |
| Barclays^ | USD | 1,066 | GBP | 857 | 15/12/2016 | (5) | - |
| Barclays^ | USD | 1,376 | GBP | 1,107 | 15/12/2016 | (7) | - |
| Barclays^ | USD | 2,127 | GBP | 1,710 | 15/12/2016 | (11) | - |
| Barclays^ | USD | 3,394 | GBP | 2,729 | 15/12/2016 | (17) | - |
| Barclays^ | USD | 10,336 | GBP | 8,311 | 15/12/2016 | (52) | - |
| Barclays^ | USD | 62,677 | GBP | 50,397 | 15/12/2016 | (314) | - |
| Barclays^ | USD | 407,644 | GBP | 327,778 | 15/12/2016 | (2,039) | - |
| Barclays^ | EUR | 85,000 | USD | 94,259 | 21/12/2016 | (4,000) | - |
| Barclays^ | EUR | 217,000 | USD | 237,148 | 21/12/2016 | (6,723) | (0.01) |
| Barclays^ | USD | 4,988,697 | GBP | 4,011,301 | 15/12/2016 | (24,959) | (0.01) |
| Chase Manhattan | EUR | 490,000 | USD | 526,784 | 21/12/2016 | (6,471) | - |
| Goldman Scahs | USD | 584,324 | EUR | 551,000 | 21/12/2016 | (763) | - |
| Goldman Scahs | EUR | 275,000 | USD | 300,013 | 21/12/2016 | (8,000) | - |
| HSBC | EUR | 138,000 | USD | 151,594 | 21/12/2016 | (5,057) | - |
| Morgan Stanley | EUR | 358,000 | USD | 380,633 | 21/12/2016 | (486) | - |
| Morgan Stanley | EUR | 94,000 | USD | 102,967 | 21/12/2016 | (3,152) | - |
| Standard Chartered | USD | 821,056 | PEN | 2,831,000 | 21/12/2016 | (7,233) | - |
| UBS | USD | 286 | GBP | 230 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | USD | 6,620 | EUR | 6,239 | 15/12/2016 | (3) | - |
| UBS | USD | 2,325 | EUR | 2,200 | 15/12/2016 | (10) | - |
| UBS | GBP | 1,810 | USD | 2,279 | 15/12/2016 | (17) | - |
| UBS | EUR | 619 | USD | 674 | 15/12/2016 | (17) | - |
| UBS | EUR | 20,717 | USD | 22,008 | 15/12/2016 | (18) | - |
| UBS | USD | 3,134 | EUR | 2,974 | 15/12/2016 | (23) | - |
| UBS | GBP | 30,056 | USD | 37,597 | 15/12/2016 | (31) | - |
| UBS | USD | 11,894 | EUR | 11,241 | 15/12/2016 | (37) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.79% (31 May 2016: 0.15%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| UBS | EUR | 6,223 | USD | 6,649 | 15/12/2016 | (43) | - |
| UBS | USD | 107,954 | EUR | 101,751 | 15/12/2016 | (54) | - |
| UBS | USD | 12,461 | GBP | 10,028 | 15/12/2016 | (73) | - |
| UBS | EUR | 122,312 | USD | 129,938 | 15/12/2016 | (105) | - |
| UBS | USD | 68,245 | EUR | 64,403 | 15/12/2016 | (119) | - |
| UBS | EUR | 18,339 | USD | 19,592 | 15/12/2016 | (126) | - |
| UBS | EUR | 20,775 | USD | 22,192 | 15/12/2016 | (140) | - |
| UBS | USD | 90,008 | EUR | 85,000 | 15/12/2016 | (219) | - |
| UBS | EUR | 22,638 | USD | 24,298 | 15/12/2016 | (268) | - |
| UBS | USD | 43,105 | EUR | 40,904 | 15/12/2016 | (314) | - |
| UBS | USD | 84,132 | GBP | 67,577 | 15/12/2016 | (332) | - |
| UBS | GBP | 33,117 | USD | 41,858 | 15/12/2016 | (466) | - |
| UBS | GBP | 43,073 | USD | 54,443 | 15/12/2016 | (607) | - |
| UBS | USD | 43,550 | GBP | 35,364 | 15/12/2016 | (651) | - |
| UBS | EUR | 28,101 | USD | 30,602 | 15/12/2016 | (773) | - |
| UBS | GBP | 67,363 | USD | 85,144 | 15/12/2016 | (949) | - |
| UBS | EUR | 93,046 | USD | 99,912 | 15/12/2016 | (1,145) | - |
| UBS | EUR | 48,822 | USD | 53,085 | 15/12/2016 | (1,261) | - |
| UBS | GBP | 101,941 | USD | 128,850 | 15/12/2016 | (1,435) | - |
| UBS | GBP | 159,274 | USD | 200,561 | 15/12/2016 | (1,487) | - |
| UBS | USD | 214,470 | GBP | 172,823 | 15/12/2016 | (1,538) | - |
| UBS | EUR | 69,793 | USD | 75,887 | 15/12/2016 | (1,803) | - |
| UBS | EUR | 124,573 | USD | 135,450 | 15/12/2016 | (3,218) | - |
| UBS | GBP | 311,101 | USD | 393,220 | 15/12/2016 | (4,380) | - |
| UBS | USD | 661,235 | GBP | 532,648 | 15/12/2016 | (4,513) | - |
| UBS | USD | 1,013,640 | GBP | 814,908 | 15/12/2016 | (4,899) | - |
| UBS | EUR | 250,023 | USD | 271,856 | 15/12/2016 | (6,459) | - |
| UBS | EUR | 278,929 | USD | 303,285 | 15/12/2016 | (7,205) | - |
| UBS | GBP | 1,907,853 | USD | 2,411,456 | 15/12/2016 | (26,863) | (0.01) |
| UBS | USD | 6,127,809 | GBP | 4,945,450 | 15/12/2016 | (53,424) | (0.02) |
| UBS | EUR | 2,561,915 | USD | 2,785,624 | 15/12/2016 | (66,181) | (0.02) |
| UBS | GBP | 7,602,850 | USD | 9,609,722 | 15/12/2016 | (107,051) | (0.04) |
| UBS | EUR | 5,743,336 | USD | 6,244,850 | 15/12/2016 | (148,365) | (0.05) |
| UBS | EUR | 12,392,787 | USD | 13,474,937 | 15/12/2016 | (320,138) | (0.12) |
| UBS | EUR | 13,544,405 | USD | 14,727,116 | 15/12/2016 | (349,888) | (0.13) |
| UBS | GBP | 151,501,680 | USD | 191,492,517 | 15/12/2016 | (2,133,210) | (0.75) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (3,330,841) | (1.17) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (2,249,507) | (0.79) |

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|--------------|
| 投資総額 | 255,920,555 | 89.85 |
| 現金および現金等価物 [*] | 28,490,758 | 10.00 |
| その他の純資産 | 388,692 | 0.14 |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>284,800,005</u> | <u>99.99</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 85.84 |
| 投資ファンドおよびAIF | 1.61 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.52 |
| その他の資産 | 12.03 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるパークレイズ・キャピタルにより担保として保有される591,952米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

† ファンドの純資産の2.91%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

** 先物契約の取引相手方は、パークレイズ・キャピタルである。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

[次へ](#)

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式：91.88% (31 May 2016: 96.05%) | | |
| | オーストラリア：5.96% (31 May 2016: 5.96%) | | |
| | エンジニアリング・建設：0.00% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| | 不動産：0.13% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 50,895 | Charter Hall Group Reits NPV | 169,781 | 0.13 |
| | 不動産投資信託：5.83% (31 May 2016: 5.53%) | | |
| 408,039 | Dexus Property Group Reits NPV | 2,744,972 | 2.07 |
| 481,034 | Goodman Group Reits NPV | 2,368,821 | 1.78 |
| 799,185 | Mirvac Group Reits NPV | 1,207,527 | 0.91 |
| 452,973 | Scentre Group Reits NPV | 1,420,713 | 1.07 |
| | オーストラリア合計 | 7,911,814 | 5.96 |
| | バミューダ：1.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 不動産：1.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 209,800 | Hongkong Land Holdings Ltd Com USD0.10 | 1,341,671 | 1.01 |
| | バミューダ合計 | 1,341,671 | 1.01 |
| | ケイマン諸島：1.14% (31 May 2016: 1.70%) | | |
| | 不動産：1.14% (31 May 2016: 1.70%) | | |
| 120,500 | Cheung Kong Property Holdings Ltd Com HKD1.00 | 823,746 | 0.62 |
| 284,000 | China Resources Land Ltd Com HKD0.10 | 691,267 | 0.52 |
| | ケイマン諸島合計 | 1,515,013 | 1.14 |
| | フィンランド：0.55% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| | 不動産：0.55% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 170,669 | Sponda OYJ Com NPV | 734,864 | 0.55 |
| | フィンランド合計 | 734,864 | 0.55 |
| | フランス：3.52% (31 May 2016: 4.44%) | | |
| | 不動産投資信託：3.52% (31 May 2016: 4.44%) | | |
| 8,322 | Gecina SA Reits EUR7.50 | 1,091,138 | 0.82 |
| 68,984 | Klepierre Reits EUR1.40 | 2,573,678 | 1.94 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 91.88% (31 May 2016: 96.05%) | | |
| | フランス(つづき) : 3.52% (31 May 2016: 4.44%) | | |
| | 不動産投資信託(つづき) : 3.52% (31 May 2016: 4.44%) | | |
| 4,553 | Unibail-Rodamco SE Reits EUR5.00 | 1,005,569 | 0.76 |
| | フランス合計 | 4,670,385 | 3.52 |
| | ドイツ : 4.32% (31 May 2016: 3.68%) | | |
| | 不動産 : 4.32% (31 May 2016: 3.68%) | | |
| 133,881 | Deutsche Wohnen AG Class B Com NPV | 4,128,549 | 3.11 |
| 45,114 | TLG Immobilien AG Class A Com NPV | 808,662 | 0.61 |
| 24,660 | Vonovia SE Com NPV | 792,431 | 0.60 |
| | ドイツ合計 | 5,729,642 | 4.32 |
| | 香港 : 4.39% (31 May 2016: 3.89%) | | |
| | 不動産 : 2.51% (31 May 2016: 2.25%) | | |
| 1,172,000 | New World Development Co Ltd Com NPV | 1,306,226 | 0.98 |
| 155,000 | Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 2,027,260 | 1.53 |
| | 不動産投資信託 : 1.88% (31 May 2016: 1.64%) | | |
| 362,500 | Link Reits NPV | 2,493,264 | 1.88 |
| | 香港合計 | 5,826,750 | 4.39 |
| | 日本 : 12.13% (31 May 2016: 10.94%) | | |
| | 不動産 : 6.92% (31 May 2016: 4.25%) | | |
| 81,300 | イオンモール | 1,176,922 | 0.89 |
| 86,000 | 三菱地所 | 1,740,076 | 1.31 |
| 135,000 | 三井不動産 | 3,186,175 | 2.40 |
| 79,000 | 住友不動産 | 2,188,802 | 1.65 |
| 68,200 | 東京建物 | 884,035 | 0.67 |
| | 不動産投資信託 : 5.21% (31 May 2016: 6.69%) | | |
| 71 | 星野リゾート・リート投資法人 | 375,111 | 0.28 |
| 1,612 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1,125,408 | 0.85 |
| 486 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 962,019 | 0.73 |
| 497 | 日本賃貸住宅投資法人 | 357,010 | 0.27 |
| 718 | 日本リテールファンド投資法人 | 1,465,364 | 1.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 91.88% (31 May 2016: 96.05%) | | |
| | 日本(つづき) : 12.13% (31 May 2016: 10.94%) | | |
| | 不動産投資信託(つづき) : 5.21% (31 May 2016: 6.69%) | | |
| 223 | ケネディクス商業リート投資法人 | 504,439 | 0.38 |
| 702 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 1,042,419 | 0.79 |
| 9 | オリックス不動産投資法人 | 13,657 | 0.01 |
| 691 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,056,406 | 0.80 |
| | 日本合計 | 16,077,843 | 12.13 |
| | メキシコ : 0.59% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 不動産投資信託 : 0.59% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 249,220 | PLA Administradora Industrial S de RL de CV Reits NPV | 344,933 | 0.26 |
| 301,820 | Prologis Property Mexico SA de CV Reits NPV | 436,163 | 0.33 |
| | メキシコ合計 | 781,096 | 0.59 |
| | オランダ : 0.73% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| | ソフトウェア : 0.73% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| 28,310 | InterXion Holding NV Com EURO.10 | 966,645 | 0.73 |
| | オランダ合計 | 966,645 | 0.73 |
| | 中国 : 0.00% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| | シンガポール : 0.50% (31 May 2016: 0.79%) | | |
| | 宿泊施設 : 0.00% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| | 不動産投資信託 : 0.50% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 375,102 | Frasers Logistics & Industrial Trust Reits NPV | 240,265 | 0.18 |
| 427,300 | Mapletree Commercial Trust Reits NPV | 429,567 | 0.32 |
| | シンガポール合計 | 669,832 | 0.50 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 91.88% (31 May 2016: 96.05%) | | |
| | スペイン : 1.36% (31 May 2016: 0.97%) | | |
| | 不動産 : 0.34% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 67,745 | Inmobiliaria Colonial SA Com EUR2.50 | 454,036 | 0.34 |
| | 不動産投資信託 : 1.02% (31 May 2016: 0.97%) | | |
| 134,477 | Merlin Properties Socimi SA Reits EUR1.00 | 1,356,133 | 1.02 |
| | スペイン合計 | 1,810,169 | 1.36 |
| | スウェーデン : 2.37% (31 May 2016: 2.18%) | | |
| | 不動産 : 2.37% (31 May 2016: 2.18%) | | |
| 83,653 | Castellum AB Class A Com SEK0.50 | 1,097,764 | 0.83 |
| 81,632 | Fabege AB Class A Com SEK30.82 | 1,283,900 | 0.97 |
| 41,942 | Wihlborgs Fastigheter AB Class A Com SEK2.50 | 755,974 | 0.57 |
| | スウェーデン合計 | 3,137,638 | 2.37 |
| | 英国 : 4.09% (31 May 2016: 7.38%) | | |
| | 住宅建設 : 0.00% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| | 不動産 : 0.79% (31 May 2016: 1.07%) | | |
| 150,234 | UNITE Group PLC Com GBPO.25 | 1,048,318 | 0.79 |
| | 不動産投資信託 : 2.89% (31 May 2016: 5.41%) | | |
| 40,393 | Big Yellow Group PLC Reits GBPO.10 | 334,218 | 0.25 |
| 168,081 | Land Securities Group PLC Reits GBPO.10 | 2,036,479 | 1.53 |
| 280,970 | Segro PLC Reits GBPO.10 | 1,467,012 | 1.11 |
| | 保管・倉庫業 : 0.41% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| 126,743 | Safestore Holdings PLC Reits GBPO.01 | 541,250 | 0.41 |
| | 英国合計 | 5,427,277 | 4.09 |
| | 米国 : 49.22% (31 May 2016: 52.50%) | | |
| | 宿泊施設 : 0.72% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 38,132 | Hilton Worldwide Holdings Inc Class I Com USD0.01 | 955,779 | 0.72 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 91.88% (31 May 2016: 96.05%) | | |
| | 米国(つづき) : 49.22% (31 May 2016: 52.50%) | | |
| | 不動産 : 0.56% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 25,680 | CBRE Group Inc Class A Class A Com USD0.01 | 746,132 | 0.56 |
| | 不動産投資信託 : 47.94% (31 May 2016: 51.55%) | | |
| 11,299 | Agree Realty Corp Com Reits USD0.0001 | 506,591 | 0.38 |
| 15,104 | Alexandria Real Estate Equities Inc Reits USD0.01 | 1,656,229 | 1.25 |
| 18,055 | American Campus Communities Inc Reits USD0.01 | 850,481 | 0.64 |
| 11,302 | American Tower Corp Reits USD0.01 | 1,156,025 | 0.87 |
| 49,425 | Apartment Investment & Management Co Reits USD0.01 | 2,081,781 | 1.57 |
| 21,584 | AvalonBay Communities Inc Reits USD0.01 | 3,550,892 | 2.68 |
| 21,705 | Boston Properties Inc Reits USD0.01 | 2,688,924 | 2.03 |
| 13,680 | Brandywine Realty Trust Reits USD0.01 | 209,920 | 0.16 |
| 21,770 | Colony Starwood Homes Reits USD0.01 | 665,400 | 0.50 |
| 1,080 | CoreSite Realty Corp Reits USD0.01 | 76,232 | 0.06 |
| 13,420 | Crown Castle International Corp Reits USD0.01 | 1,120,234 | 0.84 |
| 66,887 | CubeSmart Reits USD0.01 | 1,649,099 | 1.24 |
| 66,798 | Duke Realty Corp Reits USD0.01 | 1,699,007 | 1.28 |
| 21,523 | Education Realty Trust Reits USD0.01 | 873,619 | 0.66 |
| 15,224 | EPR Properties Reits USD0.01 | 1,058,829 | 0.80 |
| 5,380 | Equinix Inc Com Reits USD0.001 | 1,822,421 | 1.37 |
| 53,339 | Equity One Inc Reits USD0.01 | 1,593,503 | 1.20 |
| 18,452 | Equity Residential Reits USD0.01 | 1,107,766 | 0.84 |
| 15,993 | Essex Property Trust Inc Reits USD0.0001 | 3,452,969 | 2.60 |
| 18,260 | Extra Space Storage Inc Reits USD0.01 | 1,281,761 | 0.97 |
| 3,487 | Federal Realty Investment Trust Reits USD0.01 | 489,435 | 0.37 |
| 29,240 | First Industrial Realty Trust Inc Reits USD0.01 | 773,544 | 0.58 |
| 63,661 | General Growth Properties Inc Reits USD0.01 | 1,613,488 | 1.22 |
| 19,990 | Host Hotels & Resorts Inc Reits USD0.01 | 357,121 | 0.27 |
| 22,716 | Kilroy Realty Corp Reits USD0.01 | 1,642,708 | 1.24 |
| 4,448 | Pebblebrook Hotel Trust Reits USD0.01 | 127,947 | 0.10 |
| 63,787 | Physicians Realty Trust Reits USD0.01 | 1,156,139 | 0.87 |
| 59,727 | Prologis Inc Reits USD0.01 | 3,041,000 | 2.29 |
| 7,305 | Public Storage Reits USD0.10 | 1,528,316 | 1.15 |
| 12,430 | Regency Centers Corp Reits USD0.01 | 830,883 | 0.63 |
| 24,225 | Rexford Industrial Realty Inc Class I Reits USD0.01 | 535,251 | 0.40 |
| 13,930 | Saul Centers Inc Reits USD0.01 | 884,903 | 0.67 |
| 63,900 | Senior Housing Properties Trust Reits USD0.01 | 1,154,353 | 0.87 |
| 41,321 | Simon Property Group Inc Reits USD0.0001 | 7,426,210 | 5.60 |
| 24,470 | SL Green Realty Corp Reits USD0.01 | 2,578,282 | 1.94 |
| 103,006 | Spirit Realty Capital Inc Reits USD0.01 | 1,111,950 | 0.84 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|--------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 91.88% (31 May 2016: 96.05%) | | |
| | 米国(つづき) : 49.22% (31 May 2016: 52.50%) | | |
| | 不動産投資信託(つづき) : 47.94% (31 May 2016: 51.55%) | | |
| 20,670 | STAG Industrial Inc Reits USD0.01 | 487,709 | 0.37 |
| 65,274 | STORE Capital Corp Reits USD0.01 | 1,613,247 | 1.22 |
| 19,112 | Sun Communities Inc Reits USD0.01 | 1,378,262 | 1.04 |
| 106,279 | Sunstone Hotel Investors Inc Reits USD0.01 | 1,545,828 | 1.16 |
| 14,363 | Tanger Factory Outlet Centers Inc Reits USD0.01 | 495,164 | 0.37 |
| 5,571 | Vornado Realty Trust Reits USD0.04 | 544,872 | 0.41 |
| 50,386 | Welltower Inc Reits USD1.00 | 3,164,997 | 2.39 |
| | 米国合計 | 65,285,203 | 49.22 |
| | 株式合計 | 121,885,842 | 91.88 |
| | 投資ファンド: 6.76% (31 May 2016: 3.92%) | | |
| 376,889 | iShares FTSE Epra/Nareit Developed Markets Property Fund NPV [†] | 8,965,586 | 6.76 |
| | 投資ファンド合計 | 8,965,586 | 6.76 |
| | 権利証券: 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | スウェーデン: 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 先渡為替契約: -0.20% (31 May 2016: -0.10%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|---------|-----|---------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 315,850 | EUR | 288,227 | 15/12/2016 | 9,900 | 0.01 |
| UBS | USD | 219,163 | EUR | 201,783 | 15/12/2016 | 4,973 | 0.01 |
| UBS | USD | 84,839 | EUR | 76,716 | 15/12/2016 | 3,406 | - |
| UBS | USD | 48,546 | EUR | 44,696 | 15/12/2016 | 1,102 | - |
| UBS | GBP | 150,000 | USD | 186,392 | 15/12/2016 | 1,090 | - |
| UBS | USD | 38,618 | EUR | 35,463 | 15/12/2016 | 973 | - |
| UBS | GBP | 104,300 | USD | 129,482 | 15/12/2016 | 881 | - |
| UBS | USD | 122,340 | GBP | 97,293 | 15/12/2016 | 736 | - |
| UBS | GBP | 153,855 | USD | 191,601 | 15/12/2016 | 699 | - |
| UBS | USD | 90,542 | GBP | 72,005 | 15/12/2016 | 544 | - |
| UBS | USD | 46,001 | EUR | 42,841 | 15/12/2016 | 526 | - |
| UBS | USD | 22,082 | EUR | 20,330 | 15/12/2016 | 501 | - |
| UBS | GBP | 21,249 | USD | 26,168 | 15/12/2016 | 391 | - |
| UBS | GBP | 25,486 | USD | 31,628 | 15/12/2016 | 226 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.20% (31 May 2016: -0.10%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|--------|-----|--------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 5,047 | EUR | 4,647 | 15/12/2016 | 115 | - |
| UBS | GBP | 10,240 | USD | 12,699 | 15/12/2016 | 99 | - |
| UBS | EUR | 10,600 | USD | 11,170 | 15/12/2016 | 82 | - |
| UBS | GBP | 6,587 | USD | 8,162 | 15/12/2016 | 71 | - |
| UBS | USD | 2,832 | EUR | 2,607 | 15/12/2016 | 64 | - |
| UBS | USD | 9,924 | GBP | 7,893 | 15/12/2016 | 60 | - |
| UBS | GBP | 22,856 | USD | 28,521 | 15/12/2016 | 46 | - |
| UBS | GBP | 12,014 | USD | 14,971 | 15/12/2016 | 45 | - |
| UBS | USD | 5,072 | GBP | 4,034 | 15/12/2016 | 31 | - |
| UBS | USD | 4,112 | GBP | 3,270 | 15/12/2016 | 25 | - |
| UBS | GBP | 4,451 | USD | 5,541 | 15/12/2016 | 22 | - |
| UBS | USD | 1,368 | GBP | 1,088 | 15/12/2016 | 8 | - |
| UBS | GBP | 6,476 | USD | 8,088 | 15/12/2016 | 6 | - |
| UBS | USD | 6,838 | GBP | 5,467 | 15/12/2016 | 5 | - |
| UBS | USD | 123 | EUR | 113 | 15/12/2016 | 3 | - |
| UBS | USD | 5 | GBP | 4 | 15/12/2016 | - | - |

先渡為替契約に係る評価益合計

26,630

0.02

| | | | | | | | |
|-----|-----|-----------|-----|-----------|------------|-----------|--------|
| UBS | GBP | 82 | USD | 104 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 3,379 | GBP | 2,719 | 15/12/2016 | (19) | - |
| UBS | USD | 4,533 | GBP | 3,644 | 15/12/2016 | (22) | - |
| UBS | USD | 4,833 | GBP | 3,890 | 15/12/2016 | (28) | - |
| UBS | USD | 8,213 | GBP | 6,616 | 15/12/2016 | (56) | - |
| UBS | EUR | 59,600 | USD | 63,349 | 15/12/2016 | (84) | - |
| UBS | EUR | 3,401 | USD | 3,698 | 15/12/2016 | (88) | - |
| UBS | EUR | 34,300 | USD | 36,831 | 15/12/2016 | (422) | - |
| UBS | GBP | 34,673 | USD | 43,826 | 15/12/2016 | (488) | - |
| UBS | GBP | 102,803 | USD | 129,939 | 15/12/2016 | (1,448) | - |
| UBS | GBP | 125,808 | USD | 159,016 | 15/12/2016 | (1,771) | - |
| UBS | EUR | 77,425 | USD | 84,186 | 15/12/2016 | (2,000) | - |
| UBS | GBP | 249,620 | USD | 315,510 | 15/12/2016 | (3,515) | - |
| UBS | EUR | 137,424 | USD | 149,424 | 15/12/2016 | (3,550) | - |
| UBS | EUR | 594,621 | USD | 646,544 | 15/12/2016 | (15,361) | (0.01) |
| UBS | GBP | 2,262,699 | USD | 2,859,967 | 15/12/2016 | (31,860) | (0.02) |
| UBS | EUR | 1,350,761 | USD | 1,468,711 | 15/12/2016 | (34,894) | (0.03) |
| UBS | GBP | 3,158,343 | USD | 3,992,029 | 15/12/2016 | (44,471) | (0.03) |
| UBS | EUR | 6,450,002 | USD | 7,013,223 | 15/12/2016 | (166,620) | (0.13) |

先渡為替契約に係る評価損合計

(306,698)

(0.22)

先渡為替契約合計

(280,068)

(0.20)

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 130,571,360 | 98.44 |
| 現金および現金等価物 [*] | 3,150,063 | 2.37 |
| その他の純負債 | (1,073,862) | (0.81) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>132,647,561</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 90.74 |
| 投資ファンドおよびAIF | 6.67 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.02 |
| その他の資産 | 2.57 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

† ファンドの純資産の6.75%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。
添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券 : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | アルゼンチン : 0.60% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| | 国債 : 0.60% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| 1,480,000 | Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/04/2021 | 1,546,600 | 0.60 |
| | アルゼンチン合計 | 1,546,600 | 0.60 |
| | オーストラリア : 2.48% (31 May 2016: 2.97%) | | |
| | 社債 : 1.16% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| 675,000 | BlueScope Steel Finance Ltd / BlueScope Steel Finance USA LLC 6.5% 15/05/2021 [†] | 712,313 | 0.27 |
| 2,280,000 | Origin Energy Finance Ltd 3.5% 09/10/2018 | 2,308,527 | 0.89 |
| | 国債 : 1.14% (31 May 2016: 1.76%) | | |
| 3,550,000 | Australia Government Bond 4.25% 21/04/2026 | 2,965,495 | 1.14 |
| | その他資産担保証券 : 0.18% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 469,081 | SMART ABS Series 2015-1US Trust 1.5% 14/09/2018 [†] | 468,441 | 0.18 |
| | オーストラリア合計 | 6,454,776 | 2.48 |
| | ブラジル : 1.98% (31 May 2016: 2.03%) | | |
| | 社債 : 0.47% (31 May 2016: 0.68%) | | |
| 1,200,000 | Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 5.65% 19/03/2022 | 1,233,000 | 0.47 |
| | 国債 : 1.51% (31 May 2016: 1.35%) | | |
| 600,000 | Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 5.75% 26/09/2023 | 606,000 | 0.23 |
| 1,270,000 | Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 6.369% 16/06/2018 | 1,335,088 | 0.51 |
| 1,900,000 | Brazilian Government International Bond 4.25% 07/01/2025 | 1,788,375 | 0.69 |
| 200,000 | Brazilian Government International Bond 6% 17/01/2017 | 201,300 | 0.08 |
| | ブラジル合計 | 5,163,763 | 1.98 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | ブルガリア : 1.65% (31 May 2016: 1.51%) | | |
| | 国債 : 1.65% (31 May 2016: 1.51%) | | |
| 3,850,000 | Bulgaria Government International Bond 2% 26/03/2022 | 4,286,221 | 1.65 |
| | ブルガリア合計 | 4,286,221 | 1.65 |
| | カナダ : 1.65% (31 May 2016: 2.04%) | | |
| | 社債 : 0.88% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| 425,000 | Alberta Energy Co Ltd 7.375% 01/11/2031 | 454,219 | 0.18 |
| 20,000 | Alberta Energy Co Ltd 8.125% 15/09/2030 | 23,114 | 0.01 |
| 195,000 | Encana Corp 3.9% 15/11/2021 | 193,237 | 0.07 |
| 115,000 | Encana Corp 7.2% 01/11/2031 | 124,305 | 0.05 |
| 650,000 | Great Canadian Gaming Corp 6.625% 25/07/2022 | 511,212 | 0.20 |
| 425,000 | Seven Generations Energy Ltd 8.25% 15/05/2020 | 464,157 | 0.17 |
| 500,000 | TransCanada PipeLines Ltd 3.125% 15/01/2019 | 510,757 | 0.20 |
| | 国債 : 0.77% (31 May 2016: 1.45%) | | |
| 2,650,000 | Canadian Government Bond 1.5% 01/06/2023 | 2,001,552 | 0.77 |
| | カナダ合計 | 4,282,553 | 1.65 |
| | ケイマン諸島 : 0.59% (31 May 2016: 1.96%) | | |
| | 社債 : 0.59% (31 May 2016: 1.96%) | | |
| 1,500,000 | Baidu Inc 2.75% 09/06/2019 | 1,522,185 | 0.59 |
| | ケイマン諸島合計 | 1,522,185 | 0.59 |
| | チリ : 0.00% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.15%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | クロアチア : 1.88% (31 May 2016: 1.77%) | | |
| | 国債 : 1.88% (31 May 2016: 1.77%) | | |
| 1,875,000 | Croatia Government International Bond 3% 11/03/2025 | 1,987,988 | 0.76 |
| 2,000,000 | Croatia Government International Bond 3.875% 30/05/2022 | 2,274,016 | 0.87 |
| 200,000 | Croatia Government International Bond 6% 26/01/2024 - Lux | 216,904 | 0.08 |
| 400,000 | Croatia Government International Bond 6.625% 14/07/2020 | 435,144 | 0.17 |
| | クロアチア合計 | 4,914,052 | 1.88 |
| | ドミニカ共和国 : 0.62% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| | 国債 : 0.62% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 600,000 | Dominican Republic International Bond 5.5% 27/01/2025 | 578,904 | 0.22 |
| 350,000 | Dominican Republic International Bond 5.875% 18/04/2024 | 350,784 | 0.14 |
| 160,000 | Dominican Republic International Bond 6.875% 29/01/2026 | 166,131 | 0.06 |
| 550,000 | Dominican Republic International Bond 5.5% 27/01/2025 | 530,662 | 0.20 |
| | ドミニカ共和国合計 | 1,626,481 | 0.62 |
| | フィンランド : 0.91% (31 May 2016: 0.86%) | | |
| | 社債 : 0.91% (31 May 2016: 0.86%) | | |
| 2,000,000 | Citycon OYJ 3.75% 24/06/2020 | 2,376,702 | 0.91 |
| | フィンランド合計 | 2,376,702 | 0.91 |
| | フランス : 0.50% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| | 社債 : 0.50% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 1,305,000 | SFR Group SA 6.25% 15/05/2024 | 1,295,212 | 0.50 |
| | フランス合計 | 1,295,212 | 0.50 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | ドイツ : 0.00% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| | 社債 : 0.00% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| | ハンガリー : 0.89% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| | 国債 : 0.89% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| 551,780,000 | Hungary Government Bond 7% 24/06/2022 | 2,322,700 | 0.89 |
| | ハンガリー合計 | 2,322,700 | 0.89 |
| | アイスランド : 1.70% (31 May 2016: 1.54%) | | |
| | 社債 : 1.02% (31 May 2016: 0.93%) | | |
| 220,000 | Islandsbanki HF 1.75% 07/09/2020 | 238,825 | 0.09 |
| 2,255,000 | Landsbankinn HF 1.625% 15/03/2021 | 2,430,753 | 0.93 |
| | 国債 : 0.68% (31 May 2016: 0.61%) | | |
| 1,545,000 | Iceland Government International Bond 5.875% 11/05/2022 | 1,772,864 | 0.68 |
| | アイスランド合計 | 4,442,442 | 1.70 |
| | インドネシア : 0.95% (31 May 2016: 1.05%) | | |
| | 社債 : 0.62% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 200,000 | Pertamina Persero PT 4.3% 20/05/2023 - Germany | 201,530 | 0.08 |
| 1,360,000 | Perusahaan Gas Negara Persero Tbk 5.125% 16/05/2024 | 1,401,553 | 0.54 |
| | 国債 : 0.33% (31 May 2016: 0.56%) | | |
| 800,000 | Indonesia Government International Bond 4.875% 05/05/2021 | 852,053 | 0.33 |
| | インドネシア合計 | 2,455,136 | 0.95 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | アイルランド : 1.18% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 1.18% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,120,000 | Perrigo Finance Unlimited Co 3.5% 15/12/2021 | 1,134,259 | 0.44 |
| 2,000,000 | Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021 | 1,936,367 | 0.74 |
| | アイルランド合計 | 3,070,626 | 1.18 |
| | イタリア : 0.96% (31 May 2016: 1.57%) | | |
| | 社債 : 0.96% (31 May 2016: 1.57%) | | |
| 1,500,000 | Assicurazioni Generali SpA 2.875% 14/01/2020 | 1,712,196 | 0.66 |
| 700,000 | UniCredit SpA 3.625% 24/01/2019 | 789,264 | 0.30 |
| | イタリア合計 | 2,501,460 | 0.96 |
| | コートジボワール : 0.37% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| | 国債 : 0.37% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 1,000,000 | Ivory Coast Government International Bond 5.375% 23/07/2024 | 962,840 | 0.37 |
| | コートジボワール合計 | 962,840 | 0.37 |
| | ジャマイカ : 0.49% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| | 国債 : 0.49% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 200,000 | Jamaica Government International Bond 6.75% 28/04/2028 | 213,500 | 0.08 |
| 950,000 | Jamaica Government International Bond 7.625% 09/07/2025 | 1,065,017 | 0.41 |
| | ジャマイカ合計 | 1,278,517 | 0.49 |
| | 日本 : 2.40% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 2.40% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 704,300,000 | 日本国債5年 0.10% 20/06/2021 | 6,236,985 | 2.40 |
| | 日本合計 | 6,236,985 | 2.40 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | カザフスタン : 0.20% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| | 社債 : 0.20% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 500,000 | KazMunayGas National Co JSC 6.375% 09/04/2021 | 532,655 | 0.20 |
| | カザフスタン合計 | 532,655 | 0.20 |
| | ケニア : 0.11% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| | 国債 : 0.11% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| 300,000 | Kenya Government International Bond 6.875% 24/06/2024 | 286,425 | 0.11 |
| | ケニア合計 | 286,425 | 0.11 |
| | リトアニア : 2.41% (31 May 2016: 2.24%) | | |
| | 国債 : 2.41% (31 May 2016: 2.24%) | | |
| 5,470,000 | Lithuania Government International Bond 7.375% 11/02/2020 | 6,271,355 | 2.41 |
| | リトアニア合計 | 6,271,355 | 2.41 |
| | ルクセンブルグ : 1.84% (31 May 2016: 1.65%) | | |
| | 社債 : 1.84% (31 May 2016: 1.65%) | | |
| 900,000 | Altice Financing SA 6.5% 15/01/2022 | 929,813 | 0.36 |
| 800,000 | Altice Luxembourg SA 7.75% 15/05/2022 | 840,000 | 0.32 |
| 900,000 | Cosan Luxembourg SA 7% 20/01/2027 | 895,500 | 0.34 |
| 600,000 | Minerva Luxembourg SA 6.50% 20/09/2026 [†] | 566,250 | 0.22 |
| 500,000 | Wind Acquisition Finance SA 4.75% 15/07/2020 | 503,000 | 0.19 |
| 970,000 | Wind Acquisition Finance SA 7% 23/04/2021 | 1,065,633 | 0.41 |
| | ルクセンブルグ合計 | 4,800,196 | 1.84 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | メキシコ : 3.30% (31 May 2016: 3.62%) | | |
| | 社債 : 2.33% (31 May 2016: 1.92%) | | |
| 900,000 | Banco Mercantil del Norte SA FRN 04/10/2031 | 821,250 | 0.32 |
| 1,250,000 | BBVA Bancomer SA/Texas 6.5% 10/03/2021 | 1,325,625 | 0.51 |
| 800,000 | Cemex SAB de CV 7.75% 16/04/2026 | 860,000 | 0.33 |
| 200,000 | Mexico City Airport Trust 4.25% 31/10/2026 [†] | 192,000 | 0.07 |
| 210,000 | Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025 | 186,354 | 0.07 |
| 1,475,000 | Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026 | 1,513,055 | 0.58 |
| 1,200,000 | Trust F/1401 5.25% 30/01/2026 | 1,158,000 | 0.45 |
| | 国債 : 0.97% (31 May 2016: 1.70%) | | |
| 24,473,000 | Mexican Bonos 4.75% 14/06/2018 | 1,167,933 | 0.45 |
| 26,785,000 | Mexican Bonos 8.5% 13/12/2018 | 1,357,033 | 0.52 |
| | メキシコ合計 | 8,581,250 | 3.30 |
| | モロッコ : 0.32% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 社債 : 0.32% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 800,000 | OCP SA 5.625% 25/04/2024 | 827,112 | 0.32 |
| | モロッコ合計 | 827,112 | 0.32 |
| | オランダ : 2.63% (31 May 2016: 1.97%) | | |
| | 社債 : 2.63% (31 May 2016: 1.97%) | | |
| 1,100,000 | Brenntag Finance BV 5.5% 19/07/2018 | 1,268,865 | 0.49 |
| 700,000 | Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/01/2021 | 683,200 | 0.26 |
| 650,000 | Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026 | 699,075 | 0.27 |
| 1,365,000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 1.7% 19/07/2019 | 1,340,343 | 0.52 |
| 2,000,000 | Vonovia Finance BV 0.875% 30/03/2020 | 2,157,313 | 0.83 |
| 700,000 | Yandex NV 1.125% 15/12/2018 | 672,875 | 0.26 |
| | オランダ合計 | 6,821,671 | 2.63 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | パキスタン : 0.50% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 国債 : 0.50% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 1,200,000 | Pakistan Government International Bond 8.25% 15/04/2024 - Luxembourg | 1,303,450 | 0.50 |
| | パキスタン合計 | 1,303,450 | 0.50 |
| | ルーマニア : 0.61% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| | 国債 : 0.61% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 5,700,000 | Romania Government Bond 5.8% 26/07/2027 | 1,588,045 | 0.61 |
| | ルーマニア合計 | 1,588,045 | 0.61 |
| | ロシア連邦 : 0.75% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.75% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 131,300,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 20/07/2022 | 1,938,340 | 0.75 |
| | ロシア連邦合計 | 1,938,340 | 0.75 |
| | セルビア : 0.47% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| | 国債 : 0.47% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 1,100,000 | Serbia International Bond 7.25% 28/09/2021 | 1,229,349 | 0.47 |
| | セルビア合計 | 1,229,349 | 0.47 |
| | シンガポール : 1.81% (31 May 2016: 5.36%) | | |
| | 国債 : 1.81% (31 May 2016: 5.36%) | | |
| 3,350,000 | Singapore Government Bond 1.625% 01/10/2019 | 2,359,079 | 0.91 |
| 3,250,000 | Singapore Government Bond 2.25% 01/06/2021 | 2,329,726 | 0.90 |
| | シンガポール合計 | 4,688,805 | 1.81 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------|--|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | スロベニア : 2.70% (31 May 2016: 2.58%) | | |
| | 国債 : 2.70% (31 May 2016: 2.58%) | | |
| 6,740,000 | Slovenia Government International Bond 4.125% 18/02/2019 | 7,018,793 | 2.70 |
| | スロベニア合計 | 7,018,793 | 2.70 |
| | 南アフリカ : 1.24% (31 May 2016: 0.97%) | | |
| | 社債 : 0.42% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 1,115,000 | Eskom Holdings SOC Ltd 5.75% 26/01/2021 | 1,096,969 | 0.42 |
| | 国債 : 0.82% (31 May 2016: 0.61%) | | |
| 26,760,000 | South Africa Government Bond 8% 21/12/2018 | 1,907,641 | 0.73 |
| 225,000 | South Africa Government International Bond 5.5% 09/03/2020 | 239,330 | 0.09 |
| | 南アフリカ合計 | 3,243,940 | 1.24 |
| | スペイン : 1.29% (31 May 2016: 1.44%) | | |
| | 社債 : 1.29% (31 May 2016: 1.44%) | | |
| 2,000,000 | Santander Consumer Finance SA 0.9% 18/02/2020 | 2,151,160 | 0.83 |
| 1,000,000 | Telefonica Emisiones SAU 4.71% 20/01/2020 | 1,201,232 | 0.46 |
| | スペイン合計 | 3,352,392 | 1.29 |
| | 英国 : 1.98% (31 May 2016: 2.49%) | | |
| | 社債 : 1.98% (31 May 2016: 2.49%) | | |
| 710,000 | HSBC Holdings PLC 2.65% 05/01/2022 | 692,458 | 0.27 |
| 1,630,000 | Nationwide Building Society 4.125% 20/03/2023 | 1,798,313 | 0.69 |
| 845,000 | Santander UK Group Holdings PLC 2.875% 16/10/2020 | 835,600 | 0.32 |
| 1,405,000 | Virgin Media Finance PLC 6.375% 15/10/2024 | 1,816,302 | 0.70 |
| | 英国合計 | 5,142,673 | 1.98 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | 米国 : 47.41% (31 May 2016: 46.74%) | | |
| | 社債 : 11.34% (31 May 2016: 13.96%) | | |
| 1,650,000 | Abbott Laboratories 2.35% 22/11/2019 | 1,652,525 | 0.64 |
| 1,130,000 | Air Lease Corp 2.125% 15/01/2020 | 1,112,971 | 0.43 |
| 927,022 | American Airlines 2016-1 Class B Pass Through Trust 5.25% 15/01/2024 | 955,992 | 0.37 |
| 1,470,000 | Arconic Inc 5.72% 23/02/2019 | 1,557,009 | 0.60 |
| 550,000 | Buckeye Partners LP 5.5% 15/08/2019 | 588,739 | 0.23 |
| 975,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.5% 01/05/2026 | 987,188 | 0.38 |
| 2,785,000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.579% 23/07/2020 | 2,844,797 | 1.09 |
| 775,000 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/06/2024 | 829,250 | 0.32 |
| 440,000 | Citizens Bank NA/Providence RI 2.5% 14/03/2019 | 443,388 | 0.17 |
| 600,000 | CNO Financial Group Inc 5.25% 30/05/2025 | 602,250 | 0.23 |
| 750,000 | Concho Resources Inc 5.5% 01/04/2023 | 774,863 | 0.30 |
| 1,180,000 | Crown Castle International Corp 4.45% 15/02/2026 | 1,216,171 | 0.47 |
| 600,000 | DISH DBS Corp 7.75% 01/07/2026 | 663,750 | 0.26 |
| 975,000 | Dollar Tree Inc 5.75% 01/03/2023 | 1,045,687 | 0.40 |
| 350,000 | Dominion Resources Inc/VA FRN 01/07/2019 | 354,922 | 0.14 |
| 1,310,000 | EnLink Midstream Partners LP 2.7% 01/04/2019 | 1,301,393 | 0.50 |
| 850,000 | First Data Corp 7% 01/12/2023 | 891,973 | 0.34 |
| 100,000 | Harris Corp 2.7% 27/04/2020 | 100,267 | 0.04 |
| 180,000 | Hess Corp 7.3% 15/08/2031 | 198,472 | 0.08 |
| 100,000 | Hess Corp 7.875% 01/10/2029 | 116,174 | 0.04 |
| 450,000 | JC Penney Corp Inc 5.875% 01/07/2023 | 462,375 | 0.18 |
| 1,800,000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 5.3% 15/09/2020 | 1,929,569 | 0.74 |
| 1,175,000 | Match Group Inc 6.75% 15/12/2022 | 1,238,156 | 0.48 |
| 335,000 | Mead Johnson Nutrition Co 3% 15/11/2020 | 339,183 | 0.13 |
| 800,000 | Men's Wearhouse Inc 7% 01/07/2022 | 549,000 | 0.21 |
| 1,490,000 | Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021 | 1,475,317 | 0.57 |
| 1,250,000 | CSC Holdings LLC 10.125% 15/01/2023 | 1,443,750 | 0.56 |
| 800,000 | Post Holdings Inc 7.75% 15/03/2024 | 886,000 | 0.34 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | 米国(つづき) : 47.41% (31 May 2016: 46.74%) | | |
| | 社債(つづき) : 11.34% (31 May 2016: 13.96%) | | |
| 950,000 | T-Mobile USA Inc 6.5% 15/01/2026 | 1,028,375 | 0.40 |
| 875,000 | Univision Communications Inc 5.125% 15/02/2025 | 832,344 | 0.32 |
| 447,000 | Western Digital Corp 10.5% 01/04/2024 | 518,520 | 0.20 |
| 425,000 | Western Digital Corp 7.375% 01/04/2023 | 460,063 | 0.18 |
| | 国債 : 12.88% (31 May 2016: 6.05%) | | |
| 5,345,000 | United States Treasury Note/Bond 1.625% 31/12/2019 | 5,377,049 | 2.07 |
| 7,300,000 | United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/03/2021 | 7,140,597 | 2.75 |
| 5,080,000 | United States Treasury Note/Bond 1.375% 31/05/2021 | 4,989,116 | 1.92 |
| 5,825,000 | United States Treasury Note/Bond 1.125% 30/06/2021 | 5,647,404 | 2.17 |
| 7,065,000 | United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/10/2021 | 6,863,259 | 2.64 |
| 3,695,000 | United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/05/2026 | 3,460,526 | 1.33 |
| | 商業MBS : 1.94% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 735,000 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1 FRN 15/09/2048 | 777,810 | 0.30 |
| 215,000 | COMM 2016-CCRE28 Mortgage Trust Class A-HR 3.651% 12/02/2049 | 217,839 | 0.08 |
| 1,905,000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- C28 Class B 3.986% 19/10/2048 | 1,838,733 | 0.71 |
| 450,000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- C30 Class A-2 3.087% 17/07/2048 | 466,153 | 0.18 |
| 675,000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- C30 Class A-5 3.8218% 17/07/2048 | 708,914 | 0.27 |
| 125,000 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016- JP3 Class B FRN 17/08/2049 | 123,371 | 0.05 |
| 875,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 Class B FRN 16/08/2047 | 897,499 | 0.35 |
| | FNMA 担保証券 : 13.98% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,350,000 | Fannie Mae Pool 3% 15/12/2046 | 7,321,864 | 2.82 |
| 4,061,469 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/01/2041 | 4,192,701 | 1.61 |
| 1,994,549 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/05/2042 | 2,057,113 | 0.79 |
| 3,728,006 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/07/2045 | 3,831,222 | 1.47 |
| 431,099 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/11/2045 | 443,030 | 0.17 |
| 923,263 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/12/2045 | 948,829 | 0.36 |
| 109,384 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/12/2045 | 112,411 | 0.04 |
| 1,081,635 | Fannie Mae Pool 3.5% 01/12/2045 | 1,111,633 | 0.43 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | 米国(つづき) : 47.41% (31 May 2016: 46.74%) | | |
| | FNMA 担保証券(つづき) : 13.98% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,150,000 | Fannie Mae Pool 3.5% 15/12/2046 | 1,181,131 | 0.45 |
| 1,557,218 | Fannie Mae Pool 4% 01/10/2044 | 1,640,910 | 0.63 |
| 3,487,040 | Fannie Mae Pool 4% 01/01/2046 | 3,675,853 | 1.41 |
| 3,595,000 | Fannie Mae Pool 4% 15/12/2046 | 3,787,390 | 1.46 |
| 1,689,138 | Fannie Mae Pool 4.5% 01/06/2044 | 1,826,606 | 0.70 |
| 172,150 | Fannie Mae Pool 5% 01/12/2035 | 189,039 | 0.07 |
| 1,398,316 | Fannie Mae Pool 5% 01/12/2036 | 1,531,509 | 0.59 |
| 2,271,011 | Fannie Mae Pool 5.5% 01/08/2037 | 2,554,404 | 0.98 |
| | GNMA-II 担保証券 : 0.27% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 434,215 | Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2045 | 461,442 | 0.18 |
| 232,357 | Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2045 | 246,645 | 0.09 |
| | その他資産担保証券 : 3.60% (31 May 2016: 26.73%) | | |
| 246,418 | Acer 2015-1A Class A-3 1.61% 13/10/2020 | 246,804 | 0.09 |
| 750,000 | Americredit Automobile Receivables Trust 2013-5 Class C 2.29% 08/11/2019 | 753,759 | 0.29 |
| 1,170,000 | AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2015-3 Class D 3.34% 09/08/2021 | 1,190,817 | 0.46 |
| 750,000 | Capital Auto Receivables Asset Trust 2015-4 A-4 2.01% 20/07/2020 | 752,947 | 0.29 |
| 885,000 | CarMax Auto Owner Trust 2013-1 Class C 1.54% 15/12/2018 | 886,219 | 0.34 |
| 954,446 | Diamond Resorts Owner Trust 2014-1 2.54% 20/05/2027 | 949,705 | 0.36 |
| 1,166,910 | Domino's Pizza Master Issuer LLC 5.216% 25/01/2042 | 1,196,253 | 0.46 |
| 160,000 | GMF Floorplan Owner Revolving Trust 2.41% 17/05/2021 | 159,522 | 0.06 |
| 100,000 | GMF Floorplan Owner Revolving Trust 2.85% 17/05/2021 [†] | 99,464 | 0.04 |
| 886,175 | Marriott Vacation Club Owner Trust 2012-1 2.51% 20/05/2030 | 888,229 | 0.34 |
| 373,980 | Sierra Timeshare 2014-2 Receivables Funding LLC 2.05% 20/06/2031 | 373,637 | 0.14 |
| 318,775 | Sierra Timeshare 2015-3 Receivables Funding LLC 2.58% 20/09/2032 | 319,490 | 0.12 |
| 110,000 | SMB Private Education Loan Trust 2016-A 2.7% 15/05/2031 | 110,025 | 0.04 |
| 1,475,100 | Wendys Funding 2015-1A Class A2I 3.371% 15/06/2045 | 1,478,592 | 0.57 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|--------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 91.58% (31 May 2016: 92.20%) | | |
| | 米国(つづき) : 47.41% (31 May 2016: 46.74%) | | |
| | ホールローンCMO : 3.40% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,040,189 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes FRN 25/04/2024 | 2,054,608 | 0.79 |
| 325,000 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes FRN 25/04/2028 | 333,000 | 0.13 |
| 250,000 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes FRN 25/05/2028 | 255,437 | 0.10 |
| 380,000 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes FRN 25/07/2028 | 390,879 | 0.15 |
| 960,000 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes FRN 25/09/2024 | 981,978 | 0.38 |
| 2,024,152 | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes FRN 25/12/2027 | 2,055,421 | 0.79 |
| 889,843 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2005-AR1 Class M-1 FRN 25/06/2036 | 858,963 | 0.33 |
| 1,150,390 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series MLCC 2006-3 FRN Class II-A-1 25/10/2036 | 1,129,251 | 0.43 |
| 137,913 | Mill City Mortgage Loan Trust 2016-1 Class A-1 2.5% 25/04/2057 | 137,911 | 0.05 |
| 640,440 | Towd Point Mortgage Trust 2015-5 FRN 25/05/2055 | 644,848 | 0.25 |
| | 米国合計 | 123,270,194 | 47.41 |
| | ベトナム : 0.00% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | 国債 : 0.00% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | ザンビア : 0.21% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| | 国債 : 0.21% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 225,000 | Zambia Government International Bond 5.375% 20/09/2022 | 193,413 | 0.08 |
| 350,000 | Zambia Government International Bond 8.97% 30/07/2027 | 331,095 | 0.13 |
| | ザンビア合計 | 524,508 | 0.21 |
| | 債券合計 | 238,160,404 | 91.58 |
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る未収収益 : | | |
| | 0.88% (31 May 2016: 0.86%) | 2,284,337 | 0.88 |

| 契約数 | | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|---------------------------------------|------------------|--------------|
| | 先物契約** : 0.11% (31 May 2016: -0.01%) | | |
| (108) | Euro-BOBL EUX Future December 2016 | 24,059 | 0.01 |
| (582) | US 10 Year Note CBT Future March 2017 | 245,531 | 0.09 |
| 47 | US 5 Year Note CBT Future March 2017 | 1,102 | - |
| (28) | US Long Bond CBT Future March 2017 | 29,750 | 0.01 |
| | 未決済先物契約に係る評価益合計 | 300,442 | 0.11 |
| | 先物契約合計 | 300,442 | 0.11 |

先渡為替契約 : -0.44% (31 May 2016: 1.03%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| Barclays^ | USD | 1,423,150 | PLN | 5,475,000 | 09/12/2016 | 117,187 | 0.05 |
| Barclays^ | USD | 1,798,927 | RON | 7,160,000 | 11/01/2017 | 109,079 | 0.04 |
| Barclays^ | USD | 3,951,624 | ILS | 14,785,000 | 12/12/2016 | 94,528 | 0.04 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | USD | 520,221 | CAD | 688,000 | 30/12/2016 | 8,388 | - |
| Citibank | USD | 9,348,018 | JPY | 977,740,000 | 10/02/2017 | 735,857 | 0.28 |
| Citibank | USD | 8,815,378 | EUR | 7,780,000 | 11/01/2017 | 544,608 | 0.21 |
| Citibank | USD | 3,193,822 | EUR | 2,895,000 | 01/02/2017 | 113,241 | 0.04 |
| Citibank | USD | 3,160,693 | AUD | 4,195,000 | 17/01/2017 | 64,625 | 0.03 |
| Citibank | USD | 3,379,556 | CAD | 4,460,000 | 11/01/2017 | 61,096 | 0.02 |
| Citibank | USD | 1,332,925 | MXN | 27,225,000 | 20/01/2017 | 10,789 | - |
| Credit Suisse Marine Midland Bank | USD | 2,000,213 | RUB | 128,693,695 | 18/01/2017 | 27,998 | 0.01 |
| Northern Trust | USD | 5,044,707 | SGD | 6,855,000 | 11/01/2017 | 258,735 | 0.10 |
| Northern Trust | USD | 2,552,512 | HUF | 703,490,000 | 14/12/2016 | 168,774 | 0.07 |
| Northern Trust | GBP | 14,000 | USD | 17,407 | 15/12/2016 | 91 | - |
| Northern Trust | EUR | 90,000 | USD | 95,652 | 11/01/2017 | 25 | - |
| Royal Bank of Canada | USD | 1,110,616 | EUR | 1,018,000 | 15/12/2016 | 30,020 | 0.01 |
| Royal Bank of Canada | USD | 1,313,638 | MXN | 27,000,000 | 20/01/2017 | 2,429 | - |
| UBS | GBP | 10,712,697 | USD | 13,274,746 | 15/12/2016 | 114,868 | 0.05 |
| UBS | USD | 1,228,007 | EUR | 1,120,610 | 15/12/2016 | 38,493 | 0.01 |
| UBS | GBP | 342,739 | USD | 425,893 | 15/12/2016 | 2,491 | - |
| UBS | USD | 47,234 | EUR | 43,376 | 15/12/2016 | 1,191 | - |
| UBS | USD | 72,511 | EUR | 67,559 | 15/12/2016 | 798 | - |
| UBS | EUR | 76,707 | USD | 81,230 | 15/12/2016 | 194 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.44% (31 May 2016: 1.03%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|--------|-----|--------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 24,513 | EUR | 22,949 | 15/12/2016 | 154 | - |
| UBS | USD | 4,662 | EUR | 4,282 | 15/12/2016 | 117 | - |
| UBS | EUR | 5,137 | USD | 5,413 | 15/12/2016 | 40 | - |
| UBS | EUR | 11,590 | USD | 12,264 | 15/12/2016 | 38 | - |
| UBS | EUR | 20,283 | USD | 21,492 | 15/12/2016 | 38 | - |
| UBS | GBP | 9,848 | USD | 12,272 | 15/12/2016 | 37 | - |
| UBS | EUR | 28,819 | USD | 30,577 | 15/12/2016 | 15 | - |
| UBS | USD | 307 | EUR | 277 | 15/12/2016 | 12 | - |
| UBS | GBP | 194 | USD | 239 | 15/12/2016 | 4 | - |

先渡為替契約に係る評価益合計

| | | | | | | 2,505,960 | 0.96 |
|-----------------|-----|-------------|-----|------------|------------|-----------|--------|
| Bank of America | USD | 1,802,563 | GBP | 1,454,000 | 15/12/2016 | (14,766) | (0.01) |
| Barclays^ | USD | 1,913,122 | ZAR | 27,653,592 | 17/02/2017 | (29,513) | (0.01) |
| Barclays^ | MXN | 48,095,000 | USD | 2,584,460 | 10/02/2017 | (254,968) | (0.10) |
| Chase Manhattan | USD | 13,695 | GBP | 11,000 | 15/12/2016 | (53) | - |
| Citibank | USD | 13,678,509 | EUR | 12,861,000 | 31/01/2017 | (6,305) | - |
| Citibank | CAD | 1,700,000 | USD | 1,284,929 | 11/01/2017 | (20,046) | (0.01) |
| Citibank | USD | 2,305,547 | MXN | 48,095,000 | 10/02/2017 | (23,945) | (0.01) |
| Citibank | JPY | 269,720,000 | USD | 2,402,230 | 10/02/2017 | (26,474) | (0.01) |
| Citibank | ILS | 14,785,000 | USD | 3,917,941 | 15/12/2016 | (60,845) | (0.02) |
| Northern Trust | EUR | 14,000 | USD | 14,872 | 15/12/2016 | (11) | - |
| Northern Trust | PLN | 5,475,000 | USD | 1,411,658 | 09/12/2016 | (105,695) | (0.04) |
| UBS | GBP | 57 | USD | 72 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 754 | GBP | 608 | 15/12/2016 | (5) | - |
| UBS | EUR | 28,099 | USD | 29,851 | 15/12/2016 | (24) | - |
| UBS | USD | 45,699 | GBP | 36,592 | 15/12/2016 | (37) | - |
| UBS | EUR | 26,273 | USD | 27,926 | 15/12/2016 | (37) | - |
| UBS | EUR | 4,700 | USD | 5,046 | 15/12/2016 | (58) | - |
| UBS | USD | 11,692 | EUR | 11,095 | 15/12/2016 | (86) | - |
| UBS | USD | 52,702 | GBP | 42,293 | 15/12/2016 | (160) | - |
| UBS | GBP | 19,047 | USD | 24,075 | 15/12/2016 | (268) | - |
| UBS | EUR | 43,797 | USD | 46,791 | 15/12/2016 | (301) | - |
| UBS | EUR | 30,635 | USD | 32,881 | 15/12/2016 | (362) | - |
| UBS | USD | 59,648 | GBP | 48,095 | 15/12/2016 | (466) | - |
| UBS | USD | 852,776 | GBP | 682,836 | 15/12/2016 | (688) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.44% (31 May 2016: 1.03%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|---------------------|----------------------|
| UBS | EUR | 15,905 | USD | 17,590 | 15/12/2016 | (707) | - |
| UBS | EUR | 21,435 | USD | 23,490 | 15/12/2016 | (737) | - |
| UBS | USD | 577,879 | EUR | 545,727 | 15/12/2016 | (1,404) | - |
| UBS | EUR | 90,380 | USD | 98,272 | 15/12/2016 | (2,335) | - |
| UBS | GBP | 316,273 | USD | 399,757 | 15/12/2016 | (4,453) | - |
| UBS | USD | 873,269 | GBP | 703,700 | 15/12/2016 | (6,274) | - |
| UBS | USD | 1,852,279 | GBP | 1,489,125 | 15/12/2016 | (8,952) | - |
| UBS | GBP | 800,005 | USD | 1,011,177 | 15/12/2016 | (11,264) | - |
| UBS | USD | 11,375,376 | GBP | 9,163,278 | 15/12/2016 | (77,646) | (0.03) |
| UBS | EUR | 3,372,151 | USD | 3,666,611 | 15/12/2016 | (87,112) | (0.04) |
| UBS | EUR | 4,597,635 | USD | 4,999,106 | 15/12/2016 | (118,769) | (0.05) |
| UBS | GBP | 9,407,680 | USD | 11,890,960 | 15/12/2016 | (132,464) | (0.05) |
| UBS | EUR | 13,301,766 | USD | 14,463,290 | 15/12/2016 | (343,620) | (0.13) |
| UBS | GBP | 165,107,390 | USD | 208,689,632 | 15/12/2016 | (2,324,784) | (0.89) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (3,665,635) | (1.40) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (1,159,675) | (0.44) |
| | | | | | | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
| 投資総額 | | | | | | 239,585,508 | 92.13 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 38,455,940 | 14.79 |
| その他の純負債 | | | | | | (18,003,601) | (6.92) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 260,037,847 | 100.00 |

総資産の分析**総資産
比率(%)**

| | |
|---|--------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 82.66 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.96 |
| その他の資産 | 16.38 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーにより担保として保有される85,496米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーである。

† ファンドの純資産の0.57%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|------------------|--------------|
| | 株式 : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | バミューダ : 2.68% (31 May 2016: 2.40%) | | |
| | 化学 : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 12,623 | Axalta Coating Systems Ltd Com USD1.00 | 333,563 | 0.12 |
| | コンピューター : 0.13% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 14,778 | Genpact Ltd Com USD0.01 | 354,007 | 0.13 |
| | 各種金融サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| | 保険 : 2.06% (31 May 2016: 1.73%) | | |
| 9,077 | Argo Group International Holdings Ltd Com USD1.00 | 576,163 | 0.21 |
| 28,892 | Assured Guaranty Ltd Com USD0.01 | 1,033,322 | 0.38 |
| 54,607 | Maiden Holdings Ltd Com USD0.01 | 839,583 | 0.30 |
| 3,190 | White Mountains Insurance Group Ltd Com USD1.00 | 2,679,568 | 0.97 |
| 15,458 | XL Group Ltd Com NPV | 558,884 | 0.20 |
| | 石油・ガス : 0.34% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 58,613 | Nabors Industries Ltd Com USD0.001 | 944,548 | 0.34 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 小売 : 0.00% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| | 半導体 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,169 | Marvell Technology Group Ltd Com USD0.002 | 88,494 | 0.03 |
| | バミューダ合計 | 7,408,132 | 2.68 |
| | カナダ : 0.20% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | 建設資材 : 0.10% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 4,327 | Masonite International Corp Com NPV | 280,498 | 0.10 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.10% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 36,710 | Tesco Corp Com NPV | 285,420 | 0.10 |
| | カナダ合計 | 565,918 | 0.20 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | アイルランド : 0.15% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| | ヘルスケア・サービス : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | 289,493 | 0.10 |
| 3,827 | ICON PLC Com EURO.06 | | |
| | 保険 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 医薬品 : 0.05% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| 2,567 | Alkermes PLC Com USD0.01 | 145,895 | 0.05 |
| | アイルランド合計 | 435,388 | 0.15 |
| | イスラエル : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | 半導体 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | ルクセンブルグ : 0.02% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | コンピューター : 0.02% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 1,458 | Globant SA Com USD1.20 | 49,958 | 0.02 |
| | ルクセンブルグ合計 | 49,958 | 0.02 |
| | オランダ : 0.87% (31 May 2016: 1.01%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.02% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 1,172 | Mobileye NV Com EURO.01 | 43,616 | 0.02 |
| | バイオテクノロジー : 0.01% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 13,288 | Affimed NV Com EURO.01 | 26,908 | 0.01 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.77% (31 May 2016: 0.97%) | | |
| 19,064 | Core Laboratories NV Com EURO.02 | 2,128,782 | 0.77 |
| | 医薬品 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,400 | Patheon NV Com EURO.01 | 202,797 | 0.07 |
| | オランダ合計 | 2,402,103 | 0.87 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | シンガポール : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | 半導体 : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | スイス : 1.15% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| | コンピューター : 1.15% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 129,270 | Logitech International SA Com CHF0.25 | 3,182,099 | 1.15 |
| | スイス合計 | 3,182,099 | 1.15 |
| | 英国 : 0.13% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| | 商業サービス : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,083 | Cardtronics PLC Com NPV | 103,025 | 0.04 |
| | 石油・ガス : 0.05% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 14,352 | Ensco PLC Class A Com USD0.10 | 138,712 | 0.05 |
| | ソフトウェア : 0.04% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 3,599 | Atlassian Corp PLC Class A Com USD0.10 | 97,749 | 0.04 |
| | 英国合計 | 339,486 | 0.13 |
| | 米国 : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 広告 : 0.16% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 18,114 | Interpublic Group of Cos Inc Com USD0.10 | 436,276 | 0.16 |
| | 航空・防衛 : 1.78% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| 2,440 | Curtiss-Wright Corp Com USD1.00 | 245,281 | 0.09 |
| 8,768 | Esterline Technologies Corp Com USD0.20 | 771,365 | 0.28 |
| 3,682 | HEICO Corp Class A Com USD0.01 | 247,614 | 0.09 |
| 1,954 | Moog Inc Class A Com USD1.00 | 136,673 | 0.05 |
| 29,880 | Orbital ATK Inc Com USD0.01 | 2,550,109 | 0.92 |
| 7,620 | Teledyne Technologies Inc Com USD0.01 | 952,233 | 0.35 |
| | 航空 : 0.04% (31 May 2016: 0.04%) | | |
| 6,090 | JetBlue Airways Corp Com USD0.01 | 122,379 | 0.04 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | アパレル : 0.98% (31 May 2016: 0.96%) | | |
| 2,734 | Carter's Inc Com USD0.01 | 249,628 | 0.09 |
| 3,107 | Columbia Sportswear Com NPV | 176,711 | 0.06 |
| 27,850 | Deckers Outdoor Corp Com USD0.01 | 1,656,379 | 0.60 |
| 2,294 | Skechers U.S.A. Inc Com USD0.001 | 52,269 | 0.02 |
| 5,442 | Steven Madden Ltd Com USD0.0001 | 201,490 | 0.07 |
| 16,750 | Wolverine World Wide Inc Com USD1.00 | 377,545 | 0.14 |
| | 自動車製造 : 0.22% (31 May 2016: 0.31%) | | |
| 43,986 | Wabash National Corp Com USD0.01 | 606,347 | 0.22 |
| | 自動車部品・装置 : 0.86% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 23,793 | Cooper Tire & Rubber Co Com USD1.00 | 910,677 | 0.33 |
| 13,959 | Gentherm Inc Com NPV | 444,245 | 0.16 |
| 24,712 | Goodyear Tire & Rubber Co Class C Com NPV | 758,782 | 0.28 |
| 1,828 | Lear Corp Com USD0.01 | 236,699 | 0.09 |
| | 銀行 : 6.81% (31 May 2016: 5.31%) | | |
| 4,159 | Ameris Bancorp Com USD1.00 | 186,427 | 0.07 |
| 10,819 | BancorpSouth Inc Com USD2.50 | 309,153 | 0.11 |
| 21,206 | Bank of the Ozarks Inc Com USD0.01 | 1,029,127 | 0.37 |
| 25,686 | BankUnited Inc Com USD0.01 | 909,670 | 0.33 |
| 2,101 | Carolina Financial Corp Com USD0.001 | 55,761 | 0.02 |
| 19,949 | CoBiz Financial Inc Com USD0.01 | 301,828 | 0.11 |
| 24,653 | East West Bancorp Inc Com USD0.001 | 1,180,879 | 0.43 |
| 16,022 | FCB Financial Holdings Inc Class A Com USD0.001 | 709,374 | 0.26 |
| 12,702 | First Busey Corp Com USD0.001 | 348,225 | 0.13 |
| 6,207 | First Foundation Inc Com USD0.001 | 173,827 | 0.06 |
| 16,865 | Heritage Oaks Bancorp Com NPV | 167,891 | 0.06 |
| 12,188 | Hilltop Holdings Inc Com USD0.01 | 342,422 | 0.12 |
| 27,467 | Home BancShares Inc/AR Com USD0.01 | 710,709 | 0.26 |
| 94,649 | Huntington Bancshares Inc/OH Com USD0.01 | 1,179,800 | 0.43 |
| 4,554 | IBERIABANK Corp Com USD1.00 | 377,071 | 0.14 |
| 21,270 | Lakeland Bancorp Inc Com NPV | 373,820 | 0.14 |
| 9,230 | M&T Bank Corp Com USD0.50 | 1,329,028 | 0.48 |
| 8,939 | MB Financial Inc Com USD0.01 | 386,925 | 0.14 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 銀行(つづき) : 6.81% (31 May 2016: 5.31%) | | |
| 56,427 | Pacific Continental Corp Com NPV | 1,121,487 | 0.41 |
| 31,641 | PacWest Bancorp Com NPV | 1,621,127 | 0.59 |
| 7,261 | QCR Holdings Inc Com USD1.00 | 277,370 | 0.10 |
| 3,259 | Signature Bank/New York NY Com USD0.01 | 488,769 | 0.18 |
| 33,141 | Southwest Bancorp Inc Com USD1.00 | 723,302 | 0.26 |
| 1,796 | SVB Financial Group Com USD0.001 | 283,858 | 0.10 |
| 2,399 | Texas Capital Bancshares Inc Com USD0.01 | 174,467 | 0.06 |
| 10,522 | Towne Bank/Portsmouth VA Com USD1.667 | 339,071 | 0.12 |
| 38,549 | Umpqua Holdings Corp Com NPV | 684,823 | 0.25 |
| 13,265 | United Community Banks Inc/GA Com USD1.00 | 360,476 | 0.13 |
| 10,149 | Western Alliance Bancorp Com USD0.0001 | 474,314 | 0.17 |
| 15,096 | Wintrust Financial Corp Com NPV | 994,223 | 0.36 |
| 28,873 | Zions Bancorporation Com NPV | 1,149,001 | 0.42 |
| | バイオテクノロジー : 0.50% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 7,453 | Aduro Biotech Inc Com USD0.0001 | 85,151 | 0.03 |
| 800 | Alder Biopharmaceuticals Inc Com USD0.0001 | 18,860 | 0.01 |
| 1,859 | Alnylam Pharmaceuticals Inc Com USD0.01 | 81,517 | 0.03 |
| 8,885 | ARIAD Pharmaceuticals Inc Com USD0.001 | 119,814 | 0.04 |
| 1,089 | Bluebird Bio Inc Com USD0.01 | 65,748 | 0.02 |
| 9,057 | Cambrex Corp Com USD0.10 | 453,982 | 0.16 |
| 5,598 | Cytokinetics Inc Com USD0.001 | 67,316 | 0.02 |
| 1,686 | Five Prime Therapeutics Inc Com USD0.001 | 96,945 | 0.04 |
| 6,841 | GlycoMimetics Inc Com USD0.001 | 43,475 | 0.02 |
| 3,990 | Karyopharm Therapeutics Inc Com USD0.0001 | 36,868 | 0.01 |
| 2,433 | Loxo Oncology Inc Com USD0.0001 | 67,017 | 0.02 |
| 4,000 | Nivalis Therapeutics Inc Com USD0.001 | 8,660 | - |
| 4,025 | Otonomy Inc Com USD0.001 | 68,626 | 0.02 |
| 2,394 | PTC Therapeutics Inc Com USD0.001 | 26,645 | 0.01 |
| 5,607 | Syndax Pharmaceuticals Inc Com USD0.0001 | 54,108 | 0.02 |
| 1,904 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc Class I Com USD0.001 | 149,055 | 0.05 |
| | 建設資材 : 4.69% (31 May 2016: 3.93%) | | |
| 16,411 | Apogee Enterprises Inc Com USD0.333 | 782,887 | 0.28 |
| 39,960 | Armstrong World Industries Inc Com USD0.01 | 1,665,333 | 0.60 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 建設資材(つづき) : 4.69% (31 May 2016: 3.93%) | | |
| 11,757 | Boise Cascade Co Class C Com USD0.01 | 268,354 | 0.10 |
| 43,556 | Builders FirstSource Inc Com USD0.01 | 481,947 | 0.17 |
| 8,361 | Drew Industries Inc Com USD0.01 | 878,950 | 0.32 |
| 1,589 | Fortune Brands Home & Security Inc Com USD0.01 | 87,673 | 0.03 |
| 14,190 | Headwaters Inc Com USD0.001 | 336,090 | 0.12 |
| 15,370 | Martin Marietta Materials Inc Com USD0.01 | 3,374,868 | 1.22 |
| 8,337 | Owens Corning Com USD0.001 | 428,397 | 0.16 |
| 13,516 | PGT Inc Com USD0.01 | 150,365 | 0.05 |
| 26,081 | Summit Materials Inc Class A Com USD0.01 | 620,337 | 0.22 |
| 11,021 | Universal Forest Products Inc Com NPV | 1,094,771 | 0.40 |
| 98,623 | USG Corp Com USD0.10 | 2,826,042 | 1.02 |
| | 化学 : 2.00% (31 May 2016: 1.80%) | | |
| 1,700 | AdvanSix Inc Com USD0.01 | 31,798 | 0.01 |
| 7,691 | Cabot Corp Com USD1.00 | 391,741 | 0.14 |
| 5,184 | Celanese Corp Class A Com USD0.0001 | 411,273 | 0.15 |
| 7,290 | NewMarket Corp Com NPV | 3,058,556 | 1.11 |
| 8,848 | Sensient Technologies Corp Com USD0.10 | 691,073 | 0.25 |
| 15,971 | Westlake Chemical Corp Com USD0.01 | 944,924 | 0.34 |
| | 石炭 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,144 | Arch Coal Inc Com NPV | 167,457 | 0.06 |
| | 商業サービス : 1.67% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 8,171 | Aramark Com USD0.01 | 281,123 | 0.10 |
| 8,570 | Deluxe Corp Com USD1.00 | 580,318 | 0.21 |
| 4,345 | Huron Consulting Group Inc Com USD0.01 | 229,525 | 0.08 |
| 17,249 | LendingTree Inc Com USD0.01 | 1,808,126 | 0.66 |
| 2,596 | ManpowerGroup Inc Com USD0.01 | 221,737 | 0.08 |
| 4,992 | PAREXEL International Corp Com USD0.01 | 294,553 | 0.11 |
| 3,630 | Paylocity Holding Corp Com USD0.001 | 120,171 | 0.04 |
| 2,309 | Robert Half International Inc Com USD0.001 | 103,616 | 0.04 |
| 4,141 | TransUnion Com USD0.01 | 123,505 | 0.04 |
| 13,145 | TriNet Group Inc Com USD0.000025 | 331,714 | 0.12 |
| 4,638 | WEX Inc Com USD0.01 | 512,429 | 0.19 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | コンピューター : 2.19% (31 May 2016: 3.18%) | | |
| 2,328 | CACI International Inc Class A Com USD0.10 | 301,301 | 0.11 |
| 27,378 | CSRA Inc Com USD0.001 | 876,507 | 0.32 |
| 18,090 | DST Systems Inc Com USD0.01 | 1,867,431 | 0.68 |
| 828 | EPAM Systems Inc Com USD0.001 | 54,569 | 0.02 |
| 6,094 | ExIService Holdings Inc Com USD0.001 | 289,800 | 0.11 |
| 14,418 | Lumentum Holdings Inc Com USD0.001 | 578,522 | 0.21 |
| 11,469 | Pure Storage Inc Class A Com USD0.0001 | 159,935 | 0.06 |
| 111,258 | VeriFone Systems Inc Com USD0.01 | 1,878,591 | 0.68 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 1.23% (31 May 2016: 1.04%) | | |
| 61,174 | Avon Products Inc Com USD0.25 | 328,810 | 0.12 |
| 22,290 | Coty Inc Class A Com USD0.01 | 416,823 | 0.15 |
| 31,710 | Edgewell Personal Care Co Class C Com USD0.01 | 2,510,005 | 0.91 |
| 4,614 | Revlon Inc Com USD0.01 | 128,154 | 0.05 |
| | 販売/卸売 : 0.54% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 4,613 | Beacon Roofing Supply Inc Com USD0.01 | 213,997 | 0.08 |
| 9,684 | HD Supply Holdings Inc Com USD0.01 | 379,952 | 0.14 |
| 9,403 | ScanSource Inc Com NPV | 355,668 | 0.13 |
| 5,326 | SiteOne Landscape Supply Inc Com USD0.01 | 178,341 | 0.06 |
| 5,213 | WESCO International Inc Com USD0.01 | 353,572 | 0.13 |
| | 各種金融サービス : 3.81% (31 May 2016: 3.76%) | | |
| 13,246 | Affiliated Managers Group Inc Com USD0.01 | 1,963,455 | 0.71 |
| 2,859 | Cohen & Steers Inc Com USD0.01 | 101,766 | 0.04 |
| 37,600 | Eaton Vance Corp Com USD0.00390625 | 1,520,920 | 0.55 |
| 9,068 | Ellie Mae Inc Com USD0.0001 | 748,609 | 0.27 |
| 2,753 | Evercore Partners Inc Class A Com USD0.01 | 185,483 | 0.07 |
| 24,503 | Greenhill & Co Inc Com USD0.01 | 679,346 | 0.25 |
| 4,696 | Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Reits USD0.01 | 93,333 | 0.03 |
| 5,698 | Investment Technology Group Inc Com USD0.01 | 106,296 | 0.04 |
| 5,205 | Legg Mason Inc Com USD0.10 | 166,066 | 0.06 |
| 201,683 | LendingClub Corp Com USD0.01 | 1,142,534 | 0.41 |
| 15,780 | Piper Jaffray Cos Com USD0.01 | 1,149,573 | 0.42 |
| 2,993 | Raymond James Financial Inc Com USD0.01 | 215,227 | 0.08 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 各種金融サービス(つづき) : 3.81% (31 May 2016: 3.76%) | | |
| 16,697 | Stifel Financial Corp Com USD0.15 | 831,845 | 0.30 |
| 4,717 | WageWorks Inc Com USD0.001 | 348,468 | 0.13 |
| 111,596 | WisdomTree Investments Inc Com USD0.01 | 1,234,252 | 0.45 |
| | 電気 : 1.14% (31 May 2016: 1.35%) | | |
| 9,818 | ALLETE Inc Com NPV | 606,801 | 0.22 |
| 13,294 | Avista Corp Com NPV | 538,075 | 0.20 |
| 8,055 | Black Hills Corp Com USD1.00 | 473,272 | 0.17 |
| 5,406 | Empire District Electric Co Class C Com USD1.00 | 183,993 | 0.07 |
| 28,254 | OGE Energy Corp Com USD0.01 | 894,663 | 0.32 |
| 2,719 | Pinnacle West Capital Corp Com NPV | 201,029 | 0.07 |
| 8,154 | PNM Resources Inc Com NPV | 257,463 | 0.09 |
| | 電気部品・設備 : 1.61% (31 May 2016: 2.04%) | | |
| 9,079 | Belden Inc Com USD0.01 | 671,256 | 0.24 |
| 18,673 | Encore Wire Corp Com USD0.01 | 794,069 | 0.29 |
| 57,844 | Energizer Holdings Inc Com USD0.01 | 2,596,328 | 0.94 |
| 1,554 | Generac Holdings Inc Com USD0.01 | 63,675 | 0.02 |
| 2,942 | Hubbell Inc Com USD0.01 | 330,445 | 0.12 |
| 1,935 | SunPower Corp Com USD0.001 | 13,071 | - |
| | 電子 : 2.17% (31 May 2016: 2.09%) | | |
| 3,367 | Arrow Electronics Inc Com USD1.00 | 229,949 | 0.08 |
| 9,508 | Benchmark Electronics Inc Com USD0.10 | 269,789 | 0.10 |
| 806 | Coherent Inc Com USD0.01 | 105,207 | 0.04 |
| 4,897 | Itron Inc Com NPV | 314,143 | 0.11 |
| 18,682 | Jabil Circuit Inc Com USD0.001 | 395,218 | 0.14 |
| 12,044 | Methode Electronics Inc Com USD0.50 | 445,628 | 0.16 |
| 2,402 | National Instruments Corp Com USD0.01 | 70,799 | 0.03 |
| 17,465 | Plexus Corp Com USD0.01 | 892,374 | 0.32 |
| 18,065 | Rogers Corp Com USD1.00 | 1,342,681 | 0.49 |
| 28,976 | Trimble Inc Com NPV | 816,978 | 0.30 |
| 2,747 | Watts Water Technologies Inc Class A Com USD0.10 | 187,689 | 0.07 |
| 13,379 | Woodward Inc Com USD0.00292 | 906,093 | 0.33 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 代替エネルギー資源 : 0.07% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 2,927 | First Solar Inc Com USD0.001 | 88,732 | 0.03 |
| 5,443 | Pattern Energy Group Inc Com USD0.01 | 106,819 | 0.04 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.18% (31 May 2016: 0.05%) | | |
| 13,950 | TopBuild Corp Com NPV | 506,315 | 0.18 |
| | 娯楽 : 0.59% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 22,076 | Gaming and Leisure Properties Inc Reits USD0.01 | 673,428 | 0.24 |
| 22,431 | National CineMedia Inc Com USD0.01 | 344,204 | 0.12 |
| 16,543 | Pinnacle Entertainment Inc Com USD0.01 | 225,481 | 0.08 |
| 2,582 | Vail Resorts Inc Com USD0.01 | 408,924 | 0.15 |
| | 環境規制 : 0.29% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 4,211 | Advanced Disposal Services Inc Com USD0.01 | 84,515 | 0.03 |
| 10,630 | Advanced Emissions Solutions Inc Com NPV | 96,042 | 0.03 |
| 12,052 | Clean Harbors Inc Com USD0.01 | 636,888 | 0.23 |
| | 食品 : 0.80% (31 May 2016: 1.00%) | | |
| 16,610 | Hostess Brands Inc Com USD0.0001 | 214,933 | 0.08 |
| 7,901 | Ingredion Inc Com USD0.01 | 927,538 | 0.34 |
| 7,406 | Post Holdings Inc Com USD0.01 | 565,522 | 0.20 |
| 6,082 | Sanderson Farms Inc Com USD1.00 | 490,544 | 0.18 |
| | 林産品・紙製品 : 0.38% (31 May 2016: 0.41%) | | |
| 12,206 | Neenah Paper Inc Com USD0.01 | 1,036,595 | 0.38 |
| | ガス : 1.08% (31 May 2016: 1.22%) | | |
| 3,255 | Atmos Energy Corp Com NPV | 231,512 | 0.08 |
| 26,211 | CenterPoint Energy Inc Com USD0.01 | 625,526 | 0.23 |
| 27,270 | South Jersey Industries Inc Com USD1.25 | 900,046 | 0.33 |
| 3,051 | Spire Inc Com USD1.00 | 196,713 | 0.07 |
| 18,594 | UGI Corp Com NPV | 833,104 | 0.30 |
| 2,691 | WGL Holdings Inc Com NPV | 195,407 | 0.07 |
| | 工具・工作機械 : 0.00% (31 May 2016: 0.12%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | ヘルスケア用品 : 2.87% (31 May 2016: 3.71%) | | |
| 21,180 | ABIOMED Inc Com USD0.01 | 2,377,349 | 0.86 |
| 18,423 | AtriCure Inc Com USD0.001 | 331,522 | 0.12 |
| 32,495 | Bio-Techne Corp Com USD0.01 | 3,424,323 | 1.24 |
| 5,965 | Cardiovascular Systems Inc Com NPV | 144,323 | 0.05 |
| 23,867 | Endologix Inc Com USD0.001 | 175,542 | 0.06 |
| 13,059 | Globus Medical Inc Class A Com USD0.001 | 282,531 | 0.10 |
| 13,895 | Hill-Rom Holdings Inc Com NPV | 741,020 | 0.27 |
| 6,103 | Quidel Corp Com USD0.001 | 139,972 | 0.05 |
| 2,150 | Teleflex Inc Com USD1.00 | 317,770 | 0.12 |
| | ヘルスケア・サービス : 1.63% (31 May 2016: 1.41%) | | |
| 7,258 | Acadia Healthcare Co Inc Com USD0.01 | 275,949 | 0.10 |
| 14,462 | Centene Corp Com USD0.001 | 833,662 | 0.30 |
| 39,768 | Envision Healthcare Holdings Inc Com USD0.01 | 903,728 | 0.33 |
| 4,648 | LifePoint Health Inc Com USD0.01 | 255,524 | 0.09 |
| 11,182 | Magellan Health Inc Com USD0.01 | 813,490 | 0.29 |
| 13,463 | Teladoc Inc Com USD0.001 | 246,709 | 0.09 |
| 53,330 | Tenet Healthcare Corp Com USD0.05 | 813,016 | 0.29 |
| 2,791 | WellCare Health Plans Inc Com USD0.01 | 382,521 | 0.14 |
| | 各種持株会社 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,762 | Conyers Park Acquisition Corp Com NPV | 75,092 | 0.03 |
| | 住宅建設 : 0.52% (31 May 2016: 0.55%) | | |
| 15,248 | Meritage Homes Corp Com USD0.01 | 550,072 | 0.20 |
| 828 | Toll Brothers Inc Com USD0.01 | 24,571 | 0.01 |
| 26,075 | Winnebago Industries Inc Com USD0.50 | 846,786 | 0.31 |
| | 住宅家具 : 1.89% (31 May 2016: 1.58%) | | |
| 8,257 | American Woodmark Corp Com NPV | 633,105 | 0.23 |
| 19,020 | Ethan Allen Interiors Inc Com USD0.01 | 656,665 | 0.24 |
| 11,026 | Harman International Industries Inc Com USD0.01 | 1,206,024 | 0.44 |
| 1,592 | iRobot Corp Com USD0.01 | 90,752 | 0.03 |
| 31,910 | Tempur Sealy International Inc Class I Com USD0.01 | 2,020,063 | 0.73 |
| 3,792 | Whirlpool Corp Com USD1.00 | 615,954 | 0.22 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.93% (31 May 2016: 0.98%) | | |
| 21,340 | Spectrum Brands Holdings Inc Com USD0.01 | 2,554,398 | 0.93 |
| | 保険 : 2.86% (31 May 2016: 2.41%) | | |
| 1,084 | Alleghany Corp Com USD1.00 | 617,127 | 0.22 |
| 36,361 | American Equity Investment Life Holding Co Com USD1.00 | 753,582 | 0.27 |
| 3,925 | Assurant Inc Com USD0.01 | 338,943 | 0.12 |
| 19,000 | Horace Mann Educators Corp Com USD0.001 | 763,325 | 0.28 |
| 5,848 | Kemper Corp Com USD0.10 | 239,622 | 0.09 |
| 14,484 | Lincoln National Corp Com NPV | 928,786 | 0.34 |
| 161,100 | MBIA Inc Com USD1.00 | 1,674,634 | 0.61 |
| 21,741 | MGIC Investment Corp Com USD1.00 | 197,082 | 0.07 |
| 11,789 | Reinsurance Group of America Inc Com USD0.01 | 1,438,376 | 0.52 |
| 13,323 | Torchmark Corp Com USD1.00 | 933,876 | 0.34 |
| | インターネット : 2.95% (31 May 2016: 4.37%) | | |
| 11,100 | Blucora Inc Com USD0.0001 | 157,342 | 0.06 |
| 1,870 | GoDaddy Inc Com USD0.001 | 66,076 | 0.02 |
| 1,666 | GrubHub Inc Com USD0.0001 | 61,684 | 0.02 |
| 45,432 | NIC Inc Com NPV | 1,139,207 | 0.41 |
| 172,740 | Pandora Media Inc Com USD0.0001 | 2,008,102 | 0.73 |
| 63,875 | Quotient Technology Inc Com USD0.00001 | 816,003 | 0.30 |
| 27,497 | Shutterstock Inc Com USD0.01 | 1,293,734 | 0.47 |
| 19,891 | Wayfair Inc Class A Com USD0.001 | 724,729 | 0.26 |
| 43,982 | Yelp Inc Com USD0.000001 | 1,635,910 | 0.59 |
| 5,896 | Zendesk Inc Com USD0.01 | 125,496 | 0.05 |
| 761 | Zillow Group Inc Class A Com USD0.0001 | 26,749 | 0.01 |
| 2,058 | Zillow Group Inc Class C Com USD0.001 | 73,934 | 0.03 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.76% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 3,269 | Carpenter Technology Corp Com USD5.00 | 116,916 | 0.04 |
| 11,482 | Commercial Metals Co Class C Com USD0.01 | 252,776 | 0.09 |
| 15,031 | Reliance Steel & Aluminum Co Com NPV | 1,219,540 | 0.44 |
| 14,564 | Steel Dynamics Inc Com USD0.005 | 516,804 | 0.19 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 余暇 : 1.79% (31 May 2016: 1.10%) | | |
| 12,028 | Brunswick Corp/DE Com USD0.75 | 603,264 | 0.22 |
| 159,698 | Liberty TripAdvisor Holdings Inc Class A Com USD0.01 | 2,563,153 | 0.93 |
| 24,566 | Lindblad Expeditions Holdings Inc Com USD0.0001 | 235,097 | 0.09 |
| 37,950 | Vista Outdoor Inc Com USD0.01 | 1,523,882 | 0.55 |
| | 宿泊施設 : 0.06% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 6,596 | Monarch Casino & Resort Inc Com USD0.01 | 164,207 | 0.06 |
| | 建設機械・採掘機械 : 0.35% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 14,554 | Astec Industries Inc Com USD0.20 | 965,076 | 0.35 |
| | 各種機械 : 3.39% (31 May 2016: 3.45%) | | |
| 3,588 | AGCO Corp Com USD0.01 | 200,228 | 0.07 |
| 11,861 | Alamo Group Inc Com USD0.10 | 866,920 | 0.31 |
| 14,798 | Altra Industrial Motion Corp Com USD0.001 | 517,560 | 0.19 |
| 570 | Cognex Corp Com USD0.002 | 34,038 | 0.01 |
| 40,513 | Graco Inc Com USD1.00 | 3,289,656 | 1.19 |
| 3,995 | IDEX Corp Com USD0.01 | 374,152 | 0.14 |
| 5,315 | Middleby Corp Com USD0.01 | 727,677 | 0.26 |
| 7,548 | Xylem Inc/NY Com USD0.01 | 389,364 | 0.14 |
| 37,851 | Zebra Technologies Corp Class A Com USD0.01 | 2,992,689 | 1.08 |
| | メディア : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 8,229 | Liberty Media Corp-Liberty Braves Com USD0.01 | 163,551 | 0.06 |
| 5,229 | Liberty Media Corp-Liberty Media Com USD0.01 | 162,857 | 0.06 |
| | 金属加工/金属製品 : 0.23% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| 18,462 | Advanced Drainage Systems Inc Class I Com USD0.01 | 375,240 | 0.14 |
| 20,596 | LB Foster Co Class A Com USD0.01 | 251,786 | 0.09 |
| | 鉱業 : Mining: 0.11% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 2,083 | Kaiser Aluminum Corp Com USD0.01 | 171,598 | 0.06 |
| 9,789 | Stillwater Mining Co Com USD0.01 | 147,276 | 0.05 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 各種製造業 : 1.52% (31 May 2016: 1.57%) | | |
| 5,780 | AO Smith Corp Com USD1.00 | 280,908 | 0.10 |
| 8,340 | Carlisle Cos Inc Com USD1.00 | 935,540 | 0.34 |
| 5,452 | Chase Corp Com USD0.10 | 438,613 | 0.16 |
| 10,406 | CLARCOR Inc Com USD1.00 | 733,467 | 0.27 |
| 4,529 | Colfax Corp Com USD0.001 | 170,358 | 0.06 |
| 31,910 | Sturm Ruger & Co Inc Com USD1.00 | 1,639,376 | 0.59 |
| | 石油・ガス : 2.51% (31 May 2016: 1.81%) | | |
| 17,664 | Callon Petroleum Co Class C Com USD0.01 | 312,035 | 0.11 |
| 34,950 | Cobalt International Energy Inc Com USD0.01 | 47,008 | 0.02 |
| 3,540 | Diamondback Energy Inc Com USD0.01 | 381,736 | 0.14 |
| 1,838 | Energen Corp Com USD0.01 | 114,057 | 0.04 |
| 4,369 | Extraction Oil & Gas Inc Com NPV | 102,715 | 0.04 |
| 12,680 | Helmerich & Payne Inc Com USD0.10 | 959,686 | 0.35 |
| 5,845 | Laredo Petroleum Inc Com USD0.01 | 93,432 | 0.03 |
| 26,304 | Newfield Exploration Co Class C Com USD0.01 | 1,189,335 | 0.43 |
| 11,351 | Oasis Petroleum Inc Com USD0.01 | 169,868 | 0.06 |
| 34,156 | Parsley Energy Inc Class A Com USD0.01 | 1,302,198 | 0.47 |
| 17,799 | Patterson-UTL Energy Inc Com USD0.01 | 474,788 | 0.17 |
| 1,100 | PDC Energy Inc Com USD0.01 | 81,890 | 0.03 |
| 3,607 | QEP Resources Inc Com USD0.01 | 70,896 | 0.03 |
| 20,219 | Rice Energy Inc Com USD0.01 | 492,232 | 0.18 |
| 21,943 | Synergy Resources Corp Com USD0.001 | 206,813 | 0.07 |
| 25,812 | Western Refining Inc Com USD0.01 | 925,747 | 0.34 |
| | 石油・ガス・サービス : 1.22% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 50,799 | Helix Energy Solutions Group Inc Com NPV | 531,104 | 0.19 |
| 15,128 | Natural Gas Services Group Inc Com USD0.01 | 431,148 | 0.16 |
| 29,811 | NOW Inc Com USD0.01 | 641,980 | 0.23 |
| 9,250 | Oceaneering International Inc Com USD0.25 | 246,466 | 0.09 |
| 13,336 | Oil States International Inc Com USD0.01 | 479,096 | 0.17 |
| 34,191 | RPC Inc Com USD0.10 | 686,726 | 0.25 |
| 6,499 | Targa Resources Corp Com USD0.001 | 345,942 | 0.13 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 包装・容器 : 0.47% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| 7,536 | Crown Holdings Inc Com USD5.00 | 409,845 | 0.15 |
| 40,357 | Graphic Packaging Holding Co Class C Com USD0.01 | 507,489 | 0.18 |
| 9,262 | Owens-Illinois Inc Com USD0.01 | 170,189 | 0.06 |
| 2,547 | Packaging Corp of America Com USD0.01 | 215,909 | 0.08 |
| | 医薬品 : 0.44% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 4,163 | Aerie Pharmaceuticals Inc Com USD0.001 | 154,760 | 0.06 |
| 3,298 | Chiasma Inc Com USD0.01 | 6,678 | - |
| 3,287 | Dexcom Inc Com USD0.001 | 214,575 | 0.08 |
| 2,410 | Global Blood Therapeutics Inc Com USD0.001 | 46,212 | 0.02 |
| 7,869 | MyoKardia Inc Com USD0.0001 | 124,133 | 0.04 |
| 6,300 | Owens & Minor Inc Com USD2.00 | 213,665 | 0.08 |
| 3,520 | Portola Pharmaceuticals Inc Com USD0.001 | 63,342 | 0.02 |
| 3,324 | Ra Pharmaceuticals Inc Com USD0.0001 | 43,445 | 0.02 |
| 6,410 | Regulus Therapeutics Inc Com USD0.001 | 15,865 | 0.01 |
| 1,646 | TESARO Inc Com USD0.0001 | 223,362 | 0.08 |
| 13,064 | Trevena Inc Com USD0.001 | 71,656 | 0.03 |
| | パイプライン : 0.06% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 4,351 | SemGroup Corp Class A Com USD0.01 | 156,962 | 0.06 |
| | 不動産 : 0.18% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 23,766 | Kennedy-Wilson Holdings Inc Com USD0.0001 | 507,998 | 0.18 |
| | 不動産投資信託 : 7.59% (31 May 2016: 8.48%) | | |
| 10,766 | Alexandria Real Estate Equities Inc Reits USD0.01 | 1,180,546 | 0.43 |
| 13,125 | American Assets Trust Inc Reits USD0.01 | 525,853 | 0.19 |
| 5,341 | Apartment Investment & Management Co Class A Reits USD0.01 | 224,963 | 0.08 |
| 28,405 | Brixmor Property Group Inc Reits USD0.01 | 691,236 | 0.25 |
| 3,540 | CoreSite Realty Corp Reits USD0.01 | 249,871 | 0.09 |
| 7,620 | Corporate Office Properties Trust Reits USD0.01 | 218,123 | 0.08 |
| 17,005 | Douglas Emmett Inc Reits USD0.01 | 623,828 | 0.23 |
| 28,413 | Duke Realty Corp Reits USD0.01 | 722,685 | 0.26 |
| 15,575 | Empire State Realty Trust Inc Reits USD0.01 | 314,537 | 0.11 |
| 128,538 | Equity Commonwealth Reits USD0.01 | 3,739,813 | 1.36 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 不動産投資信託(つづき) : 7.59% (31 May 2016: 8.48%) | | |
| 6,359 | Equity LifeStyle Properties Inc Reits USD0.01 | 441,569 | 0.16 |
| 10,745 | Equity One Inc Reits USD0.01 | 321,007 | 0.12 |
| 54,550 | First Industrial Realty Trust Inc Reits USD0.01 | 1,443,120 | 0.52 |
| 10,312 | LaSalle Hotel Properties Reits USD0.01 | 289,509 | 0.11 |
| 127,779 | Outfront Media Inc Reits USD0.01 | 3,223,225 | 1.17 |
| 16,606 | Physicians Realty Trust Reits USD0.01 | 300,984 | 0.11 |
| 26,406 | Potlatch Corp Reits USD1.00 | 1,084,626 | 0.39 |
| 10,818 | Redwood Trust Inc Reits USD0.01 | 164,704 | 0.06 |
| 5,957 | Regency Centers Corp Reits USD0.01 | 398,196 | 0.14 |
| 41,672 | Retail Opportunity Investments Corp Reits USD0.0001 | 859,902 | 0.31 |
| 19,394 | Rexford Industrial Realty Inc Class I Reits USD0.01 | 428,510 | 0.16 |
| 36,600 | Sabra Health Care Inc Reits USD0.01 | 809,592 | 0.29 |
| 31,173 | STAG Industrial Inc Reits USD0.01 | 735,527 | 0.27 |
| 10,218 | STORE Capital Corp Reits USD0.01 | 252,538 | 0.09 |
| 9,826 | Sun Communities Inc Reits USD0.01 | 708,602 | 0.26 |
| 13,316 | Taubman Centers Inc Reits USD0.01 | 967,474 | 0.35 |
| | 小売 : 8.98% (31 May 2016: 10.83%) | | |
| 1,528 | American Eagle Outfitters Inc Com USD0.01 | 25,296 | 0.01 |
| 1,284 | Burlington Stores Inc Com USD0.0001 | 112,896 | 0.04 |
| 10,857 | Cabela's Inc Com USD0.01 | 675,577 | 0.25 |
| 39,270 | CarMax Inc Com USD0.50 | 2,271,180 | 0.82 |
| 2,204 | Cheesecake Factory Inc Com USD0.01 | 130,433 | 0.05 |
| 9,570 | Chico's FAS Inc Com USD0.01 | 146,565 | 0.05 |
| 47,360 | Copart Inc Com NPV | 2,591,539 | 0.94 |
| 34,908 | DineEquity Inc Com USD0.01 | 2,917,785 | 1.06 |
| 27,620 | Dollar Tree Inc Com USD0.01 | 2,435,255 | 0.88 |
| 5,389 | DSW Inc Class A Com NPV | 128,070 | 0.05 |
| 65,408 | Dunkin' Brands Group Inc Com USD0.001 | 3,551,654 | 1.29 |
| 8,884 | Five Below Inc Com USD0.01 | 349,630 | 0.13 |
| 2,493 | Foot Locker Inc Com USD0.01 | 178,698 | 0.06 |
| 2,631 | Jack in the Box Inc Com USD0.01 | 273,729 | 0.10 |
| 23,797 | Jamba Inc Com USD0.001 | 236,423 | 0.09 |
| 9,772 | Kate Spade & Co Class C Com USD1.00 | 145,065 | 0.05 |
| 24,800 | MSC Industrial Direct Co Inc Class A Com USD0.001 | 2,215,508 | 0.80 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 小売(つづき) : 8.98% (31 May 2016: 10.83%) | | |
| 1,284 | Panera Bread Co Class A Com USD0.0001 | 272,375 | 0.10 |
| 18,090 | PriceSmart Inc Com USD0.0001 | 1,651,165 | 0.60 |
| 137,852 | Sally Beauty Holdings Inc Com USD0.01 | 3,609,655 | 1.31 |
| 9,242 | Texas Roadhouse Inc Com USD0.001 | 433,450 | 0.16 |
| 12,284 | Wingstop Inc Com USD0.01 | 376,812 | 0.14 |
| | 貯蓄貸付組合 : 0.43% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 18,729 | Sterling Bancorp/DE Com USD0.01 | 426,553 | 0.16 |
| 22,808 | Washington Federal Inc Com USD1.00 | 740,690 | 0.27 |
| | 半導体 : 1.76% (31 May 2016: 1.45%) | | |
| 9,407 | Cavium Inc Com USD0.001 | 536,575 | 0.19 |
| 5,151 | Cypress Semiconductor Corp Com USD0.01 | 57,923 | 0.02 |
| 23,137 | FormFactor Inc Com USD0.001 | 259,713 | 0.09 |
| 1,963 | Integrated Device Technology Inc Com USD0.001 | 45,924 | 0.02 |
| 6,000 | Intersil Corp Class A Com USD0.01 | 132,930 | 0.05 |
| 1,907 | Lattice Semiconductor Corp Com USD0.01 | 13,359 | - |
| 1,148 | MACOM Technology Solutions Holdings Inc Com USD0.001 | 57,159 | 0.02 |
| 3,581 | MaxLinear Inc Com NPV | 73,178 | 0.03 |
| 21,350 | Microsemi Corp Com USD0.20 | 1,169,019 | 0.42 |
| 9,148 | MKS Instruments Inc Com NPV | 526,696 | 0.19 |
| 114,397 | ON Semiconductor Corp Com USD0.01 | 1,347,025 | 0.49 |
| 651 | Silicon Laboratories Inc Com USD0.0001 | 43,210 | 0.02 |
| 7,859 | Skyworks Solutions Inc Com USD0.25 | 604,003 | 0.22 |
| | ソフトウェア : 5.13% (31 May 2016: 3.54%) | | |
| 5,515 | 2U Inc Com USD0.001 | 182,381 | 0.07 |
| 11,241 | Allscripts Healthcare Solutions Inc Com USD0.01 | 123,482 | 0.04 |
| 13,204 | athenahealth Inc Com USD0.01 | 1,248,834 | 0.45 |
| 3,524 | Benefitfocus Inc Com USD0.001 | 96,293 | 0.04 |
| 55,083 | Blackbaud Inc Com USD0.001 | 3,458,387 | 1.25 |
| 473 | BroadSoft Inc Com NPV | 19,630 | 0.01 |
| 12,670 | Cadence Design Systems Inc Com USD0.01 | 332,904 | 0.12 |
| 2,808 | Envestnet Inc Com NPV | 101,439 | 0.04 |
| 2,929 | Guidewire Software Inc Com USD0.0001 | 163,145 | 0.06 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | ソフトウェア(つづき) : 5.13% (31 May 2016: 3.54%) | | |
| 4,740 | HubSpot Inc Com USD0.001 | 265,796 | 0.10 |
| 45,953 | j2 Global Inc Com USD0.01 | 3,378,235 | 1.22 |
| 25,782 | MSCI Inc Com USD0.01 | 2,030,978 | 0.74 |
| 31,821 | Paycom Software Inc Com USD0.01 | 1,427,967 | 0.52 |
| 2,245 | Splunk Inc Com USD0.001 | 129,334 | 0.05 |
| 9,033 | SS&C Technologies Holdings Inc Com USD0.01 | 270,900 | 0.10 |
| 14,802 | Synopsys Inc Com USD0.01 | 895,373 | 0.32 |
| | 通信 : 0.91% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| 33,707 | ADTRAN Inc Com USD0.01 | 686,780 | 0.25 |
| 14,908 | Arista Networks Inc Com USD0.0001 | 1,414,247 | 0.51 |
| 5,684 | Ciena Corp Com USD0.01 | 122,007 | 0.04 |
| 1,930 | Finisar Corp Com USD0.001 | 64,124 | 0.02 |
| 11,864 | Oclaro Inc Com USD0.01 | 106,005 | 0.04 |
| 12,528 | ORBCOMM Inc Com USD0.001 | 105,423 | 0.04 |
| 1,018 | Quantenna Communications Inc Com USD0.0001 | 19,362 | 0.01 |
| | 繊維 : 0.40% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 1,940 | Mohawk Industries Inc Com USD0.01 | 383,179 | 0.14 |
| 4,997 | UniFirst Corp/MA Com USD0.10 | 706,576 | 0.26 |
| | 玩具/ゲーム/趣味 : 0.46% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 14,842 | Hasbro Inc Com USD0.50 | 1,267,581 | 0.46 |
| | 運輸 : 3.23% (31 May 2016: 2.67%) | | |
| 34,604 | Expeditors International of Washington Inc Com USD0.01 | 1,824,842 | 0.66 |
| 2,528 | Genesee & Wyoming Inc Class A Com USD0.01 | 193,127 | 0.07 |
| 21,186 | Heartland Express Inc Com USD0.01 | 455,923 | 0.17 |
| 29,866 | Hornbeck Offshore Services Inc Com USD0.01 | 152,466 | 0.06 |
| 1,571 | JB Hunt Transport Services Inc Com USD0.01 | 149,834 | 0.05 |
| 10,507 | Kirby Corp Com USD0.10 | 666,932 | 0.24 |
| 10,347 | Knight Transportation Inc Com USD0.01 | 361,886 | 0.13 |
| 39,760 | Old Dominion Freight Line Inc Com USD0.10 | 3,470,452 | 1.26 |
| 30,097 | Saia Inc Com USD0.001 | 1,255,797 | 0.46 |
| 8,362 | XPO Logistics Inc Com USD0.001 | 372,402 | 0.13 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|--------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.83% (31 May 2016: 94.10%) | | |
| | 米国(つづき) : 91.63% (31 May 2016: 89.30%) | | |
| | 水道 : 0.00% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| | 米国合計 | <u>252,779,578</u> | <u>91.63</u> |
| | 株式合計 | <u>267,162,662</u> | <u>96.83</u> |
| | 投資ファンド: 0.70% (31 May 2016: 1.55%) | | |
| 53,879 | DB X-Trackers Russell Midcap UCITS ETF NPV | 1,033,658 | 0.37 |
| 6,814 | iShares Russell 2000 ETF NPV [†] | 897,063 | 0.33 |
| | 投資ファンド合計 | <u>1,930,721</u> | <u>0.70</u> |
| | | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
| 契約数 | 先物契約 ^{**} : 0.01% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| 3 | Russell 2000 Mini NYFE Future December 2016 [†] | 29,157 | 0.01 |
| | 未決済先物契約に係る評価益合計 | <u>29,157</u> | <u>0.01</u> |
| | 先物契約合計 | <u>29,157</u> | <u>0.01</u> |
| | 先渡為替契約 : -0.74% (31 May 2016: 0.37%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|------------------|--------------|
| Barclays^ | GBP | 4,155,755 | USD | 5,168,349 | 15/12/2016 | 25,858 | 0.01 |
| Barclays^ | GBP | 267,259 | USD | 332,379 | 15/12/2016 | 1,663 | - |
| Barclays^ | GBP | 13,478 | USD | 16,762 | 15/12/2016 | 84 | - |
| Barclays^ | GBP | 13,239 | USD | 16,465 | 15/12/2016 | 82 | - |
| Barclays^ | GBP | 10,092 | USD | 12,551 | 15/12/2016 | 63 | - |
| Barclays^ | GBP | 2,022 | USD | 2,514 | 15/12/2016 | 13 | - |
| Barclays^ | GBP | 1,990 | USD | 2,474 | 15/12/2016 | 12 | - |
| UBS | GBP | 3,081,307 | USD | 3,831,004 | 15/12/2016 | 20,268 | 0.01 |
| UBS | USD | 45,657 | EUR | 41,285 | 15/12/2016 | 1,833 | - |
| UBS | EUR | 210,714 | USD | 222,273 | 15/12/2016 | 1,397 | - |
| UBS | GBP | 199,442 | USD | 247,967 | 15/12/2016 | 1,312 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.74% (31 May 2016: 0.37%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|---------|-----|---------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | EUR | 164,476 | USD | 173,499 | 15/12/2016 | 1,090 | - |
| UBS | GBP | 76,500 | USD | 95,158 | 15/12/2016 | 458 | - |
| UBS | USD | 30,092 | EUR | 28,037 | 15/12/2016 | 331 | - |
| UBS | USD | 113,611 | GBP | 90,825 | 15/12/2016 | 90 | - |
| UBS | GBP | 9,999 | USD | 12,413 | 15/12/2016 | 84 | - |
| UBS | USD | 12,884 | EUR | 12,062 | 15/12/2016 | 81 | - |
| UBS | GBP | 10,160 | USD | 12,627 | 15/12/2016 | 72 | - |
| UBS | USD | 1,690 | EUR | 1,528 | 15/12/2016 | 68 | - |
| UBS | GBP | 10,098 | USD | 12,555 | 15/12/2016 | 66 | - |
| UBS | GBP | 9,917 | USD | 12,330 | 15/12/2016 | 65 | - |
| UBS | EUR | 8,848 | USD | 9,334 | 15/12/2016 | 59 | - |
| UBS | GBP | 7,533 | USD | 9,366 | 15/12/2016 | 50 | - |
| UBS | EUR | 14,793 | USD | 15,654 | 15/12/2016 | 49 | - |
| UBS | USD | 1,099 | EUR | 1,003 | 15/12/2016 | 34 | - |
| UBS | USD | 28,829 | EUR | 27,138 | 15/12/2016 | 22 | - |
| UBS | EUR | 2,645 | USD | 2,790 | 15/12/2016 | 18 | - |
| UBS | EUR | 33,954 | USD | 36,024 | 15/12/2016 | 17 | - |
| UBS | USD | 11,962 | EUR | 11,255 | 15/12/2016 | 16 | - |
| UBS | GBP | 6,308 | USD | 7,872 | 15/12/2016 | 13 | - |
| UBS | GBP | 1,519 | USD | 1,889 | 15/12/2016 | 10 | - |
| UBS | GBP | 1,515 | USD | 1,883 | 15/12/2016 | 10 | - |

先渡為替契約に係る評価益合計

55,288

0.02

| | | | | | | | |
|-----|-----|--------|-----|--------|------------|------|---|
| UBS | USD | 2,523 | GBP | 2,020 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | GBP | 1,287 | USD | 1,610 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | GBP | 1,349 | USD | 1,688 | 15/12/2016 | (2) | - |
| UBS | USD | 1,246 | GBP | 1,000 | 15/12/2016 | (5) | - |
| UBS | GBP | 6,743 | USD | 8,440 | 15/12/2016 | (12) | - |
| UBS | GBP | 8,845 | USD | 11,071 | 15/12/2016 | (16) | - |
| UBS | GBP | 8,998 | USD | 11,262 | 15/12/2016 | (16) | - |
| UBS | USD | 5,157 | GBP | 4,149 | 15/12/2016 | (29) | - |
| UBS | USD | 14,228 | EUR | 13,436 | 15/12/2016 | (35) | - |
| UBS | USD | 5,119 | GBP | 4,127 | 15/12/2016 | (40) | - |
| UBS | EUR | 3,406 | USD | 3,658 | 15/12/2016 | (42) | - |
| UBS | USD | 10,777 | GBP | 8,673 | 15/12/2016 | (63) | - |
| UBS | EUR | 2,291 | USD | 2,496 | 15/12/2016 | (64) | - |
| UBS | USD | 24,142 | GBP | 19,392 | 15/12/2016 | (95) | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.74% (31 May 2016: 0.37%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| UBS | EUR | 11,449 | USD | 12,296 | 15/12/2016 | (143) | - |
| UBS | USD | 25,280 | GBP | 20,341 | 15/12/2016 | (144) | - |
| UBS | EUR | 8,044 | USD | 8,763 | 15/12/2016 | (225) | - |
| UBS | USD | 77,698 | GBP | 62,392 | 15/12/2016 | (285) | - |
| UBS | GBP | 162,764 | USD | 203,723 | 15/12/2016 | (287) | - |
| UBS | USD | 94,212 | GBP | 75,654 | 15/12/2016 | (346) | - |
| UBS | USD | 114,505 | GBP | 91,890 | 15/12/2016 | (347) | - |
| UBS | GBP | 54,537 | USD | 68,932 | 15/12/2016 | (768) | - |
| UBS | GBP | 55,507 | USD | 70,158 | 15/12/2016 | (782) | - |
| UBS | USD | 157,519 | EUR | 149,482 | 15/12/2016 | (1,155) | - |
| UBS | USD | 77,981 | GBP | 63,324 | 15/12/2016 | (1,166) | - |
| UBS | EUR | 189,656 | USD | 203,562 | 15/12/2016 | (2,244) | - |
| UBS | EUR | 94,582 | USD | 102,841 | 15/12/2016 | (2,443) | - |
| UBS | EUR | 207,936 | USD | 223,315 | 15/12/2016 | (2,594) | - |
| UBS | EUR | 257,731 | USD | 276,794 | 15/12/2016 | (3,215) | - |
| UBS | GBP | 273,316 | USD | 345,461 | 15/12/2016 | (3,848) | - |
| UBS | EUR | 146,478 | USD | 159,578 | 15/12/2016 | (4,093) | - |
| UBS | USD | 992,669 | GBP | 798,048 | 15/12/2016 | (4,798) | - |
| UBS | GBP | 2,774,901 | USD | 3,473,198 | 15/12/2016 | (4,897) | - |
| UBS | GBP | 358,559 | USD | 453,205 | 15/12/2016 | (5,049) | - |
| UBS | EUR | 181,176 | USD | 197,378 | 15/12/2016 | (5,062) | - |
| UBS | GBP | 368,519 | USD | 465,795 | 15/12/2016 | (5,189) | - |
| UBS | USD | 622,925 | GBP | 502,732 | 15/12/2016 | (5,431) | - |
| UBS | USD | 971,477 | GBP | 782,839 | 15/12/2016 | (6,979) | - |
| UBS | USD | 1,173,459 | GBP | 945,264 | 15/12/2016 | (8,010) | (0.01) |
| UBS | EUR | 318,151 | USD | 345,932 | 15/12/2016 | (8,219) | (0.01) |
| UBS | GBP | 7,363,078 | USD | 9,306,658 | 15/12/2016 | (103,675) | (0.04) |
| UBS | EUR | 5,857,139 | USD | 6,368,590 | 15/12/2016 | (151,305) | (0.05) |
| UBS | EUR | 7,270,128 | USD | 7,904,963 | 15/12/2016 | (187,807) | (0.07) |
| UBS | GBP | 113,327,566 | USD | 143,241,851 | 15/12/2016 | (1,595,702) | (0.58) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (2,116,631) | (0.76) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (2,061,343) | (0.74) |

| | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 267,061,197 | 96.80 |
| 現金および現金等価物 [*] | 11,832,266 | 4.29 |
| その他の純負債 | (3,005,285) | (1.09) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>275,888,178</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 94.48 |
| 投資ファンドおよびAIF | 0.68 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.03 |
| その他の資産 | 4.81 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される285,593米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、ゴールドマン・サックスである。

^ 関係会社。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

[次へ](#)

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス 米国バリューストックファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|------------------|--------------|
| | 株式 : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | バミューダ : 1.11% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | 農業 : 0.14% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 8,200 | Bunge Ltd Com USD0.01 | 560,265 | 0.14 |
| | 各種金融サービス : 0.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,000 | Invesco Ltd Com USD0.20 | 31,305 | 0.01 |
| | 保険 : 0.93% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 2,000 | RenaissanceRe Holdings Ltd Com USD1.00 | 260,970 | 0.06 |
| 3,400 | Validus Holdings Ltd Com USD0.175 | 184,773 | 0.04 |
| 96,000 | XL Group Ltd Com NPV | 3,470,880 | 0.83 |
| | 小売 : 0.03% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,200 | Signet Jewellers Ltd Com USD0.18 | 109,578 | 0.03 |
| | バミューダ合計 | 4,617,771 | 1.11 |
| | キュラソー : 0.62% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| | 石油・ガス・サービス : 0.62% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 31,015 | Schlumberger Ltd Com USD0.01 | 2,606,345 | 0.62 |
| | キュラソー合計 | 2,606,345 | 0.62 |
| | フランス : 0.44% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| | 医薬品 : 0.44% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 45,500 | Sanofi ADR NPV | 1,828,873 | 0.44 |
| | フランス合計 | 1,828,873 | 0.44 |
| | アイルランド : 3.90% (31 May 2016: 3.78%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 8,047 | Adient plc Com USD0.001 | 431,520 | 0.10 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | アイルランド(つづき) : 3.90% (31 May 2016: 3.78%) | | |
| | 建設資材 : 0.57% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 72,700 | CRH ADR NPV | 2,406,734 | 0.57 |
| | 電子 : 1.28% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 119,590 | Johnson Controls International PLC Com USD0.01 | 5,382,147 | 1.28 |
| | ヘルスケア用品 : 1.26% (31 May 2016: 1.45%) | | |
| 72,400 | Medtronic PLC Com USD0.10 | 5,284,475 | 1.26 |
| | 保険 : 0.37% (31 May 2016: 1.04%) | | |
| 12,486 | Willis Towers Watson PLC Com USD0.000304635 | 1,552,697 | 0.37 |
| | 各種製造業 : 0.28% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 17,600 | Eaton Corp Com PLC Com USD0.01 | 1,170,664 | 0.28 |
| | 医薬品 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,900 | Mallinckrodt PLC Com USD0.20 | 152,816 | 0.04 |
| | アイルランド合計 | 16,381,053 | 3.90 |
| | ジャージー : 0.11% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.11% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 6,900 | Delphi Automotive PLC Com USD0.01 | 441,635 | 0.11 |
| | ジャージー合計 | 441,635 | 0.11 |
| | オランダ : 0.83% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| | 化学 : 0.83% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| 38,700 | LyondellBasell Industries NV Class A Com EURO.04 | 3,494,803 | 0.83 |
| | オランダ合計 | 3,494,803 | 0.83 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | パナマ : 0.29% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 余暇 : 0.29% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| 23,600 | Carnival Corp Com USD0.01 | 1,213,394 | 0.29 |
| | パナマ合計 | 1,213,394 | 0.29 |
| | スイス : 0.65% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| | 電子 : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 5,600 | Garmin Ltd Com CHF10.00 | 292,040 | 0.07 |
| | 保険 : 0.58% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 2,400 | Allied World Assurance Co Holdings AG Com USD4.10 | 112,356 | 0.03 |
| 18,015 | Chubb Ltd Com CHF24.15 | 2,304,389 | 0.55 |
| | スイス合計 | 2,708,785 | 0.65 |
| | 英国 : 2.69% (31 May 2016: 1.76%) | | |
| | 飲料 : 0.00% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| | 保険 : 0.56% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 20,733 | Aon PLC Com USD0.01 | 2,365,324 | 0.56 |
| | 鉱業 : 0.34% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 37,600 | Rio Tinto Plc ADR NPV | 1,425,228 | 0.34 |
| | 石油・ガス : 1.79% (31 May 2016: 1.01%) | | |
| 143,300 | BP Plc ADR NPV | 5,016,216 | 1.20 |
| 45,620 | Royal Dutch Shell PLC Com ADR NPV | 2,470,551 | 0.59 |
| | 英国合計 | 11,277,319 | 2.69 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国 : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | 広告 : 0.15% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,000 | Omnicom Group Inc Com USD0.15 | 608,650 | 0.15 |
| | 航空・防衛 : 6.08% (31 May 2016: 6.03%) | | |
| 27,100 | Boeing Co Com USD5.00 | 4,082,208 | 0.97 |
| 1,100 | Curtiss-Wright Corp Com USD1.00 | 110,578 | 0.03 |
| 20,400 | General Dynamics Corp Com USD1.00 | 3,578,975 | 0.85 |
| 6,100 | Lockheed Martin Corp Com USD1.00 | 1,619,183 | 0.39 |
| 10,000 | Northrop Grumman Corp Com USD1.00 | 2,498,449 | 0.60 |
| 38,800 | Raytheon Co Com USD0.01 | 5,800,599 | 1.38 |
| 4,800 | Spirit AeroSystems Holdings Inc Com USD0.01 | 279,672 | 0.07 |
| 69,705 | United Technologies Corp Com USD1.00 | 7,509,667 | 1.79 |
| | 農業 : 2.35% (31 May 2016: 3.13%) | | |
| 70,100 | Altria Group Inc Com USD0.333 | 4,481,843 | 1.07 |
| 61,000 | Philip Morris International Inc Com NPV | 5,388,434 | 1.28 |
| | 航空 : 1.59% (31 May 2016: 1.66%) | | |
| 41,300 | Delta Air Lines Inc Com USD0.0001 | 1,990,867 | 0.47 |
| 86,900 | Southwest Airlines Co Class C Com USD1.00 | 4,051,712 | 0.97 |
| 8,800 | United Continental Holdings Inc Com USD0.01 | 606,892 | 0.15 |
| | アパレル : 0.02% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 700 | Carter's Inc Com USD0.01 | 63,914 | 0.02 |
| | 自動車製造 : 0.18% (31 May 2016: 0.89%) | | |
| 11,822 | PACCAR Inc Com USD1.00 | 734,796 | 0.18 |
| | 自動車部品・装置 : 0.21% (31 May 2016: 1.37%) | | |
| 3,600 | BorgWarner Inc Com USD0.01 | 128,178 | 0.03 |
| 5,800 | Lear Corp Com USD0.01 | 751,013 | 0.18 |
| | 銀行 : 12.10% (31 May 2016: 11.10%) | | |
| 434,500 | Bank of America Corp Com USD0.01 | 9,187,502 | 2.19 |
| 20,960 | Capital One Financial Corp Com USD0.01 | 1,762,001 | 0.42 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国(つづき) : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | 銀行(つづき) : 12.10% (31 May 2016: 11.10%) | | |
| 49,507 | Citigroup Inc Com USD0.01 | 2,792,937 | 0.67 |
| 30,000 | Comerica Inc Com USD5.00 | 1,912,350 | 0.46 |
| 22,800 | Fifth Third BanCorp Com NPV | 593,142 | 0.14 |
| 141,275 | JPMorgan Chase & Co Class C Com USD1.00 | 11,326,722 | 2.70 |
| 95,500 | State Street Corp Com USD1.00 | 7,523,967 | 1.79 |
| 8,500 | Synovus Financial Corp Com USD1.00 | 329,078 | 0.08 |
| 72,216 | US Bancorp Com USD0.01 | 3,582,996 | 0.85 |
| 221,792 | Wells Fargo & Co Class C Com USD1.666 | 11,740,560 | 2.80 |
| | 飲料 : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 8,400 | Brown-Forman Corp Com USD0.15 | 380,982 | 0.09 |
| | バイオテクノロジー : 0.95% (31 May 2016: 1.24%) | | |
| 54,100 | Gilead Sciences Inc Com USD0.001 | 3,988,251 | 0.95 |
| | 建設資材 : 0.08% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 6,500 | Owens Corning Com USD0.001 | 334,003 | 0.08 |
| | 化学 : 2.41% (31 May 2016: 2.42%) | | |
| 4,200 | Albemarle Corp Com USD0.01 | 368,802 | 0.09 |
| 38,736 | Dow Chemical Co/The Com USD2.50 | 2,159,919 | 0.52 |
| 76,100 | El du Pont de Nemours & Co Com USD0.30 | 5,599,819 | 1.33 |
| 9,000 | Huntsman Corp Com USD0.01 | 175,365 | 0.04 |
| 18,820 | PPG Industries Inc Com USD1.67 | 1,805,591 | 0.43 |
| | 商業サービス : 0.42% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 2,400 | Avis Budget Group Inc Com USD0.01 | 91,932 | 0.02 |
| 4,800 | ManpowerGroup Inc Com USD0.01 | 409,992 | 0.10 |
| 6,000 | United Rentals Inc Com USD0.01 | 607,410 | 0.14 |
| 31,300 | Western Union Co Class C Com USD0.01 | 658,396 | 0.16 |
| | コンピューター : 1.88% (31 May 2016: 2.75%) | | |
| 20,480 | Apple Inc Com USD0.00001 | 2,263,347 | 0.54 |
| 4,700 | Computer Sciences Corp Com USD1.00 | 284,632 | 0.07 |
| 47,600 | Hewlett Packard Enterprise Co Com USD0.01 | 1,132,642 | 0.27 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国(つづき) : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | コンピューター(つづき) : 1.88% (31 May 2016: 2.75%) | | |
| 25,100 | International Business Machines Corp Com USD0.20 | 4,074,608 | 0.97 |
| 300 | NCR Corp Com USD0.01 | 11,633 | - |
| 4,300 | Teradata Corp Com USD0.01 | 115,477 | 0.03 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.69% (31 May 2016: 0.78%) | | |
| 35,153 | Procter & Gamble Co Com NPV | 2,899,244 | 0.69 |
| | 販売/卸売 : 0.21% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 3,800 | VW Grainger Inc Com USD0.50 | 876,831 | 0.21 |
| | 各種金融サービス : 4.68% (31 May 2016: 3.42%) | | |
| 115,400 | American Express Co Class C Com USD0.20 | 8,311,684 | 1.98 |
| 42,900 | Ameriprise Financial Inc Com USD0.01 | 4,898,966 | 1.17 |
| 9,352 | BlackRock Inc Com USD0.01 | 3,467,768 | 0.83 |
| 31,800 | Discover Financial Services Com USD0.01 | 2,155,245 | 0.51 |
| 7,600 | E*TRADE Financial Corp Com USD0.01 | 262,314 | 0.06 |
| 31,200 | Navient Corp Com USD0.01 | 537,420 | 0.13 |
| | 電気 : 1.77% (31 May 2016: 2.15%) | | |
| 17,220 | Edison International Com NPV | 1,184,306 | 0.28 |
| 66,200 | Entergy Corp Com USD0.01 | 4,550,257 | 1.08 |
| 15,101 | NextEra Energy Inc Com USD0.01 | 1,726,195 | 0.41 |
| | 電気部品・設備 : 0.60% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 44,200 | Emerson Electric Co Class C Com USD0.50 | 2,496,195 | 0.60 |
| | 電子 : 2.04% (31 May 2016: 2.64%) | | |
| 25,620 | Agilent Technologies Inc Com USD0.01 | 1,126,896 | 0.27 |
| 49,800 | Corning Inc Com USD0.50 | 1,196,943 | 0.29 |
| 54,522 | Honeywell International Inc Com USD1.00 | 6,218,507 | 1.48 |
| | 食品 : 2.01% (31 May 2016: 1.08%) | | |
| 30,405 | Campbell Soup Co Com USD0.0375 | 1,729,284 | 0.41 |
| 31,338 | Conagra Brands Inc Com USD5.00 | 1,149,635 | 0.28 |
| 1 | Lamb Weston Holdings Inc Com USD1.00 | 22 | - |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国(つづき) : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | 食品(つづき) : 2.01% (31 May 2016: 1.08%) | | |
| 105,800 | Mondelez International Inc Class A Com NPV | 4,363,721 | 1.04 |
| 12,400 | Pilgrim's Pride Corp Com USD0.01 | 218,426 | 0.05 |
| 17,200 | Tyson Foods Inc Com USD0.10 | 977,218 | 0.23 |
| | 林産品・紙製品 : 0.74% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| 63,900 | International Paper Co Class C Com USD1.00 | 3,113,528 | 0.74 |
| | ガス : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 11,800 | NiSource Inc Com USD0.01 | 258,951 | 0.06 |
| | 工具・工作機械 : 1.24% (31 May 2016: 1.33%) | | |
| 2,300 | Lincoln Electric Holdings Inc Com NPV | 180,585 | 0.05 |
| 42,200 | Stanley Black & Decker Inc Com USD2.50 | 5,006,397 | 1.19 |
| | ヘルスケア用品 : 0.35% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 32,600 | Baxter International Inc Com USD1.00 | 1,445,647 | 0.35 |
| | ヘルスケア・サービス : 1.75% (31 May 2016: 1.52%) | | |
| 22,168 | Cigna Corp Com USD0.25 | 2,989,244 | 0.71 |
| 4,100 | Quest Diagnostics Inc Com USD0.01 | 358,648 | 0.09 |
| 25,339 | UnitedHealth Group Inc Com USD0.01 | 4,016,358 | 0.95 |
| | 住宅建設 : 0.00% (31 May 2016: 1.02%) | | |
| | 住宅家具 : 0.62% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 6,400 | Leggett & Platt Inc Com USD0.01 | 307,616 | 0.08 |
| 14,000 | Whirlpool Corp Com USD1.00 | 2,274,090 | 0.54 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.05% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 2,800 | Avery Dennison Corp Com USD1.00 | 201,894 | 0.05 |
| | 保険 : 4.21% (31 May 2016: 4.56%) | | |
| 52,297 | Allstate Corp Com USD0.01 | 3,656,083 | 0.87 |
| 4,100 | Assurant Inc Com USD0.01 | 354,056 | 0.08 |
| 24,900 | Hartford Financial Services Group Inc Com USD0.01 | 1,173,413 | 0.28 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国(つづき) : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | 保険(つづき) : 4.21% (31 May 2016: 4.56%) | | |
| 101,100 | Loews Corp Com USD0.01 | 4,514,621 | 1.08 |
| 47,395 | MetLife Inc Com USD0.01 | 2,606,962 | 0.62 |
| 53,965 | Progressive Corp Com USD1.00 | 1,797,304 | 0.43 |
| 25,500 | Travelers Cos Inc NPV | 2,891,573 | 0.69 |
| 15,900 | Unum Group Com USD0.10 | 672,014 | 0.16 |
| | インターネット : 0.46% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 3,800 | CDW Corporation Com USD0.01 | 194,712 | 0.05 |
| 62,400 | eBay Inc Com USD0.001 | 1,735,968 | 0.41 |
| | 余暇 : 0.21% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 14,800 | Harley-Davidson Inc Com USD0.01 | 901,838 | 0.21 |
| | 宿泊施設 : 0.15% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 8,900 | Wyndham Worldwide Corp Com USD0.01 | 640,756 | 0.15 |
| | 建設機械・採掘機械 : 0.06% (31 May 2016: 0.33%) | | |
| 3,700 | Oshkosh Corp Com USD0.01 | 258,889 | 0.06 |
| | 各種機械 : 0.72% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 8,300 | Cummins Inc Com USD2.50 | 1,176,816 | 0.28 |
| 8,700 | Deere & Co Class C Com USD1.00 | 872,045 | 0.21 |
| 700 | Graco Inc Com USD1.00 | 56,840 | 0.01 |
| 2,000 | Nordson Corp Com NPV | 213,510 | 0.05 |
| 2,500 | Rockwell Automation Inc Com USD1.00 | 334,213 | 0.08 |
| 4,600 | Wabtec Corporation Com USD0.01 | 389,528 | 0.09 |
| | メディア : 2.35% (31 May 2016: 1.91%) | | |
| 31,800 | CBS Corp Class B Com USD0.001 | 1,930,419 | 0.46 |
| 41,827 | Comcast Corp Class A Com USD0.01 | 2,907,604 | 0.69 |
| 3,800 | Discovery Communications Inc Com USD0.01 | 102,961 | 0.02 |
| 14,600 | TEGNA Inc Com USD1.00 | 327,697 | 0.08 |
| 37,300 | Time Warner Inc Com USD0.01 | 3,429,549 | 0.82 |
| 11,890 | Walt Disney Co Com USD0.01 | 1,179,072 | 0.28 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国(つづき) : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | 各種製造業 : 1.60% (31 May 2016: 1.94%) | | |
| 19,300 | 3M Co Class C Com USD0.01 | 3,316,705 | 0.79 |
| 103,477 | General Electric Co Class C Com USD0.06 | 3,186,574 | 0.76 |
| 1,600 | Parker-Hannifin Corp Com USD0.50 | 222,416 | 0.05 |
| | 事務用機器 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,000 | Pitney Bowes Inc Com USD1.00 | 100,415 | 0.02 |
| | 石油・ガス : 6.14% (31 May 2016: 6.84%) | | |
| 40,359 | Chevron Corp Com USD0.75 | 4,504,670 | 1.07 |
| 89,000 | ConocoPhillips Com USD0.01 | 4,319,615 | 1.03 |
| 19,558 | EOG Resources Inc Com USD0.01 | 2,004,988 | 0.47 |
| 46,682 | Exxon Mobil Corp Com NPV | 4,076,039 | 0.97 |
| 59,700 | Occidental Petroleum Corp Com USD0.20 | 4,262,282 | 1.02 |
| 49,600 | Phillips 66 Com NPV | 4,123,496 | 0.98 |
| 41,100 | Valero Energy Corp Com USD0.01 | 2,533,199 | 0.60 |
| | 包装・容器 : 0.12% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 6,000 | Packaging Corp of America Com USD0.01 | 508,620 | 0.12 |
| | 医薬品 : 7.47% (31 May 2016: 7.17%) | | |
| 48,600 | Cardinal Health Inc Com NPV | 3,451,329 | 0.82 |
| 38,600 | Express Scripts Holding Co Class C Com USD0.01 | 2,930,126 | 0.70 |
| 88,197 | Johnson & Johnson Com USD1.00 | 9,824,705 | 2.34 |
| 102,100 | Merck & Co Inc Com USD0.50 | 6,252,094 | 1.49 |
| 277,097 | Pfizer Inc Com USD0.05 | 8,912,824 | 2.12 |
| | 不動産投資信託 : 0.95% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| 23,335 | Crown Castle International Corp Reits USD0.01 | 1,947,889 | 0.46 |
| 9,766 | Public Storage Reits USD0.10 | 2,043,194 | 0.49 |
| | 小売 : 6.45% (31 May 2016: 4.59%) | | |
| 8,700 | American Eagle Outfitters Inc Com USD0.01 | 144,029 | 0.04 |
| 5,200 | AutoNation Inc Com USD0.01 | 232,206 | 0.06 |
| 12,600 | Bed Bath & Beyond Inc Com USD0.01 | 564,669 | 0.13 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|--------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.99% (31 May 2016: 95.99%) | | |
| | 米国(つづき) : 86.22% (31 May 2016: 87.21%) | | |
| | 小売(つづき) : 6.45% (31 May 2016: 4.59%) | | |
| 16,000 | Best Buy Co Inc Com USD0.10 | 731,280 | 0.18 |
| 9,700 | CarMax Inc Com USD0.50 | 561,000 | 0.13 |
| 1,300 | Dick's Sporting Goods Inc Com USD0.01 | 76,811 | 0.02 |
| 7,100 | Dollar General Corp Com USD0.875 | 549,434 | 0.13 |
| 121,800 | Gap Inc Com USD0.05 | 3,041,955 | 0.73 |
| 3,000 | Kohl's Corp Com USD0.01 | 161,505 | 0.04 |
| 52,059 | Macy's Inc Com USD0.01 | 2,197,150 | 0.52 |
| 11,600 | Nordstrom Inc Com NPV | 648,730 | 0.16 |
| 2,100 | Penske Automotive Group Inc Com USD0.0001 | 104,780 | 0.02 |
| 1,200 | PVH Corp Com USD1.00 | 127,134 | 0.03 |
| 106,400 | Target Corp Com USD0.0833 | 8,219,932 | 1.96 |
| 7,300 | Urban Outfitters Inc Com USD0.0001 | 230,607 | 0.06 |
| 133,100 | Wal-Mart Stores Inc Com USD0.10 | 9,378,892 | 2.24 |
| | 半導体 : 3.62% (31 May 2016: 3.70%) | | |
| 87,081 | Applied Materials Inc Com USD0.01 | 2,804,444 | 0.67 |
| 49,734 | Intel Corp Com USD0.001 | 1,726,018 | 0.41 |
| 85,200 | QUALCOMM Inc Com USD0.0001 | 5,803,824 | 1.38 |
| 66,023 | Texas Instruments Inc Com USD1.00 | 4,881,741 | 1.16 |
| | ソフトウェア : 1.80% (31 May 2016: 2.22%) | | |
| 22,900 | CA Inc Com USD0.10 | 731,999 | 0.17 |
| 63,879 | Microsoft Corp Com USD0.00000625 | 3,849,349 | 0.92 |
| 74,148 | Oracle Corp Com USD0.01 | 2,981,120 | 0.71 |
| | 通信 : 3.27% (31 May 2016: 4.62%) | | |
| 92,200 | AT&T Inc Com USD1.00 | 3,564,913 | 0.85 |
| 54,583 | Cisco Systems Inc Com USD0.001 | 1,628,211 | 0.39 |
| 170,391 | Verizon Communications Inc Com USD0.10 | 8,503,363 | 2.03 |
| | 運輸 : 1.30% (31 May 2016: 1.34%) | | |
| 2,300 | Expeditors International of Washington Inc Com USD0.01 | 121,291 | 0.03 |
| 11,222 | FedEx Corp Com USD0.10 | 2,152,267 | 0.51 |
| 29,900 | Norfolk Southern Corp Com USD1.00 | 3,183,752 | 0.76 |
| | 米国合計 | 361,741,750 | 86.22 |

先渡為替契約(つづき) : -1.05% (31 May 2016:0.25%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|------------|-----|------------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | GBP | 187 | USD | 234 | 15/12/2016 | - | - |
| UBS | GBP | 2,560 | USD | 3,205 | 15/12/2016 | (5) | - |
| UBS | GBP | 3,103 | USD | 3,883 | 15/12/2016 | (5) | - |
| UBS | USD | 2,154 | EUR | 2,035 | 15/12/2016 | (7) | - |
| UBS | USD | 12,095 | GBP | 9,685 | 15/12/2016 | (10) | - |
| UBS | USD | 2,245 | GBP | 1,807 | 15/12/2016 | (13) | - |
| UBS | GBP | 7,527 | USD | 9,421 | 15/12/2016 | (13) | - |
| UBS | EUR | 20,400 | USD | 21,683 | 15/12/2016 | (29) | - |
| UBS | USD | 5,040 | EUR | 4,782 | 15/12/2016 | (37) | - |
| UBS | USD | 6,878 | EUR | 6,527 | 15/12/2016 | (50) | - |
| UBS | USD | 138,086 | EUR | 130,153 | 15/12/2016 | (69) | - |
| UBS | EUR | 7,100 | USD | 7,624 | 15/12/2016 | (87) | - |
| UBS | GBP | 6,624 | USD | 8,372 | 15/12/2016 | (93) | - |
| UBS | EUR | 16,322 | USD | 17,495 | 15/12/2016 | (169) | - |
| UBS | USD | 80,137 | EUR | 75,678 | 15/12/2016 | (195) | - |
| UBS | GBP | 142,629 | USD | 178,521 | 15/12/2016 | (252) | - |
| UBS | EUR | 25,887 | USD | 27,748 | 15/12/2016 | (269) | - |
| UBS | USD | 218,806 | EUR | 206,632 | 15/12/2016 | (532) | - |
| UBS | EUR | 20,602 | USD | 22,445 | 15/12/2016 | (576) | - |
| UBS | USD | 204,470 | GBP | 164,088 | 15/12/2016 | (621) | - |
| UBS | EUR | 38,068 | USD | 41,472 | 15/12/2016 | (1,064) | - |
| UBS | GBP | 90,197 | USD | 114,006 | 15/12/2016 | (1,270) | - |
| UBS | GBP | 112,935 | USD | 142,746 | 15/12/2016 | (1,590) | - |
| UBS | EUR | 54,100 | USD | 59,286 | 15/12/2016 | (1,860) | - |
| UBS | EUR | 267,830 | USD | 287,077 | 15/12/2016 | (2,778) | - |
| UBS | GBP | 270,143 | USD | 341,450 | 15/12/2016 | (3,804) | - |
| UBS | EUR | 776,327 | USD | 832,116 | 15/12/2016 | (8,053) | - |
| UBS | GBP | 5,843,232 | USD | 7,313,667 | 15/12/2016 | (10,313) | - |
| UBS | EUR | 383,026 | USD | 417,280 | 15/12/2016 | (10,702) | - |
| UBS | USD | 1,969,729 | GBP | 1,587,253 | 15/12/2016 | (14,151) | - |
| UBS | USD | 1,641,283 | GBP | 1,324,598 | 15/12/2016 | (14,309) | - |
| UBS | EUR | 770,716 | USD | 838,016 | 15/12/2016 | (19,910) | - |
| UBS | USD | 3,220,736 | GBP | 2,594,420 | 15/12/2016 | (21,984) | (0.01) |
| UBS | EUR | 979,871 | USD | 1,067,501 | 15/12/2016 | (27,379) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,207,166 | USD | 1,312,577 | 15/12/2016 | (31,184) | (0.01) |
| UBS | USD | 10,596,054 | GBP | 8,518,612 | 15/12/2016 | (51,210) | (0.01) |
| UBS | GBP | 4,630,170 | USD | 5,852,363 | 15/12/2016 | (65,195) | (0.02) |
| UBS | EUR | 12,620,088 | USD | 13,722,087 | 15/12/2016 | (326,010) | (0.08) |

先渡為替契約(つづき) : -1.05% (31 May 2016: 0.25%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| UBS | EUR | 36,962,224 | USD | 40,189,802 | 15/12/2016 | (954,831) | (0.23) |
| UBS | GBP | 201,424,203 | USD | 254,592,739 | 15/12/2016 | (2,836,141) | (0.68) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (4,406,770) | (1.05) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (4,373,583) | (1.05) |
| 投資総額 | | | | | | 402,491,436 | 95.94 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 23,508,730 | 5.60 |
| その他の純負債 | | | | | | (6,478,705) | (1.54) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 419,521,461 | 100.00 |

総資産の分析

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている
譲渡性のある有価証券および短期金融商品
規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品
その他の資産

**総資産
比率(%)**

93.83

0.01

6.17

100.01

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される169,833米ドルを除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式 : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | オーストラリア : 2.28% (31 May 2016: 3.20%) | | |
| | 銀行 : 0.50% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| 16,331 | Commonwealth Bank of Australia Com NPV | 949,064 | 0.31 |
| 9,825 | National Australia Bank Ltd Com NPV | 209,682 | 0.07 |
| 16,111 | Westpac Banking Corp Com NPV | 372,107 | 0.12 |
| | バイオテクノロジー : 0.06% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 2,491 | CSL Ltd Com NPV | 180,459 | 0.06 |
| | 建設資材 : 0.10% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 79,357 | Boral Ltd Com NPV | 294,630 | 0.10 |
| | コンピューター : 0.07% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 24,963 | Computershare Ltd NPV | 214,134 | 0.07 |
| | 各種金融サービス : 0.15% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 7,448 | Macquarie Group Ltd Com NPV | 461,560 | 0.15 |
| | 電気 : 0.06% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 10,856 | AGL Energy Ltd Com NPV | 168,320 | 0.06 |
| | ヘルスケア・サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| | 保険 : 0.97% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 305,160 | Challenger Ltd/Australia Com NPV † | 2,413,629 | 0.80 |
| 41,001 | Insurance Australia Group Ltd Com NPV | 169,493 | 0.06 |
| 37,080 | Suncorp Group Ltd Com NPV | 342,320 | 0.11 |
| | 余暇 : 0.06% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 7,926 | Flight Centre Travel Group Ltd Com NPV | 195,624 | 0.06 |
| | 鉱業 : 0.11% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 163,221 | South32 Ltd Com NPV | 326,212 | 0.11 |
| | 各種製造業 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 石油・ガス : 0.07% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| 9,418 | Caltex Australia Ltd Com NPV | 209,103 | 0.07 |

| | | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | | |
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | オーストラリア(つづき) : 2.28% (31 May 2016: 3.20%) | | |
| | 不動産投資信託 : 0.09% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 187,305 | Mirvac Group Reits NPV | 283,008 | 0.09 |
| | 通信 : 0.04% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 33,176 | Telstra Corp Ltd Com NPV | 123,909 | 0.04 |
| | 運輸 : 0.00% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| | オーストラリア合計 | <u>6,913,254</u> | <u>2.28</u> |
| | ベルギー : 0.06% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| | 化学 : 0.00% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| | 半導体 : 0.06% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 2,914 | Melexis NV Com NPV | 182,595 | 0.06 |
| | ベルギー合計 | <u>182,595</u> | <u>0.06</u> |
| | バミューダ : 0.94% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| | 農業 : 0.51% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 22,791 | Bunge Ltd Com USD0.01 | 1,557,195 | 0.51 |
| | 各種金融サービス : 0.38% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 29,711 | Lazard Ltd Class A Com USD0.01 | 1,154,124 | 0.38 |
| | 不動産 : 0.05% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 47,500 | Kerry Properties Ltd Com HKD1.00 | 135,642 | 0.05 |
| | ソフトウェア : 0.00% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | 運輸 : 0.00% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| | バミューダ合計 | <u>2,846,961</u> | <u>0.94</u> |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | ブラジル : 1.15% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| | 銀行 : 0.51% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 162,188 | Banco do Brasil SA Com NPV | 1,366,311 | 0.45 |
| 16,746 | Itau Unibanco Holding SA ADR NPV | 173,237 | 0.06 |
| | 商業サービス : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 81,439 | CCR SA Com NPV | 355,491 | 0.12 |
| | 電気 : 0.29% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 41,393 | AES Tiete Energia SA NPV | 179,400 | 0.06 |
| 305,840 | Cia Energetica de Minas Gerais Pref BRL5.00 | 717,017 | 0.23 |
| | 通信 : 0.23% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 53,752 | Telefonica Brasil SA Pref NPV | 716,058 | 0.23 |
| | ブラジル合計 | 3,507,514 | 1.15 |
| | カナダ : 2.83% (31 May 2016: 4.58%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.00% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| | 銀行 : 2.03% (31 May 2016: 2.21%) | | |
| 13,896 | Bank of Montreal Com NPV | 915,342 | 0.30 |
| 48,979 | Canadian Imperial Bank of Commerce Com NPV | 3,851,915 | 1.27 |
| 21,526 | Royal Bank of Canada Com NPV | 1,394,003 | 0.46 |
| | 保険 : 0.67% (31 May 2016: 1.10%) | | |
| 23,335 | Power Corporation Company of Canada NPV | 520,291 | 0.17 |
| 28,687 | Power Financial Corp Com NPV | 722,082 | 0.24 |
| 20,991 | Sun Life Financial Inc Com NPV | 804,998 | 0.26 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| | 鉱業 : 0.00% (31 May 2016: 0.41%) | | |
| | 不動産投資信託 : 0.13% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 24,504 | H&R Real Estate Investment Trust Reits NPV | 397,557 | 0.13 |
| | カナダ合計 | 8,606,188 | 2.83 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | ケイマン諸島 : 0.57% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| | 保険 : 0.27% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 92,442 | Phoenix Group Holdings Com EURO.0001 | 818,008 | 0.27 |
| | 小売 : 0.18% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 183,260 | ANTA Sports Products Ltd Com HKD0.10 | 536,314 | 0.18 |
| | 半導体 : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 51,368 | Himax Technologies Inc ADR USD0.60 | 378,839 | 0.12 |
| | ケイマン諸島合計 | 1,733,161 | 0.57 |
| | チェコ共和国 : 0.67% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 銀行 : 0.67% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 621,973 | Moneta Money Bank AS Class A Com CZK1.00 | 2,029,301 | 0.67 |
| | チェコ共和国合計 | 2,029,301 | 0.67 |
| | デンマーク : 1.50% (31 May 2016: 1.41%) | | |
| | 銀行 : 0.61% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 62,832 | Danske Bank A/S Com DKK10.00 | 1,839,647 | 0.61 |
| | 電気 : 0.18% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 16,223 | DONG Energy A/S Com DKK10.00 | 556,758 | 0.18 |
| | 医薬品 : 0.21% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 19,191 | Novo Nordisk A/S Class B Com DKK0.20 | 650,545 | 0.21 |
| | 運輸 : 0.50% (31 May 2016: 0.81%) | | |
| 450 | AP Moeller - Maersk A/S Class B Com DKK1000.00 | 599,906 | 0.20 |
| 21,785 | Dfds A/S Com DKK20.00 | 897,821 | 0.30 |
| | デンマーク合計 | 4,544,677 | 1.50 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | フィンランド : 1.05% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| | 食品 : 0.39% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 23,997 | Kesko OYJ Com NPV | 1,181,796 | 0.39 |
| | 林産品・紙製品 : 0.28% (31 May 2016: 0.31%) | | |
| 36,828 | UPM-Kymmene OYJ Com NPV | 844,436 | 0.28 |
| | 石油・ガス : 0.15% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 10,699 | Neste OYJ Com NPV | 439,566 | 0.15 |
| | 通信 : 0.23% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 164,909 | Nokia OYJ Com NPV | 709,363 | 0.23 |
| | フィンランド合計 | 3,175,161 | 1.05 |
| | フランス : 2.22% (31 May 2016: 3.22%) | | |
| | 銀行 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 37,696 | Natixis SA Com EUR11.20 | 190,083 | 0.06 |
| | コンピューター : 0.26% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 4,441 | Atos SE Com EUR1.00 | 459,512 | 0.15 |
| 4,311 | Capgemini SA Com EUR8.00 | 340,651 | 0.11 |
| | 販売/卸売 : 0.10% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 18,954 | Rexel SA Com EUR5.00 | 293,403 | 0.10 |
| | 各種金融サービス : 0.27% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 16,856 | Amundi SA Com EUR2.50 | 828,598 | 0.27 |
| | 保険 : 0.75% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 75,853 | AXA SA Com EUR2.29 | 1,787,929 | 0.59 |
| 27,109 | CNP Assurances Com EUR1.00 | 476,435 | 0.16 |
| | 石油・ガス : 0.04% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 2,818 | TOTAL SA Com EUR2.50 | 134,393 | 0.04 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.16%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | フランス(つづき) : 2.22% (31 May 2016: 3.22%) | | |
| | 医薬品 : 0.22% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 8,212 | Sanofi Com EUR2.00 | 663,365 | 0.22 |
| | 不動産投資信託 : 0.05% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 1,780 | Fonciere Des Regions Reits EUR3.00 | 139,880 | 0.05 |
| | 通信 : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 16,690 | Eutelsat Communications SA Com EUR1.00 | 300,184 | 0.10 |
| | 運輸 : 0.04% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| 13,992 | Groupe Eurotunnel SE Com EURO.40 | 123,187 | 0.04 |
| | 水道 : 0.33% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 57,945 | Veolia Environnement SA Com EUR5.00 | 1,002,390 | 0.33 |
| | フランス合計 | 6,740,010 | 2.22 |
| | ドイツ : 3.82% (31 May 2016: 4.33%) | | |
| | 自動車製造 : 0.39% (31 May 2016: 0.45%) | | |
| 17,721 | Daimler AG Com NPV | 1,178,380 | 0.39 |
| | 銀行 : 0.22% (31 May 2016: 0.26%) | | |
| 63,990 | Deutsche Pfandbriefbank AG Class A Com NPV | 664,415 | 0.22 |
| | 化学 : 0.51% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 3,867 | BASF SE Com NPV | 333,133 | 0.11 |
| 11,777 | Covestro AG Class A Com NPV | 757,641 | 0.25 |
| 16,312 | Evonik Industries AG Class A Com NPV | 453,489 | 0.15 |
| | インターネット : 0.00% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| | 余暇 : 0.34% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 78,509 | TUI AG Class D Com NPV | 1,033,369 | 0.34 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.54%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | ドイツ(つづき) : 3.82% (31 May 2016: 4.33%) | | |
| | 各種製造業 : 0.73% (31 May 2016: 0.74%) | | |
| 19,631 | Siemens AG Com NPV | 2,218,857 | 0.73 |
| | 医薬品 : 0.38% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 12,241 | Bayer AG Com NPV | 1,146,533 | 0.38 |
| | 不動産 : 0.17% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| 28,190 | TLG Immobilien AG Class A Com NPV | 505,302 | 0.17 |
| | 小売 : 0.00% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| | 半導体 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 10,914 | Infineon Technologies AG Class A Com NPV | 182,607 | 0.06 |
| | 通信 : 1.02% (31 May 2016: 0.45%) | | |
| 134,255 | Deutsche Telekom AG Com NPV | 2,113,479 | 0.69 |
| 26,246 | Drillisch AG Class A Com NPV | 1,011,073 | 0.33 |
| | ドイツ合計 | 11,598,278 | 3.82 |
| | 香港 : 0.08% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| | 各種持株会社 : 0.05% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 16,000 | Swire Pacific Ltd Class A Com HKD0.60 | 159,296 | 0.05 |
| | 水道 : 0.03% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 65,000 | Guangdong Investment Ltd Com NPV | 90,922 | 0.03 |
| | 香港合計 | 250,218 | 0.08 |
| | アイルランド : 2.75% (31 May 2016: 1.11%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.11% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,202 | Adient plc Com USD0.001 | 332,582 | 0.11 |
| | コンピューター : 0.84% (31 May 2016: 0.96%) | | |
| 12,703 | Accenture PLC Class A Com USD0.0000225 | 1,517,881 | 0.50 |
| 25,417 | Seagate Technology PLC Com USD0.00001 | 1,019,349 | 0.34 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | アイルランド(つづき) : 2.75% (31 May 2016: 1.11%) | | |
| | 電子 : 0.67% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 45,245 | Johnson Controls International PLC Com USD0.01 | 2,036,251 | 0.67 |
| | 食品 : 0.27% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 224,657 | Greencore Group PLC Com GBP0.01 | 816,938 | 0.27 |
| | ヘルスケア用品 : 0.71% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 29,588 | Medtronic PLC Com USD0.10 | 2,159,628 | 0.71 |
| | 各種製造業 : 0.15% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,837 | Eaton Corp Com PLC Com USD0.01 | 454,763 | 0.15 |
| | 不動産投資信託 : 0.00% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| | アイルランド合計 | 8,337,392 | 2.75 |
| | イスラエル : 0.40% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| | 銀行 : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | 化学 : 0.00% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| | 通信 : 0.40% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 654,182 | Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Com Ltd ILS1.00 | 1,205,337 | 0.40 |
| | イスラエル合計 | 1,205,337 | 0.40 |
| | イタリア : 2.00% (31 May 2016: 2.39%) | | |
| | 銀行 : 0.13% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 190,248 | UniCredit SpA Com NPV | 407,868 | 0.13 |
| | 商業サービス : 0.12% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 15,813 | Atlantia SpA Com EUR1.00 | 351,005 | 0.12 |
| | 電気 : 0.34% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 251,879 | Enel SpA Com EUR1.00 | 1,018,808 | 0.34 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | イタリア(つづき) : 2.00% (31 May 2016: 2.39%) | | |
| | エンジニアリング・建設 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 34,448 | Enav SpA Com NPV | 116,607 | 0.04 |
| | 娯楽 : 0.31% (31 May 2016: 0.56%) | | |
| 290,387 | RAI Way SpA Com NPV | 944,150 | 0.31 |
| | 保険 : 0.37% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| 18,652 | Assicurazioni Generali SpA Com EUR1.00 | 235,949 | 0.08 |
| 468,855 | UnipolSai SpA Com NPV | 896,245 | 0.29 |
| | 通信 : 0.69% (31 May 2016: 0.82%) | | |
| 24,170 | Ei Towers SpA Com EURO.10 | 1,096,347 | 0.36 |
| 236,895 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA Com NPV | 1,003,434 | 0.33 |
| | イタリア合計 | 6,070,413 | 2.00 |
| | 日本 : 6.55% (31 May 2016: 7.19%) | | |
| | 農業 : 0.11% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 9,300 | 日本たばこ産業 | 321,862 | 0.11 |
| | 航空 : 0.11% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 11,400 | 日本航空 | 338,613 | 0.11 |
| | 自動車製造 : 0.57% (31 May 2016: 0.90%) | | |
| 30,300 | 富士重工業 | 1,235,055 | 0.41 |
| 24,600 | 日野自動車 | 250,653 | 0.08 |
| 20,200 | いすゞ自動車 | 239,104 | 0.08 |
| | 自動車部品・装置 : 0.35% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 11,100 | ブリヂストン | 425,218 | 0.14 |
| 19,200 | 住友ゴム工業 | 318,132 | 0.10 |
| 26,300 | 東洋ゴム工業 | 322,446 | 0.11 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 日本(つづき) : 6.55% (31 May 2016: 7.19%) | | |
| | 銀行 : 0.69% (31 May 2016: 0.67%) | | |
| 117,000 | あおぞら銀行 | 403,023 | 0.13 |
| 135,200 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 793,556 | 0.26 |
| 92,247 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 553,021 | 0.18 |
| 21,000 | りそなホールディングス | 101,392 | 0.03 |
| 7,800 | 三井住友フィナンシャルグループ | 287,849 | 0.09 |
| | 飲料 : 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 化学 : 0.18% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 34,000 | 旭化成 | 303,611 | 0.10 |
| 16,300 | J S R | 235,248 | 0.08 |
| | 商業サービス : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,400 | セコム | 175,211 | 0.06 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.05% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 3,100 | 花王 | 143,227 | 0.05 |
| | 販売/卸売 : 0.49% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 79,700 | 伊藤忠商事 | 1,092,032 | 0.36 |
| 35,800 | 丸紅 | 196,838 | 0.06 |
| 17,100 | 住友商事 | 204,736 | 0.07 |
| | 各種金融サービス : 0.63% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 62,000 | 大和証券グループ本社 | 373,649 | 0.12 |
| 65,000 | めぶきフィナンシャルグループ | 237,307 | 0.08 |
| 82,728 | オリックス [†] | 1,294,001 | 0.43 |
| | 電気部品・設備 : 0.06% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 10,300 | ブラザー工業 | 176,812 | 0.06 |
| | 電子 : 0.13% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,500 | H O Y A | 177,638 | 0.06 |
| 20,800 | ミネベア | 207,005 | 0.07 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 日本(つづき) : 6.55% (31 May 2016: 7.19%) | | |
| | エンジニアリング・建設 : 0.01% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,410 | 熊谷組 [†] | 16,623 | 0.01 |
| | 食品 : 0.33% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 25,547 | セブン&アイ・ホールディングス [†] | 1,002,867 | 0.33 |
| | ガス : 0.08% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 68,000 | 大阪瓦斯 | 258,107 | 0.08 |
| | 工具・工作機械 : 0.08% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 11,000 | T H K | 237,580 | 0.08 |
| | 住宅建設 : 0.53% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| 97,900 | 積水ハウス | 1,606,034 | 0.53 |
| | 住宅家具 : 0.12% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 36,200 | パナソニック | 369,561 | 0.12 |
| | 保険 : 0.14% (31 May 2016: 0.20%) | | |
| 10,000 | 東京海上ホールディングス | 429,725 | 0.14 |
| | インターネット : 0.13% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 11,300 | ミクシィ | 393,708 | 0.13 |
| | 宿泊施設 : 0.15% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 23,893 | リゾートトラスト [†] | 467,501 | 0.15 |
| | 建設機械・採掘機械 : 0.00% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| | 各種機械 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 27,000 | 住友重機械工業 | 163,026 | 0.05 |
| | 鉱業 : 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 事務用機器 : 0.17% (31 May 2016: 0.37%) | | |
| 18,300 | キヤノン | 523,729 | 0.17 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 日本(つづき) : 6.55% (31 May 2016: 7.19%) | | |
| | 石油・ガス : 0.07% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| 22,000 | 東燃ゼネラル石油 | 210,066 | 0.07 |
| | 医薬品 : 0.14% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 20,900 | 第一三共 | 437,003 | 0.14 |
| | 不動産 : 0.11% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 1,400 | 大東建託 | 218,303 | 0.07 |
| 8,100 | 野村不動産ホールディングス | 131,689 | 0.04 |
| | 不動産投資信託 : 0.51% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| 1,377 | G L P 投資法人 | 1,549,269 | 0.51 |
| | 小売 : 0.13% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 2,400 | ローソン | 167,028 | 0.06 |
| 38,500 | ヤマダ電機 | 206,615 | 0.07 |
| | 半導体 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,600 | 東京エレクトロン | 146,983 | 0.05 |
| | 通信 : 0.23% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 7,000 | 日本電信電話 | 284,005 | 0.09 |
| 17,900 | N T T ドコモ | 412,449 | 0.14 |
| | 運輸 : 0.09% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 51,000 | 日本通運 | 264,522 | 0.09 |
| | 日本合計 | 19,903,632 | 6.55 |
| | ジャージー : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 石油・ガス・サービス : 0.09% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 26,646 | Petrofac Ltd Com USD0.02 | 264,418 | 0.09 |
| | ジャージー合計 | 264,418 | 0.09 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | ルクセンブルグ : 0.20% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | 金属加工/金属製品 : 0.20% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 37,678 | Tenaris SA Com USD1.00 | 602,530 | 0.20 |
| | 通信 : 0.00% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| | ルクセンブルグ合計 | <u>602,530</u> | <u>0.20</u> |
| | オランダ : 2.36% (31 May 2016: 1.57%) | | |
| | 銀行 : 0.42% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 93,331 | ING Groep NV Com EURO.01 | 1,272,468 | 0.42 |
| | 化学 : 0.76% (31 May 2016: 0.82%) | | |
| 25,491 | LyondellBasell Industries NV Class A Com EURO.04 | 2,301,965 | 0.76 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.17% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 12,574 | Unilever NV EURO.16 | 504,929 | 0.17 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.30% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 29,205 | Boskalis Westminster Com EURO.80 | 912,458 | 0.30 |
| | 食品 : 0.45% (31 May 2016: 0.39%) | | |
| 69,398 | Koninklijke Ahold Delhaize NV Com EURO.01 | 1,370,204 | 0.45 |
| | 各種機械 : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 50,975 | CNH Industrial NV Com EURO.01 | 434,892 | 0.14 |
| | メディア : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 22,193 | Altice NV Com EURO.01 | 382,328 | 0.12 |
| | オランダ合計 | <u>7,179,244</u> | <u>2.36</u> |
| | ニュージーランド : 0.42% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| | 建設資材 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 20,123 | Fletcher Building Ltd Com NPV | 147,267 | 0.05 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | ニュージーランド(つづき) : 0.42% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| | 宿泊施設 : 0.37% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| 404,864 | SKYCITY Entertainment Group Ltd Com NPV | 1,134,957 | 0.37 |
| | ニュージーランド合計 | 1,282,224 | 0.42 |
| | ノルウェー : 1.14% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| | 保険 : 0.76% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 437,935 | Storebrand ASA Com NOK5.00 | 2,292,264 | 0.76 |
| | 鉱業 : 0.00% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 通信 : 0.24% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| 49,820 | Telenor ASA Com NOK6.00 | 736,490 | 0.24 |
| | 運輸 : 0.14% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 54,661 | Ocean Yield ASA Com NOK10.00 | 439,020 | 0.14 |
| | ノルウェー合計 | 3,467,774 | 1.14 |
| | パナマ : 0.52% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 航空 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 余暇 : 0.52% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 30,597 | Carnival Corp Com USD0.01 | 1,573,145 | 0.52 |
| | パナマ合計 | 1,573,145 | 0.52 |
| | 中国 : 0.98% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| | 銀行 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 85,000 | Bank of Communications Co Ltd Com CNY1.00 | 65,476 | 0.02 |
| | 建設資材 : 0.25% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 263,000 | Anhui Conch Cement Co Ltd Com CNY1.00 | 762,046 | 0.25 |
| | 商業サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.07%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 中国(つづき) : 0.98% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| | 各種金融サービス : 0.08% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 713,000 | China Cinda Asset Management Co Ltd Com CNY1.00 | 256,920 | 0.08 |
| | 電気 : 0.00% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| | エンジニアリング・建設 : 0.09% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 262,000 | Beijing Capital International Airport Co Ltd Com CNY1.00 | 259,242 | 0.09 |
| | 保険 : 0.31% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 168,500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Com CNY1.00 | 932,472 | 0.31 |
| | 石油・ガス : 0.23% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,006,000 | China Petroleum & Chemical Corp Com CNY1.00 | 703,596 | 0.23 |
| | 中国合計 | 2,979,752 | 0.98 |
| | ポルトガル : 0.98% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| | 商業サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.33%) | | |
| | 電気 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 50,028 | EDP - Energias de Portugal SA Com EUR1.00 | 144,668 | 0.05 |
| | 食品 : 0.12% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 23,710 | Jeronimo Martins SGPS SA Com EUR1.00 | 374,444 | 0.12 |
| | 石油・ガス : 0.81% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 181,071 | Galp Energia SGPS SA Com EUR1.00 | 2,453,343 | 0.81 |
| | ポルトガル合計 | 2,972,455 | 0.98 |
| | 韓国 : 0.46% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 通信 : 0.46% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 101,515 | KT Corp Com ADR NPV | 1,408,521 | 0.46 |
| | 韓国合計 | 1,408,521 | 0.46 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | ロシア連邦 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 鉱業 : 0.05% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 9,713 | MMC Norilsk Nickel PJSC ADR NPV | 162,450 | 0.05 |
| | ロシア連邦合計 | 162,450 | 0.05 |
| | シンガポール : 0.70% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| | 食品 : 0.06% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 77,700 | Wilmar International Ltd Com NPV | 191,212 | 0.06 |
| | 不動産投資信託 : 0.06% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 114,200 | CapitaLand Mall Trust Reits NPV | 155,267 | 0.05 |
| 58,400 | Mapletree Logistics Trust Reits NPV | 41,178 | 0.01 |
| | 半導体 : 0.44% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,809 | Broadcom Ltd NPV | 1,331,005 | 0.44 |
| | 造船 : 0.14% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 730,700 | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd Com NPV | 417,025 | 0.14 |
| | シンガポール合計 | 2,135,687 | 0.70 |
| | 南アフリカ : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 鉄・鉄鋼 : 0.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 5,799 | Kumba Iron Ore Ltd Com ZAR0.0001 | 68,693 | 0.02 |
| | 南アフリカ合計 | 68,693 | 0.02 |
| | スペイン : 1.45% (31 May 2016: 2.11%) | | |
| | 銀行 : 0.17% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 116,294 | Banco Santander SA Com EURO.50 | 531,948 | 0.17 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.00% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 娯楽 : 0.31% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 68,141 | Parques Reunidos Servicios Centrales SAU Class C Com NPV | 949,089 | 0.31 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | スペイン(つづき) : 1.45% (31 May 2016: 2.11%) | | |
| | ガス : 0.18% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| 22,150 | Enagas SA Com EUR1.50 | 546,181 | 0.18 |
| | 石油・ガス : 0.40% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 89,930 | Repsol SA Com EUR1.00 | 1,202,250 | 0.40 |
| | 通信 : 0.39% (31 May 2016: 0.51%) | | |
| 137,887 | Euskaltel SA Com NPV | 1,171,700 | 0.39 |
| | スペイン合計 | 4,401,168 | 1.45 |
| | スウェーデン : 1.77% (31 May 2016: 1.84%) | | |
| | 農業 : 0.10% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 10,099 | Swedish Match AB Class A Com SEK1.9823 | 315,211 | 0.10 |
| | 自動車製造 : 0.00% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| | 銀行 : 0.86% (31 May 2016: 0.87%) | | |
| 97,436 | Nordea Bank AB Class A Com SEK1.00 | 1,020,323 | 0.34 |
| 68,673 | Swedbank AB Class A Com SEK22.00 | 1,581,443 | 0.52 |
| | 商業サービス : 0.64% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 133,068 | Securitas AB Com SEK1.00 | 1,953,788 | 0.64 |
| | 通信 : 0.17% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 40,924 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson Class B Com SEK5.00 | 210,782 | 0.07 |
| 78,725 | Telia Co AB Class A Com SEK3.20 | 294,281 | 0.10 |
| | スウェーデン合計 | 5,375,828 | 1.77 |
| | スイス : 2.78% (31 May 2016: 3.83%) | | |
| | 商業サービス : 0.14% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| 6,788 | Adecco Group AG Com CHF1.00 | 417,316 | 0.14 |
| | 各種金融サービス : 0.17% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 7,141 | Cembra Money Bank AG Class A Com CHF1.00 | 526,646 | 0.17 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | スイス(つづき) : 2.78% (31 May 2016: 3.83%) | | |
| | 食品 : 0.18% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 8,019 | Nestle SA Com CHF0.10 | 538,654 | 0.18 |
| | ヘルスケア用品 : 0.06% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 1,390 | Sonova Holding AG Com CHF0.05 | 167,772 | 0.06 |
| | 保険 : 0.88% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| 10,195 | Zurich Insurance Group AG Class A Com CHF0.10 | 2,667,724 | 0.88 |
| | 金属加工/金属製品 : 0.00% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| | 医薬品 : 1.30% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| 15,517 | Novartis AG Com CHF0.50 | 1,069,731 | 0.35 |
| 13,034 | Roche Holding AG Com NPV | 2,900,070 | 0.95 |
| | 通信 : 0.05% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 385 | Swisscom AG Com CHF1.00 | 164,201 | 0.05 |
| | スイス合計 | 8,452,114 | 2.78 |
| | 台湾 : 0.93% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 電子 : 0.25% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 318,966 | Pegatron Corp Com TWD10.00 | 758,561 | 0.25 |
| | 半導体 : 0.40% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 210,267 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 1,208,905 | 0.40 |
| | 通信 : 0.28% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 364,200 | Far EastTone Telecommunications Co Ltd Com TWD10.00 | 844,426 | 0.28 |
| | 台湾合計 | 2,811,892 | 0.93 |
| | 英国 : 8.75% (31 May 2016: 7.40%) | | |
| | 航空・防衛 : 0.28% (31 May 2016: 0.56%) | | |
| 29,340 | BAE Systems PLC Com GBPO.025 | 220,219 | 0.07 |
| 313,758 | Cobham PLC Com GBPO.025 | 644,463 | 0.21 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 英国(つづき) : 8.75% (31 May 2016: 7.40%) | | |
| | 農業 : 0.64% (31 May 2016: 1.08%) | | |
| 12,734 | British American Tobacco PLC Com GBPO.25 | 699,079 | 0.23 |
| 28,919 | Imperial Brands PLC Com GBPO.10 | 1,240,572 | 0.41 |
| | 銀行 : 0.75% (31 May 2016: 1.25%) | | |
| 24,453 | BGEO Group PLC Com GBPO.01 | 905,549 | 0.30 |
| 173,844 | HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 1,379,224 | 0.45 |
| | 化学 : 0.19% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 116,622 | Essentra PLC Com GBPO.2 | 577,657 | 0.19 |
| | 商業サービス : 0.76% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 163,118 | Babcock International Group PLC Com GBPO.60 | 1,946,796 | 0.64 |
| 17,826 | Capita PLC Com GBPO.020667 | 116,760 | 0.04 |
| 83,129 | G4S PLC Com GBPO.25 | 253,629 | 0.08 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.13% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 10,037 | Unilever PLC Com GBPO.0311 | 400,754 | 0.13 |
| | 各種金融サービス : 0.26% (31 May 2016: 0.63%) | | |
| 102,098 | Aberdeen Asset Management PLC Com GBPO.10 | 341,737 | 0.11 |
| 12,124 | Provident Financial PLC Com GBPO.2072727 | 441,480 | 0.15 |
| | 電気 : 0.19% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 30,502 | SSE PLC Com GBPO.50 | 561,920 | 0.19 |
| | 娯楽 : 0.23% (31 May 2016: 0.43%) | | |
| 12,624 | International Game Technology PLC Com USD0.10 | 325,636 | 0.11 |
| 98,366 | William Hill PLC Com GBPO.10 | 370,109 | 0.12 |
| | 林産品・紙製品 : 0.09% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 13,323 | Mondi PLC Com EURO.20 | 271,742 | 0.09 |
| | ガス : 0.25% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 67,177 | National Grid PLC Com GBPO.1139535 | 766,499 | 0.25 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 英国(つづき) : 8.75% (31 May 2016: 7.40%) | | |
| | 住宅建設 : 0.69% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 175,283 | Barratt Developments PLC Com GBPO.10 | 1,027,432 | 0.34 |
| 34,281 | Bellway PLC Com GBPO.125 | 1,045,711 | 0.35 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.10% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 3,641 | Reckitt Benckiser Group PLC Com GBPO.10 | 307,562 | 0.10 |
| | 保険 : 0.58% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 78,062 | Prudential PLC Com GBPO.05 | 1,509,531 | 0.50 |
| 58,190 | Standard Life PLC Com GBPO.122222 | 251,296 | 0.08 |
| | 各種機械 : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| | 鉱業 : 1.15% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 212,887 | BHP Billiton PLC Com USD0.50 | 3,494,326 | 1.15 |
| | 石油・ガス : 0.45% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 238,760 | BP PLC Com USD0.25 | 1,370,719 | 0.45 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.21% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 117,879 | Amec Foster Wheeler PLC Com GBPO.50 | 642,574 | 0.21 |
| | 医薬品 : 0.00% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| | プライベート・エクイティ : 0.26% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| 90,874 | 3i Group PLC Com GBPO.738636 | 781,993 | 0.26 |
| | 不動産 : 0.30% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 433,208 | McCarthy & Stone PLC Com GBPO.08 | 901,452 | 0.30 |
| | 小売 : 0.22% (31 May 2016: 0.34%) | | |
| 44,951 | Marks & Spencer Group PLC Com GBPO.25 | 184,660 | 0.06 |
| 7,643 | Next PLC Com GBPO.10 | 468,243 | 0.16 |
| | ソフトウェア : 0.00% (31 May 2016: 0.15%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 英国(つづき) : 8.75% (31 May 2016: 7.40%) | | |
| | 通信 : 1.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 436,279 | BT Group PLC Com GBPO.05 | 1,945,824 | 0.64 |
| 480,165 | Vodafone Group PLC Com USD0.2095 | 1,163,391 | 0.38 |
| | 英国合計 | 26,558,539 | 8.75 |
| | 米国 : 43.97% (31 May 2016: 47.27%) | | |
| | 航空・防衛 : 0.00% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| | 農業 : 2.22% (31 May 2016: 1.95%) | | |
| 51,073 | Altria Group Inc Com USD0.333 | 3,265,352 | 1.08 |
| 39,226 | Philip Morris International Inc Com NPV | 3,465,029 | 1.14 |
| | アパレル : 0.36% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 47,262 | Hanesbrands Inc Com USD0.01 | 1,097,187 | 0.36 |
| | 自動車製造 : 1.22% (31 May 2016: 1.51%) | | |
| 97,671 | Ford Motor Co Class C Com USD0.01 | 1,168,634 | 0.38 |
| 1,050 | General Motors Co Class C Com USD0.01 | 36,325 | 0.01 |
| 73,164 | General Motors Co Class C Com USD0.01 | 2,527,450 | 0.83 |
| | 自動車部品・装置 : 0.00% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| | 銀行 : 3.29% (31 May 2016: 2.18%) | | |
| 34,158 | Bank of America Corp Com USD0.01 | 722,271 | 0.24 |
| 13,218 | Bank of New York Mellon Corp Com USD0.01 | 626,731 | 0.21 |
| 27,820 | Citigroup Inc Com USD0.01 | 1,569,465 | 0.52 |
| 40,886 | JPMorgan Chase & Co Class C Com USD1.00 | 3,278,035 | 1.08 |
| 5,861 | State Street Corp Com USD1.00 | 461,759 | 0.15 |
| 17,460 | Wells Fargo & Co Class C Com USD1.666 | 924,245 | 0.31 |
| 59,756 | Zions Bancorporation Com NPV | 2,377,990 | 0.78 |
| | 飲料 : 0.73% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 22,268 | PepsiCo Inc Com USD0.017 | 2,230,252 | 0.73 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 米国(つづき) : 43.97% (31 May 2016: 47.27%) | | |
| | バイオテクノロジー : 0.50% (31 May 2016: 0.96%) | | |
| 6,988 | Amgen Inc Com USD0.0001 | 1,006,901 | 0.33 |
| 6,815 | Gilead Sciences Inc Com USD0.001 | 502,402 | 0.17 |
| | 建設資材 : 0.78% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 42,771 | Fortune Brands Home & Security Inc Com USD0.01 | 2,359,890 | 0.78 |
| | 商業サービス : 0.53% (31 May 2016: 1.11%) | | |
| 32,895 | H&R Block Inc Com NPV | 729,447 | 0.24 |
| 41,504 | Western Union Co Class C Com USD0.01 | 873,037 | 0.29 |
| | コンピューター : 2.77% (31 May 2016: 2.79%) | | |
| 22,910 | Apple Inc Com USD0.00001 | 2,531,899 | 0.83 |
| 45,153 | Hewlett Packard Enterprise Co Com USD0.01 | 1,074,416 | 0.35 |
| 53,602 | HP Inc Com USD0.01 | 825,739 | 0.27 |
| 10,368 | International Business Machines Corp Com USD0.20 | 1,683,089 | 0.56 |
| 36,442 | Western Digital Corp Com USD0.01 | 2,320,080 | 0.76 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.36% (31 May 2016: 0.69%) | | |
| 13,329 | Procter & Gamble Co Com NPV | 1,099,309 | 0.36 |
| | 販売/卸売 : 0.26% (31 May 2016: 0.45%) | | |
| 16,413 | Fastenal Co Class C Com USD0.01 | 778,140 | 0.26 |
| | 各種金融サービス : 1.49% (31 May 2016: 2.05%) | | |
| 14,506 | CME Group Inc/IL Com USD0.01 | 1,637,800 | 0.54 |
| 105,121 | Navient Corp Com USD0.01 | 1,810,709 | 0.60 |
| 31,093 | Synchrony Financial Com USD0.001 | 1,074,730 | 0.35 |
| | 電気 : 1.29% (31 May 2016: 0.98%) | | |
| 25,958 | CMS Energy Corp Com USD0.01 | 1,044,161 | 0.34 |
| 19,044 | Entergy Corp Com USD0.01 | 1,308,989 | 0.43 |
| 49,324 | OGE Energy Corp Com USD0.01 | 1,561,844 | 0.52 |
| | 電気部品・設備 : 0.15% (31 May 2016: 0.61%) | | |
| 8,292 | Emerson Electric Co Class C Com USD0.50 | 468,291 | 0.15 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 米国(つづき) : 43.97% (31 May 2016: 47.27%) | | |
| | 電子 : 0.45% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 56,633 | Corning Inc Com USD0.50 | 1,361,174 | 0.45 |
| | 食品 : 0.92% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 28,258 | Kraft Heinz Co/The Com USD0.01 | 2,307,407 | 0.76 |
| 9,118 | Sysco Corp Com USD1.00 | 485,670 | 0.16 |
| | 林産品・紙製品 : 0.39% (31 May 2016: 0.60%) | | |
| 24,138 | International Paper Co Class C Com USD1.00 | 1,176,124 | 0.39 |
| | ヘルスケア用品 : 0.38% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 30,181 | Abbott Laboratories Com NPV | 1,149,142 | 0.38 |
| | ヘルスケア・サービス : 0.67% (31 May 2016: 0.52%) | | |
| 3,960 | Aetna Inc Com USD0.01 | 517,968 | 0.17 |
| 9,630 | UnitedHealth Group Inc Com USD0.01 | 1,526,403 | 0.50 |
| | 住宅家具 : 0.82% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 52,857 | Newell Brands Inc Com USD1.00 | 2,484,543 | 0.82 |
| | 保険 : 2.10% (31 May 2016: 1.32%) | | |
| 55,103 | Arthur J Gallagher & Co Class C Com USD1.00 | 2,774,161 | 0.91 |
| 18,649 | Hartford Financial Services Group Inc Com USD0.01 | 878,834 | 0.29 |
| 38,208 | MetLife Inc Com USD0.01 | 2,101,631 | 0.69 |
| 6,431 | Prudential Financial Inc Com USD0.01 | 647,023 | 0.21 |
| | インターネット : 0.45% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,746 | Alphabet Inc Com USD0.001 | 1,354,189 | 0.45 |
| | 鉄・鉄鋼 : 0.19% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,957 | Reliance Steel & Aluminum Co Com NPV | 564,456 | 0.19 |
| | 宿泊施設 : 0.34% (31 May 2016: 0.33%) | | |
| 16,324 | Las Vegas Sands Corp Com USD0.001 | 1,023,433 | 0.34 |
| | 各種機械 : 0.52% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 11,229 | Cummins Inc Com USD2.50 | 1,592,104 | 0.52 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 米国(つづき) : 43.97% (31 May 2016: 47.27%) | | |
| | メディア : 0.56% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 7,074 | Scripps Networks Interactive Inc Class A Com USD0.01 | 489,981 | 0.16 |
| 33,655 | TEGNA Inc Com USD1.00 | 755,386 | 0.25 |
| 4,587 | Walt Disney Co Com USD0.01 | 454,870 | 0.15 |
| | 各種製造業 : 1.16% (31 May 2016: 1.30%) | | |
| 12,736 | Dover Corp Com USD1.00 | 924,825 | 0.31 |
| 83,782 | General Electric Co Class C Com USD0.06 | 2,580,067 | 0.85 |
| | 石油・ガス : 3.47% (31 May 2016: 3.17%) | | |
| 13,910 | Chevron Corp Com USD0.75 | 1,552,565 | 0.51 |
| 39,004 | Exxon Mobil Corp Com NPV | 3,405,634 | 1.12 |
| 7,051 | Hess Corp Com USD1.00 | 394,539 | 0.13 |
| 51,265 | HollyFrontier Corp Com USD0.01 | 1,475,150 | 0.49 |
| 19,438 | Occidental Petroleum Corp Com USD0.20 | 1,387,776 | 0.46 |
| 37,235 | Valero Energy Corp Com USD0.01 | 2,294,979 | 0.76 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.27%) | | |
| | 医薬品 : 4.44% (31 May 2016: 5.66%) | | |
| 35,060 | AbbVie Inc Com USD0.01 | 2,131,823 | 0.70 |
| 11,809 | AmerisourceBergen Corp Com USD0.01 | 921,279 | 0.30 |
| 7,805 | Cardinal Health Inc Com NPV | 554,272 | 0.18 |
| 30,096 | Eli Lilly & Co Class C Com NPV | 2,020,495 | 0.67 |
| 10,430 | Johnson & Johnson Com USD1.00 | 1,161,850 | 0.38 |
| 32,901 | Merck & Co Inc Com USD0.50 | 2,014,693 | 0.66 |
| 146,110 | Pfizer Inc Com USD0.05 | 4,699,628 | 1.55 |
| | プライベート・エクイティ : 0.49% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 10,433 | Blackstone Group LP NPV | 268,493 | 0.09 |
| 21,219 | Carlyle Group LP CNY1CNY1.00 | 329,425 | 0.11 |
| 57,809 | KKR & Co LP NPV | 885,345 | 0.29 |
| | 不動産投資信託 : 2.11% (31 May 2016: 2.21%) | | |
| 18,061 | American Tower Corp Reits USD0.01 | 1,847,369 | 0.61 |
| 2,684 | Equinix Inc Com Reits USD0.001 | 909,178 | 0.30 |
| 17,807 | GEO Group Inc/The Reits USD0.01 | 592,172 | 0.19 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------|--|--------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 96.44% (31 May 2016: 99.47%) | | |
| | 米国(つづき) : 43.97% (31 May 2016: 47.27%) | | |
| | 不動産投資信託(つづき) : 2.11% (31 May 2016: 2.21%) | | |
| 20,259 | HCP Inc Reits USD1.00 | 598,552 | 0.20 |
| 61,010 | Host Hotels & Resorts Inc Reits USD0.01 | 1,089,944 | 0.36 |
| 25,309 | Liberty Property Trust Reits USD0.001 | 998,060 | 0.33 |
| 14,692 | Outfront Media Inc Reits USD0.01 | 370,606 | 0.12 |
| | 小売 : 3.58% (31 May 2016: 3.87%) | | |
| 35,833 | Gap Inc Com USD0.05 | 894,929 | 0.29 |
| 19,256 | Home Depot Inc Com USD0.05 | 2,492,978 | 0.82 |
| 16,155 | Kohl's Corp Com USD0.01 | 869,704 | 0.29 |
| 18,601 | McDonald's Corp Com USD0.01 | 2,219,378 | 0.73 |
| 395,521 | Staples Inc Com USD0.0006 | 3,826,666 | 1.26 |
| 8,331 | Wal-Mart Stores Inc Com USD0.10 | 587,044 | 0.19 |
| | 半導体 : 0.87% (31 May 2016: 1.55%) | | |
| 63,949 | Intel Corp Com USD0.001 | 2,219,350 | 0.73 |
| 6,156 | QUALCOMM Inc Com USD0.0001 | 419,347 | 0.14 |
| | ソフトウェア : 2.22% (31 May 2016: 3.83%) | | |
| 32,343 | Activision Blizzard Inc Com USD0.000001 | 1,183,916 | 0.39 |
| 38,889 | CA Inc Com USD0.10 | 1,243,087 | 0.41 |
| 71,412 | Microsoft Corp Com USD0.00000625 | 4,303,287 | 1.42 |
| | 通信 : 1.40% (31 May 2016: 2.46%) | | |
| 38,814 | AT&T Inc Com USD1.00 | 1,500,743 | 0.49 |
| 52,527 | Cisco Systems Inc Com USD0.001 | 1,566,880 | 0.52 |
| 23,870 | Verizon Communications Inc Com USD0.10 | 1,191,232 | 0.39 |
| | 玩具/ゲーム/趣味 : 0.25% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| 9,020 | Hasbro Inc Com USD0.50 | 770,353 | 0.25 |
| | 運輸 : 0.24% (31 May 2016: 1.19%) | | |
| 6,362 | United Parcel Service Inc Class B Com USD0.01 | 737,960 | 0.24 |
| | 米国合計 | 133,521,670 | 43.97 |
| | 株式合計 | 292,862,196 | 96.44 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--------|--------------------------------------|---------------|--------------|
| | 権利証券 : 0.01% (31 May 2016: 0.02%) | | |
| | オーストラリア : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 35,746 | Boral Ltd NPV | 6,141 | - |
| | オーストラリア合計 | 6,141 | - |
| | ジャージー : 0.00% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| | 米国 : 0.01% (31 May 2016: 0.01%) | | |
| 15,678 | Safeway CASA LEY USD1.00 ** | 15,912 | 0.01 |
| 15,678 | Safeway PDC LLV USD1.00 ** | 765 | - |
| | 米国合計 | 16,677 | 0.01 |
| | 権利証券合計 | 22,818 | 0.01 |
| | 先渡為替契約 : -0.53% (31 May 2016: 0.31%) | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 15,987,587 | EUR | 14,198,000 | 13/12/2016 | 918,352 | 0.30 |
| UBS | GBP | 49,114,903 | USD | 60,861,223 | 15/12/2016 | 526,638 | 0.17 |
| UBS | USD | 1,303,053 | EUR | 1,165,000 | 13/12/2016 | 66,564 | 0.02 |
| UBS | USD | 999,600 | JPY | 112,320,000 | 13/12/2016 | 13,272 | 0.01 |
| UBS | USD | 32,852 | EUR | 29,706 | 15/12/2016 | 1,319 | - |
| UBS | USD | 84,942 | EUR | 79,141 | 15/12/2016 | 935 | - |
| UBS | USD | 9,145 | EUR | 8,269 | 15/12/2016 | 367 | - |
| UBS | USD | 30,162 | EUR | 28,233 | 15/12/2016 | 193 | - |
| UBS | USD | 5,964 | EUR | 5,442 | 15/12/2016 | 187 | - |
| UBS | GBP | 25,000 | USD | 31,133 | 15/12/2016 | 114 | - |
| UBS | USD | 6,390 | EUR | 5,951 | 15/12/2016 | 73 | - |
| UBS | GBP | 20,000 | USD | 24,957 | 15/12/2016 | 40 | - |
| UBS | USD | 16,230 | EUR | 15,270 | 15/12/2016 | 21 | - |

先渡為替契約(つづき) : -0.53% (31 May 2016: 0.31%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|-----------|-----|-----------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | USD | 3,333 | EUR | 3,121 | 15/12/2016 | 21 | - |
| UBS | USD | 8,476 | GBP | 6,776 | 15/12/2016 | 7 | - |
| UBS | GBP | 499 | USD | 621 | 15/12/2016 | 2 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 1,528,105 | 0.50 |
| UBS | EUR | 216 | USD | 235 | 15/12/2016 | (6) | - |
| UBS | USD | 27,526 | EUR | 25,945 | 15/12/2016 | (14) | - |
| UBS | USD | 28,341 | EUR | 26,712 | 15/12/2016 | (14) | - |
| UBS | USD | 8,057 | EUR | 7,604 | 15/12/2016 | (14) | - |
| UBS | USD | 6,116 | EUR | 5,780 | 15/12/2016 | (19) | - |
| UBS | USD | 3,357 | EUR | 3,186 | 15/12/2016 | (25) | - |
| UBS | EUR | 56,737 | USD | 60,275 | 15/12/2016 | (49) | - |
| UBS | EUR | 10,115 | USD | 10,807 | 15/12/2016 | (69) | - |
| UBS | USD | 12,424 | GBP | 10,008 | 15/12/2016 | (85) | - |
| UBS | USD | 6,878 | GBP | 5,586 | 15/12/2016 | (103) | - |
| UBS | USD | 44,841 | EUR | 42,346 | 15/12/2016 | (109) | - |
| UBS | USD | 30,476 | GBP | 24,472 | 15/12/2016 | (112) | - |
| UBS | USD | 69,293 | EUR | 65,394 | 15/12/2016 | (123) | - |
| UBS | USD | 26,927 | EUR | 25,553 | 15/12/2016 | (197) | - |
| UBS | USD | 43,138 | GBP | 34,783 | 15/12/2016 | (337) | - |
| UBS | EUR | 258,704 | USD | 274,978 | 15/12/2016 | (367) | - |
| UBS | USD | 77,524 | GBP | 62,390 | 15/12/2016 | (455) | - |
| UBS | USD | 200,990 | GBP | 161,963 | 15/12/2016 | (1,444) | - |
| UBS | EUR | 138,158 | USD | 148,288 | 15/12/2016 | (1,635) | - |
| UBS | GBP | 126,618 | USD | 160,040 | 15/12/2016 | (1,783) | - |
| UBS | GBP | 199,184 | USD | 251,761 | 15/12/2016 | (2,805) | - |
| UBS | EUR | 183,430 | USD | 199,749 | 15/12/2016 | (5,040) | - |
| UBS | EUR | 233,737 | USD | 254,147 | 15/12/2016 | (6,038) | - |
| UBS | USD | 1,027,331 | GBP | 827,552 | 15/12/2016 | (7,012) | - |
| UBS | GBP | 760,753 | USD | 961,564 | 15/12/2016 | (10,712) | - |
| UBS | USD | 963,062 | GBP | 780,000 | 15/12/2016 | (11,778) | - |
| UBS | USD | 2,550,714 | GBP | 2,050,626 | 15/12/2016 | (12,327) | - |
| UBS | GBP | 1,002,581 | USD | 1,267,226 | 15/12/2016 | (14,117) | - |
| UBS | EUR | 676,945 | USD | 736,056 | 15/12/2016 | (17,487) | (0.01) |
| UBS | GBP | 1,374,752 | USD | 1,737,636 | 15/12/2016 | (19,357) | (0.01) |
| UBS | EUR | 931,620 | USD | 1,012,970 | 15/12/2016 | (24,066) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,066,585 | USD | 1,159,720 | 15/12/2016 | (27,553) | (0.01) |
| UBS | GBP | 1,977,796 | USD | 2,499,862 | 15/12/2016 | (27,848) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,193,964 | USD | 1,298,223 | 15/12/2016 | (30,843) | (0.01) |

先渡為替契約(つづき) : -0.53% (31 May 2016: 0.31%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|-------------|-----|-------------|----------------|--------------------|---------------|
| UBS | GBP | 2,744,462 | USD | 3,468,899 | 15/12/2016 | (38,643) | (0.01) |
| UBS | EUR | 2,207,185 | USD | 2,399,919 | 15/12/2016 | (57,017) | (0.02) |
| UBS | GBP | 780,000 | USD | 1,037,322 | 13/12/2016 | (62,482) | (0.02) |
| UBS | EUR | 1,165,000 | USD | 1,314,295 | 13/12/2016 | (77,807) | (0.03) |
| UBS | EUR | 6,435,471 | USD | 6,997,423 | 15/12/2016 | (166,245) | (0.06) |
| UBS | EUR | 6,763,674 | USD | 7,354,285 | 15/12/2016 | (174,724) | (0.06) |
| UBS | GBP | 14,006,359 | USD | 17,703,520 | 15/12/2016 | (197,216) | (0.07) |
| UBS | EUR | 19,123,022 | USD | 20,792,863 | 15/12/2016 | (493,998) | (0.16) |
| UBS | GBP | 116,402,129 | USD | 147,127,984 | 15/12/2016 | (1,638,993) | (0.54) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (3,131,068) | (1.03) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (1,602,963) | (0.53) |
| 投資総額 | | | | | | 291,282,051 | 95.92 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 15,508,124 | 5.10 |
| その他の純負債 | | | | | | (3,107,230) | (1.02) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 303,682,945 | 100.00 |

| 総資産の分析 | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 94.08 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.49 |
| その他の資産 | 5.43 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** スティール・プライス(取引が頻繁でなく流動性が低いため長期間変動していない価格)で評価される。

† ファンドの純資産の1.65%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|---------------|---|-------------------|--------------|
| | 債券 : 90.18% (31 May 2016: 86.15%) | | |
| | アルゼンチン : 0.51% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 国債 : 0.51% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,507,000 | Argentine Bonos del Tesoro 15.5% 17/10/2026 | 154,561 | 0.14 |
| 3,080,000 | Argentine Bonos del Tesoro 16% 17/10/2023 | 189,043 | 0.17 |
| 81,190 | Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033 | 85,136 | 0.08 |
| 123,849 | Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033 'REGS' | 128,095 | 0.12 |
| | アルゼンチン合計 | 556,835 | 0.51 |
| | ブラジル : 16.50% (31 May 2016: 15.36%) | | |
| | 国債 : 14.83% (31 May 2016: 15.36%) | | |
| 23,000 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2017 | 67,225 | 0.06 |
| 294,200 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2018 | 769,400 | 0.71 |
| 333,400 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2018 | 827,669 | 0.76 |
| 221,100 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2019 | 520,021 | 0.48 |
| 104,000 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2019 | 231,817 | 0.21 |
| 528,000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2018 | 1,531,978 | 1.40 |
| 1,432,000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2021 | 4,014,640 | 3.68 |
| 1,711,200 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2023 | 4,685,448 | 4.30 |
| 1,265,800 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2025 | 3,412,494 | 3.13 |
| 40,100 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2027 | 106,689 | 0.10 |
| | インデックス連動国債 : 1.67% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 76,000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series B 6% 15/08/2020 | 637,761 | 0.58 |
| 137,800 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Series B 6% 15/05/2045 | 1,186,935 | 1.09 |
| | ブラジル合計 | 17,992,077 | 16.50 |
| | コロンビア : 10.77% (31 May 2016: 9.11%) | | |
| | 国債 : 10.36% (31 May 2016: 9.11%) | | |
| 456,000,000 | Colombia Government International Bond 4.375% 21/03/2023 | 129,459 | 0.12 |
| 528,000,000 | Colombia Government International Bond 7.75% 14/04/2021 | 180,935 | 0.17 |
| 1,058,000,000 | Colombia Government International Bond 9.85% 28/06/2027 | 405,609 | 0.37 |
| 1,084,000,000 | Colombian TES 5% 21/11/2018 | 347,642 | 0.32 |
| 4,657,500,000 | Colombian TES 7% 04/05/2022 | 1,542,878 | 1.41 |
| 4,925,100,000 | Colombian TES 7.5% 26/08/2026 | 1,642,955 | 1.51 |
| 2,131,200,000 | Colombian TES 7.75% 18/09/2030 | 712,842 | 0.65 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|----------------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.18% (31 May 2016: 86.15%) | | |
| | コロンビア(つづき) : 10.77% (31 May 2016: 9.11%) | | |
| | 国債(つづき) : 10.36% (31 May 2016: 9.11%) | | |
| 14,950,400,000 | Colombian TES 10% 24/07/2024 | 5,719,121 | 5.24 |
| 1,652,800,000 | Colombian TES 11% 24/07/2020 | 616,376 | 0.57 |
| | 地方債 : 0.41% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 1,350,000,000 | Bogota Distrito Capital 9.75% 26/07/2028 | 451,684 | 0.41 |
| | コロンビア合計 | 11,749,501 | 10.77 |
| | インドネシア : 9.22% (31 May 2016: 8.83%) | | |
| | 国債 : 9.22% (31 May 2016: 8.83%) | | |
| 8,909,000,000 | Indonesia Treasury Bond 5.625% 15/05/2023 | 575,405 | 0.53 |
| 3,230,000,000 | Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/05/2028 | 201,082 | 0.18 |
| 1,400,000,000 | Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/05/2033 | 88,349 | 0.08 |
| 8,233,000,000 | Indonesia Treasury Bond 7% 15/05/2022 | 578,910 | 0.53 |
| 2,000,000,000 | Indonesia Treasury Bond 7% 15/05/2027 | 137,344 | 0.13 |
| 479,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/07/2021 | 35,839 | 0.03 |
| 1,400,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/06/2032 | 102,293 | 0.09 |
| 20,493,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/05/2036 | 1,522,361 | 1.40 |
| 4,709,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/03/2024 | 349,375 | 0.32 |
| 14,877,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/09/2026 | 1,123,648 | 1.03 |
| 24,421,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/03/2034 | 1,798,351 | 1.65 |
| 23,105,000,000 | Indonesia Treasury Bond 8.75% 15/05/2031 | 1,780,291 | 1.63 |
| 22,665,000,000 | Indonesia Treasury Bond 9% 15/03/2029 | 1,766,039 | 1.62 |
| | インドネシア合計 | 10,059,287 | 9.22 |
| | マレーシア : 6.14% (31 May 2016: 7.34%) | | |
| | 国債 : 6.14% (31 May 2016: 7.34%) | | |
| 9,200,000 | Malaysia Government Bond 3.26% 01/03/2018 | 2,044,765 | 1.87 |
| 4,970,000 | Malaysia Government Bond 3.314% 31/10/2017 | 1,111,183 | 1.02 |
| 1,660,000 | Malaysia Government Bond 3.418% 15/08/2022 | 354,080 | 0.32 |
| 1,410,000 | Malaysia Government Bond 3.48% 15/03/2023 | 296,536 | 0.27 |
| 140,000 | Malaysia Government Bond 3.492% 31/03/2020 | 30,562 | 0.03 |
| 4,950,000 | Malaysia Government Bond 3.62% 30/11/2021 | 1,086,021 | 1.00 |
| 300,000 | Malaysia Government Bond 3.654% 31/10/2019 | 66,301 | 0.06 |
| 4,180,000 | Malaysia Government Bond 3.759% 15/03/2019 | 933,056 | 0.86 |
| 430,000 | Malaysia Government Bond 3.844% 15/04/2033 | 85,791 | 0.08 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|--|---|-------------------|--------------|
| 債券(つづき) : 90.18% (31 May 2016: 86.15%) | | | |
| マレーシア(つづき) : 6.14% (31 May 2016: 7.34%) | | | |
| 国債(つづき) : 6.14% (31 May 2016: 7.34%) | | | |
| 550,000 | Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026 | 117,734 | 0.11 |
| 464,000 | Malaysia Government Bond 3.955% 15/09/2025 | 99,924 | 0.09 |
| 270,000 | Malaysia Government Bond 4.16% 15/07/2021 | 60,383 | 0.06 |
| 1,430,000 | Malaysia Government Bond 4.181% 15/07/2024 | 314,230 | 0.29 |
| 380,000 | Malaysia Government Bond 4.392% 15/04/2026 | 82,357 | 0.07 |
| 60,000 | Malaysia Government Bond 4.498% 15/04/2030 | 13,023 | 0.01 |
| マレーシア合計 | | 6,695,946 | 6.14 |
| メキシコ : 12.31% (31 May 2016: 12.28%) | | | |
| 社債 : 0.96% (31 May 2016: 1.03%) | | | |
| 4,070,000 | America Movil SAB de CV 6% 09/06/2019 | 192,978 | 0.18 |
| 2,720,000 | Petroleos Mexicanos 7.19% 12/09/2024 | 112,847 | 0.10 |
| 2,630,000 | Petroleos Mexicanos 7.19% 12/09/2024 - Germany [†] | 109,113 | 0.10 |
| 15,780,000 | Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026 | 631,730 | 0.58 |
| 国債 : 10.66% (31 May 2016: 11.25%) | | | |
| 4,790,000 | Mexican Bonos 4.75% 14/06/2018 | 228,595 | 0.21 |
| 28,046,500 | Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021 | 1,346,679 | 1.23 |
| 1,200,000 | Mexican Bonos 7.25% 15/12/2016 | 58,654 | 0.05 |
| 62,100,500 | Mexican Bonos 7.75% 14/12/2017 | 3,085,977 | 2.83 |
| 24,410,000 | Mexican Bonos 7.75% 29/05/2031 | 1,211,339 | 1.11 |
| 6,960,000 | Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034 | 344,846 | 0.32 |
| 17,450,000 | Mexican Bonos 7.75% 13/11/2042 | 862,874 | 0.79 |
| 12,180,000 | Mexican Bonos 8% 11/06/2020 | 617,947 | 0.57 |
| 1,260,000 | Mexican Bonos 8% 07/12/2023 | 64,459 | 0.06 |
| 3,030,000 | Mexican Bonos 8.5% 13/12/2018 | 153,512 | 0.14 |
| 15,680,000 | Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029 | 830,247 | 0.76 |
| 8,609,000 | Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038 | 458,790 | 0.42 |
| 39,896,200 | Mexican Bonos 10% 05/12/2024 | 2,279,517 | 2.09 |
| 1,395,000 | Mexican Bonos 10% 20/11/2036 | 84,676 | 0.08 |
| インデックス連動国債 : 0.69% (31 May 2016: 0.00%) | | | |
| 2,490,000 | Mexican Udibonos 4.5% 22/11/2035 | 749,644 | 0.69 |
| メキシコ合計 | | 13,424,424 | 12.31 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.18% (31 May 2016: 86.15%) | | |
| | ペルー : 4.45% (31 May 2016: 3.86%) | | |
| | 国債 : 4.45% (31 May 2016: 3.86%) | | |
| 5,560,000 | Peru Government Bond 5.7% 12/08/2024 | 1,615,635 | 1.48 |
| 8,825,000 | Peru Government Bond 7.84% 12/08/2020 | 2,804,940 | 2.57 |
| 630,000 | Peru Government Bond 8.2% 12/08/2026 | 210,549 | 0.19 |
| 775,000 | Peruvian Government International Bond 6.35% 12/08/2028 | 225,276 | 0.21 |
| | ペルー合計 | 4,856,400 | 4.45 |
| | ポーランド : 5.49% (31 May 2016: 6.20%) | | |
| | 国債 : 5.31% (31 May 2016: 6.20%) | | |
| 1,860,000 | Poland Government Bond 0% 25/10/2018 | 427,919 | 0.39 |
| 3,240,000 | Poland Government Bond 1.5% 25/04/2020 | 749,457 | 0.69 |
| 2,260,000 | Poland Government Bond 1.75% 25/07/2021 | 513,334 | 0.47 |
| 2,280,000 | Poland Government Bond 2% 25/04/2021 | 525,790 | 0.48 |
| 6,210,000 | Poland Government Bond 2.5% 25/07/2026 | 1,346,699 | 1.23 |
| 370,000 | Poland Government Bond 2.75% 25/04/2028 | 80,340 | 0.07 |
| 4,850,000 | Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025 | 1,130,238 | 1.04 |
| 2,756,000 | Poland Government Bond 4% 25/10/2023 | 684,178 | 0.63 |
| 1,090,000 | Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022 | 295,420 | 0.27 |
| 160,000 | Poland Government Bond 5.75% 25/04/2029 | 45,485 | 0.04 |
| | インデックス連動国債 : 0.18% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 660,000 | Poland Index Linked Government Bond 2.75% 25/08/2023 | 194,717 | 0.18 |
| | ポーランド合計 | 5,993,577 | 5.49 |
| | ルーマニア : 0.48% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| | 国債 : 0.48% (31 May 2016: 0.49%) | | |
| 580,000 | Romania Government Bond 4.75% 24/02/2025 | 149,974 | 0.14 |
| 210,000 | Romania Government Bond 5.8% 26/07/2027 | 58,507 | 0.05 |
| 460,000 | Romania Government Bond 5.85% 26/04/2023 | 125,824 | 0.12 |
| 680,000 | Romania Government Bond 5.95% 11/06/2021 | 184,394 | 0.17 |
| | ルーマニア合計 | 518,699 | 0.48 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-------------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.18% (31 May 2016: 86.15%) | | |
| | ロシア連邦 : 7.96% (31 May 2016: 7.14%) | | |
| | 国債 : 7.96% (31 May 2016: 7.14%) | | |
| 102,640,000 | Russian Federal Bond - OFZ 6.4% 27/05/2020 | 1,489,333 | 1.37 |
| 10,060,000 | Russian Federal Bond - OFZ 6.7% 15/05/2019 | 149,946 | 0.14 |
| 13,210,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7% 25/01/2023 | 188,714 | 0.17 |
| 113,810,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023 | 1,618,807 | 1.48 |
| 106,800,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/01/2028 | 1,465,761 | 1.34 |
| 3,639,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 27/02/2019 | 55,254 | 0.05 |
| 79,710,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 14/04/2021 | 1,186,300 | 1.09 |
| 34,656,000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 20/07/2022 | 511,615 | 0.47 |
| 113,930,000 | Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 03/02/2027 | 1,712,523 | 1.57 |
| 20,000,000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 7.85% 10/03/2018 | 305,846 | 0.28 |
| | ロシア連邦合計 | 8,684,099 | 7.96 |
| | 南アフリカ : 9.32% (31 May 2016: 7.90%) | | |
| | 国債 : 9.32% (31 May 2016: 7.90%) | | |
| 57,330,000 | South Africa Government Bond 6.25% 31/03/2036 | 2,887,830 | 2.65 |
| 2,890,000 | South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041 | 144,827 | 0.13 |
| 7,000,000 | South Africa Government Bond 6.75% 31/03/2021 | 468,971 | 0.43 |
| 35,892,000 | South Africa Government Bond 7% 28/02/2031 | 2,079,826 | 1.91 |
| 1,589,000 | South Africa Government Bond 7.75% 28/02/2023 | 108,099 | 0.10 |
| 1,044,000 | South Africa Government Bond 8.75% 31/01/2044 | 67,270 | 0.06 |
| 21,030,000 | South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048 | 1,353,522 | 1.24 |
| 39,131,000 | South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026 | 3,059,088 | 2.80 |
| | 南アフリカ合計 | 10,169,433 | 9.32 |
| | タイ : 1.26% (31 May 2016: 1.20%) | | |
| | 国債 : 1.04% (31 May 2016: 1.20%) | | |
| 20,230,000 | Thailand Government Bond 3.85% 12/12/2025 | 623,052 | 0.57 |
| 2,405,000 | Thailand Government Bond 4.675% 29/06/2044 | 84,222 | 0.08 |
| 12,432,000 | Thailand Government Bond 4.875% 22/06/2029 | 420,076 | 0.39 |
| | インデックス連動国債 : 0.22% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 8,200,000 | Thailand Government Bond 1.2% 14/07/2021 [†] | 239,688 | 0.22 |
| | タイ合計 | 1,367,038 | 1.26 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 債券(つづき) : 90.18% (31 May 2016: 86.15%) | | |
| | トルコ : 5.77% (31 May 2016: 6.44%) | | |
| | 国債 : 4.47% (31 May 2016: 6.44%) | | |
| 380,000 | Turkey Government Bond 6.3% 14/02/2018 | 106,343 | 0.10 |
| 1,150,000 | Turkey Government Bond 7.1% 08/03/2023 | 281,731 | 0.26 |
| 650,000 | Turkey Government Bond 7.4% 05/02/2020 | 175,163 | 0.16 |
| 7,480,000 | Turkey Government Bond 8% 12/03/2025 | 1,858,656 | 1.70 |
| 220,000 | Turkey Government Bond 8.3% 20/06/2018 | 62,494 | 0.06 |
| 360,000 | Turkey Government Bond 8.5% 10/07/2019 | 101,213 | 0.09 |
| 1,660,000 | Turkey Government Bond 8.5% 14/09/2022 | 440,078 | 0.40 |
| 580,000 | Turkey Government Bond 8.8% 14/11/2018 | 165,434 | 0.15 |
| 195,000 | Turkey Government Bond 9% 08/03/2017 | 57,008 | 0.05 |
| 740,000 | Turkey Government Bond 9% 24/07/2024 | 196,827 | 0.18 |
| 380,000 | Turkey Government Bond 9.2% 22/09/2021 | 105,285 | 0.10 |
| 880,000 | Turkey Government Bond 9.5% 12/01/2022 | 245,870 | 0.23 |
| 1,825,000 | Turkey Government Bond 10.4% 27/03/2019 | 535,450 | 0.49 |
| 880,000 | Turkey Government Bond 10.4% 20/03/2024 | 253,056 | 0.23 |
| 307,000 | Turkey Government Bond 10.5% 15/01/2020 | 90,476 | 0.08 |
| 250,000 | Turkey Government Bond 10.6% 11/02/2026 | 71,745 | 0.07 |
| 450,000 | Turkey Government Bond 10.7% 17/02/2021 | 132,160 | 0.12 |
| | インデックス連動国債 : 1.30% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 2,880,000 | Turkey Government Bond 4% 01/04/2020 [†] | 1,412,669 | 1.30 |
| | トルコ合計 | 6,291,658 | 5.77 |
| | 債券合計 | 98,358,974 | 90.18 |
| | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る 未収収益 : 2.09% (31 May 2016: 2.26%) | 2,275,790 | 2.09 |
| | 投資ファンド : 3.51% (31 May 2016: 9.75%) | | |
| | アイルランド : 3.51% (31 May 2016: 9.75%) | | |
| 55,298 | SPDR Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF | 3,832,245 | 3.51 |
| | 投資ファンド合計 | 3,832,245 | 3.51 |

先渡為替契約：-0.06% (31 May 2016: 0.16%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 利益 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|---------------|-----|----------------|----------------|------------------|--------------|
| Chase Manhattan | USD | 339,771 | BRL | 1,082,340 | 02/12/2016 | 19,789 | 0.02 |
| Chase Manhattan | BRL | 1,756,518 | USD | 510,126 | 02/12/2016 | 9,170 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 86,208 | TRY | 275,000 | 09/12/2016 | 6,098 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 115,000 | BRL | 368,403 | 02/12/2016 | 6,086 | 0.01 |
| Chase Manhattan | USD | 63,500 | MYR | 268,897 | 09/12/2016 | 3,349 | - |
| Chase Manhattan | USD | 237,803 | ZAR | 3,332,576 | 13/01/2017 | 2,135 | - |
| Chase Manhattan | USD | 377,937 | THB | 13,458,352 | 13/01/2017 | 838 | - |
| Chase Manhattan | MXN | 3,010,400 | USD | 145,807 | 13/01/2017 | 518 | - |
| Chase Manhattan | RUB | 1,930,420 | USD | 29,456 | 13/01/2017 | 150 | - |
| Citibank | USD | 115,000 | BRL | 368,460 | 02/12/2016 | 6,069 | 0.01 |
| Citibank | USD | 115,000 | BRL | 368,460 | 02/12/2016 | 6,069 | 0.01 |
| Citibank | BRL | 907,824 | USD | 263,634 | 02/12/2016 | 4,754 | - |
| Citibank | BRL | 1,375,644 | USD | 402,000 | 02/12/2016 | 4,694 | - |
| Citibank | BRL | 1,887,594 | USD | 543,678 | 02/12/2016 | 4,447 | - |
| Citibank | USD | 73,042 | BRL | 232,800 | 02/12/2016 | 4,217 | - |
| Citibank | USD | 134,000 | BRL | 440,056 | 02/12/2016 | 3,902 | - |
| Citibank | USD | 134,000 | BRL | 440,056 | 02/12/2016 | 3,902 | - |
| Citibank | USD | 54,400 | MYR | 230,727 | 09/12/2016 | 2,787 | - |
| Citibank | BRL | 511,950 | USD | 150,000 | 02/12/2016 | 1,353 | - |
| Citibank | MXN | 7,906,938 | USD | 385,000 | 14/12/2016 | 753 | - |
| Citibank | MXN | 3,373,595 | USD | 163,346 | 13/01/2017 | 632 | - |
| Citibank | RUB | 3,432,245 | USD | 52,351 | 13/01/2017 | 289 | - |
| Citibank | MXN | 3,809,058 | USD | 185,000 | 13/01/2017 | 145 | - |
| Citibank | USD | 4,531 | ZAR | 63,375 | 13/01/2017 | 49 | - |
| Goldman Sachs | USD | 363,498 | TRY | 1,159,449 | 09/12/2016 | 25,740 | 0.02 |
| Goldman Sachs | USD | 321,951 | BRL | 1,026,137 | 02/12/2016 | 18,584 | 0.02 |
| Goldman Sachs | BRL | 1,700,539 | USD | 493,812 | 02/12/2016 | 8,935 | 0.01 |
| Goldman Sachs | USD | 78,100 | MYR | 330,972 | 09/12/2016 | 4,063 | - |
| Goldman Sachs | USD | 135,000 | BRL | 443,408 | 02/12/2016 | 3,911 | - |
| Goldman Sachs | USD | 178,040 | ZAR | 2,496,393 | 13/01/2017 | 1,504 | - |
| Goldman Sachs | MXN | 2,385,955 | USD | 115,476 | 13/01/2017 | 497 | - |
| Goldman Sachs | RUB | 4,944,471 | USD | 75,469 | 13/01/2017 | 364 | - |
| Northern Trust | ZAR | 48,501,000 | USD | 3,326,315 | 20/01/2017 | 98,971 | 0.10 |
| Northern Trust | ZAR | 30,864,000 | USD | 2,143,423 | 20/01/2017 | 36,286 | 0.04 |
| Northern Trust | USD | 712,180 | TRY | 2,392,000 | 20/01/2017 | 21,907 | 0.02 |
| Northern Trust | MXN | 27,558,000 | USD | 1,316,989 | 20/01/2017 | 21,318 | 0.02 |
| Northern Trust | USD | 5,232,572 | IDR | 71,319,956,000 | 13/01/2017 | 16,801 | 0.02 |
| Northern Trust | COP | 1,018,937,500 | USD | 320,320 | 13/01/2017 | 10,552 | 0.01 |
| Northern Trust | USD | 501,488 | PLN | 2,084,000 | 20/01/2017 | 4,656 | - |
| Northern Trust | RUB | 6,709,000 | USD | 102,516 | 13/01/2017 | 379 | - |
| UBS | USD | 21,410 | GBP | 17,024 | 15/12/2016 | 132 | - |
| UBS | USD | 742 | GBP | 590 | 15/12/2016 | 5 | - |
| UBS | USD | 363 | GBP | 288 | 15/12/2016 | 2 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 366,802 | 0.33 |

先渡為替契約(つづき) : -0.06% (31 May 2016: 0.16%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|-----------------|-----|-------------|-----|---------------|----------------|------------------|--------------|
| Chase Manhattan | RON | 1,490,218 | USD | 351,906 | 20/01/2017 | (142) | - |
| Chase Manhattan | RUB | 3,436,711 | USD | 54,000 | 02/12/2016 | (779) | - |
| Chase Manhattan | EUR | 177,000 | USD | 189,132 | 06/01/2017 | (1,010) | - |
| Chase Manhattan | HUF | 36,108,500 | USD | 124,238 | 20/01/2017 | (1,761) | - |
| Chase Manhattan | BRL | 134,280 | USD | 41,509 | 02/12/2016 | (1,810) | - |
| Chase Manhattan | EUR | 177,000 | USD | 194,916 | 02/12/2016 | (7,154) | (0.01) |
| Chase Manhattan | MYR | 585,913 | USD | 138,842 | 09/12/2016 | (7,775) | (0.01) |
| Citibank | USD | 166,000 | ZAR | 2,350,560 | 13/01/2017 | (223) | - |
| Citibank | RON | 3,473,332 | USD | 820,285 | 20/01/2017 | (408) | - |
| Citibank | MYR | 50,150 | USD | 11,877 | 09/12/2016 | (658) | - |
| Citibank | USD | 187,978 | RON | 799,377 | 20/01/2017 | (714) | - |
| Citibank | RUB | 3,432,245 | USD | 54,000 | 02/12/2016 | (849) | - |
| Citibank | EUR | 177,000 | USD | 189,103 | 06/01/2017 | (980) | - |
| Citibank | PEN | 567,059 | USD | 167,536 | 09/12/2016 | (1,373) | - |
| Citibank | MXN | 1,605,512 | USD | 80,000 | 14/12/2016 | (1,672) | - |
| Citibank | USD | 60,590 | COP | 192,010,000 | 20/01/2017 | (1,683) | - |
| Citibank | BRL | 133,492 | USD | 41,284 | 02/12/2016 | (1,819) | - |
| Citibank | PLN | 1,840,065 | USD | 440,893 | 20/01/2017 | (2,216) | - |
| Citibank | HUF | 74,297,550 | USD | 255,718 | 20/01/2017 | (3,708) | - |
| Citibank | EUR | 177,000 | USD | 194,889 | 02/12/2016 | (7,128) | (0.01) |
| Citibank | TRY | 970,318 | USD | 294,000 | 09/12/2016 | (11,338) | (0.01) |
| Goldman Sachs | RUB | 3,438,180 | USD | 54,000 | 02/12/2016 | (757) | - |
| Goldman Sachs | PEN | 551,084 | USD | 162,946 | 09/12/2016 | (1,464) | - |
| Goldman Sachs | BRL | 137,466 | USD | 42,500 | 02/12/2016 | (1,860) | - |
| Northern Trust | USD | 2,322,076 | MXN | 47,835,000 | 20/01/2017 | (950) | - |
| Northern Trust | MXN | 2,713,000 | USD | 133,166 | 20/01/2017 | (1,414) | - |
| Northern Trust | MXN | 10,902,000 | USD | 533,105 | 20/01/2017 | (3,668) | - |
| Northern Trust | MXN | 53,520,000 | USD | 2,603,797 | 20/01/2017 | (4,689) | - |
| Northern Trust | USD | 984,077 | PEN | 3,393,000 | 13/01/2017 | (5,777) | (0.01) |
| Northern Trust | HUF | 99,420,000 | USD | 344,281 | 20/01/2017 | (7,058) | (0.01) |
| Northern Trust | USD | 2,971,621 | BRL | 10,220,000 | 13/01/2017 | (13,883) | (0.01) |
| Northern Trust | USD | 3,598,140 | PEN | 12,383,000 | 13/01/2017 | (14,403) | (0.01) |
| Northern Trust | PLN | 5,054,000 | USD | 1,221,865 | 20/01/2017 | (16,976) | (0.02) |
| Northern Trust | TRY | 1,986,000 | USD | 596,629 | 20/01/2017 | (23,518) | (0.02) |
| Northern Trust | HUF | 373,288,000 | USD | 1,292,213 | 20/01/2017 | (26,056) | (0.02) |
| Northern Trust | USD | 3,020,101 | BRL | 10,442,000 | 13/01/2017 | (30,254) | (0.03) |
| Northern Trust | USD | 1,259,683 | ZAR | 18,291,000 | 20/01/2017 | (32,083) | (0.03) |
| Northern Trust | TRY | 2,918,000 | USD | 875,251 | 20/01/2017 | (33,187) | (0.03) |
| Northern Trust | MYR | 17,979,000 | USD | 4,042,496 | 13/01/2017 | (44,418) | (0.04) |
| Northern Trust | USD | 1,759,379 | COP | 5,570,195,000 | 13/01/2017 | (49,386) | (0.05) |
| Northern Trust | PLN | 11,158,000 | USD | 2,716,660 | 20/01/2017 | (56,559) | (0.06) |

先渡為替契約(つづき) : -0.06% (31 May 2016: 0.16%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 米ドル | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|---------|-----|---------|----------------|---------------------|----------------------|
| UBS | USD | 192 | GBP | 154 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 416 | GBP | 334 | 15/12/2016 | (1) | - |
| UBS | USD | 11,240 | GBP | 9,023 | 15/12/2016 | (37) | - |
| UBS | GBP | 6,666 | USD | 8,425 | 15/12/2016 | (94) | - |
| UBS | GBP | 14,013 | USD | 17,712 | 15/12/2016 | (197) | - |
| UBS | GBP | 391,934 | USD | 495,390 | 15/12/2016 | (5,519) | (0.01) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (429,409) | (0.39) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | (62,607) | (0.06) |
| | | | | | | 公正価値 米ドル | 純資産 比率(%) |
| 投資総額 | | | | | | 104,404,402 | 95.72 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 5,947,709 | 5.45 |
| その他の純負債 | | | | | | (1,273,122) | (1.17) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 109,078,989 | 100.00 |

| 総資産の分析 | 総資産 比率(%) |
|---|----------------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 90.84 |
| 投資ファンドおよびAIF | 3.46 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.33 |
| その他の資産 | 5.37 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

† ファンドの純資産の1.62%を表章する有価証券が、単一のブローカーによって値付けされている。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

[次へ](#)

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|--------|---|------------------|--------------|
| | 株式 : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | オーストリア : 1.25% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| | 銀行 : 0.76% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 99,033 | Erste Group Bank AG Com NPV | 2,590,208 | 0.76 |
| | 建設資材 : 0.16% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 32,403 | Wienerberger AG Class A Com NPV | 542,021 | 0.16 |
| | 電気部品・設備 : 0.00% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.33% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 31,143 | voestalpine AG Com NPV | 1,119,824 | 0.33 |
| | オーストリア合計 | 4,252,053 | 1.25 |
| | ベルギー : 2.15% (31 May 2016: 2.73%) | | |
| | 飲料 : 1.73% (31 May 2016: 1.19%) | | |
| 60,350 | Anheuser-Busch InBev SA/NV Com NPV | 5,916,412 | 1.73 |
| | 化学 : 0.20% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 12,154 | Umicore SA Com NPV | 687,126 | 0.20 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.22% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| 29,870 | Ontex Group NV Com NPV | 765,344 | 0.22 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| | 運輸 : 0.00% (31 May 2016: 0.89%) | | |
| | ベルギー合計 | 7,368,882 | 2.15 |
| | デンマーク : 7.88% (31 May 2016: 7.64%) | | |
| | 飲料 : 0.28% (31 May 2016: 0.33%) | | |
| 25,926 | Royal Unibrew A/S Com DKK2.00 | 971,002 | 0.28 |
| | 広告 : 0.29% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 30,865 | ISS A/S Com DKK1.00 | 998,546 | 0.29 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | デンマーク(つづき) : 7.88% (31 May 2016: 7.64%) | | |
| | 代替エネルギー資源 : 0.82% (31 May 2016: 1.40%) | | |
| 45,000 | Vestas Wind Systems A/S Com DKK1.00 | 2,795,555 | 0.82 |
| | 食品 : 0.15% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 9,783 | Chr Hansen Holding A/S Com DKK10.00 | 509,727 | 0.15 |
| | ヘルスケア用品 : 0.58% (31 May 2016: 0.41%) | | |
| 32,908 | Coloplast A/S Class B Com DKK1.00 | 1,975,579 | 0.58 |
| | 保険 : 0.36% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 72,429 | Tryg A/S Com DKK5.00 | 1,225,642 | 0.36 |
| | 各種機械 : 0.42% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 22,421 | NKT Holding A/S Com DKK20.00 | 1,436,114 | 0.42 |
| | 医薬品 : 2.01% (31 May 2016: 2.61%) | | |
| 215,413 | Novo Nordisk A/S Class B Com DKK0.20 | 6,883,637 | 2.01 |
| | 小売 : 1.51% (31 May 2016: 1.23%) | | |
| 46,041 | Pandora A/S Com DKK1.00 | 5,178,047 | 1.51 |
| | ソフトウェア : 0.56% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| 43,006 | SimCorp A/S Com DKK1.00 | 1,926,304 | 0.56 |
| | 運輸 : 0.90% (31 May 2016: 0.97%) | | |
| 72,060 | DSV A/S Com DKK1.00 | 3,065,929 | 0.90 |
| | デンマーク合計 | 26,966,082 | 7.88 |
| | フィンランド : 2.92% (31 May 2016: 3.09%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.38% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 38,103 | Nokian Renkaat OYJ Com NPV | 1,297,979 | 0.38 |
| | 林産品・紙製品 : 0.25% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 39,276 | UPM-Kymmene OYJ Com NPV | 848,951 | 0.25 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|--------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | フィンランド(つづき) : 2.92% (31 May 2016: 3.09%) | | |
| | 保険 : 0.68% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| 55,712 | Sampo Oyj Class A Com NPV | 2,325,419 | 0.68 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.20% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| 92,905 | Outokumpu OYJ Com NPV | 678,207 | 0.20 |
| | 各種機械 : 0.35% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 29,156 | Kone OYJ Class B Com NPV | 1,211,578 | 0.35 |
| | 各種製造業 : 0.84% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 71,959 | Wartsila OYJ Abp Com NPV | 2,873,323 | 0.84 |
| | 石油・ガス : 0.00% (31 May 2016: 0.24%) | | |
| | 通信 : 0.07% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 55,824 | Nokia OYJ Com NPV | 226,366 | 0.07 |
| | 運輸 : 0.15% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 13,198 | Cargotec Oyj Class B Com NPV | 504,692 | 0.15 |
| | フィンランド合計 | 9,966,515 | 2.92 |
| | フランス : 14.52% (31 May 2016: 15.17%) | | |
| | 広告 : 0.21% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 12,008 | Publicis Groupe SA Com EURO.40 | 735,130 | 0.21 |
| | 航空・防衛 : 0.34% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 12,567 | Thales SA Com EUR3.00 | 1,157,735 | 0.34 |
| | アパレル : 0.55% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 10,943 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE Com EURO.30 | 1,878,913 | 0.55 |
| | 自動車製造 : 0.20% (31 May 2016: 0.13%) | | |
| 9,175 | Renault SA Com EUR3.81 | 682,115 | 0.20 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | フランス(つづき) : 14.52% (31 May 2016: 15.17%) | | |
| | 自動車部品・装置 : 0.44% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 9,319 | Cie Generale des Etablissements Michelin Com EUR2.00 | 940,520 | 0.28 |
| 16,030 | Faurecia Com EUR7.00 | 542,175 | 0.16 |
| | 銀行 : 0.62% (31 May 2016: 0.30%) | | |
| 26,321 | BNP Paribas SA Com EUR2.00 | 1,442,128 | 0.42 |
| 147,406 | Natixis SA Com EUR11.20 | 700,694 | 0.20 |
| | 化学 : 0.69% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 15,537 | Air Liquide SA Com EUR5.50 | 1,492,795 | 0.44 |
| 9,432 | Arkema SA Com EUR10.00 | 852,417 | 0.25 |
| | 商業サービス : 0.44% (31 May 2016: 0.50%) | | |
| 84,958 | Bureau Veritas SA Com EURO.12 | 1,510,341 | 0.44 |
| | コンピューター : 0.63% (31 May 2016: 1.14%) | | |
| 29,299 | Ingenico Group SA Com EUR1.00 | 2,155,234 | 0.63 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.56% (31 May 2016: 0.61%) | | |
| 11,859 | L'Oreal SA Com EURO.20 | 1,911,078 | 0.56 |
| | 電気部品・設備 : 0.86% (31 May 2016: 0.63%) | | |
| 29,083 | Legrand SA Com EUR4.00 | 1,533,837 | 0.45 |
| 6,804 | Nexans SA Com EUR1.00 | 335,182 | 0.10 |
| 17,019 | Schneider Electric SE Com EUR4.00 | 1,068,878 | 0.31 |
| | エンジニアリング・建設 : 2.85% (31 May 2016: 2.62%) | | |
| 18,371 | Eiffage SA Com EUR4.00 | 1,144,054 | 0.33 |
| 84,251 | SPIE SA Com EURO.47 | 1,467,021 | 0.43 |
| 116,939 | Vinci SA Com EUR2.50 | 7,161,929 | 2.09 |
| | 食品サービス : 0.46% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 15,138 | Sodexo SA Com EUR4.00 | 1,560,728 | 0.46 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.47% (31 May 2016: 0.44%) | | |
| 13,256 | Societe BIC SA Com EUR3.82 | 1,617,232 | 0.47 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | フランス(つづき) : 14.52% (31 May 2016: 15.17%) | | |
| | 保険 : 2.00% (31 May 2016: 1.90%) | | |
| 239,361 | AXA SA Com EUR2.29 | 5,318,601 | 1.55 |
| 51,509 | SCOR SE Com EUR7.876972 | 1,543,854 | 0.45 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.03%) | | |
| | 石油・ガス : 0.55% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 41,795 | TOTAL SA Com EUR2.50 | 1,878,999 | 0.55 |
| | 石油・ガス・サービス : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 7,487 | Technip SA Com EURO.7625 | 489,837 | 0.14 |
| | 医薬品 : 0.29% (31 May 2016: 1.55%) | | |
| 13,113 | Sanofi Com EUR2.00 | 998,555 | 0.29 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | 不動産投資信託 : 1.34% (31 May 2016: 1.47%) | | |
| 22,068 | Unibail-Rodamco SE Reits EUR5.00 | 4,594,558 | 1.34 |
| | 小売 : 0.30% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 4,917 | Kering Com EUR4.00 | 1,007,862 | 0.30 |
| | ソフトウェア : 0.29% (31 May 2016: 0.36%) | | |
| 13,513 | Dassault Systemes Com EURO.50 | 972,936 | 0.29 |
| | 運輸 : 0.29% (31 May 2016: 1.07%) | | |
| 121,052 | Groupe Eurotunnel SE Com EURO.40 | 1,004,671 | 0.29 |
| | フランス合計 | 49,700,009 | 14.52 |
| | ドイツ : 19.97% (31 May 2016: 17.04%) | | |
| | アパレル : 0.26% (31 May 2016: 0.14%) | | |
| 6,336 | adidas AG Class A Com NPV | 878,803 | 0.26 |

| | | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | | |
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | ドイツ(つづき) : 19.97% (31 May 2016: 17.04%) | | |
| | 自動車製造 : 0.99% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| 10,463 | Daimler AG Com NPV | 655,873 | 0.19 |
| 22,638 | Volkswagen AG Pref NPV | 2,757,308 | 0.80 |
| | 自動車部品・装置 : 0.44% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 9,026 | Continental AG Class A Com NPV | 1,510,952 | 0.44 |
| | 銀行 : 0.00% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| | 建設資材 : 0.00% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| | 化学 : 2.09% (31 May 2016: 1.60%) | | |
| 10,409 | BASF SE Com NPV | 845,315 | 0.25 |
| 33,850 | Brenntag AG Class A Com NPV | 1,678,198 | 0.49 |
| 20,878 | Evonik Industries AG Class A Com NPV | 547,160 | 0.16 |
| 19,559 | FUCHS PETROLUB SE Pref NPV | 729,502 | 0.21 |
| 11,724 | Linde AG Com NPV | 1,844,771 | 0.54 |
| 26,164 | Symrise AG Class A Com NPV | 1,490,956 | 0.44 |
| | 各種金融サービス : 1.10% (31 May 2016: 0.11%) | | |
| 49,495 | Deutsche Boerse AG Com NPV | 3,767,559 | 1.10 |
| | 電気 : 0.65% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 110,832 | RWE AG Com NPV | 1,317,238 | 0.38 |
| 77,629 | Uniper SE Com NPV | 914,081 | 0.27 |
| | 代替エネルギー資源 : 0.61% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 62,705 | Innogy SE Com EUR2.00 | 2,078,514 | 0.61 |
| | ヘルスケア・サービス : 1.34% (31 May 2016: 1.14%) | | |
| 67,679 | Fresenius SE & Co KGaA Com NPV | 4,588,975 | 1.34 |
| | 住宅家具 : 0.28% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| 2,337 | Rational AG Class A Com NPV | 970,089 | 0.28 |
| | 家庭用品・雑貨 : 0.93% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| 29,282 | Henkel AG & Co KGaA Pref NPV | 3,193,202 | 0.93 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | ドイツ(つづき) : 19.97% (31 May 2016: 17.04%) | | |
| | 保険 : 1.37% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 17,326 | Allianz SE Com NPV | 2,597,167 | 0.76 |
| 12,922 | Hannover Rueck SE Com NPV | 1,295,754 | 0.38 |
| 4,588 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG Com NPV | 789,251 | 0.23 |
| | インターネット : 0.54% (31 May 2016: 0.42%) | | |
| 36,207 | Scout24 AG Class A Com NPV | 1,228,232 | 0.36 |
| 17,267 | United Internet AG Com NPV | 624,461 | 0.18 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.87% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 138,568 | thyssenkrupp AG Com NPV | 2,965,702 | 0.87 |
| | メディア : 0.99% (31 May 2016: 1.14%) | | |
| 105,656 | ProSiebenSat.1 Media SE Com NPV | 3,402,123 | 0.99 |
| | 各種製造業 : 0.50% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 16,042 | Siemens AG Com NPV | 1,709,275 | 0.50 |
| | 医薬品 : 1.56% (31 May 2016: 1.12%) | | |
| 52,713 | Bayer AG Com NPV | 4,654,294 | 1.36 |
| 7,328 | Merck KGaA Com NPV | 692,643 | 0.20 |
| | 不動産 : 0.93% (31 May 2016: 1.15%) | | |
| 44,485 | LEG Immobilien AG Class A Com NPV | 3,173,560 | 0.93 |
| | 小売 : 0.11% (31 May 2016: 0.54%) | | |
| 7,256 | HUGO BOSS AG Com NPV | 391,316 | 0.11 |
| | 半導体 : 1.89% (31 May 2016: 2.23%) | | |
| 529,359 | AIXTRON SE Com NPV | 2,024,004 | 0.59 |
| 282,057 | Infineon Technologies AG Class A Com NPV | 4,448,744 | 1.30 |
| | ソフトウェア : 2.19% (31 May 2016: 1.87%) | | |
| 95,015 | SAP SE Com NPV | 7,481,481 | 2.19 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | ドイツ(つづき) : 19.97% (31 May 2016: 17.04%) | | |
| | 通信 : 0.33% (31 May 2016: 1.47%) | | |
| 75,179 | Deutsche Telekom AG Com NPV | 1,115,656 | 0.33 |
| | ドイツ合計 | 68,362,159 | 19.97 |
| | アイルランド : 4.85% (31 May 2016: 5.27%) | | |
| | 航空 : 1.45% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 55,521 | Ryanair Holdings Plc Com EURO.006 - England | 765,912 | 0.22 |
| 304,157 | Ryanair Holdings Plc Com EURO.006 - Ireland | 4,227,022 | 1.23 |
| | 建設資材 : 1.71% (31 May 2016: 0.95%) | | |
| 89,858 | CRH Plc Com EURO.32 | 2,824,012 | 0.83 |
| 119,249 | Kingspan Group Plc Com EURO.13 | 3,002,094 | 0.88 |
| | 娯楽 : 0.00% (31 May 2016: 0.62%) | | |
| | 食品 : 0.46% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 23,457 | Kerry Group Plc Class A Com EURO.125 | 1,560,829 | 0.46 |
| | 林産品・紙製品 : 0.62% (31 May 2016: 1.11%) | | |
| 99,368 | Smurfit Kappa Group PLC Com EURO.001 | 2,124,764 | 0.62 |
| | 石油・ガス : 0.61% (31 May 2016: 0.72%) | | |
| 29,191 | DCC Plc Com EURO.25 | 2,106,688 | 0.61 |
| | アイルランド合計 | 16,611,321 | 4.85 |
| | イタリア : 5.28% (31 May 2016: 9.10%) | | |
| | アパレル : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 銀行 : 1.17% (31 May 2016: 3.58%) | | |
| 71,316 | Banca Generali SpA Com EUR1.00 | 1,416,336 | 0.41 |
| 403,513 | FinecoBank Banca Fineco SpA Com NPV | 1,959,459 | 0.57 |
| 315,110 | Intesa Sanpaolo SpA Com EURO.52 | 660,786 | 0.19 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | イタリア(つづき) : 5.28% (31 May 2016: 9.10%) | | |
| | 建設資材 : 0.08% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 13,506 | Buzzi Unicem SpA Com EURO.60 | 270,593 | 0.08 |
| | 商業サービス : 0.97% (31 May 2016: 1.23%) | | |
| 159,319 | Atlantia SpA Com EUR1.00 | 3,333,750 | 0.97 |
| | 販売金融サービス : 0.00% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| | 販売/卸売 : 0.29% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 60,236 | MARR SpA Com EURO.50 | 988,172 | 0.29 |
| | 電気 : 1.08% (31 May 2016: 1.13%) | | |
| 969,961 | Enel SpA Com EUR1.00 | 3,698,461 | 1.08 |
| | 電気部品・設備 : 0.22% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 33,333 | Prysmian SpA Com EURO.10 | 752,826 | 0.22 |
| | エンジニアリング・建設 : 0.20% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 208,528 | Enav SpA Com NPV | 665,413 | 0.20 |
| | ガス : 0.14% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 143,636 | Italgas SpA Com NPV | 484,484 | 0.14 |
| | 住宅家具 : 0.30% (31 May 2016: 0.28%) | | |
| 48,421 | De'Longhi SpA Com EUR1.50 | 1,014,662 | 0.30 |
| | 保険 : 0.13% (31 May 2016: 0.17%) | | |
| 37,504 | Assicurazioni Generali SpA Com EUR1.00 | 447,235 | 0.13 |
| | インターネット : 0.30% (31 May 2016: 0.93%) | | |
| 40,203 | Yoox Net-A-Porter Group SpA Class A Com NPV | 1,025,579 | 0.30 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| | 小売 : 0.24% (31 May 2016: 0.25%) | | |
| 16,697 | Luxottica Group SpA Com EURO.06 | 819,823 | 0.24 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | イタリア(つづき) : 5.28% (31 May 2016: 9.10%) | | |
| | 通信 : 0.16% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| 765,168 | Telecom Italia SpA/Milano Com NPV | 546,139 | 0.16 |
| | イタリア合計 | 18,083,718 | 5.28 |
| | ジャージー : 0.79% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | 医薬品 : 0.79% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 16,366 | Shire PLC Com ADR NPV | 2,693,802 | 0.79 |
| | ジャージー合計 | 2,693,802 | 0.79 |
| | リベリア : 0.00% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| | 余暇 : 0.00% (31 May 2016: 1.50%) | | |
| | ルクセンブルグ : 1.15% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 鉄/鉄鋼 : 1.15% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| 550,581 | ArcelorMittal Com NPV | 3,925,092 | 1.15 |
| | ルクセンブルグ合計 | 3,925,092 | 1.15 |
| | オランダ : 8.16% (31 May 2016: 7.17%) | | |
| | 航空・防衛 : 0.00% (31 May 2016: 0.65%) | | |
| | 銀行 : 0.14% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 38,426 | ING Groep NV Com EURO.01 | 493,870 | 0.14 |
| | 飲料 : 0.25% (31 May 2016: 0.21%) | | |
| 12,307 | Heineken NV Com EUR1.60 | 870,659 | 0.25 |
| | 化学 : 1.12% (31 May 2016: 0.38%) | | |
| 20,508 | Akzo Nobel NV Com EUR2.00 | 1,204,127 | 0.35 |
| 46,322 | Koninklijke DSM NV Com EUR1.50 | 2,650,776 | 0.77 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|-----------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | オランダ(つづき) : 8.16% (31 May 2016: 7.17%) | | |
| | 商業サービス : 0.73% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 163,032 | RELX NV Com EURO.07 | 2,483,793 | 0.73 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.85% (31 May 2016: 0.89%) | | |
| 76,607 | Unilever NV EURO.16 | 2,899,958 | 0.85 |
| | 食品 : 0.94% (31 May 2016: 1.32%) | | |
| 173,479 | Koninklijke Ahold Delhaize NV Com EURO.01 | 3,228,878 | 0.94 |
| | 保険 : 0.58% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 20,911 | ASR Nederland NV Com EURO.16 | 412,679 | 0.12 |
| 51,480 | NN Group NV Com NPV | 1,560,745 | 0.46 |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.35%) | | |
| | 小売 : 0.56% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 56,399 | GrandVision NV Com NPV | 1,081,733 | 0.32 |
| 186,193 | Steinhoff International Holdings NV Com EURO.50 | 838,613 | 0.24 |
| | 半導体 : 1.58% (31 May 2016: 1.27%) | | |
| 55,405 | ASML Holding NV Com EURO.09 | 5,406,697 | 1.58 |
| | 通信 : 1.41% (31 May 2016: 1.38%) | | |
| 1,772,268 | Koninklijke KPN NV Com EURO.04 | 4,810,821 | 1.41 |
| | オランダ合計 | 27,943,349 | 8.16 |
| | ノルウェー : 1.82% (31 May 2016: 2.06%) | | |
| | 銀行 : 0.00% (31 May 2016: 0.09%) | | |
| | 化学 : 0.04% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 3,765 | Yara International ASA Com NOK1.70 | 131,285 | 0.04 |
| | 食品 : 1.55% (31 May 2016: 1.19%) | | |
| 235,845 | Grieg Seafood ASA Com NOK4.00 | 2,115,378 | 0.62 |
| 188,077 | Marine Harvest ASA Com NOK7.50 | 3,187,464 | 0.93 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|---|------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | ノルウェー(つづき) : 1.82% (31 May 2016: 2.06%) | | |
| | 鉱業 : 0.23% (31 May 2016: 0.07%) | | |
| 178,972 | Norsk Hydro ASA Com NOK1.098 | 796,290 | 0.23 |
| | 半導体 : 0.00% (31 May 2016: 0.71%) | | |
| | ノルウェー合計 | 6,230,417 | 1.82 |
| | ポルトガル : 0.28% (31 May 2016: 0.18%) | | |
| | 電気 : 0.00% (31 May 2016: 0.08%) | | |
| | 石油・ガス : 0.28% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 75,412 | Galp Energia SGPS SA Com EUR1.00 | 963,200 | 0.28 |
| | ポルトガル合計 | 963,200 | 0.28 |
| | スペイン : 5.24% (31 May 2016: 5.71%) | | |
| | 航空 : 0.00% (31 May 2016: 0.56%) | | |
| | 銀行 : 0.42% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 176,628 | Banco Santander SA Com EURO.50 | 761,620 | 0.22 |
| 797,122 | Bankia SA Com EURO.80 | 669,582 | 0.20 |
| | 電気 : 1.20% (31 May 2016: 1.02%) | | |
| 155,092 | Endesa SA Com EUR1.20 | 3,025,845 | 0.88 |
| 192,708 | Iberdrola SA Com EURO.75 | 1,094,774 | 0.32 |
| | 電気部品・設備 : 0.77% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 134,313 | Gamesa Corporation Company Tecnologica SA Com EURO.17 | 2,631,527 | 0.77 |
| | 食品 : 0.00% (31 May 2016: 0.06%) | | |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.10% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 27,425 | Acerinox SA Com EURO.25 | 325,192 | 0.10 |
| | 不動産 : 0.00% (31 May 2016: 0.48%) | | |

| | | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|------------|---|-------------------|--------------|
| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | | |
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | スペイン(つづき) : 5.24% (31 May 2016: 5.71%) | | |
| | 小売 : 0.75% (31 May 2016: 0.66%) | | |
| 79,850 | Inditex SA Com EURO.03 | 2,576,959 | 0.75 |
| | ソフトウェア : 0.77% (31 May 2016: 0.78%) | | |
| 61,774 | Amadeus IT Holding SA Class A Com EURO.01 | 2,640,530 | 0.77 |
| | 通信 : 0.79% (31 May 2016: 1.20%) | | |
| 10,935 | Telefonica SA Com EUR1.00 - Unquoted | 85,878 | 0.02 |
| 335,058 | Telefonica SA Com EUR1.00 | 2,631,378 | 0.77 |
| | 運輸 : 0.44% (31 May 2016: 0.47%) | | |
| 70,946 | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA Com EURO.20 | 1,503,700 | 0.44 |
| | スペイン合計 | 17,946,985 | 5.24 |
| | スウェーデン : 6.69% (31 May 2016: 6.69%) | | |
| | 銀行 : 0.57% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| 120,927 | Nordea Bank AB Class A Com SEK1.00 | 1,193,736 | 0.35 |
| 79,680 | Skandinaviska Enskilda Banken AB Com SEK10.00 | 746,697 | 0.22 |
| | 商業サービス : 0.29% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 40,334 | Loomis AB Com SEK5.00 | 1,003,891 | 0.29 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.49% (31 May 2016: 0.59%) | | |
| 66,647 | Svenska Cellulosa AB SCA Class B Com SEK3.33 | 1,668,675 | 0.49 |
| | 電気 : 1.02% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 197,033 | Assa Abloy AB Class B Com SEK1.00 | 3,504,756 | 1.02 |
| | 工具・工作機械 : 0.22% (31 May 2016: 0.10%) | | |
| 66,908 | Sandvik AB Class A Com SEK1.20 | 745,714 | 0.22 |
| | ヘルスケア用品 : 0.34% (31 May 2016: 0.32%) | | |
| 148,307 | Elekta AB Class B Com SEK0.50 | 1,160,387 | 0.34 |
| | 住宅家具 : 0.00% (31 May 2016: 0.14%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | スウェーデン(つづき) : 6.69% (31 May 2016: 6.69%) | | |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.39% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 363,518 | SSAB AB Com SEK8.80 | 1,325,149 | 0.39 |
| | 建設機械・採掘機械 : 0.81% (31 May 2016: 0.76%) | | |
| 97,830 | Atlas Copco AB Class A Com SEK0.64 | 2,788,063 | 0.81 |
| | 各種機械 : 1.51% (31 May 2016: 1.68%) | | |
| 155,067 | Hexagon AB Class B Com EURO.22 | 5,186,420 | 1.51 |
| | 金属加工/金属製品 : 0.00% (31 May 2016: 1.07%) | | |
| | 各種製造業 : 0.82% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 136,526 | Hexpol AB Class A Com SEK0.20 | 1,080,756 | 0.32 |
| 98,388 | Trelleborg AB Class B Com SEK25.00 | 1,694,837 | 0.50 |
| | 通信 : 0.23% (31 May 2016: 0.12%) | | |
| 46,145 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson Class B Com SEK5.00 | 224,050 | 0.06 |
| 168,524 | Telia Co AB Class A Com SEK3.20 | 593,851 | 0.17 |
| | スウェーデン合計 | 22,916,982 | 6.69 |
| | スイス : 12.05% (31 May 2016: 10.45%) | | |
| | 銀行 : 0.41% (31 May 2016: 0.23%) | | |
| 93,619 | UBS Group AG Com CHF0.10 | 1,400,494 | 0.41 |
| | 建設資材 : 1.36% (31 May 2016: 1.38%) | | |
| 5,114 | Geberit AG Com CHF0.10 | 1,904,409 | 0.56 |
| 18,738 | LafargeHolcim Ltd Com CHF2.00 | 933,359 | 0.27 |
| 398 | Sika AG Class B Com CHF0.60 | 1,817,288 | 0.53 |
| | 化学 : 0.60% (31 May 2016: 0.68%) | | |
| 68,395 | Clariant AG Com CHF3.70 | 1,040,245 | 0.30 |
| 3,715 | Lonza Group AG Com CHF1.00 | 624,161 | 0.18 |
| 1,124 | Syngenta AG Com CHF0.10 | 408,145 | 0.12 |
| | コンピューター : 0.00% (31 May 2016: 0.23%) | | |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|--------|---|-------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | スイス(つづき) : 12.05% (31 May 2016: 10.45%) | | |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.42% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 60,200 | Oriflame Holding AG Com CHF1.50 | 1,441,485 | 0.42 |
| | 各種金融サービス : 0.98% (31 May 2016: 1.26%) | | |
| 32,152 | Julius Baer Group Ltd Com CHF0.02 | 1,336,562 | 0.39 |
| 4,381 | Partners Group Holding AG Class A Com CHF0.01 | 2,003,326 | 0.59 |
| | 食品 : 1.47% (31 May 2016: 1.20%) | | |
| 319 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG Com CHF10.00 | 1,477,530 | 0.43 |
| 56,048 | Nestle SA Com CHF0.10 | 3,549,085 | 1.04 |
| | 工具・工作機械 : 0.09% (31 May 2016: 0.15%) | | |
| 1,855 | Schindler Holding AG Com CHF0.10 | 309,944 | 0.09 |
| | 保険 : 2.01% (31 May 2016: 0.73%) | | |
| 20,089 | Swiss Re AG Class A Com CHF0.10 | 1,740,571 | 0.51 |
| 20,835 | Zurich Insurance Group AG Class A Com CHF0.10 | 5,139,415 | 1.50 |
| | 各種機械 : 0.20% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 9,193 | Kardex AG Com CHF7.35 | 699,737 | 0.20 |
| | 金属加工/金属製品 : 0.29% (31 May 2016: 0.19%) | | |
| 13,285 | VAT Group AG Class A Com CHF0.10 | 978,625 | 0.29 |
| | 医薬品 : 2.37% (31 May 2016: 2.36%) | | |
| 3,461 | Actelion Ltd Com CHF0.50 | 627,608 | 0.18 |
| 27,282 | Novartis AG Com CHF0.50 | 1,773,003 | 0.52 |
| 27,240 | Roche Holding AG Com NPV | 5,713,528 | 1.67 |
| | 小売 : 1.05% (31 May 2016: 1.01%) | | |
| 58,306 | Cie Financiere Richemont SA Com CHF1.00 | 3,584,151 | 1.05 |
| | 通信 : 0.80% (31 May 2016: 1.03%) | | |
| 46,771 | Sunrise Communications Group AG Com NPV | 2,740,901 | 0.80 |
| | スイス合計 | 41,243,572 | 12.05 |

| | | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|---------|--|--------------------|--------------|
| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | | |
| | 株式(つづき) : 97.84% (31 May 2016: 98.38%) | | |
| | 英国 : 2.84% (31 May 2016: 3.95%) | | |
| | 農業 : 1.95% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 164,940 | Imperial Brands PLC Com GBPO.10 | 6,670,080 | 1.95 |
| | インターネット : 0.00% (31 May 2016: 0.22%) | | |
| | メディア : 0.00% (31 May 2016: 0.46%) | | |
| | 石油・ガス : 0.89% (31 May 2016: 1.28%) | | |
| 126,898 | Royal Dutch Shell PLC Class A Com EURO.07 | 3,043,332 | 0.89 |
| | 小売 : 0.00% (31 May 2016: 0.70%) | | |
| | 英国合計 | <u>9,713,412</u> | <u>2.84</u> |
| | 株式合計 | <u>334,887,550</u> | <u>97.84</u> |
| | 権利証券 : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| | スペイン : 0.00% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 30,658 | Telefonica SA NPV | 9,657 | - |
| | スペイン合計 | <u>9,657</u> | <u>-</u> |
| | 権利証券合計 | <u>9,657</u> | <u>-</u> |
| | 投資ファンド 0.83% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| | アイルランド : 0.83% (31 May 2016: 0.16%) | | |
| 103,479 | iShares MSCI Europe ex-UK UCITS ETF EUR Dist NPV | 2,844,648 | 0.83 |
| | 投資ファンド合計 | <u>2,844,648</u> | <u>0.83</u> |

先渡為替契約：0.44% (31 May 2016: 1.19%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|-----|------------|-----|-------------|----------------|------------------|---------------|
| UBS | GBP | 94,420,704 | EUR | 110,072,068 | 15/12/2016 | 1,106,532 | 0.33 |
| UBS | USD | 8,373,393 | EUR | 7,684,999 | 15/12/2016 | 203,357 | 0.06 |
| UBS | GBP | 6,379,952 | EUR | 7,437,506 | 15/12/2016 | 74,768 | 0.02 |
| UBS | USD | 2,793,758 | EUR | 2,564,078 | 15/12/2016 | 67,850 | 0.02 |
| UBS | USD | 2,356,018 | EUR | 2,162,325 | 15/12/2016 | 57,219 | 0.02 |
| UBS | USD | 2,101,601 | EUR | 1,928,824 | 15/12/2016 | 51,040 | 0.01 |
| UBS | USD | 770,696 | EUR | 707,335 | 15/12/2016 | 18,717 | 0.01 |
| UBS | GBP | 1,210,259 | EUR | 1,410,873 | 15/12/2016 | 14,183 | - |
| UBS | GBP | 1,186,028 | EUR | 1,382,626 | 15/12/2016 | 13,899 | - |
| UBS | USD | 148,900 | EUR | 137,043 | 15/12/2016 | 3,232 | - |
| UBS | GBP | 45,600 | EUR | 51,170 | 15/12/2016 | 2,523 | - |
| UBS | GBP | 165,376 | EUR | 192,789 | 15/12/2016 | 1,938 | - |
| UBS | GBP | 139,622 | EUR | 162,766 | 15/12/2016 | 1,636 | - |
| UBS | GBP | 43,411 | EUR | 50,606 | 15/12/2016 | 509 | - |
| UBS | GBP | 35,800 | EUR | 41,690 | 15/12/2016 | 464 | - |
| UBS | GBP | 3,000 | EUR | 3,408 | 15/12/2016 | 124 | - |
| UBS | EUR | 10,286 | GBP | 8,719 | 15/12/2016 | 19 | - |
| UBS | EUR | 13,407 | USD | 14,225 | 15/12/2016 | 6 | - |
| UBS | EUR | 3,067 | USD | 3,254 | 15/12/2016 | 1 | - |
| 先渡為替契約に係る評価益合計 | | | | | | 1,618,017 | 0.47 |
| UBS | USD | 3,922 | EUR | 3,703 | 15/12/2016 | (9) | - |
| UBS | EUR | 4,710 | USD | 5,162 | 15/12/2016 | (153) | - |
| UBS | EUR | 138,331 | USD | 147,785 | 15/12/2016 | (894) | - |
| UBS | EUR | 2,431,884 | GBP | 2,074,447 | 15/12/2016 | (10,737) | - |
| UBS | EUR | 794,165 | USD | 864,842 | 15/12/2016 | (20,581) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,960,426 | GBP | 1,683,509 | 15/12/2016 | (21,874) | (0.01) |
| UBS | EUR | 1,226,822 | GBP | 1,093,315 | 15/12/2016 | (60,536) | (0.01) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (114,784) | (0.03) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | 1,503,233 | 0.44 |

| | 公正価値 ユーロ | 純資産 比率(%) |
|-----------------------|--------------------|---------------|
| 投資総額 | 339,245,088 | 99.11 |
| 現金および現金等価物* | 10,641,858 | 3.11 |
| その他の純負債 | (7,614,747) | (2.22) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | <u>342,272,199</u> | <u>100.00</u> |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 94.75 |
| 投資ファンドおよびAIF | 0.80 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 0.46 |
| その他の資産 | 3.99 |
| | <u>100.00</u> |

* すべての現金保有高は、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

投資有価証券明細表(2016年11月30日現在)

公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券。括弧内の比率は、2016年5月31日現在の同分野の保有高を表す。

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 日本円 | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式 : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 日本 : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 航空 : 1.35% (31 May 2016: 1.41%) | | |
| 62,900 | 日本航空 | 212,885,050 | 1.35 |
| | アパレル : 0.44% (31 May 2016: 0.40%) | | |
| 28,800 | アシックス | 69,321,600 | 0.44 |
| | 自動車製造 : 6.64% (31 May 2016: 6.69%) | | |
| 22,600 | 富士重工業 | 104,965,700 | 0.67 |
| 43,300 | 本田技研工業 | 144,297,250 | 0.92 |
| 187,400 | いすゞ自動車 | 252,755,750 | 1.60 |
| 56,600 | マツダ | 103,747,800 | 0.66 |
| 66,200 | トヨタ自動車 | 439,932,100 | 2.79 |
| | 自動車部品・装置 : 5.64% (31 May 2016: 5.90%) | | |
| 77,500 | ブリヂストン | 338,287,500 | 2.15 |
| 18,500 | デンソー | 92,111,500 | 0.58 |
| 39,100 | ジェイテクト | 71,494,350 | 0.45 |
| 30,900 | 小糸製作所 | 184,164,000 | 1.17 |
| 39,400 | 住友電気工業 | 63,118,800 | 0.40 |
| 38,000 | 東洋ゴム工業 | 53,086,000 | 0.34 |
| 39,700 | ユニプレス | 86,962,850 | 0.55 |
| | 銀行 : 6.08% (31 May 2016: 5.61%) | | |
| 152,000 | 七十七銀行 | 81,928,000 | 0.52 |
| 158,000 | ふくおかフィナンシャルグループ | 78,289,000 | 0.50 |
| 317,400 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 212,277,120 | 1.35 |
| 87,900 | 三井住友フィナンシャルグループ | 369,619,500 | 2.34 |
| 27,100 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 112,478,550 | 0.71 |
| 40,400 | スルガ銀行 | 104,009,800 | 0.66 |
| | 飲料 : 0.41% (31 May 2016: 0.48%) | | |
| 21,200 | サッポロホールディングス | 63,918,000 | 0.41 |
| | 化学 : 3.87% (31 May 2016: 3.78%) | | |
| 5,600 | 日本触媒 | 39,256,000 | 0.25 |
| 49,000 | 日本曹達 | 24,279,500 | 0.15 |
| 5,800 | 日東電工 | 45,791,000 | 0.29 |
| 66,200 | サカイクス | 99,134,500 | 0.63 |
| 30,000 | エスケー化研 | 329,250,000 | 2.09 |
| 74,700 | T & K T O K A | 71,973,450 | 0.46 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 日本円 | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 日本(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 商業サービス : 0.66% (31 May 2016: 0.53%) | | |
| 24,000 | リクルートホールディングス | 104,760,000 | 0.66 |
| | コンピューター : 3.16% (31 May 2016: 2.63%) | | |
| 211,000 | 富士通 | 142,361,700 | 0.90 |
| 13,500 | 大塚商会 | 75,127,500 | 0.48 |
| 36,400 | T D K | 279,916,000 | 1.78 |
| | 化粧品/パーソナルケア : 0.92% (31 May 2016: 0.86%) | | |
| 16,300 | 花王 | 85,811,350 | 0.54 |
| 24,600 | ユニ・チャーム | 59,876,400 | 0.38 |
| | 販売/卸売 : 5.70% (31 May 2016: 5.46%) | | |
| 90,500 | 稲畑産業 | 109,414,500 | 0.69 |
| 91,100 | 伊藤忠商事 | 142,229,875 | 0.90 |
| 49,700 | 三菱商事 | 122,783,850 | 0.78 |
| 235,000 | 三井物産 | 362,370,000 | 2.30 |
| 41,100 | 住友商事 | 56,070,675 | 0.36 |
| 21,800 | テクノアソシエ | 20,459,300 | 0.13 |
| 29,800 | 豊田通商 | 85,213,100 | 0.54 |
| | 各種金融サービス : 2.69% (31 May 2016: 2.20%) | | |
| 31,000 | 日立キャピタル | 86,862,000 | 0.55 |
| 77,800 | 日本取引所グループ | 131,754,300 | 0.84 |
| 88,300 | 三菱UFJリース | 46,534,100 | 0.30 |
| 174,500 | 野村ホールディングス | 107,055,750 | 0.68 |
| 85,800 | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 50,707,800 | 0.32 |
| | 電気部品・設備 : 2.93% (31 May 2016: 3.05%) | | |
| 108,600 | ハイレックスコーポレーション | 308,858,400 | 1.96 |
| 15,000 | 日本電産 | 153,562,500 | 0.97 |
| | 電子 : 3.37% (31 May 2016: 3.90%) | | |
| 10,400 | 日立ハイテクノロジーズ クラスC | 46,878,000 | 0.30 |
| 17,500 | H O Y A | 78,715,000 | 0.50 |
| 2,400 | キーエンス | 187,644,000 | 1.19 |
| 7,400 | 京セラ | 40,204,200 | 0.25 |
| 8,400 | S C R E E Nホールディングス | 57,288,000 | 0.36 |
| 69,300 | 安川電機 | 121,586,850 | 0.77 |
| | エンジニアリング・建設 : | | |
| | 1.10% (31 May 2016: 1.08%) | | |
| 57,800 | 日揮 | 109,097,500 | 0.69 |
| 67,500 | 三機工業 | 64,665,000 | 0.41 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 日本円 | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 日本(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 娯楽 : 0.21% (31 May 2016: 0.29%) | | |
| 9,200 | SANKYO | 33,235,000 | 0.21 |
| | 食品 : 1.30% (31 May 2016: 1.63%) | | |
| 36,240 | セブン&アイ・ホールディングス | 160,724,400 | 1.02 |
| 11,000 | 東洋水産 | 44,495,000 | 0.28 |
| | 工具・工作機械 : 1.66% (31 May 2016: 1.49%) | | |
| 11,600 | ディスコ | 157,296,000 | 1.00 |
| 3,200 | S M C | 104,032,000 | 0.66 |
| | ヘルスケア用品 : 1.53% (31 May 2016: 1.29%) | | |
| 88,000 | 島津製作所 | 153,340,000 | 0.97 |
| 51,600 | トプコン | 87,694,200 | 0.56 |
| | 住宅建設 : 2.26% (31 May 2016: 2.38%) | | |
| 126,300 | 長谷工コーポレーション | 149,539,200 | 0.95 |
| 31,600 | 飯田グループホールディングス | 70,088,800 | 0.44 |
| 79,500 | 積水化学工業 | 137,694,000 | 0.87 |
| | 住宅家具 : 0.61% (31 May 2016: 0.57%) | | |
| 29,100 | ソニー | 95,651,700 | 0.61 |
| | 保険 : 4.42% (31 May 2016: 4.04%) | | |
| 36,000 | M S & A Dインシュアランス グループ ホールディングス | 127,710,000 | 0.81 |
| 85,000 | S O M P Oホールディングス | 316,710,000 | 2.01 |
| 44,800 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 73,920,000 | 0.47 |
| 124,900 | T & Dホールディングス | 178,419,650 | 1.13 |
| | インターネット : 3.84% (31 May 2016: 3.37%) | | |
| 37,800 | サイバーエージェント | 105,140,700 | 0.67 |
| 53,000 | G M Oインターネット | 83,130,500 | 0.53 |
| 44,100 | カカクコム | 79,093,350 | 0.50 |
| 5,000 | L I N E | 22,000,000 | 0.14 |
| 31,700 | ネクスト | 25,391,700 | 0.16 |
| 91,900 | 楽天 | 103,640,225 | 0.66 |
| 62,400 | S B Iホールディングス | 89,419,200 | 0.57 |
| 55,100 | スタートトゥデイ | 96,865,800 | 0.61 |
| | 鉄/鉄鋼 : 0.25% (31 May 2016:0.22%) | | |
| 23,800 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 39,734,100 | 0.25 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 日本円 | 純資産 比率(%) |
|---------|--|-------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 日本(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 娯楽 : 0.14% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 6,900 | エイチ・アイ・エス | 21,752,250 | 0.14 |
| | 建設機械・採掘機械 : 1.45% (31 May 2016: 1.30%) | | |
| 198,000 | 日立製作所 | 120,641,400 | 0.77 |
| 67,800 | 三菱電機 | 106,869,750 | 0.68 |
| | 各種機械 : 2.88% (31 May 2016: 2.85%) | | |
| 3,700 | ファナック | 71,474,750 | 0.45 |
| 67,000 | クボタ | 115,709,000 | 0.73 |
| 44,800 | ナブテスコ | 130,188,800 | 0.83 |
| 131,400 | 日本トムソン | 56,567,700 | 0.36 |
| 118,000 | 住友重機械工業 | 81,184,000 | 0.51 |
| | 金属加工/金属製品 : 0.70% (31 May 2016: 0.58%) | | |
| 53,800 | ミスミグループ本社 | 110,074,800 | 0.70 |
| | 鉱業 : 1.08% (31 May 2016: 0.91%) | | |
| 117,000 | DOWAホールディングス | 102,784,500 | 0.65 |
| 44,000 | 住友金属鉱山 | 67,232,000 | 0.43 |
| | 各種製造業 : 0.91% (31 May 2016: 1.00%) | | |
| 21,200 | 富士フイルムホールディングス | 90,047,000 | 0.57 |
| 48,400 | コニカミノルタ | 52,877,000 | 0.34 |
| | 事務用機器 : 0.75% (31 May 2016: 0.88%) | | |
| 36,450 | キヤノン | 118,863,450 | 0.75 |
| | 石油・ガス : 1.84% (31 May 2016: 1.46%) | | |
| 144,200 | 国際石油開発帝石 | 156,457,000 | 0.99 |
| 305,600 | JXホールディングス | 133,333,280 | 0.85 |
| | 医薬品 : 2.96% (31 May 2016: 3.41%) | | |
| 61,500 | アステラス製薬 | 97,108,500 | 0.62 |
| 8,600 | キッセイ薬品工業 | 23,086,700 | 0.15 |
| 34,600 | 大塚ホールディングス | 160,699,700 | 1.02 |
| 103,300 | 参天製薬 | 144,155,150 | 0.91 |
| 6,600 | 沢井製薬 | 40,425,000 | 0.26 |
| | プライベート・エクイティ : 0.24% (31 May 2016: 0.00%) | | |
| 9,600 | ジャフコ | 37,920,000 | 0.24 |

| 保有高 | 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 公正価値 日本円 | 純資産 比率(%) |
|---------|---|-----------------------|--------------|
| | 株式(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 日本(つづき) : 94.26% (31 May 2016: 93.32%) | | |
| | 不動産 : 1.72% (31 May 2016: 1.63%) | | |
| 27,590 | イオンモール | 45,509,705 | 0.29 |
| 40,000 | 三菱地所 | 92,220,000 | 0.58 |
| 30,000 | 三井不動産 | 80,677,500 | 0.51 |
| 28,900 | 野村不動産ホールディングス | 53,537,250 | 0.34 |
| | 小売 : 6.70% (31 May 2016: 6.14%) | | |
| 14,000 | エービーシー・マート | 93,800,000 | 0.59 |
| 110,000 | A Tグループ | 273,625,000 | 1.74 |
| 21,900 | ドンキホーテホールディングス | 95,867,250 | 0.61 |
| 51,000 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 87,210,000 | 0.55 |
| 15,100 | イズミ | 75,651,000 | 0.48 |
| 116,900 | ナフコ | 197,677,900 | 1.25 |
| 7,700 | ニトリホールディングス | 91,976,500 | 0.58 |
| 232,600 | ヤマダ電機 | 142,234,900 | 0.90 |
| | 半導体 : 1.01% (31 May 2016: 1.06%) | | |
| 49,100 | アドバンテスト | 76,154,100 | 0.48 |
| 13,300 | ローム | 83,125,000 | 0.53 |
| | 通信 : 5.12% (31 May 2016: 6.07%) | | |
| 109,000 | K D D I | 326,455,000 | 2.07 |
| 67,500 | 日本電信電話 | 312,052,500 | 1.98 |
| 25,100 | ソフトバンク | 168,395,900 | 1.07 |
| | 玩具/ゲーム/趣味 : 0.76% (31 May 2016: 1.22%) | | |
| 4,300 | 任天堂 | 119,368,000 | 0.76 |
| | 運輸 : 4.96% (31 May 2016: 5.55%) | | |
| 6,600 | 東海旅客鉄道 クラスC | 123,189,000 | 0.78 |
| 28,900 | 東日本旅客鉄道 クラスC | 282,194,050 | 1.79 |
| 54,600 | 日立物流 | 127,654,800 | 0.81 |
| 16,100 | 近鉄エクスプレス | 26,106,150 | 0.17 |
| 127,000 | 商船三井 | 37,338,000 | 0.24 |
| 277,000 | 山九 | 184,205,000 | 1.17 |
| | 日本合計 | 14,857,784,080 | 94.26 |
| | 株式合計 | 14,857,784,080 | 94.26 |

| 契約数 | 先物契約 ** : 0.19% (31 May 2016: 0.13%) | 未実現利益 日本円 | 純資産 比率(%) |
|--|--------------------------------------|-------------------|--------------|
| 30 | Topix Index OSE December 2016 | 30,303,636 | 0.19 |
| 未決済先物契約に係る評価益合計 | | 30,303,636 | 0.19 |
| 先物契約合計 | | 30,303,636 | 0.19 |
| 先渡為替契約 : 3.24% (31 May 2016: 1.38%) | | | |

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現利益 日本円 | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|------------|-----|---------------|----------------|--------------|--------------|
| UBS | GBP | 46,565,588 | JPY | 6,249,972,659 | 15/12/2016 | 376,961,057 | 2.40 |
| UBS | USD | 6,829,763 | JPY | 724,453,450 | 15/12/2016 | 53,196,966 | 0.34 |
| UBS | EUR | 5,812,672 | JPY | 671,142,768 | 15/12/2016 | 31,394,557 | 0.20 |
| UBS | GBP | 1,838,756 | JPY | 238,861,112 | 15/12/2016 | 22,819,552 | 0.15 |
| UBS | EUR | 3,841,965 | JPY | 443,601,009 | 15/12/2016 | 20,750,663 | 0.13 |
| UBS | GBP | 2,003,213 | JPY | 268,868,710 | 15/12/2016 | 16,216,557 | 0.10 |
| UBS | GBP | 1,449,534 | JPY | 196,214,533 | 15/12/2016 | 10,074,474 | 0.07 |
| UBS | GBP | 1,261,196 | JPY | 174,371,391 | 15/12/2016 | 5,114,471 | 0.03 |
| UBS | EUR | 935,469 | JPY | 108,011,110 | 15/12/2016 | 5,052,518 | 0.03 |
| UBS | USD | 536,453 | JPY | 56,903,165 | 15/12/2016 | 4,178,427 | 0.03 |
| UBS | USD | 332,786 | JPY | 35,299,623 | 15/12/2016 | 2,592,069 | 0.02 |
| UBS | EUR | 433,446 | JPY | 50,046,509 | 15/12/2016 | 2,341,063 | 0.02 |
| UBS | USD | 202,691 | JPY | 22,055,065 | 15/12/2016 | 1,023,775 | 0.01 |
| UBS | GBP | 846,940 | JPY | 119,530,746 | 15/12/2016 | 1,000,666 | 0.01 |
| UBS | EUR | 164,844 | JPY | 19,265,975 | 15/12/2016 | 657,588 | - |
| UBS | USD | 62,791 | JPY | 6,660,430 | 15/12/2016 | 489,078 | - |
| UBS | USD | 178,373 | JPY | 19,823,215 | 15/12/2016 | 486,718 | - |
| UBS | EUR | 154,224 | JPY | 18,178,502 | 15/12/2016 | 461,488 | - |
| UBS | EUR | 109,108 | JPY | 12,751,925 | 15/12/2016 | 435,249 | - |
| UBS | EUR | 101,988 | JPY | 11,935,574 | 15/12/2016 | 391,034 | - |
| UBS | EUR | 103,453 | JPY | 12,194,034 | 15/12/2016 | 309,563 | - |
| UBS | GBP | 21,550 | JPY | 2,892,398 | 15/12/2016 | 174,452 | - |
| UBS | EUR | 42,167 | JPY | 4,924,118 | 15/12/2016 | 172,272 | - |
| UBS | GBP | 18,329 | JPY | 2,460,038 | 15/12/2016 | 148,375 | - |
| UBS | GBP | 17,659 | JPY | 2,382,411 | 15/12/2016 | 130,682 | - |
| UBS | USD | 129,345 | JPY | 14,598,813 | 15/12/2016 | 128,655 | - |
| UBS | EUR | 26,594 | JPY | 3,108,155 | 15/12/2016 | 106,088 | - |
| UBS | EUR | 104,229 | JPY | 12,493,684 | 15/12/2016 | 103,698 | - |
| UBS | USD | 15,885 | JPY | 1,728,503 | 15/12/2016 | 80,236 | - |
| UBS | EUR | 25,136 | JPY | 2,962,749 | 15/12/2016 | 75,214 | - |
| UBS | EUR | 74,298 | JPY | 8,905,993 | 15/12/2016 | 73,920 | - |
| UBS | USD | 9,824 | JPY | 1,069,012 | 15/12/2016 | 49,623 | - |
| UBS | GBP | 7,757 | JPY | 1,055,065 | 15/12/2016 | 48,866 | - |
| UBS | EUR | 11,750 | JPY | 1,373,293 | 15/12/2016 | 46,873 | - |
| UBS | USD | 14,200 | JPY | 1,578,041 | 15/12/2016 | 38,746 | - |
| UBS | EUR | 7,618 | JPY | 886,045 | 15/12/2016 | 34,645 | - |

先渡為替契約(つづき) : 3.24% (31 May 2016: 1.38%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損益 日本円 | 純資産 比率(%) |
|-------|-----|--------|-----|-----------|----------------|------------------|--------------|
| UBS | EUR | 11,578 | JPY | 1,364,702 | 15/12/2016 | 34,644 | - |
| UBS | GBP | 4,170 | JPY | 564,513 | 15/12/2016 | 28,985 | - |
| UBS | USD | 8,966 | JPY | 996,425 | 15/12/2016 | 24,465 | - |
| UBS | EUR | 17,357 | JPY | 2,080,528 | 15/12/2016 | 17,268 | - |
| UBS | GBP | 3,560 | JPY | 492,165 | 15/12/2016 | 14,436 | - |
| UBS | USD | 9,716 | JPY | 1,096,564 | 15/12/2016 | 9,663 | - |
| UBS | USD | 1,821 | JPY | 198,187 | 15/12/2016 | 9,200 | - |
| UBS | EUR | 7,955 | JPY | 953,552 | 15/12/2016 | 7,915 | - |
| UBS | EUR | 7,343 | JPY | 880,405 | 15/12/2016 | 7,115 | - |
| UBS | USD | 6,100 | JPY | 688,533 | 15/12/2016 | 6,067 | - |
| UBS | EUR | 986 | JPY | 114,186 | 15/12/2016 | 5,028 | - |
| UBS | USD | 1,683 | JPY | 187,031 | 15/12/2016 | 4,592 | - |
| UBS | GBP | 642 | JPY | 86,879 | 15/12/2016 | 4,461 | - |
| UBS | GBP | 548 | JPY | 74,129 | 15/12/2016 | 3,806 | - |
| UBS | EUR | 818 | JPY | 95,670 | 15/12/2016 | 3,210 | - |
| UBS | GBP | 2,643 | JPY | 373,054 | 15/12/2016 | 3,123 | - |
| UBS | GBP | 560 | JPY | 77,429 | 15/12/2016 | 2,271 | - |
| UBS | GBP | 480 | JPY | 66,391 | 15/12/2016 | 1,947 | - |
| UBS | EUR | 265 | JPY | 30,693 | 15/12/2016 | 1,332 | - |
| UBS | USD | 1,184 | JPY | 133,584 | 15/12/2016 | 1,177 | - |
| UBS | GBP | 421 | JPY | 59,362 | 15/12/2016 | 497 | - |
| UBS | GBP | 348 | JPY | 49,044 | 15/12/2016 | 410 | - |

先渡為替契約に係る評価益合計

557,551,490

3.54

| | | | | | | | |
|-----|-----|------------|-----|--------|------------|----------|---|
| UBS | JPY | 35,718 | EUR | 306 | 15/12/2016 | (1,209) | - |
| UBS | JPY | 117,894 | EUR | 986 | 15/12/2016 | (1,225) | - |
| UBS | JPY | 87,063 | USD | 776 | 15/12/2016 | (1,270) | - |
| UBS | JPY | 182,075 | EUR | 1,519 | 15/12/2016 | (1,570) | - |
| UBS | JPY | 69,602 | EUR | 590 | 15/12/2016 | (1,762) | - |
| UBS | JPY | 55,288 | EUR | 472 | 15/12/2016 | (1,814) | - |
| UBS | JPY | 67,665 | EUR | 585 | 15/12/2016 | (3,011) | - |
| UBS | JPY | 361,160 | EUR | 3,014 | 15/12/2016 | (3,114) | - |
| UBS | JPY | 180,616 | EUR | 1,578 | 15/12/2016 | (10,111) | - |
| UBS | JPY | 1,694,828 | EUR | 14,144 | 15/12/2016 | (14,614) | - |
| UBS | JPY | 648,722 | EUR | 5,503 | 15/12/2016 | (16,420) | - |
| UBS | JPY | 1,574,615 | GBP | 11,195 | 15/12/2016 | (18,613) | - |
| UBS | JPY | 706,381 | EUR | 6,102 | 15/12/2016 | (31,134) | - |
| UBS | JPY | 762,789 | EUR | 6,589 | 15/12/2016 | (33,620) | - |
| UBS | JPY | 1,258,898 | EUR | 10,781 | 15/12/2016 | (44,084) | - |
| UBS | JPY | 1,649,808 | USD | 14,918 | 15/12/2016 | (48,800) | - |
| UBS | JPY | 729,208 | GBP | 5,609 | 15/12/2016 | (68,973) | - |
| UBS | JPY | 11,604,618 | EUR | 96,794 | 15/12/2016 | (94,210) | - |
| UBS | JPY | 5,577,287 | EUR | 46,932 | 15/12/2016 | (95,040) | - |

先渡為替契約(つづき) : 3.24% (31 May 2016: 1.38%)

| 取引相手方 | 通貨 | 買い | 通貨 | 売り | 満期日 (日/月/年) | 未実現 損失 日本円 | 純資産 比率(%) |
|------------------------------|-----|-------------|-----|-----------|----------------|-----------------------|----------------------|
| UBS | JPY | 13,172,175 | EUR | 109,869 | 15/12/2016 | (106,936) | - |
| UBS | JPY | 12,649,817 | EUR | 105,565 | 15/12/2016 | (109,080) | - |
| UBS | JPY | 2,412,994 | EUR | 21,082 | 15/12/2016 | (135,082) | - |
| UBS | JPY | 14,747,594 | EUR | 123,286 | 15/12/2016 | (153,178) | - |
| UBS | JPY | 7,155,786 | EUR | 61,210 | 15/12/2016 | (242,188) | - |
| UBS | JPY | 137,773,371 | GBP | 975,943 | 15/12/2016 | (1,116,889) | (0.01) |
| UBS | JPY | 72,270,784 | GBP | 555,812 | 15/12/2016 | (6,828,962) | (0.05) |
| UBS | JPY | 318,725,634 | GBP | 2,340,310 | 15/12/2016 | (14,333,160) | (0.09) |
| UBS | JPY | 241,512,905 | GBP | 1,859,263 | 15/12/2016 | (23,086,130) | (0.15) |
| 先渡為替契約に係る評価損合計 | | | | | | (46,602,199) | (0.30) |
| 先渡為替契約合計 | | | | | | 510,949,291 | 3.24 |
| | | | | | | 公正価値 日本円 | 純資産 比率(%) |
| 投資総額 | | | | | | 15,399,037,007 | 97.69 |
| 現金および現金等価物* | | | | | | 549,434,121 | 3.49 |
| その他の純負債 | | | | | | (185,776,051) | (1.18) |
| 買戻可能参加投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | | 15,762,695,077 | 100.00 |

総資産の分析

| | 総資産 比率(%) |
|---|---------------|
| 公認の証券取引所への上場が認められているかまたは規制ある市場で取引されている 譲渡性のある有価証券および短期金融商品 | 92.42 |
| 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品 | 3.66 |
| その他の資産 | 3.92 |
| | 100.00 |

* すべての現金保有高は、デリバティブ契約の取引相手方であるゴールドマン・サックスにより担保として保有される44,163,204円を除き、ノーザン・トラスト・カンパニー、ロンドン支店に保有されている。

** 先物契約の取引相手方は、ゴールドマン・サックスである。

添付の注記は、財務書類と不可分のものである。

業種分類ベンチマーク(「ICB」)は、FTSEおよびダウ・ジョーンズにより共同所有され、使用が許諾されている。

FTSEおよびダウ・ジョーンズは、ICBの誤りまたは不備により生じるいかなる損失または損害について何人にも責任を負わない。

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 英ポンド |
|--|--------------|
| 46,504 GlaxoSmithKline PLC Com GBPO.25 | 764,119 |
| 186,839 BT Group PLC Com GBPO.05 | 718,122 |
| 367,395 Tesco PLC Com GBPO.05 | 623,176 |
| 27,154 Royal Dutch Shell PLC Class B Com EURO.07 | 546,033 |
| 150,800 Marks & Spencer Group PLC Com GBPO.25 | 501,441 |
| 34,924 Barrick Gold Corp Com NPV | 475,023 |
| 208,938 Centrica PLC Com GBPO.06 | 471,285 |
| 220,105 Barclays PLC Com GBPO.25^ | 378,524 |
| 40,237 Pearson PLC Com GBPO.25 | 324,353 |
| 174,729 Royal Bank of Scotland Group PLC Com GBP1.00 | 320,693 |
| 13,227 CRH PLC Com EURO.32 | 295,342 |
| 134,033 Legal & General Group PLC Com GBPO.03 | 285,264 |
| 63,058 BP PLC Com USD0.25 | 271,447 |
| 9,041 Johnson Matthey PLC Com GBP1.11 | 270,740 |
| 23,407 Smith & Nephew PLC Com USD0.20 | 263,398 |
| 44,792 Amec Foster Wheeler PLC Com GBPO.50 | 240,308 |
| 8,694 London Stock Exchange Group PLC Com GBPO.07 | 239,683 |
| 102,760 Vodafone Group PLC Com USD0.21 | 224,033 |
| 114,196 ITV PLC Com GBPO.10 | 209,526 |
| 52,597 Aviva PLC Com GBPO.25 | 204,005 |
| 84,213 J Sainsbury PLC Com GBPO.29 | 201,873 |
| 39,154 Royal Mail PLC Com GBPO.01 | 198,460 |
| 22,077 IG Group Holdings PLC Com GBPO.00005 | 182,918 |
| 158,536 Hays PLC Com GBPO.01 | 173,241 |
| 14,713 Ryanair Holdings PLC Com EURO.006 | 170,578 |
| 59,899 Hochschild Mining PLC Com GBPO.25 | 145,054 |
| 25,387 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 139,546 |
| 96,317 Melrose Industries PLC Com GBPO.07 | 138,221 |
| 34,299 Restaurant Group PLC Com GBPO.28 | 132,641 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド

売却上位銘柄

手取額
英ポンド

| | | |
|---------|--|-----------|
| 24,296 | AstraZeneca PLC Com USD0.25 | 1,168,637 |
| 525,613 | Vodafone Group PLC Com USD0.21 | 1,134,039 |
| 65,964 | GlaxoSmithKline PLC Com GBPO.25 | 1,034,197 |
| 177,118 | HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 927,278 |
| 195,725 | BP PLC Com USD0.25 | 864,912 |
| 40,311 | Royal Dutch Shell PLC Class B Com EURO.07 | 802,717 |
| 109,940 | Tate & Lyle PLC Com GBPO.25 | 739,582 |
| 54,644 | Orange SA Com EUR4.00 | 649,538 |
| 276,261 | Legal & General Group PLC Com GBPO.03 | 545,913 |
| 37,628 | Berendsen PLC Com GBPO.30 | 458,835 |
| 229,176 | Royal Bank of Scotland Group PLC Com GBP1.00 | 457,419 |
| 107,154 | Aviva PLC Com GBPO.25 | 444,183 |
| 50,459 | Anglo American PLC Com USD0.55 | 442,355 |
| 296,591 | South32 Ltd Com NPV | 438,901 |
| 215,084 | Barclays PLC Com GBPO.25^ | 419,927 |
| 161,879 | Koninklijke KPN NV Com EURO.04 | 413,217 |
| 393,903 | Firstgroup PLC Com GBPO.05 | 409,088 |
| 30,334 | Smith & Nephew PLC Com USD0.20 | 372,511 |
| 17,189 | Micro Focus International PLC Com GBPO.10 | 339,625 |
| 95,000 | National Express Group PLC Com GBPO.05 | 327,083 |
| 509,339 | Lloyds Banking Group PLC Com GBPO.10 | 289,536 |
| 28,375 | TUI AG Class D Com NPV | 287,829 |
| 18,160 | RELX PLC Com GBPO.14 | 258,685 |
| 100,000 | CYBG PLC Com GBPO.10 | 253,721 |
| 28,775 | Pearson PLC Com GBPO.25 | 250,682 |
| 116,341 | Centrica PLC Com GBPO.06 | 249,158 |
| 84,944 | Balfour Beatty PLC Com GBPO.50 | 237,191 |
| 108,705 | Rentokil Initial PLC Com GBPO.01 | 229,314 |
| 9,076 | Rio Tinto PLC Com GBPO.10 | 227,207 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 英ポンド |
|--|--------------|
| 189,394 Aggreko PLC Com GBPO.04832911 | 1,802,379 |
| 241,120 Restaurant Group PLC Com GBPO.28125 | 936,005 |
| 1,407,248 Lloyds Banking Group PLC Com GBPO.10 | 787,621 |
| 447,796 Barclays PLC Com GBPO.25^ | 719,089 |
| 223,358 Pagegroup PLC Com GBPO.01 | 707,440 |
| 77,600 Pearson PLC Com GBPO.25 | 642,407 |
| 35,527 GlaxoSmithKline PLC Com GBPO.25 | 583,395 |
| 40,300 Travis Perkins PLC Com GBPO.10 | 578,930 |
| 20,000 London Stock Exchange Group PLC Com GBPO.06918605 | 569,094 |
| 294,361 Wm Morrison Supermarkets PLC Com GBPO.10 | 561,838 |
| 88,859 Britvic PLC Com GBPO.20 | 529,386 |
| 184,062 Electrocomponents PLC Com GBPO.10 | 525,693 |
| 476,111 Cobham PLC Com GBPO.025 | 508,355 |
| 23,500 Diageo PLC Com GBPO.2893518 | 506,486 |
| 237,589 Elementis PLC Com GBPO.05 | 504,485 |
| 223,451 Vodafone Group PLC Com USD0.2095 | 493,784 |
| 118,793 Aviva PLC Com GBPO.25 | 478,935 |
| 91,263 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 461,406 |
| 66,650 Savills PLC Com GBPO.025 | 454,060 |
| 33,000 Hargreaves Lansdown PLC Com GBPO.004 | 444,876 |
| 419,958 Hays PLC Com GBPO.01 | 437,576 |
| 60,596 Daily Mail & General Trust PLC Class A Com GBPO.125 | 415,207 |
| 47,763 Anglo American PLC Com USD0.54945 | 391,203 |
| 19,161 Royal Dutch Shell PLC Class B Com EURO.07 | 389,659 |
| 14,000 Schroders PLC Com GBP1.00 | 388,531 |
| 205,849 Senior PLC Com GBPO.10 | 372,015 |
| 80,666 BP PLC Com USD0.25 | 349,317 |
| 20,279 Ultra Electronics Holdings PLC Com GBPO.05 | 347,436 |
| 128,696 Ascential PLC Com GBPO.01 | 332,188 |
| 141,716 QinetiQ Group PLC Com GBPO.01 | 326,744 |
| 141,941 Urban & Civic PLC Com GBPO.20 | 300,954 |
| 21,000 Burberry Group PLC Com GBPO.0005 | 285,966 |
| 117,148 Imagination Technologies Group PLC Com GBPO.10 | 277,437 |
| 4,500 Heineken Holding NV Com EUR1.60 | 276,292 |
| 232,312 Man Group PLC Com USD0.03428571 | 267,317 |
| 5,205 AstraZeneca PLC Com USD0.25 | 257,230 |
| 10,000 Fidessa Group PLC Com GBPO.10 | 250,999 |
| 186,643 Chemring Group PLC Com GBPO.01 | 248,007 |
| 107,902 CMC Markets PLC Com GBPO.25 | 240,838 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 英ポンド |
|--|-------------|
| 111,440 Royal Dutch Shell PLC Class B Com EURO.07 | 2,263,193 |
| 482,051 Electrocomponents PLC Com GBPO.10 | 1,675,409 |
| 50,600 Unilever PLC Com GBPO.0311 | 1,611,643 |
| 113,000 RELX PLC Com GBPO.144397 | 1,516,431 |
| 147,105 Anglo American PLC Com USD0.54945 | 1,452,568 |
| 305,579 BP PLC Com USD0.25 | 1,335,389 |
| 82,041 GlaxoSmithKline PLC Com GBPO.25 | 1,288,434 |
| 44,715 Rio Tinto PLC Com GBPO.10 | 1,275,406 |
| 43,500 London Stock Exchange Group PLC Com GBPO.06918605 | 1,232,936 |
| 61,000 Diageo PLC Com GBPO.2893518 | 1,228,032 |
| 196,084 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 1,203,992 |
| 165,500 Sage Group PLC Com GBPO.01051948 | 1,101,787 |
| 509,424 Wm Morrison Supermarkets PLC Com GBPO.10 | 1,071,930 |
| 82,000 Hargreaves Lansdown PLC Com GBPO.004 | 1,007,168 |
| 487,677 Old Mutual Plc Com GBPO.11 | 974,268 |
| 31,000 Schroders PLC Com GBP1.00 | 881,736 |
| 266,610 C&C Group Plc Com EURO.01 | 833,150 |
| 136,060 3i Group PLC Com GBPO.738636 | 797,006 |
| 351,693 Barclays PLC Com GBPO.25^ | 738,498 |
| 85,504 Sky PLC Com GBPO.50 | 730,351 |
| 348,319 Vodafone Group PLC Com USD0.2095 | 721,976 |
| 354,938 Centrica PLC Com GBPO.061728 | 709,474 |
| 1,089,392 Lloyds Banking Group PLC Com GBPO.10 | 656,727 |
| 19,500 Mondelez International Inc Class A Com NPV | 648,384 |
| 13,619 AstraZeneca PLC Com USD0.25 | 608,617 |
| 13,000 British American Tobacco PLC Com GBPO.25 | 601,689 |
| 80,000 Daily Mail & General Trust PLC Class A Com GBPO.125 | 600,679 |
| 43,000 Burberry Group PLC Com GBPO.0005 | 596,720 |
| 125,773 Aviva PLC Com GBPO.25 | 578,792 |
| 75,100 Pearson PLC Com GBPO.25 | 570,669 |
| 226,983 QinetiQ Group PLC Com GBPO.01 | 562,398 |
| 30,000 Rathbone Brothers PLC Com GBPO.05 | 548,139 |
| 9,000 Heineken Holding NV Com EUR1.60 | 507,611 |
| 21,500 Fidessa Group PLC Com GBPO.10 | 501,709 |
| 126,143 National Express Group PLC Com GBPO.05 | 444,342 |
| 89,895 Acacia Mining PLC Com GBPO.10 | 441,848 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|---|-------------|
| 24,100,000 United States Treasury Bill 0% 02/02/2017 | 24,077,635 |
| 24,000,000 United States Treasury Bill 0% 16/02/2017 | 23,970,273 |
| 2,090,000,000 Japan Treasury Discount Bill 0% 12/12/2016 | 20,575,479 |
| 2,160,000,000 Japan Treasury Discount Bill 0% 12/09/2016 | 20,301,586 |
| 14,000,000 United States Treasury Bill 0% 17/11/2016 | 13,989,737 |
| 12,000,000 United States Treasury Bill 0% 27/10/2016 | 11,990,445 |
| 11,000,000 United States Treasury Bill 0% 22/12/2016 | 10,992,006 |
| 10,000,000 United States Treasury Bill 0% 22/09/2016 | 9,993,162 |
| 7,260,000 United States Treasury Note/Bond 6.25% 15/08/2023 | 9,538,114 |
| 8,510,000 United States Treasury Bonds 2.38% 31/01/2018 | 8,761,602 |
| 8,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 8,755,469 |
| 8,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 8,731,875 |
| 8,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 8,729,688 |
| 7,200,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2021 | 7,448,611 |
| 8,750,000 Canadian Government Bond 01/08/2018 | 6,691,484 |
| 5,300,000 Bundesrepublik Deutschland Bundesobligation Inflation Linked Bond 0.75% 15/04/2018 | 6,454,150 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,371,406 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,367,813 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,360,000 |
| 3,800,000 United States Treasury Note/Bond 1.88% 30/06/2020 | 3,946,953 |
| 2,800,000 Spain Government Bond 2.15% 31/10/2025 | 3,388,647 |
| 1,980,000 United Kingdom Gilt 3.75% 07/09/2021 | 3,343,981 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|---|------------|
| 2,160,000,000 Japan Treasury Discount Bill 0% 12/09/2016 | 21,187,549 |
| 2,160,000,000 Japan Treasury Discount Bill 0% 13/06/2016 | 20,323,466 |
| 14,000,000 United States Treasury Bill 0% 18/08/2016 | 14,000,000 |
| 14,000,000 United States Treasury Bill 0% 17/11/2016 | 14,000,000 |
| 12,770,000 United States Treasury Note/Bond 3.125% 15/05/2019 | 13,524,340 |
| 12,100,000 United States Treasury Bill 0% 02/02/2017 | 12,089,744 |
| 12,000,000 United States Treasury Bill 0% 28/07/2016 | 12,000,000 |
| 12,000,000 United States Treasury Bill 0% 23/06/2016 | 12,000,000 |
| 12,000,000 United States Treasury Bill 0% 27/10/2016 | 12,000,000 |
| 10,000,000 United States Treasury Bill 0% 22/09/2016 | 10,000,000 |
| 8,510,000 United States Treasury Bonds 2.38% 31/01/2018 | 8,759,702 |
| 8,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 8,741,563 |
| 8,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 8,725,313 |
| 7,800,000 United States Treasury Bill 0% 16/02/2017 | 7,792,083 |
| 8,750,000 Canadian Government Bond 01/08/2018 | 6,677,737 |
| 5,100,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/01/2025 | 5,171,347 |
| 3,850,000 United States Treasury Note/Bond 6.25% 15/08/2023 | 4,986,666 |
| 3,970,000 France Government Bond OAT 4.25% 25/10/2017 | 4,626,372 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,370,625 |
| 4,000,000 Fannie Mae Pool 4.50% 15/12/2046 | 4,368,125 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,366,250 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,365,000 |
| 4,000,000 Fannie Mae 4.5% Perp | 4,357,500 |
| 430,000,000 Japan Government Ten Year Bond 0.4% 20/06/2025 | 4,286,540 |
| 3,800,000 United States Treasury Note/Bond 1.88% 30/06/2020 | 3,914,594 |
| 5,100,000 Canadian Government Bond 0.75% 01/09/2020 | 3,887,533 |
| 3,000,000 Spain Government Bond 2.75% 31/10/2024 | 3,799,603 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 19,230 Alibaba Group Holding Ltd ADR USD0.000025 | 1,846,461 |
| 51,162 KB Financial Group Inc Com KRW5000.00 | 1,492,972 |
| 1,101 Samsung Electronics Co Ltd Com KRW5000.00 | 1,407,136 |
| 11,704 Samsung SDI Co Ltd Com KRW5000.00 | 1,118,605 |
| 17,864 Korea Electric Power Corp Com KRW5000.00 | 968,794 |
| 157,484 Beijing Enterprises Holdings Ltd Com NPV | 825,968 |
| 619,872 Tingyi Cayman Islands Holding Corp Com USD0.005 | 744,505 |
| 44,900 Nexon Co Ltd Com NPV | 671,967 |
| 3,655 Baidu Inc ADR USD0.00005 | 668,599 |
| 233,000 Foxconn Technology Co Ltd Com TWD10.00 | 598,698 |
| 4,742 Hyundai Motor Co Com KRW5000.00 | 574,842 |
| 99,088 Wuliangye Yibin Co Ltd NPV | 472,127 |
| 36,000 Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 441,130 |
| 1,866 LG Chem Ltd Com KRW5000.00 | 407,203 |
| 10,827 Rio Tinto Ltd Com NPV | 383,888 |
| 364,000 Dongfeng Motor Group Co Ltd Com CNY1.00 | 381,262 |
| 47,300 ASM Pacific Technology Ltd Com HKD0.10 | 363,104 |
| 31,500 CK Hutchison Holdings Ltd Com HKD1.00 | 349,730 |
| 44,376 QBE Insurance Group Ltd Com NPV | 342,678 |
| 5,429 Macquarie Group Ltd Com NPV | 333,594 |
| 75,064 Origin Energy Ltd Com NPV | 323,264 |
| 17,627 Newcrest Mining Ltd Com NPV | 316,870 |
| 439,037 Propertylink Group NPV | 297,160 |
| 14,402 Australia & New Zealand Banking Group Ltd Com NPV | 295,652 |
| 90,600 Singapore Telecommunications Ltd Com NPV | 268,250 |
| 5,497 Ctrip.com International Ltd ADR NPV | 267,806 |
| 34,088 TPG Telecom Ltd NPV | 254,489 |
| 321,000 China Life Insurance Co Ltd/Taiwan Com TWD10.00 | 252,007 |
| 9,700 Jardine Cycle & Carriage Ltd Com NPV | 248,549 |
| 30,800 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 245,053 |
| 33,000 MediaTek Inc Com TWD10.00 | 237,806 |
| 8,843 JD.com Inc ADR USD0.00002 | 228,232 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|------------|
| 18,391 Baidu Inc ADR USD0.00005 | 3,030,841 |
| 64,271 Korea Electric Power Corp Com KRW5000.00 | 3,013,322 |
| 285,558 E-House China Holdings Ltd ADR each repr 1 ord USD.001 | 1,937,746 |
| 85,897 JD.com Inc ADR USD0.00002 | 1,870,343 |
| 1,326 Samsung Electronics Co Ltd Com KRW5000.00 | 1,751,415 |
| 311,000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 1,668,219 |
| 1,488,000 COSCO SHIPPING Ports Ltd HKD0.10 | 1,485,485 |
| 5,627 Hyundai Mobis Co Ltd Com KRW5000.00 | 1,355,976 |
| 180,824 Cheung Kong Property Holdings Ltd Com HKD1.00 | 1,207,654 |
| 100,500 China Mobile Ltd Com NPV | 1,166,322 |
| 1,364,809 Xinyi Glass Holdings Ltd Com HKD0.10 | 1,096,095 |
| 29,060 Tata Consultancy Services Ltd Com INR1.00 | 1,078,250 |
| 26,998 Samsung Card Co Ltd Class C Com KRW5000.00 | 1,075,098 |
| 44,900 Tencent Holdings Ltd Com HKD0.00002 | 1,059,149 |
| 166,061 GAIL India Ltd Com INR10.00 | 949,558 |
| 44,464 HDFC Bank Ltd Com INR2.00 | 949,217 |
| 153,000 AIA Group Ltd Com NPV | 939,349 |
| 227,135 Telstra Corp Ltd Com NPV | 902,933 |
| 15,621 Commonwealth Bank of Australia Com NPV | 872,538 |
| 161,576 Oil Search Ltd Com NPV | 857,358 |
| 19,995 New Oriental Education & Technology Group Inc ADR USD0.01 | 837,487 |
| 9,683 Alibaba Group Holding Ltd ADR USD0.000025 | 824,716 |
| 24,562 Hyundai Engineering & Construction Co Ltd Com KRW5000.00 | 813,547 |
| 2,784 Schroder International Selection Fund - Asian Smaller Companies Class I Acc NPV | 802,378 |
| 303,000 Powertech Technology Inc Com TWD10.00 | 791,791 |
| 298,113 Power Grid Corp of India Ltd Com INR10.00 | 772,085 |
| 77,165 Suncorp Group Ltd Com NPV | 729,970 |
| 29,262 Hana Financial Group Inc Com KRW5000.00 | 705,539 |
| 498,139 Mayne Pharma Group Ltd Com NPV | 704,816 |
| 1,172,400 Genting Singapore PLC Com USD0.10 | 696,449 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 880,871 iShares MSCI Eastern Europe Capped Fund NPV | 16,688,974 |
| 5,050 Samsung Electronics Co Ltd Com KRW5000.00 | 6,823,471 |
| 857,116 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 5,986,985 |
| 54,983 Alibaba Group Holding Ltd ADR USD0.000025 | 4,813,033 |
| 336,000 Hengan International Group Co Ltd Com HKD0.10 | 2,849,100 |
| 494,761 Ambev SA Com NPV | 2,765,031 |
| 44,611 MOL Hungarian Oil & Gas PLC Com HUF1000.00 | 2,737,635 |
| 231,373 Eurocash SA Com PLN1.00 | 2,432,599 |
| 1,042,000 Win Semiconductors Corp Com TWD10.00 | 2,321,540 |
| 71,263 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR NPV | 1,935,661 |
| 1,182,000 China Resources Power Holdings Co Ltd Com NPV | 1,818,104 |
| 79,561 Coca-Cola HBC AG Com CHF6.70 | 1,693,045 |
| 105,581 MMC Norilsk Nickel PJSC ADR NPV | 1,643,226 |
| 146,000 CK Hutchison Holdings Ltd Com HKD1.00 | 1,618,757 |
| 121,000 Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 1,517,540 |
| 8,922 Baidu Inc ADR USD0.00005 | 1,455,052 |
| 82,025 Reliance Industries Ltd Com INR10.00 | 1,288,698 |
| 163,500 ASM Pacific Technology Ltd Com HKD0.10 | 1,252,722 |
| 66,605 Infosys Ltd Com INR5.00 | 1,248,109 |
| 22,775 Cognizant Technology Solutions Corp Class A Com USD0.01 | 1,213,372 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|------------|
| 726,410 iShares MSCI Eastern Europe Capped Fund NPV | 12,817,537 |
| 738,000 China Mobile Ltd Com NPV | 8,810,528 |
| 3,704 Samsung Electronics Co Ltd Com KRW5000.00 | 4,787,340 |
| 39,475 Alibaba Group Holding Ltd ADR USD0.000025 | 3,923,365 |
| 561,256 Cheung Kong Property Holdings Ltd Com HKD1.00 | 3,805,361 |
| 696,000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd Com TWD10.00 | 3,757,283 |
| 94,772 Tata Consultancy Services Ltd Com INR1.00 | 3,555,772 |
| 16,742 Baidu Inc ADR USD0.00005 | 2,856,002 |
| 375,798 Wipro Ltd Com INR2.00 | 2,719,179 |
| 362,624 Axis Bank Ltd Com INR2.00 | 2,715,497 |
| 92,848 OTP Bank PLC Com HUF100.00 | 2,355,294 |
| 107,559 JD.com Inc ADR USD0.00002 | 2,214,003 |
| 294,000 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 2,209,959 |
| 10,034 NCSOFT Corp Com KRW500.00 | 2,206,279 |
| 497,759 Sanlam Ltd Com ZAR0.01 | 2,148,178 |
| 464,000 Galaxy Entertainment Group Ltd Com NPV | 1,830,272 |
| 6,000 Schroder International Selection Fund - Asian Smaller Companies Class I Acc NPV | 1,779,367 |
| 827,500 L'Occitane International International SA EURO.03 | 1,698,594 |
| 4,269,900 LPN Development PCL THB1.00 | 1,585,348 |
| 3,955,868 China Power International Development Ltd Com NPV | 1,507,946 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 4,750,000 Sprint Capital Corp 8.75% 15/03/2032 | 4,566,406 |
| 4,495,000 SBA Communications Corp 4.875% 01/09/2024 | 4,461,093 |
| 3,770,000 KFC Holding Co / Pizza Hut Holdings LLC / Taco Bell of America LLC 5% 01/06/2024 | 3,795,100 |
| 3,200,000 Quintiles IMS Inc 3.5% 15/10/2024 | 3,599,360 |
| 3,375,000 Frontier Communications Corp 11% 15/09/2025 | 3,496,969 |
| 3,285,000 NRG Yield Operating LLC 5% 15/09/2026 | 3,284,294 |
| 3,035,000 Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 5.875% 15/06/2021 | 3,101,250 |
| 3,045,000 Albertsons Cos LLC / Safeway Inc / New Albertson's Inc / Albertson's LLC 5.75% 15/03/2025 | 3,044,938 |
| 2,940,000 Alcoa Nederland Holding BV 6.75% 30/09/2024 | 2,994,850 |
| 2,905,000 Novelis Corp 5.875% 30/09/2026 | 2,905,875 |
| 2,765,000 Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp 7.125% 15/06/2024 | 2,812,594 |
| 2,560,000 Live Nation Entertainment Inc 4.875% 01/11/2024 | 2,576,150 |
| 2,540,000 Extraction Oil & Gas Holdings LLC / Extraction Finance Corp 7.875% 15/07/2021 | 2,540,000 |
| 2,500,000 Numericable-SFR SA 7.375% 01/05/2026 | 2,530,750 |
| 2,410,000 Boyd Gaming Corp 6.375% 01/04/2026 | 2,522,600 |
| 2,800,000 Sprint Corp 7.875% 15/09/2023 | 2,490,250 |
| 2,395,000 Six Flags Entertainment Corp 4.875% 31/07/2024 | 2,395,000 |
| 2,165,000 ARD Finance SA PIK 15/09/2023 | 2,366,924 |
| 2,090,000 Unitymedia GmbH 3.75% 15/01/2027 | 2,355,181 |
| 2,090,000 IHO Verwaltungs GmbH PIK 15/09/2023 'REGS' | 2,350,022 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|------------|
| 5,375,000 Frontier Communications Corp 11% 15/09/2025 | 5,547,438 |
| 4,825,000 Sprint Corp 7.875% 15/09/2023 | 4,180,688 |
| 3,850,000 AerCap Ireland Capital Ltd / AerCap Global Aviation Trust 5% 01/10/2021 | 4,026,700 |
| 3,160,000 Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 4.25% 15/01/2022 | 3,601,714 |
| 2,315,000 Ball Corp 4.375% 15/12/2023 | 3,006,538 |
| 2,875,000 Sprint Capital Corp 8.75% 15/03/2032 | 2,946,969 |
| 2,625,000 Western Digital Corp 10.5% 01/04/2024 | 2,941,344 |
| 2,780,000 Global Brass & Copper Inc 9.5% 01/06/2019 | 2,912,050 |
| 2,800,000 Energy Transfer Equity LP 5.875% 15/01/2024 | 2,872,226 |
| 2,650,000 Sinclair Television Group Inc 6.375% 01/11/2021 | 2,800,539 |
| 2,295,000 Darling Global Finance BV 4.75% 30/05/2022 | 2,691,416 |
| 2,250,000 Hanesbrands Finance Ltd 3.50% 15/06/2024 | 2,646,072 |
| 2,210,000 IMS Health Inc 4.125% 01/04/2023 | 2,575,558 |
| 2,800,000 Sprint Corp 7.125% 15/06/2024 | 2,541,406 |
| 2,060,000 HomeVi SAS 6.875% 15/08/2021 | 2,489,652 |
| 1,900,000 Sealed Air Corp 4.5% 15/09/2023 | 2,392,404 |
| 2,800,000 Valeant Pharmaceuticals International Inc 5.875% 15/05/2023 | 2,368,500 |
| 2,260,000 CommScope Holding Co Inc PIK 01/06/2020 | 2,334,874 |
| 2,165,000 Tempur Sealy International Inc 6.875% 15/12/2020 | 2,300,970 |
| 2,200,000 Numericable-SFR SA 6% 15/05/2022 '144A' | 2,262,750 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|---|-------------|
| 80,199,000 United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/02/2046 | 83,460,823 |
| 19,500,000 United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/08/2026 | 18,621,001 |
| 11,500,000 United States Treasury Note/Bond 1.125% 28/02/2021 | 11,464,351 |
| 10,763,000 United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/05/2046 | 10,861,261 |
| 10,100,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 05/08/2016 | 10,096,372 |
| 9,900,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 09/09/2016 | 9,897,927 |
| 9,400,000 Fannie Mae Pool 3.50% 15/12/2046 | 9,781,047 |
| 6,950,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/09/2021 | 9,222,255 |
| 10,080,000 United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/08/2046 | 8,697,238 |
| 5,685,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.6% 01/06/2026 | 6,517,958 |
| 3,900,000 United Kingdom Gilt 3.75% 07/09/2021 | 5,970,716 |
| 5,900,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 18/11/2016 | 5,899,303 |
| 4,700,000 Fannie Mae 3.50% Perp 15/11/2046 | 4,955,078 |
| 4,700,000 Fannie Mae 3.50% Perp 15/10/2046 | 4,949,277 |
| 4,700,000 Fannie Mae 3.50% Perp 15/01/2046 | 4,917,375 |
| 4,700,000 Fannie Mae Pool 3.50% 15/02/2046 | 4,819,703 |
| 3,700,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 21/11/2016 | 3,699,926 |
| 3,075,000 AT&T Inc 3.6% 17/02/2023 | 3,231,961 |
| 3,100,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 17/11/2016 | 3,099,978 |
| 3,000,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 21/09/2016 | 2,998,605 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|---|------------|
| 84,695,000 United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/02/2046 | 87,879,938 |
| 17,200,000 United States Treasury Note/Bond 1.125% 28/02/2021 | 17,187,836 |
| 17,500,000 United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/08/2026 | 16,667,281 |
| 8,900,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/09/2021 | 11,848,685 |
| 10,100,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 05/08/2016 | 10,096,698 |
| 9,900,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 09/09/2016 | 9,898,483 |
| 9,400,000 Fannie Mae Pool 3.50% 15/12/2046 | 9,773,152 |
| 6,350,000 United Kingdom Gilt 3.75% 07/09/2021 | 9,718,608 |
| 8,640,000 United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/08/2046 | 7,349,400 |
| 7,183,000 United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/05/2046 | 6,943,044 |
| 6,900,000 Canada Housing Trust No 1 3.8% 15/06/2021 | 6,127,037 |
| 5,900,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 18/11/2016 | 5,899,372 |
| 4,700,000 Fannie Mae 3.50% Perp 15/10/2046 | 4,960,816 |
| 4,700,000 Fannie Mae 3.50% Perp 15/11/2046 | 4,937,479 |
| 4,700,000 Fannie Mae 3.50% Perp 15/01/2046 | 4,826,680 |
| 3,920,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.6% 01/06/2026 | 4,459,312 |
| 3,800,000 Goldman Sachs Group Inc 5.95% 18/01/2018 | 4,051,091 |
| 2,100,000 United Kingdom Gilt 3.25% 22/01/2044 | 3,799,440 |
| 3,700,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 21/11/2016 | 3,700,000 |
| 3,500,000 AT&T Inc 2.80% 17/02/2021 | 3,569,055 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 250,200,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15/01/2025 | 378,756,495 |
| 86,300,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15/02/2044 | 103,127,699 |
| 41,600,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/01/2023 | 43,679,783 |
| 34,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/07/2046 | 35,263,672 |
| 27,510,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.25% 15/07/2020 | 32,292,544 |
| 28,932,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2018 | 30,379,762 |
| 25,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/11/2046 | 25,797,695 |
| 13,890,000 United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2029 | 24,504,472 |
| 22,900,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2020 | 23,858,637 |
| 19,800,000 France Government Bond OAT 0.25% 25/07/2018 | 23,509,056 |
| 16,120,000 France Government Bond OAT 0.1% 25/07/2021 | 19,268,942 |
| 9,030,000 United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.75% 22/03/2034 | 19,174,705 |
| 18,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/12/2046 | 18,362,773 |
| 17,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/08/2046 | 17,583,203 |
| 17,000,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 18/11/201 | 16,999,592 |
| 13,300,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.625% 15/07/2017 | 15,926,679 |
| 15,100,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 07/10/2016 | 15,090,624 |
| 15,000,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 17/11/2016 | 14,999,894 |
| 14,000,000 Fannie Mae Pool 3.5% 15/12/2046 | 14,584,844 |
| 9,130,000 France Government Bond OAT 1.1% 25/07/2022 | 12,417,195 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|-------------|
| 255,720,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15/01/2025 | 387,165,438 |
| 88,420,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15/02/2044 | 105,719,242 |
| 52,500,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/01/2023 | 55,093,435 |
| 33,580,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.25% 15/07/2020 | 39,436,302 |
| 34,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/07/2046 | 35,281,289 |
| 17,630,000 United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2029 | 30,998,384 |
| 24,500,000 France Government Bond OAT 0.25% 25/07/2018 | 29,066,714 |
| 25,876,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2018 | 27,175,621 |
| 21,860,000 France Government Bond OAT 0.1% 25/07/2021 | 26,216,253 |
| 25,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/11/2046 | 25,766,582 |
| 21,000,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.625% 15/07/2017 | 25,151,248 |
| 11,560,000 United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.75% 22/03/2034 | 24,519,808 |
| 22,900,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/04/2020 | 23,856,187 |
| 17,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/08/2046 | 17,615,020 |
| 12,540,000 France Government Bond OAT 1.1% 25/07/2022 | 17,094,688 |
| 17,000,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 18/11/2016 | 16,999,586 |
| 15,100,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 07/10/2016 | 15,090,563 |
| 15,000,000 Federal Home Loan Bank Consolidated Discount Note 17/11/2016 | 14,999,788 |
| 14,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/12/2046 | 14,567,656 |
| 8,560,000 United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2024 | 14,161,073 |
| 12,300,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/01/2024 | 13,175,708 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|---|-------------|
| 3,776,850 Ivory Coast Government International Bond FRN 31/12/2032 | 3,720,490 |
| 2,830,000 Ecuador Government International Bond 10.75% 28/03/2022 | 2,899,074 |
| 2,385,000 Turkey Government International Bond 7% 05/06/2020 | 2,651,663 |
| 2,370,000 Hungary Government International Bond 6.25% 29/01/2020 | 2,636,625 |
| 2,145,000 Lithuania Government International Bond 7.375% 11/02/2020 | 2,533,505 |
| 2,460,000 Oman Government International Bond 3.625% 15/06/2021 | 2,466,566 |
| 2,275,000 Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047 - Germany | 2,301,126 |
| 2,105,000 Uruguay Government International Bond 5.1% 18/06/2050 | 2,061,674 |
| 1,835,000 KazMunayGas National Co JSC 7% 05/05/2020 | 2,027,198 |
| 1,900,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 5% 29/04/2020 | 2,024,015 |
| 1,925,000 Colombia Government International Bond 4% 26/02/2024 | 2,002,738 |
| 1,790,000 Argentine Republic Government International Bond 7.5% 22/04/2026 | 1,946,689 |
| 1,730,000 Croatia Government International Bond 5.5% 04/04/2023 | 1,843,180 |
| 1,600,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/09/2023 - United States of America | 1,738,296 |
| 1,610,000 Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/05/2021 | 1,719,167 |
| 1,710,000 Senegal Government International Bond 6.25% 30/07/2024 | 1,706,940 |
| 1,600,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/09/2023 | 1,706,850 |
| 1,645,000 Saudi Government International Bond 2.375% 26/10/2021 | 1,612,788 |
| 1,441,000 Croatia Government International Bond 6.375% 24/03/2021 'REGS' | 1,591,165 |
| 1,547,000 Dominican Republic International Bond 6.85% 27/01/2045 | 1,571,539 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|---|------------|
| 244,269 iShares JP Morgan Emerging Markets Bond NPV UCITS ETF | 28,199,899 |
| 4,135,000 South Africa Government International Bond 5.875% 16/09/2025 | 4,633,051 |
| 3,185,000 Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026 | 3,584,232 |
| 2,940,000 Lithuania Government International Bond 6.125% 09/03/2021 - Frankfurt | 3,434,405 |
| 2,260,000 Croatia Government International Bond 6.25% 27/04/2017 | 2,342,490 |
| 1,525,000 Indonesia Government International Bond 8.5% 12/10/2035 | 2,197,943 |
| 1,705,000 Dominican Republic International Bond 7.5% 06/05/2021 | 1,903,048 |
| 2,139,000 Petroleos Mexicanos 5.5% 27/06/2044 | 1,884,792 |
| 1,110,000 Peruvian Government International Bond 8.75% 21/11/2033 | 1,759,643 |
| 1,370,000 Croatia Government International Bond 5.5% 04/04/2023 | 1,496,994 |
| 1,205,000 Dominican Republic International Bond 6.875% 29/01/2026 | 1,378,304 |
| 1,150,000 Grupo Televisa SAB 6.125% 31/01/2046 | 1,324,819 |
| 1,070,000 Serbia International Bond 7.25% 28/09/2021 - England | 1,207,742 |
| 1,125,000 Ivory Coast Government International Bond 6.375% 03/03/2028 | 1,190,250 |
| 1,005,000 Serbia International Bond 7.25% 28/09/2021 | 1,159,450 |
| 1,075,000 Corp Nacional del Cobre de Chile 5.625% 18/10/2043 | 1,134,965 |
| 955,000 Lithuania Government International Bond 6.125% 09/03/2021 - United States of America | 1,120,463 |
| 1,004,000 Romanian Government International Bond 4.875% 22/01/2024 | 1,105,581 |
| 975,000 KazMunayGas National Co JSC 7% 05/05/2020 | 1,083,469 |
| 1,040,000 Turkey Government International Bond 5.125% 25/03/2022 - Luxembourg | 1,082,640 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 278,658 iShares FTSE Epra/Nareit Developed Markets Property Fund NPV | 7,222,446 |
| 124,000 Sumitomo Realty & Development Co Ltd Com NPV | 3,300,296 |
| 194,000 Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 2,870,833 |
| 314,414 Dexus Property Group Reits NPV | 2,200,376 |
| 86,000 Mitsubishi Estate Co Ltd Com NPV | 1,716,185 |
| 206,500 Link Reits NPV | 1,456,982 |
| 209,800 Hongkong Land Holdings Ltd Com USD0.10 | 1,429,302 |
| 1,612 Japan Hotel Investment Corp Reits NPV | 1,210,343 |
| 38,411 Deutsche Wohnen AG Class B Com NPV | 1,208,851 |
| 6,000 Simon Property Group Inc Reits USD0.0001 | 1,105,470 |
| 691 United Urban Investment Corp Reits NPV | 1,063,062 |
| 350 Japan Retail Fund Investment Corp Reits NPV | 777,781 |
| 284,000 China Resources Land Ltd Com HKD0.10 | 757,901 |
| 10,530 Kilroy Realty Corp Reits NPV | 735,707 |
| 22,870 Colony Starwood Homes Reits USD0.01 | 706,186 |
| 30,500 Senior Porperties Trust Reits NPV | 670,979 |
| 5,550 SI Green Realty Co Reits USD0.01 | 587,698 |
| 21,650 Store Capital Corp Reits USD0.01 | 558,607 |
| 15,711 Vonovia SE Com NPV | 549,431 |
| 10,920 Prologis Inc Reits USD0.01 | 533,944 |
| 38,400 Aeon Mall Co Ltd Com NPV | 529,652 |
| 11,299 Agree Realty Corp Com Reits USD0.0001 | 516,969 |
| 3,120 Avalonbay Communities Reits NPV | 515,252 |
| 40,517 Land Securities Group PLC Reits GBPO.10 | 513,879 |
| 2,360 Essex Property Trust Inc Reits USD0.0001 | 506,940 |
| 21,000 Mitsui Fudosan Co Ltd Com NPV | 492,968 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|------------|
| 113,126 iShares FTSE Epra/Nareit Developed Markets Property Fund NPV | 2,832,472 |
| 10,330 Simon Property Group PLC USD0.0001 | 2,179,331 |
| 290,000 Cheung Kong Property Holdings Ltd Com HKD1.00 | 2,030,156 |
| 29,360 Equity Residential Reits USD0.01 | 1,891,430 |
| 204,500 Link Reits NPV | 1,428,035 |
| 871 Nomura Real Estate Master Fund Reits NPV | 1,407,123 |
| 105,000 Sun Hung Kai Properties Ltd Com NPV | 1,386,230 |
| 852,587 Mirvac Group Reits NPV | 1,350,004 |
| 225,500 Henderson Land Dev. | 1,322,512 |
| 42,900 General Growth Properties Inc Reits USD0.01 | 1,208,952 |
| 45,000 Sumitomo Realty & Development Co Ltd Com NPV | 1,107,831 |
| 437 Japan Retail Fund Reits NPV | 1,099,668 |
| 49,000 Mitsui Fudosan Co Ltd Com NPV | 1,070,533 |
| 682 Orix JREIT Inc Reits NPV | 1,065,906 |
| 271,217 Scentre Group Reits NPV | 1,031,235 |
| 379 Advance Residence Investments Reits NPV | 1,028,252 |
| 7,460 Boston Properties Reits USD0.01 | 972,043 |
| 12,844 Welltower Inc Reits USD1.00 | 948,142 |
| 22,668 Klepierre Reits EUR1.40 | 920,930 |
| 17,560 Prologis Inc Reits USD0.01 | 858,790 |
| 28,446 Pebblebrook Hotel Trust Reits USD0.01 | 769,292 |
| 101,561 Great Portland Estates Plc Reits GBPO.125 | 753,420 |
| 121 Kenedix Office Investment Reits NPV | 734,839 |
| 27,739 Duke Realty Reits USD0.01 | 698,154 |
| 113,100 City Developments Ltd NPV | 678,030 |
| 106,100 Dalian Wanda Commercial Properties Co Ltd Com CNY1.00 | 675,425 |
| 3,490 Avalonbay Communities Reits USD0.01 | 632,594 |
| 2,700 Essex Property Trust Inc Reits USD0.0001 | 619,732 |
| 38,990 DDR Corp Reits NPV | 611,824 |
| 20,540 Cubesmart Reits USD0.01 | 611,696 |
| 5,560 SI Green Realty Co Reits USD0.01 | 592,822 |
| 16,140 Deutsche Wohnen AG Class B Com NPV | 575,366 |
| 62,357 Workspace Group PLC Reits GBPO.01 | 567,358 |
| 60,029 Landlease Group PLC Reits NPV | 545,586 |
| 38,302 Land Securities Group PLC Reits GBPO.10 | 505,293 |
| 67,672 British Land Co Reits GBPO.25 | 495,209 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 9,500,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 9,794,463 |
| 7,750,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 8,025,215 |
| 7,190,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 7,699,900 |
| 7,350,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 7,495,383 |
| 7,065,000 United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/10/2021 | 7,044,302 |
| 704,300,000 Japan Government Five Year Bond 0.10% 20/06/2021 | 6,985,035 |
| 6,000,000 Fannie Mae Pool 3% 15/07/2046 | 6,249,844 |
| 5,825,000 United States Treasury Note/Bond 1.125% 30/06/2021 | 5,848,437 |
| 5,500,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 5,718,281 |
| 5,500,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 5,702,813 |
| 5,080,000 United States Treasury Note/Bond 1.375% 31/05/2021 | 5,167,114 |
| 14,745,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,909,738 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,855,076 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,854,045 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,850,255 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,847,212 |
| 3,695,000 United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/05/2026 | 3,681,816 |
| 3,550,000 Australia Government Bond 4.25% 21/04/2026 | 3,151,373 |
| 551,780,000 Hungary Government Bond 7% 24/06/2022 | 2,526,249 |
| 2,255,000 Landsbankinn HF 1.625% 15/03/2021 | 2,452,214 |
| 2,000,000 AT&T Inc 2.3% 11/03/2019 | 2,020,520 |
| 131,300,000 Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 20/07/2022 | 2,005,987 |
| 2,000,000 Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021 | 1,953,440 |
| 2,140,000 Canadian Government 2.50% 01/06/2024 | 1,863,349 |
| 1,650,000 Abbott Laboratories 2.35% 22/11/2019 | 1,648,383 |
| 1,500,000 Baidu Inc 2.75% 09/06/2019 | 1,527,600 |
| 1,490,000 Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021 | 1,482,386 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|---|------------|
| 13,500,000 Fannie Mae Pool 3% 15/07/2046 | 14,031,641 |
| 9,500,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 9,781,660 |
| 7,750,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 8,021,553 |
| 7,190,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 7,700,883 |
| 7,750,000 Singapore Government Bond 2.25% 01/06/2021 | 5,945,181 |
| 5,500,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 5,714,414 |
| 5,500,000 Fannie Mae Pool 3.00% 15/12/2046 | 5,706,895 |
| 6,500,000 Australia Government Bond 3.25% 21/04/2025 | 5,327,418 |
| 6,650,000 Singapore Government Bond 1.625% 01/10/2019 | 4,959,182 |
| 4,000,000 United States Treasury Note/Bond 2% 15/11/2021 | 4,159,531 |
| 14,745,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,891,172 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4% 01/07/2049 | 3,857,463 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,856,784 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,853,952 |
| 3,595,000 Fannie Mae Pool 4.00% 15/12/2046 | 3,853,485 |
| 3,500,000 AT&T Inc 2.3% 11/03/2019 | 3,538,825 |
| 2,800,000 Tencent Holdings Ltd 3.375% 02/05/2019 | 2,900,436 |
| 2,375,000 Arion Banki HF 3.125% 12/03/2018 | 2,621,149 |
| 2,500,892 Fannie Mae Pool 3.5% 01/12/2045 | 2,561,644 |
| 2,500,000 Hewlett Packard Enterprise Co 2.45% 05/10/2017 | 2,521,978 |
| 2,495,000 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP11 FRN 15/06/2049 | 2,501,755 |
| 2,525,000 Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ14 FRN 15/04/2049 | 2,448,634 |
| 2,140,000 Discover Bank/Greenwood DE 2.6% 13/11/2018 | 2,173,919 |
| 2,650,000 Canadian Government Bond 1.5% 01/06/2023 | 2,172,821 |
| 2,130,000 Schlumberger Holdings Corp 3% 21/12/2020 | 2,168,979 |
| 2,000,000 LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007-C6 FRN 15/07/2040 | 2,053,000 |
| 37,500,000 Mexican Bonos 5% 11/12/2019 | 1,933,240 |
| 2,140,000 Canadian Government 2.50% 01/06/2024 | 1,869,892 |
| 1,920,000 Cooperativa Muratori & Cementisti-CMC di Ravenna SC 7.5% 01/08/2021 | 1,718,638 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド

購入上位銘柄

取得原価
米ドル

| | | |
|---------|--|-----------|
| 279,307 | DB X-Trackers Russell Midcap UCITS ETF NPV | 5,124,496 |
| 28,149 | iShares Russell 2000 ETF NPV | 3,508,104 |
| 41,100 | Armstrong World Industries Inc Com USD0.01 | 1,829,215 |
| 90,949 | Liberty TripAdvisor Holdings Inc Class A Com USD0.01 | 1,694,751 |
| 17,869 | LendingTree Inc Com USD0.01 | 1,532,848 |
| 25,590 | FCB Financial Holdings Inc Class A Com USD0.001 | 928,989 |
| 14,462 | Centene Corp Com USD0.001 | 902,631 |
| 11,594 | Magellan Health Inc Com USD0.01 | 712,781 |
| 8,622 | Regency Centers Corp Reits USD0.01 | 681,871 |
| 17,351 | Bank of the Ozarks Inc Com USD0.01 | 653,707 |
| 20,688 | OGE Energy Corp Com USD0.01 | 650,009 |
| 32,745 | NOW Inc Com USD0.01 | 635,715 |
| 30,521 | Wolverine World Wide Inc Com USD1.00 | 625,939 |
| 31,629 | Summit Materials Inc Class A Com USD0.01 | 625,930 |
| 16,973 | TopBuild Corp Com NPV | 616,587 |
| 9,024 | American Woodmark Corp Com NPV | 604,569 |
| 60,775 | Nabors Industries Ltd Com USD0.001 | 594,053 |
| 8,150 | Skyworks Solutions Inc Com USD0.25 | 577,837 |
| 35,453 | RPC Inc Com USD0.10 | 570,963 |
| 13,473 | Paycom Software Inc Com USD0.01 | 564,853 |

売却上位銘柄

手取額
米ドル

| | | |
|---------|--|-----------|
| 369,219 | DB X-Trackers Russell Midcap UCITS ETF NPV | 6,771,062 |
| 37,029 | iShares Russell 2000 ETF NPV | 4,532,580 |
| 28,345 | Zebra Technologies Corp Class A Com USD0.01 | 1,671,671 |
| 23,469 | Shutterstock Inc Com USD0.01 | 1,309,900 |
| 9,041 | ABIOMED Inc Com USD0.01 | 1,045,992 |
| 10,420 | Dollar Tree Inc Com USD0.01 | 978,152 |
| 14,803 | Cabela's Inc Com USD0.01 | 899,504 |
| 9,881 | Camden Property Trust Reits USD0.01 | 795,852 |
| 7,033 | Bio-Techne Corp Com USD0.01 | 781,461 |
| 4,130 | Martin Marietta Materials Inc Com USD0.01 | 768,885 |
| 18,746 | Best Buy Co Inc Com USD0.10 | 718,639 |
| 5,690 | Zimmer Biomet Holdings Inc Com USD0.01 | 697,933 |
| 4,345 | Federal Realty Investment Trust Reits USD0.01 | 683,343 |
| 34,219 | Logitech International SA Com CHF0.25 | 669,463 |
| 5,369 | F5 Networks Inc Com NPV | 667,969 |
| 10,991 | Deckers Outdoor Corp Com USD0.01 | 658,832 |
| 8,664 | Global Payments Inc Com NPV | 649,399 |
| 12,550 | Copart Inc Com NPV | 637,577 |
| 11,658 | Expeditors International of Washington Inc Com USD0.01 | 592,757 |
| 21,858 | Invesco Ltd Com USD0.20 | 587,375 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 476,354 iShares S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF | 20,420,983 |
| 54,300 Wal-Mart Stores Inc Com USD0.10 | 3,835,143 |
| 49,400 Time Warner Inc Com USD0.01 | 3,783,802 |
| 55,070 American Express Co Class C Com USD0.20 | 3,519,702 |
| 45,700 El du Pont de Nemours & Co Com USD0.30 | 3,236,061 |
| 36,500 Gilead Sciences Inc Com USD0.001 | 2,979,999 |
| 52,460 Royal Dutch Shell PLC Com ADR NPV | 2,838,619 |
| 38,000 Express Scripts Holding Co Class C Com USD0.01 | 2,808,769 |
| 45,629 Bristol-Myers Squibb Co Com USD0.10 | 2,720,320 |
| 26,120 United Technologies Corp Com USD1.00 | 2,705,833 |
| 61,995 Delta Air Lines Inc Com USD0.0001 | 2,358,239 |
| 21,420 PPG Industries Inc Com USD1.67 | 2,249,886 |
| 10,051 Public Storage Reits USD0.10 | 2,192,332 |
| 38,625 Campbell Soup Co Com USD0.0375 | 2,136,358 |
| 7,300 Biogen Inc Com USD0.0005 | 2,060,175 |
| 19,437 Apple Inc Com USD0.00001 | 1,961,591 |
| 41,600 Baxter International Inc Com USD1.00 | 1,887,944 |
| 70,200 eBay Inc Com USD0.001 | 1,791,736 |
| 43,780 Hartford Financial Services Group Inc Com USD0.01 | 1,786,490 |
| 20,960 Capital One Financial Corp Com USD0.01 | 1,709,239 |
| 83,860 Hewlett Packard Enterprise Co Com USD0.01 | 1,666,541 |
| 14,475 Honeywell International Inc Com USD1.00 | 1,642,520 |
| 34,888 Conagra Brands Inc Com USD5.00 | 1,557,996 |
| 16,430 Walt Disney Co Com USD0.01 | 1,524,357 |
| 6,100 Lockheed Martin Corp Com USD1.00 | 1,493,462 |
| 22,000 Tyson Foods Inc Com USD0.10 | 1,466,475 |
| 15,311 Crown Castle International Corp Reits USD0.01 | 1,373,099 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス 米国バリューストックファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|------------|
| 507,542 iShares S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF | 21,401,540 |
| 69,830 Honeywell International Inc Com USD1.00 | 8,105,086 |
| 64,057 Apple Inc Com USD0.00001 | 6,878,956 |
| 118,500 Dow Chemical Co/The Com USD2.50 | 6,123,303 |
| 19,300 Biogen Inc Com USD0.0005 | 5,427,996 |
| 115,900 Lennar Corp Class A Com USD0.10 | 5,129,478 |
| 145,800 CRH ADR NPV | 4,935,466 |
| 62,000 Phillips 66 Com NPV | 4,921,337 |
| 100,040 Wells Fargo & Co Class C Com USD1.666 | 4,747,145 |
| 147,000 General Motors Co Class C Com USD0.01 | 4,557,535 |
| 18,000 Lockheed Martin Corp Com USD1.00 | 4,541,122 |
| 67,885 JPMorgan Chase & Co Class C Com USD1.00 | 4,413,399 |
| 81,980 Verizon Communications Inc Com USD0.10 | 4,381,593 |
| 106,400 AT&T Inc Com USD1.00 | 4,369,017 |
| 27,300 General Dynamics Corp Com USD1.00 | 4,060,508 |
| 226,600 Bank of America Corp Com USD0.01 | 3,649,305 |
| 53,985 Texas Instruments Inc Com USD1.00 | 3,622,121 |
| 100,910 Pfizer Inc Com USD0.05 | 3,551,696 |
| 84,995 Oracle Corp Com USD0.01 | 3,369,329 |
| 123,527 Morgan Stanley Com USD0.01 | 3,106,483 |
| 94,874 CSX Corp Com USD1.00 | 3,073,877 |
| 76,720 Delta Air Lines Inc Com USD0.0001 | 3,019,796 |
| 114,600 Twenty-First Century Fox Inc Class A Com USD0.01 | 3,011,370 |
| 24,520 Johnson & Johnson Com USD1.00 | 2,946,348 |
| 80,800 PPL Corp Com USD0.01 | 2,846,636 |
| 89,595 Cisco Systems Inc Com USD0.001 | 2,678,546 |
| 84,970 General Electric Co Class C Com USD0.06 | 2,651,761 |
| 25,800 Philip Morris International Inc Com NPV | 2,607,465 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

購入上位銘柄

取得原価
米ドル

| | | |
|---------|--|-----------|
| 586,730 | Staples Inc Com USD0.0006 | 4,999,487 |
| 52,810 | Canadian Imperial Bank of Commerce Com NPV | 3,968,618 |
| 104,105 | Pfizer Inc Com USD0.05 | 3,473,036 |
| 46,884 | Altria Group Inc Com USD0.333 | 3,063,281 |
| 42,906 | JPMorgan Chase & Co Class C Com USD1.00 | 2,955,860 |
| 29,449 | Philip Morris International Inc Com NPV | 2,802,813 |
| 55,468 | Newell Brands Inc Com USD1.00 | 2,766,590 |
| 31,050 | Medtronic PLC Com USD0.10 | 2,631,888 |
| 44,884 | Fortune Brands Home & Security Inc Com USD0.01 | 2,629,543 |
| 20,207 | Home Depot Inc Com USD0.05 | 2,573,831 |
| 29,654 | Kraft Heinz Co/The Com USD0.01 | 2,566,811 |
| 38,404 | Bunge Ltd Com USD0.01 | 2,512,645 |
| 52,840 | Citigroup Inc Com USD0.01 | 2,492,830 |
| 174,867 | Galp Energia SGPS SA Com EUR1.00 | 2,453,755 |
| 23,368 | PepsiCo Inc Com USD0.017 | 2,448,384 |
| 171,173 | Babcock International Group PLC Com GBPO.60 | 2,396,730 |
| 31,175 | Eli Lilly & Co Class C Com NPV | 2,356,803 |
| 87,948 | HollyFrontier Corp Com USD0.01 | 2,329,199 |
| 457,823 | BT Group PLC Com GBPO.05 | 2,310,005 |
| 139,639 | Securitas AB Com SEK1.00 | 2,292,413 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス グローバル株式ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|---|------------|
| 79,500 Microsoft Corp Com USD0.00000625 | 4,421,579 |
| 33,278 Apple Inc Com USD0.00001 | 3,460,807 |
| 71,713 Wells Fargo & Co Class C Com USD1.666 | 3,379,592 |
| 26,889 Johnson & Johnson Com USD1.00 | 3,234,886 |
| 40,388 Canadian Imperial Bank of Commerce Com NPV | 3,150,436 |
| 84,334 Pfizer Inc Com USD0.05 | 2,840,052 |
| 40,512 Altria Group Inc Com USD0.333 | 2,720,900 |
| 34,689 LyondellBasell Industries NV Class A Com EURO.04 | 2,679,875 |
| 19,223 Dun & Bradstreet Corp Com USD0.01 | 2,517,338 |
| 279,366 Staples Inc Com USD0.0006 | 2,430,947 |
| 19,818 McDonald's Corp Com USD0.01 | 2,411,146 |
| 38,453 AbbVie Inc Com USD0.01 | 2,400,055 |
| 23,281 Philip Morris International Inc Com NPV | 2,327,835 |
| 21,989 CME Group Inc/IL Com USD0.01 | 2,280,881 |
| 21,514 Digital Reality Trust Com USD0.01 | 2,191,277 |
| 558,780 Aberdeen Asset Management PLC Com GBPO.10 | 2,048,866 |
| 282,117 HSBC Holdings PLC Com USD0.50 | 2,022,969 |
| 66,148 General Electric Co Class C Com USD0.06 | 2,019,230 |
| 42,947 TOTAL SA Com EUR2.50 | 1,985,685 |
| 39,411 Sysco Corp Com USD1.00 | 1,971,350 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 米ドル |
|--|-------------|
| 1,182,000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2021 | 3,583,956 |
| 7,061,900,000 Colombian TES 10% 24/07/2024 | 2,711,488 |
| 28,109 SPDR Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF | 2,111,423 |
| 729,600 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2023 | 2,071,732 |
| 590,000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2025 | 1,624,860 |
| 528,000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2018 | 1,611,050 |
| 25,024,000 Mexican Bonos 10% 05/12/2024 | 1,549,848 |
| 25,650,000 Mexican Bonos 7.75% 14/12/2017 | 1,348,296 |
| 26,550,000 South Africa Government Bond 6.25% 31/03/2036 | 1,340,877 |
| 3,887,200,000 Colombian TES 7.5% 26/08/2026 | 1,273,773 |
| 4,286,000 Poland Government Bond 4% 25/10/2023 | 1,178,798 |
| 4,850,000 Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025 | 1,164,512 |
| 14,877,000,000 Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/09/2026 | 1,159,138 |
| 4,760,000 Poland Government Bond 2.5% 25/07/2026 | 1,141,486 |
| 4,950,000 Malaysia Government Bond 3.62% 30/11/2021 | 1,128,259 |
| 13,155,000,000 Indonesia Treasury Bond 8.75% 15/05/2031 | 1,066,962 |
| 18,280,000 South Africa Government Bond 7% 28/02/2031 | 1,050,267 |
| 68,500,000 Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 14/04/2021 | 1,020,908 |
| 4,180,000 Malaysia Government Bond 3.759% 15/03/2019 | 1,018,559 |
| 2,900,000 Peru Government Bond 7.84% 12/08/2020 | 933,082 |
| 2,980,000 Peru Government Bond 5.7% 12/08/2024 | 893,512 |
| 3,090,000 Turkey Government Bond 8% 12/03/2025 | 853,283 |
| 10,790,000 South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026 | 818,997 |
| 12,710,000 Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029 | 746,188 |
| 16,869,000 Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021 | 883,944 |
| 47,010,000 Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023 | 685,422 |
| 8,465,000,000 Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/05/2036 | 662,452 |
| 42,590,000 Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 03/02/2027 | 660,185 |
| 8,236,000,000 Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/03/2034 | 648,087 |
| 1,923,900,000 Colombian TES 7% 04/05/2022 | 635,307 |
| 1,190,000 Turkey Government Bond 4% 01/04/2020 | 632,300 |
| 43,640,000 Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/01/2028 | 620,352 |
| 40,690,000 Russian Federal Bond - OFZ 6.4% 27/05/2020 | 598,366 |
| 7,136,000,000 Indonesia Treasury Bond 9% 15/03/2029 | 593,386 |
| 18,417,000 Thailand Government Bond 3.85% 12/12/2025 | 585,474 |
| 2,260,000 Poland Government Bond 1.75% 25/07/2021 | 570,372 |
| 2,260,000 Poland Government Bond 0% 25/10/2018 | 563,886 |
| 1,825,000 Turkey Government Bond 10.4% 27/03/2019 | 560,269 |
| 57,000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series B 6% 15/05/2045 | 530,154 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 米ドル |
|--|------------|
| 77,462 SPDR Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF | 5,762,841 |
| 960,000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2017 | 3,003,462 |
| 5,120,000 Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025 | 1,328,871 |
| 3,820,000 Poland Government Bond 4% 25/10/2023 | 1,056,253 |
| 1,990,000 Poland Index Linked Government Bond 3% 24/08/2016 | 656,698 |
| 8,258,000 South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026 | 646,492 |
| 1,990,000 Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022 | 609,794 |
| 254,000 Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2018 | 603,430 |
| 201,500 Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/10/2016 | 603,250 |
| 6,440,000,000 Indonesia Treasury Bond 7% 15/05/2022 | 492,407 |
| 955,500,000 Colombian TES 10% 24/07/2024 | 373,760 |
| 1,068,000 Turkey Government Bond 10.5% 15/01/2020 | 361,151 |
| 1,319,000 Malaysia Government Bond 3.314% 31/10/2017 | 323,241 |
| 4,740,000 Mexican Bonos 8.5% 13/12/2018 | 273,750 |
| 771,400,000 Colombian TES 7.75% 18/09/2030 | 271,043 |
| 3,930,000 Mexican Bonos 10% 05/12/2024 | 260,647 |
| 4,672,000 Mexican Bonos 7.25% 15/12/2016 | 253,674 |
| 83,000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F 10% 01/01/2021 | 241,040 |
| 670,000 Peru Government Bond 7.84% 12/08/2020 | 218,956 |
| 870,000 Poland Government Bond 2.5% 25/07/2026 | 212,562 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 ユーロ |
|---|-------------|
| 831,527 iShares MSCI Europe ex-UK UCITS ETF EUR Dist NPV | 22,436,261 |
| 11,687,121 Institutional Cash Series PLC - Institutional Euro Assets Liquidity Fund NPV Distributing | 11,687,121 |
| 157,449 Nestle SA Com CHF0.10 | 10,788,979 |
| 27,359 Roche Holding AG Com NPV | 6,234,497 |
| 130,371 Imperial Brands PLC Com GBPO.10 | 6,044,668 |
| 52,045 Anheuser-Busch InBev SA/NV Com NPV | 5,837,078 |
| 357,783 RWE AG Com NPV | 5,651,410 |
| 74,956 Novartis AG Com CHF0.50 | 5,334,438 |
| 45,354 Pandora A/S Com DKK1.00 | 5,223,778 |
| 57,271 Bayer AG Com NPV | 5,213,359 |
| 861,348 ArcelorMittal Com NPV | 4,893,387 |
| 1,125,496 Enel SpA Com EUR1.00 | 4,500,362 |
| 63,456 Vinci SA Com EUR2.50 | 4,257,407 |
| 33,330 Volkswagen AG Pref NPV | 4,207,631 |
| 192,654 thyssenkrupp AG Com NPV | 4,031,068 |
| 140,466 Erste Group Bank AG Com NPV | 3,749,514 |
| 104,588 Novo Nordisk A/S Class B Com DKK0.20 | 3,732,538 |
| 21,790 Shire PLC Com ADR NPV | 3,668,642 |
| 64,451 Koninklijke DSM NV Com EUR1.50 | 3,660,386 |
| 192,823 Gamesa Corporation Company Tecnologica SA Com EURO.17 | 3,611,511 |
| 384,086 Telefonica SA Com EUR1.00 | 3,415,423 |
| 94,491 Innogy SE Com EUR2.00 | 3,399,865 |
| 62,165 AstraZeneca PLC Com USD0.25 | 3,355,655 |
| 20,734 Linde AG Com NPV | 3,241,628 |
| 37,761 Swiss Re AG Class A Com CHF0.10 | 3,096,171 |
| 90,293 DONG Energy A/S Com DKK10.00 | 3,089,167 |
| 163,054 AXA SA Com EUR2.29 | 3,032,535 |
| 32,171 Hannover Rueck SE Com NPV | 2,960,521 |
| 12,055 Zurich Insurance Group AG Class A Com CHF0.10 | 2,770,855 |
| 35,047 Deutsche Boerse AG Class A Com NPV | 2,766,954 |
| 871,482 Koninklijke KPN NV Com EURO.04 | 2,673,112 |
| 145,894 Endesa SA Com EUR1.20 | 2,598,763 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 ユーロ |
|---|------------|
| 728,048 iShares MSCI Europe ex-UK UCITS ETF EUR Dist NPV | 19,923,924 |
| 12,526,009 Institutional Cash Series PLC - Institutional Euro Assets Liquidity Fund NPV Distributing | 12,524,870 |
| 152,414 Nestle SA Com CHF0.10 | 10,487,850 |
| 71,766 Volkswagen AG Pref NPV | 8,040,411 |
| 533,499 Deutsche Telekom AG Com NPV | 7,898,951 |
| 33,745 Roche Holding AG Com NPV | 7,427,820 |
| 100,510 Sanofi Com EUR2.00 | 7,252,453 |
| 3,962,637 Intesa Sanpaolo SpA EURO.52 | 7,105,083 |
| 111,489 Royal Caribbean Cruises Ltd Com USD0.01 | 6,822,833 |
| 97,893 Novartis AG Com CHF0.50 | 6,685,976 |
| 158,541 Novo Nordisk A/S Class B Com DKK0.20 | 6,672,519 |
| 104,377 Vestas Wind Systems A/S Com DKK1.00 | 6,502,495 |
| 1,581,690 Enel SpA Com EUR1.00 | 6,131,276 |
| 156,663 Sampo OYJ Class A Com NPV | 6,104,506 |
| 65,502 Bayer AG Com NPV | 5,977,147 |
| 245,400 Royal Dutch Shell PLC Class A Com EURO.07 | 5,696,879 |
| 259,659 AXA SA Com EUR2.29 | 5,263,371 |
| 46,687 Pandora A/S Com DKK1.00 | 5,205,939 |
| 545,055 Groupe Eurotunnel SE Com EURO.40 | 4,915,140 |
| 582,785 Euskaltel SA Com EUR3.00 | 4,628,302 |
| 72,498 Vinci SA Com EUR2.50 | 4,581,228 |
| 100,950 Imperial Brands PLC Com GBPO.10 | 4,515,246 |
| 214,462 Koninklijke Ahold Delhaize NV Com EURO.01 | 4,495,146 |
| 41,535 Anheuser-Busch InBev SA/NV Com NPV | 4,304,774 |
| 223,967 Endesa SA Com EUR1.20 | 4,092,802 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)

グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

| 購入上位銘柄 | 取得原価 日本円 |
|--------------------------|-------------|
| 35,400 日立キャピタル | 71,137,064 |
| 18,800 日本航空 | 64,612,771 |
| 6,900 T D K | 46,538,074 |
| 35,700 いすゞ自動車 | 45,180,418 |
| 10,200 リクルートホールディングス | 38,729,400 |
| 9,400 三井住友フィナンシャルグループ | 33,337,697 |
| 20,000 島津製作所 | 31,634,519 |
| 10,100 ジャフコ | 30,354,967 |
| 31,700 ネクスト | 29,059,124 |
| 8,900 S O M P Oホールディングス | 24,645,900 |
| 30,100 国際石油開発帝石 | 24,607,516 |
| 10,300 ユニ・チャーム | 21,998,353 |
| 17,300 近鉄エクスプレス | 21,949,516 |
| 6,900 エイチ・アイ・エス | 19,126,762 |
| 10,900 日揮 | 18,198,037 |
| 9,300 野村不動産ホールディングス | 16,925,372 |
| 5,000 L I N E | 16,500,000 |
| 12,000 三菱電機 | 14,546,723 |
| 9,800 エイチ・ツー・オー リテイリング | 13,389,016 |
| 2,900 大塚ホールディングス | 13,276,774 |
| 4,000 プリヂストーン | 13,051,473 |
| 7,800 参天製薬 | 12,626,546 |
| 9,200 日本取引所グループ | 11,534,623 |
| 12,100 長谷工コーポレーション | 11,485,372 |
| 10,000 東洋ゴム工業 | 11,458,495 |
| 3,700 K D D I | 10,385,083 |
| 8,300 ソニーフィナンシャルホールディングス | 10,012,065 |
| 5,800 アシックス | 9,979,474 |
| 28,000 三井住友トラスト・ホールディングス | 9,685,716 |
| 4,000 三井不動産 | 9,337,697 |
| 500 東海旅客鉄道 クラスC | 8,459,985 |
| 6,400 ジェイテクト | 8,205,981 |

パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド・パブリック・リミテッド・カンパニー

ポートフォリオ変動明細表(2016年11月30日に終了した6か月間)(続き)

グローバル・アクセス ジャパン・ファンド

| 売却上位銘柄 | 手取額 日本円 |
|---------------------------|-------------|
| 55,300 三井住友 フィナンシャルグループ | 178,267,619 |
| 44,100 トヨタ自動車 | 252,827,730 |
| 138,900 三井物産 | 179,336,048 |
| 270,500 野村ホールディングス | 117,575,669 |
| 59,100 S O M P Oホールディングス | 179,928,703 |
| 12,100 任天堂 | 309,329,313 |
| 51,400 プリヂェストーン | 180,441,673 |
| 91,400 いすゞ自動車 | 116,521,646 |
| 19,000 東日本旅客鉄道 クラスC | 175,451,250 |
| 91,500 T & Dホールディングス | 95,651,524 |
| 213,100 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 107,226,452 |
| 44,900 日本電信電話 | 213,829,764 |
| 286,000 商船三井 | 63,345,148 |
| 72,300 K D D I | 228,888,064 |
| 16,900 京セラ | 87,332,383 |
| 37,400 日本航空 | 117,828,412 |
| 20,900 T D K | 132,031,280 |
| 28,300 本田技研工業 | 80,405,162 |
| 56,600 ハイレックスコーポレーション | 149,552,247 |
| 39,600 日立ハイテクノロジーズ | 136,868,610 |
| 25,100 セブン&アイ・ホールディングス | 109,436,840 |
| 24,100 キヤノン | 71,158,068 |
| 33,100 日揮 | 52,151,891 |
| 78,000 D O W Aホールディングス | 46,972,807 |
| 122,000 日立製作所 | 57,077,073 |
| 135,000 富士通 | 59,734,975 |
| 36,100 楽天 | 44,501,949 |
| 88,800 新光電気工業 | 53,234,646 |

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

1. グローバル・アクセス ユーケー・アルファ・ファンド クラスB(無分配型)英ポンド建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 977,989 | 390,028 |
| 2016年12月末日 | (0) | (850,000) | (390,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

2. グローバル・アクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド クラスB(無分配型)英ポンド建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 156,206 | 610,000 |
| 2016年12月末日 | (0) | (50,000) | (610,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

3. グローバル・アクセス 米国中小型株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|-----------|-----------|-------------|
| 2016年1月1日～ | 663,220 | 1,138,910 | 4,008,957 |
| 2016年12月末日 | (600,000) | (830,000) | (3,610,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

4. グローバル・アクセス 米国バリュー株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|---------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 5,500 | 183,000 | 125,000 |
| 2016年12月末日 | (5,500) | (183,000) | (125,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

5. グローバル・アクセス 欧州(除く英国)・アルファ・ファンド クラスB(無分配型)ユーロ建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|-----------|----------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 614,456 | 247,739 |
| 2016年12月末日 | (0) | (535,000) | (65,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

6. グローバル・アクセス ジャパン・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|-----------|-------------|-------------|
| 2016年1月1日～ | 140,000 | 2,290,000 | 4,900,000 |
| 2016年12月末日 | (140,000) | (2,290,000) | (4,900,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

7. グローバル・アクセス パシフィック・リム(除く日本)・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|-----------|----------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 140,000 | 55,000 |
| 2016年12月末日 | (0) | (140,000) | (55,000) |

(注)()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

8. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|-----------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 1,280,220 | 890,071 | 4,422,509 |
| 2016年12月末日 | (500,000) | (170,000) | (910,000) |

(注)()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

9. グローバル・アクセス グローバル・プロパティ・セキュリティーズ・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 290,000 | 160,000 |
| 2016年12月末日 | (0) | (290,000) | (160,000) |

(注)()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

10. グローバル・アクセス グローバル株式ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 1,208,096 | 2,533,630 |
| 2016年12月末日 | (0) | (365,000) | (695,000) |

(注)()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

11. グローバル・アクセス グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建
当該ファンド証券は2016年12月末日現在、運用の実績がないため、該当なし

12. グローバル・アクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|----------|---------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 20,000 | 340,004 | 1,501,088 |
| 2016年12月末日 | (20,000) | (0) | (970,000) |

(注)()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

13. グローバル・アクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|-----------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 478,904 | 3,379,377 | 3,392,380 |
| 2016年12月末日 | (170,000) | (0) | (170,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

14. グローバル・アクセス グローバル・インフレーション・リンク・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|---------|-------------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 713,800 | 1,220,000 | 1,737,912 |
| 2016年12月末日 | (0) | (1,220,000) | (220,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

15. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・デット・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|---------|-----------|---------|
| 2016年1月1日～ | 333,518 | 1,967,037 | 724,679 |
| 2016年12月末日 | (0) | (0) | (0) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

16. グローバル・アクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|------|------|-------------|
| 2016年1月1日～ | 0 | 0 | 2,732,719 |
| 2016年12月末日 | (0) | (0) | (1,160,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

17. グローバル・アクセス グローバル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスB(無分配型)米ドル建

| | 販売株数 | 買戻株数 | 発行済株数 |
|------------|-----------|-----------|-----------|
| 2016年1月1日～ | 470,000 | 900,000 | 646,380 |
| 2016年12月末日 | (470,000) | (900,000) | (590,000) |

(注) ()内の数は、本邦内における販売、買戻しおよび発行済株数である。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

(注) 下線部は訂正部分を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 外国投資法人の概況

(2) 外国投資法人の目的及び基本的性格

<訂正前>

a. 外国投資法人の目的および基本的性格

(前略)

| 定款 | | |
|--|---|----------------------------|
| 当初公告 | 2004年8月26日 | 本投資法人のアイランドの登記上の住所地で提出された。 |
| 修正 | 2005年8月9日 2005年11月9日 2006年11月30日 2007年10月22日 2008年10月23日 2011年11月22日 2012年11月22日 2013年12月9日 2014年11月25日 2015年12月4日 | 本投資法人の特別決議で採択された。 |
| 投資運用会社および マネジメント・サポート・ サービス・プロバイダー | パークレイズ・バンク・ピーエルシー (Barclays Bank PLC) | |

(後略)

<訂正後>

a. 外国投資法人の目的および基本的性格

(前略)

| 定款 | | |
|------|------------|----------------------------|
| 当初公告 | 2004年8月26日 | 本投資法人のアイランドの登記上の住所地で提出された。 |

| | | |
|--|--|-------------------|
| 修正 | 2005年8月9日 2005年11月9日 2006年11月30日 2007年10月22日 2008年10月23日 2011年11月22日 2012年11月22日 2013年12月9日 2014年11月25日 2015年12月4日 2016年11月30日 | 本投資法人の特別決議で採択された。 |
| 投資運用会社および マネジメント・サポート・ サービス・プロバイダー | パークレイズ・バンク・ピーエルシー (Barclays Bank PLC) | |

(後略)

第三部 外国投資法人の詳細情報

第1 外国投資法人の追加情報

1 外国投資法人の沿革

<訂正前>

| | |
|-------------|----------------|
| 2004年8月26日 | 本投資法人の設立 |
| 2005年8月9日 | 基本定款および通常定款の修正 |
| 2006年11月30日 | 同上 |
| 2007年10月22日 | 同上 |
| 2008年11月22日 | 同上 |
| 2011年11月22日 | 同上 |
| 2012年11月22日 | 同上 |
| 2013年12月9日 | 同上 |
| 2014年11月25日 | 同上 |
| 2015年12月4日 | 同上 |

<訂正後>

| | |
|--------------------|----------------|
| 2004年8月26日 | 本投資法人の設立 |
| 2005年8月9日 | 基本定款および通常定款の修正 |
| 2006年11月30日 | 同上 |
| 2007年10月22日 | 同上 |
| 2008年11月22日 | 同上 |
| 2011年11月22日 | 同上 |
| 2012年11月22日 | 同上 |
| 2013年12月9日 | 同上 |
| 2014年11月25日 | 同上 |
| 2015年12月4日 | 同上 |
| <u>2016年11月30日</u> | <u>同上</u> |

