

【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28年6月16日

【発行者名】 UBSアセット・マネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 三木 桂一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区大手町一丁目5番1号
大手町ファースト スクエア

【事務連絡者氏名】 山木 龍太郎

【電話番号】 03-5293-3693

【届出の対象とした募集（売
出）内国投資信託受益証券に係
るファンドの名称】 UBSグローバル・アロケーション Cコース（年4回決算
型・円ヘッジコース） / Dコース（年4回決算型・ユーロ
コース）

【届出の対象とした募集（売
出）内国投資信託受益証券の金
額】 UBSグローバル・アロケーション Cコース（年4回決算
型・円ヘッジコース）
当初申込期間：上限 1億円
継続申込期間：上限 3,000億円

UBSグローバル・アロケーション Dコース（年4回決算
型・ユーロコース）
当初申込期間：上限 1億円
継続申込期間：上限 3,000億円

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年9月18日付をもって提出した有価証券届出書(平成27年12月1日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。)の記載事項のうち、有価証券報告書の提出に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正箇所および訂正事項】

下線部分_____は本訂正届出書の訂正箇所を示します。

第一部【証券情報】

(3)【発行(売出)価額の総額】

<訂正前>

当初申込期間：各ファンド1億円を上限とします。

継続申込期間：各ファンド3,000億円を上限とします。

当初申込期間中は、委託会社または委託会社の関係会社による申込のみ受け付けます。

なお、上記金額には申込手数料(当該手数料に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。))に相当する額を含みます。以下同じ。)は含まれません。

<訂正後>

各ファンド3,000億円を上限とします。

なお、上記金額には申込手数料(当該手数料に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。))に相当する額を含みます。以下同じ。)は含まれません。

(4)【発行(売出)価格】

<訂正前>

当初申込期間：1口当たり1円

継続申込期間：買付申込受付日の翌々営業日の基準価額

(以下略)

<訂正後>

買付申込受付日の翌々営業日の基準価額(当初元本1口=1円)

(以下略)

(5)【申込手数料】

<訂正前>

当初申込については1口当たり1円に、継続申込については買付申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%(税抜3.0%)以内で販売会社が定める率を乗じて得た額とします。

(以下略)

<訂正後>

買付申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%(税抜3.0%)以内で販売会社が定める率を乗じて得た額とします。

(以下略)

(6)【申込単位】

< 訂正前 >

販売会社が独自に定める単位とします。（当初元本1口＝1円）
（以下略）

< 訂正後 >

販売会社が独自に定める単位とします。
（以下略）

(7) 【申込期間】

< 訂正前 >

当初申込期間：平成27年10月8日
継続申込期間：平成27年10月9日から平成28年12月19日まで

当初申込期間中は、委託会社または委託会社の関係会社による申込のみ受け付けます。
ただし、継続申込期間中は、申込日がロンドン証券取引所もしくはニューヨーク証券取引所の休業日またはロンドン、ニューヨークもしくはルクセンブルグの銀行の休業日と同日の場合には、買付申込の受付は行いません。
なお、継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

< 訂正後 >

平成27年10月9日から平成28年12月19日まで

申込日がロンドン証券取引所もしくはニューヨーク証券取引所の休業日またはロンドン、ニューヨークもしくはルクセンブルグの銀行の休業日と同日の場合には、買付申込の受付は行いません。
なお、申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(9) 【払込期日】

< 訂正前 >

当初申込期間
買付申込者は、当初申込期間中に申込代金を販売会社にお支払いください。当初申込に係る発行価額の総額は、販売会社によって、当初設定日（平成27年10月9日）に、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座に振り込まれます。

継続申込期間

買付申込者は、販売会社の指定する期日までに申込代金をお申込の販売会社にお支払いください。各買付申込受付日の発行価額の総額は、各追加信託を行う日に、販売会社より、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座に振り込まれます。

< 訂正後 >

買付申込者は、販売会社の指定する期日までに申込代金をお申込の販売会社にお支払いください。各買付申込受付日の発行価額の総額は、各追加信託を行う日に、販売会社より、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座に振り込まれます。

(12) 【その他】

< 訂正前 >

（前略）

お申込は、原則として販売会社の営業日の午後3時まで（当初申込期間中においては、販売会社の指定する時間まで）に受付たお申込を当日の受付分とします。ただし、継続申込期間中は、申込日が

ロンドン証券取引所もしくはニューヨーク証券取引所の休業日またはロンドン、ニューヨークもしくはルクセンブルグの銀行の休業日と同日の場合には、申込の受付けを行いません。受付時間を過ぎてからの申込は翌営業日(上記のお申込の受付けを行わない日を除きます。)扱いとなります

(後略)

<訂正後>

(前略)

お申込は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに受付けたお申込を当日の受付分とします。ただし、申込日がロンドン証券取引所もしくはニューヨーク証券取引所の休業日またはロンドン、ニューヨークもしくはルクセンブルグの銀行の休業日と同日の場合には、申込の受付けを行いません。受付時間を過ぎてからの申込は翌営業日(上記のお申込の受付けを行わない日を除きます。)扱いとなります

(後略)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

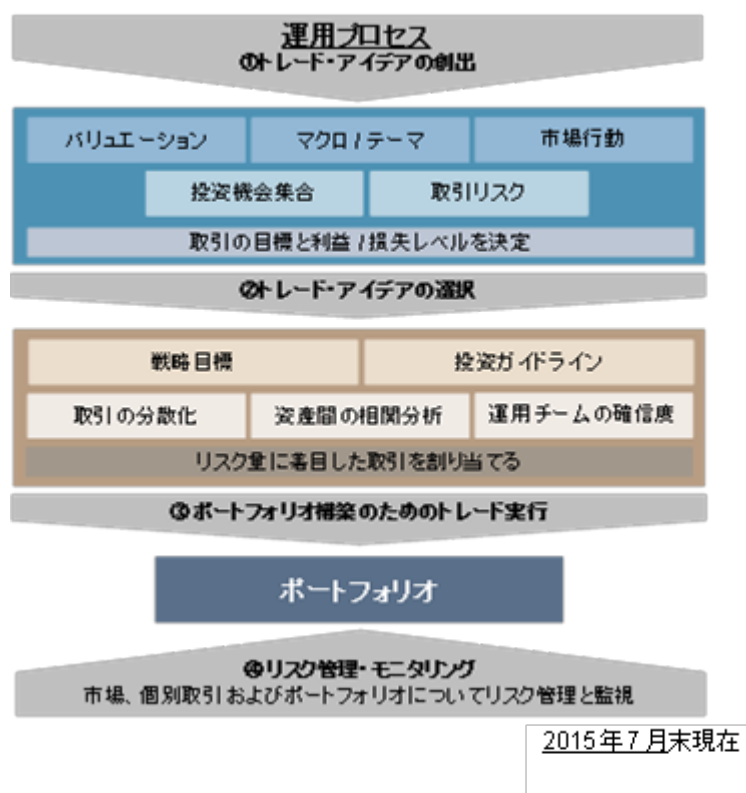
<訂正前>

(前略)

ファンドの特色

(前略)

運用プロセス



(中略)

主な投資制限

(中略)

<p>一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率</p>	<p>原則として、それぞれ純資産総額の10%、合計で20%以内とします。</p>
--	--

(中略)

分配方針

毎決算時（毎年3月、6月、9月および12月の17日。休業日の場合には翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

(中略)

第1期決算日は2015年12月17日です。

(以下略)

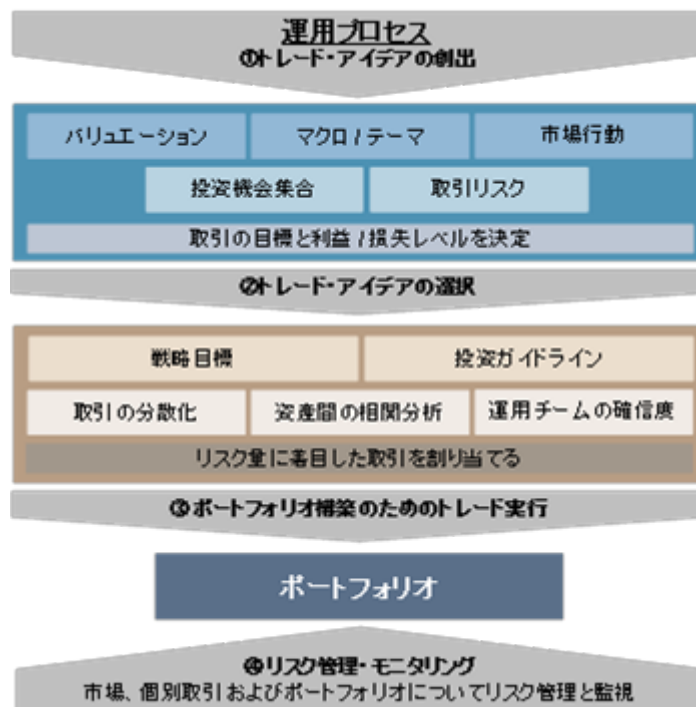
<訂正後>

(前略)

ファンドの特色

(前略)

運用プロセス



2016年3月末現在

(中略)

主な投資制限

(中略)

一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率

原則として、それぞれ信託財産の純資産総額の10%、合計で20%以内とします。

(中略)

分配方針

毎決算時（毎年3月、6月、9月および12月の17日。休業日の場合には翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

(中略)

(削除)

(以下略)

(2) 【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

平成27年10月9日 信託契約締結、設定日、運用開始（予定）

< 訂正後 >

平成27年10月9日 信託契約締結、設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

委託会社の概況（平成27年12月1日現在）

(前略)

3) 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
ユービーエス・ エイ・ジー	スイス国 バーゼル市 CH-4051 エーシェンフォルシュタット 1 スイス国 チューリッヒ市 CH-8001 バーンホフストラッセ 45	21,600株	100.00%

< 訂正後 >

委託会社の概況（平成28年5月13日現在）

(前略)

3) 大株主の状況

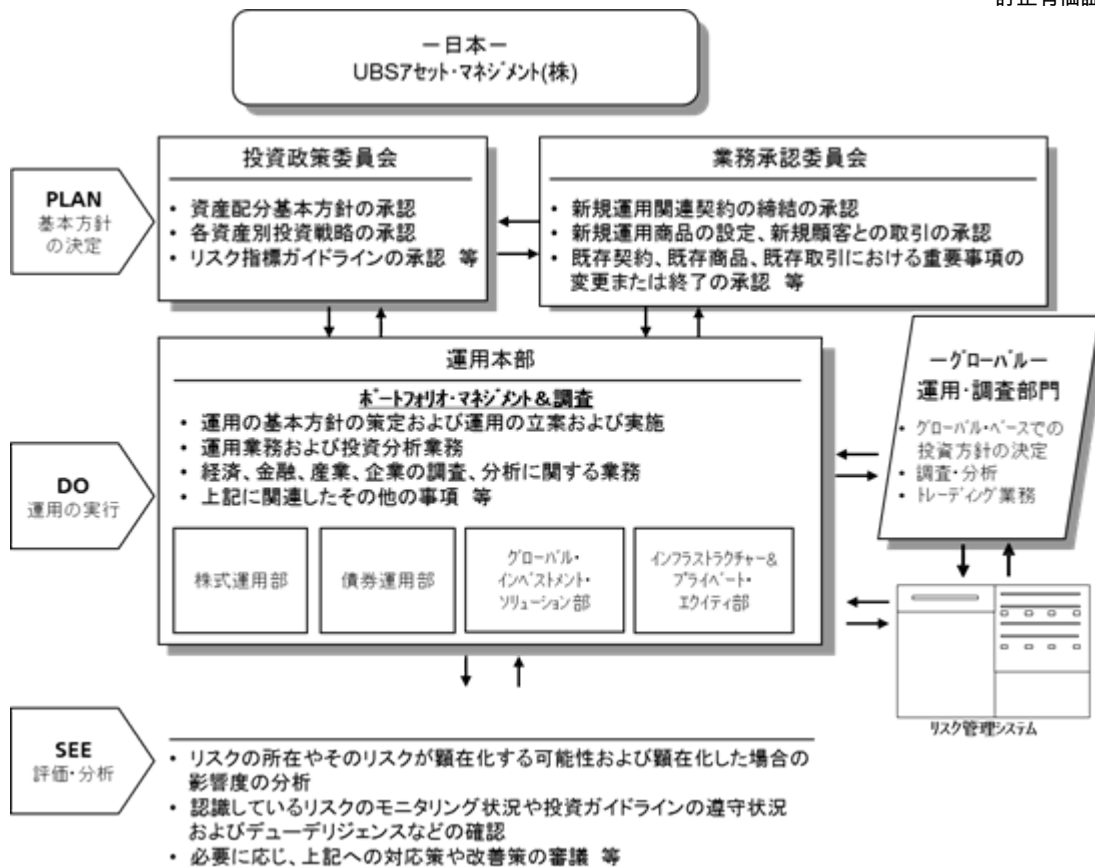
株主名	住所	持株数	持株比率
UBSアセット・マネジ メント・エイ・ジ	スイス国 チューリッヒ市 CH-8001 バーンホフストラッセ 45	21,600株	100.00%

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

< UBSアセット・マネジメント株式会社の運用体制 >



（平成27年7月末日現在）

上記の体制は今後変更される場合があります。

<運用体制に関する社内規則等およびファンドに係る法人等の管理>

ファンドの運用に関しましては、当社の運用本部（15～20名程度）は、運用に関する社内規則を遵守することが求められております。当該社内規則におきましては、運用者の適正な行動基準および禁止行為が規定されており、法令遵守、顧客の保護、最良執行・公平性の確保等が規定されています。実際の取引においては、取引を行う第一種金融商品取引業者の承認基準、利害関係人との取引・ファンド間売買等の種々の社内規程を設けて、利益相反となる取引、インサイダー取引等の防止措置を講じております。当社では、受託会社または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を受託会社より受取っております。

<内部管理およびファンドに係る意思決定を監督する組織>

投資政策委員会：

投資政策および運用の基本方針、運用戦略等の決定機関として投資政策委員会を経営委員会直属の機関として設置しております。投資政策委員会は、原則として議長である運用本部長が毎月および必要に応じて招集し、その議事運営には、運用本部長の他、運用本部を構成する各部のうち、投資判断を行う部の部長またはその代理の5～10名程度が構成員として参加しております。なお、議長の承認により構成員以外の者を参考人として出席させることができます。

業務承認委員会：

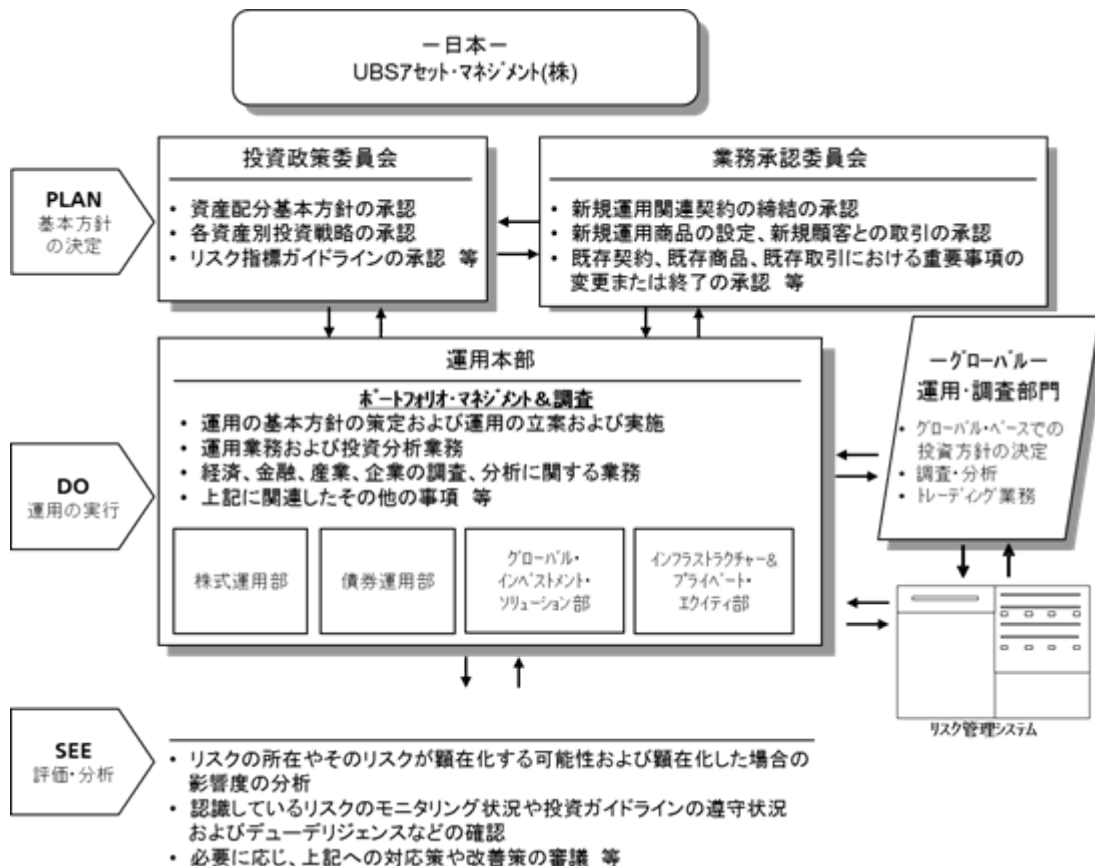
商品性、収益性、リスク管理等の観点から、新規運用関連契約の締結、新規運用商品の設定、新規顧客との取引、既存契約および既存商品ならびに既存取引における重要事項の変更ないし終了等を包括的にレビューし、承認する機関として、経営委員会直属である業務承認委員会を設置しております。業務承認委員会は、原則として案件の申請者または議長である商品本部長が招集し、その議事運営には、社長、チーフ・アドミニストレイティブ・オフィサー、審議案件に關与する機関投資家営業本部長または投信営業本部長、運用本部長、管理本部長、商品本部長、リーガル&コンプライアンス部長、リスク管理部長、経理部長等、またはその代理の8～10名程度が構成員として参加しております。なお、議長の承認により構成員以外の者を参考人として出席させることができます。

リスク委員会：

業務の執行にあたって、経営上ならびに業務上のリスクの分析、モニタリングおよび管理状況の確認などの総合的な評価および検討を行い、必要に応じて改善策等を講じるための機関であり、また、業務上のリスクの所在やそのリスクが顕在化する可能性および顕在化した場合の影響度を分析し、認識しているリスクのモニタリング状況や投資ガイドラインの遵守状況およびデューデリジェンスなどの確認を行い、必要に応じて対応策や改善策などを決議する機関として、経営委員会直属であるリスク委員会を設置しております。リスク委員会は、原則としてチーフ・アドミニストレイティブ・オフィサーまたはリスク管理部長が毎月および必要に応じて招集し、その議事運営には、社長、チーフ・アドミニストレイティブ・オフィサー、リスク管理部長、リーガル&コンプライアンス部長、運用本部長、機関投資家営業本部長、投信営業本部長、商品本部長、管理本部長、経理部長等の10名程度の構成員が参加しております。なお、議長の承認により構成員以外の者を参考人として出席させることができます。

< 訂正後 >

< UBSアセット・マネジメント株式会社の運用体制 >



（平成28年3月末現在）

上記の体制は今後変更される場合があります。

< 運用体制に関する社内規則等およびファンドに関する法人等の管理 >

ファンドの運用に関しましては、当社の運用本部（15～20名程度）は、運用に関する社内規則を遵守することが求められております。当該社内規則におきましては、運用者の適正な行動基準および禁止行為が規定されており、法令遵守、顧客の保護、最良執行・公平性の確保等が規定されています。実際の取引においては、取引を行う第一種金融商品取引業者の承認基準、利害関係人との取引・ファンド間売買等の種々の社内規程を設けて、利益相反となる取引、インサイダー取引等の防止措置を講じております。当社では、受託会社または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を受託会社より受取っております。

< 内部管理およびファンドに係る意思決定を監督する組織 >

投資政策委員会：

投資政策および運用の基本方針、運用戦略等の決定機関として投資政策委員会を経営委員会直属の機関として設置しております。投資政策委員会は、原則として議長である運用本部長が毎月および必要に応じて招集し、その議事運営には、運用本部長の他、運用本部を構成する各部のうち、投資判断を行う部の部長またはその代理の5～10名程度が構成員として参加しております。なお、議長の承認により構成員以外の者を参考人として出席させることができます。

業務承認委員会：

商品性、収益性、リスク管理等の観点から、新規運用関連契約の締結、新規運用商品の設定、新規顧客との取引、既存契約および既存商品ならびに既存取引における重要事項の変更ないし終了等を包括的にレビューし、承認する機関として、経営委員会直属である業務承認委員会を設置しております。業務承認委員会は、原則として案件の申請者または議長である商品本部長が招集し、その議事運営には、社長、チーフ・アドミニストレイティブ・オフィサー、審議案件に関する機関投資家営業本部長または投信営業本部長、運用本部長、管理本部長、商品本部長、コンプライアンス&オペレーショナル・リスク・コント

ロール部長、法務部長、リスク管理部長、経理部長等、またはその代理の10名程度が構成員として参加しております。なお、議長の承認により構成員以外の者を参考人として出席させることができます。

リスク委員会：

業務の執行にあたって、経営上ならびに業務上のリスクの分析、モニタリングおよび管理状況の確認などの総合的な評価および検討を行い、必要に応じて改善策等を講じるための機関であり、また、業務上のリスクの所在やそのリスクが顕在化する可能性および顕在化した場合の影響度を分析し、認識しているリスクのモニタリング状況や投資ガイドラインの遵守状況およびデューデリジェンスなどの確認を行い、必要に応じて対応策や改善策などを決議する機関として、経営委員会直属であるリスク委員会を設置しております。リスク委員会は、原則としてチーフ・アドミニストレイティブ・オフィサーまたはリスク管理部長が毎月および必要に応じて招集し、その議事運営には、社長、チーフ・アドミニストレイティブ・オフィサー、リスク管理部長、コンプライアンス&オペレーショナル・リスク・コントロール部長、法務部長、運用本部長、機関投資家営業本部長、投信営業本部長、商品本部長、管理本部長、経理部長、テクノロジー部長の12名程度の構成員が参加しております。なお、議長の承認により構成員以外の者を参考人として出席させることができます。

3【投資リスク】

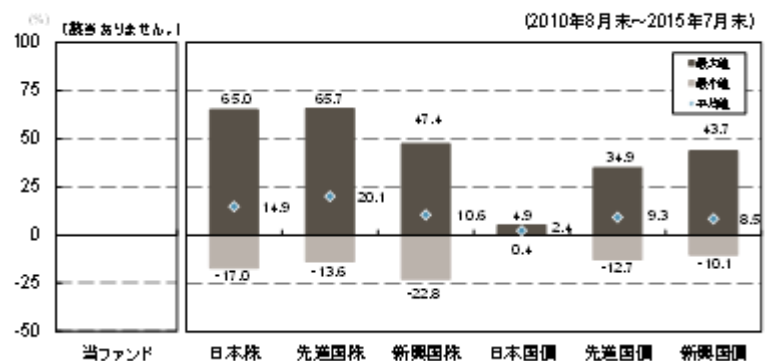
<訂正前>
(前略)

【円ヘッジコース】

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

該当事項はありません。

当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

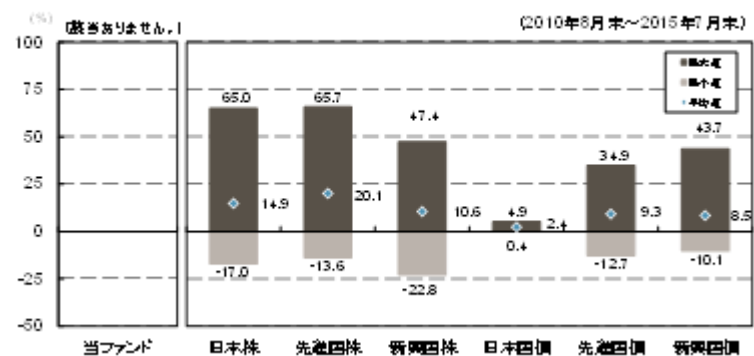


【ユーロコース】

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

該当事項はありません。

当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



「当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移」における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、当ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すことを目的としています。したがって、当ファンドが収益分配を行っている場合には、実際の基準価額の年間騰落率や基準価額の推移とは異なります。なお、当ファンドについては2015年10月9日から運用を開始する予定のため、2015年9月18日現在において記載すべき事項はありません。

「当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、2010年8月から2015年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示したものです。なお、当ファンドについては2015年10月9日から運用を開始する予定のため、2015年9月18日現在において記載すべき事項はありません。

(注1) 各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。

各資産クラスの指数

- 日本株 : 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株 : MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)
- 新興国株 : MSCIEマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)
- 日本国債 : シティ日本国債インデックス
- 先進国債 : シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)
- 新興国債 : JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円換算ベース)

(注1) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

(注2) 詳細は下記の「指数に関して」をご覧ください。

指数に関して

・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株)東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標又は標章に関するすべての権利は (株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は (株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、本件商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- ・MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)
- ・MSCIEマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)

MSCIインデックスに関する著作権、およびその他知的財産権はMSCI Inc.に帰属しております。MSCI Inc.が指数構成銘柄への投資を推奨するものではなく、MSCI Inc.は当指数の利用に伴う如何なる責任も負いません。MSCI Inc.は情報の確実性および完結性を保証するものではなく、MSCI Inc.の許諾なしにデータを複製・頒布・使用等することは禁じられております。

・シティ日本国債インデックス

・シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

シティ債券インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスです。騰落率の数字は、シティ日本国債インデックス・データおよびシティ世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

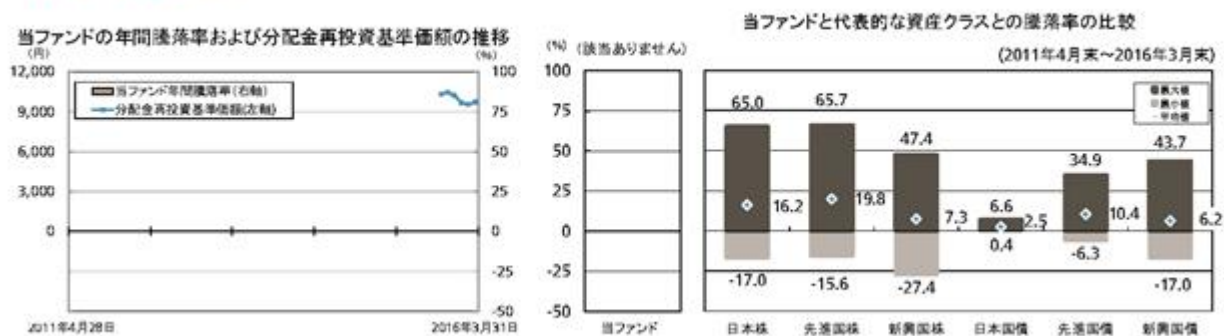
・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JP.Morgan Securities LLCが算出し公表している指数です。当指数の著作権はJP.Morgan Securities LLCに帰属します。

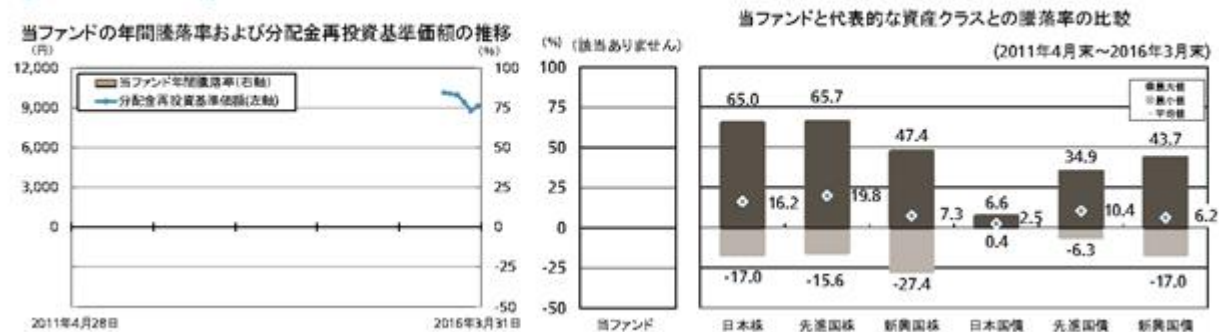
<訂正後>

(前略)

[円ヘッジコース]



[ユーロコース]



「当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移」における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、当ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すことを目的としています。したがって、当ファンドが収益分配を行っている場合には、実際の基準価額の年間騰落率や基準価額の推移とは異なります。なお、当ファンドの年間騰落率については、2016年3月末時点において当ファンドが設定から1年経過していないため、記載しておりません。

「当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、2011年4月から2016年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率については、2016年3月末時点において当ファンドが設定から1年経過していないため、記載しておりません。

(注1) 各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。

(注2) グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成するものですが、2016年3月末時点において当ファンドは設定から1年経過していないため、代表的な資産クラスと比較できるデータがありません。

各資産クラスの指数

日本株 : 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株 : MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)

新興国株 : MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)

日本国債 : シティ日本国債インデックス

先進国債 : シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)

新興国債 : JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円換算ベース)

(注1) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

(注2) 詳細は下記の「指数に関して」をご覧ください。

指数に関して

- ・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（（株）東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数(TOPIX)の商標又は標章に関するすべての権利は（株）東京証券取引所が有しています。なお、本商品は（株）東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、（株）東京証券取引所は、本件商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- ・MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCIインデックスに関する著作権、およびその他知的財産権はMSCI Inc.に帰属しております。MSCI Inc.が指数構成銘柄への投資を推奨するものではなく、MSCI Inc.は当指数の利用に伴う如何なる責任も負いません。MSCI Inc.は情報の確実性および完結性を保証するものではなく、MSCI Inc.の許諾なしにデータを複製・頒布・使用等することは禁じられております。

- ・シティ日本国債インデックス

- ・シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

シティ債券インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスです。騰落率の数字は、シティ日本国債インデックス・データおよびシティ世界国債インデックス・データに基づき当社が計算したものです。

- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディパーシファイド（円換算ベース）

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディパーシファイドは、JP.Morgan Securities LLCが算出し公表している指数です。当指数の著作権はJP.Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

<訂正前>

当初申込については1口当たり1円に、継続買付申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）以内で販売会社が定める率を乗じて得た額とします。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続きの対価です。

詳しくは、販売会社または下記までお問い合わせください。

委託会社のホームページ <http://www.ubs.com/japanfunds/>

委託会社の電話番号 03-5293-3700（営業日の9：00～17：00）

<訂正後>

買付申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）以内で販売会社が定める率を乗じて得た額とします。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続きの対価です。

詳しくは、販売会社または下記までお問い合わせください。

委託会社のホームページ <http://www.ubs.com/japanfunds/>

委託会社の電話番号 03-5293-3700（営業日の9：00～17：00）

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

個人の受益者に対する課税

（前略）

<損益通算>

一部解約時および償還時の損益については、確定申告により上場株式等の譲渡損益および申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

<平成28年1月1日以降の損益通算>

平成28年1月1日以降は上記に加え、特定公社債等（注）の譲渡損益および特定公社債等の利子所得も損益通算の対象とすることが可能となります。

（注）「特定公社債等」とは、国債、地方債、外国国債、外国地方債、公募公社債、上場公社債、平成27年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）や公募公社債投資信託などをいいます。

<少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合>

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円^{（注1）}の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上^{（注2）}の方で、販売会社で非課税口座（以下「NISA口座」ということがあります。）を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

なお、NISA口座で公募株式投資信託を購入した場合の分配金の取扱いについては、下記の点にご留意ください。

- ・ NISA口座での投資額が年間100万円^{（注1）}以下の元本から支払われる公募株式投資信託の分配金については非課税となります。また、公募株式投資信託の分配金のうち元本払戻金（特別分配金）に相当する額については、特定口座や一般口座など他の課税口座で管理されても非課税となります。
- ・ 公募株式投資信託の分配金がNISA口座内で再投資される場合、当該再投資額は当初投資元本に加え非課税投資枠に加算されますので、同一元本から発生する分配金再投資であっても、これらの合計額が年間100万円^{（注1）}を超える非課税投資枠の利用はできません。

（注1）平成28年分以降の年間限度額は、120万円となります。

（注2）20歳未満の方の未成年者口座であっても、所定の手続きを経て非課税管理勘定を開設した場合には、平成28年4月1日以降に新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当等所得および譲渡所得について、毎年、年間80万円の非課税投資枠の適用を5年間受けることができます（「ジュニアNISA」）。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(中略)

< 参考情報 >

ファンドの費用・税金

[ファンドの費用]

・投資者が直接的に負担する費用

時期	項目	費用
購入時	購入時手数料	購入申込受付日の翌々営業日の基準価額(当初申込期間においては1口当たり1円)に、 3.24%(税抜 3.00%)以内 で販売会社が定める率を乗じて得た額を、販売会社が定める方法により支払うものとします。 購入時手数料は、商品および関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続きの対価です。
換金時	信託財産留保額	ありません。

・投資者が信託財産で間接的に負担する費用

時期	項目	費用									
保有時	運用管理費用 (信託報酬)	当ファンド 日々の純資産総額に 年率1.9224%(税抜年率1.78%) を乗じて得た額とします。 (運用管理費用(信託報酬) = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率) 配分は以下の通りです。(税抜、年率表示) <table border="1"> <tr> <td>委託会社</td> <td>0.90%</td> <td>委託した資金の運用の対価</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>0.85%</td> <td>購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>0.03%</td> <td>運用財産の管理、運用指図実行等の対価</td> </tr> </table> 運用管理費用(信託報酬)は毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。	委託会社	0.90%	委託した資金の運用の対価	販売会社	0.85%	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価	受託会社	0.03%	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
委託会社	0.90%	委託した資金の運用の対価									
販売会社	0.85%	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価									
受託会社	0.03%	運用財産の管理、運用指図実行等の対価									
	マザーファンドが投資対象とする投資信託証券	当ファンドの純資産総額に対して年率0.065%程度 (委託会社が試算した概算値)									
	実質的な負担	当ファンドの純資産総額に対して 年率1.9874%程度									
	その他の費用・手数料	諸費用(日々の純資産総額に対して上限年率0.1%)として、原則毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われる主な費用 <table border="1"> <tr> <td>監査費用</td> <td>監査法人等に支払うファンド監査に係る費用</td> </tr> <tr> <td>印刷費用等</td> <td>法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用(EDINET含む)等</td> </tr> </table> 実費として、原則発生都度ファンドから支払われる主な費用 <table border="1"> <tr> <td>売買委託手数料</td> <td>有価証券等を取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料</td> </tr> <tr> <td>保管費用</td> <td>海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用</td> </tr> </table> 信託財産の規模、取引量等により変動しますので、事前に金額および計算方法を表示することができません。	監査費用	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用	印刷費用等	法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用(EDINET含む)等	売買委託手数料	有価証券等を取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料	保管費用	海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用	
監査費用	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用										
印刷費用等	法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用(EDINET含む)等										
売買委託手数料	有価証券等を取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料										
保管費用	海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用										

投資者の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することはできません。

[税金]

税金は表に記載の時期に適用されます。

以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

上記は平成27年7月末現在のものです。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円（注1）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上（注2）の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（注1）平成28年分以降の年間限度額は、120万円となります。

（注2）20歳未満の方の未成年者口座であっても、所定の手続きを経て非課税管理勘定を開設した場合には、平成28年4月1日以降に新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当等所得および譲渡所得について、毎年、年間80万円の非課税投資枠の適用を5年間受けることができます（「ジュニアNISA」）。

法人の場合は上記と異なります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

個人の受益者に対する課税

（前略）

<損益通算>

一部解約時および償還時の損益については、確定申告により上場株式等および特定公社債等の譲渡損益ならびに申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得および特定公社債等の利子所得との損益通算が可能です。

<少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合>

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上（注）の方で、販売会社で非課税口座（以下「NISA口座」ということがあります。）を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

なお、NISA口座で公募株式投資信託を購入した場合の分配金の取扱いについては、下記の点にご留意ください。

- ・ NISA口座での投資額が年間120万円以下の元本から支払われる公募株式投資信託の分配金については非課税となります。また、公募株式投資信託の分配金のうち元本払戻金（特別分配金）に相当する額については、特定口座や一般口座など他の課税口座で管理されても非課税となります。
- ・ 公募株式投資信託の分配金がNISA口座内で再投資される場合、当該再投資額は当初投資元本に加え非課税投資枠に加算されますので、同一元本から発生する分配金再投資であっても、これらの合計額が年間120万円を超える非課税投資枠の利用はできません。

（注）20歳未満の方の未成年者口座であっても、所定の手続きを経て非課税管理勘定を開設した場合には、年間80万円の非課税投資枠（「ジュニアNISA」）の適用を受けることができます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

< 参考情報 >

ファンドの費用・税金

[ファンドの費用]

・投資者が直接的に負担する費用

時期	項目	費用
購入時	購入時手数料	購入申込受付日の翌々営業日の基準価額に、 3.24% (税抜 3.00%) 以内 で販売会社が定める率を乗じて得た額を、販売会社が定める方法により支払うものとします。 購入時手数料は、商品および関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続きの対価です。
換金時	信託財産留保額	ありません。

・投資者が信託財産で間接的に負担する費用

時期	項目	費用	
保有時	運用管理費用 (信託報酬)	当ファンド	日々の純資産総額に 年率1.9224% (税抜年率1.78%) を乗じて得た額とします。 (運用管理費用(信託報酬) = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率) 配分は以下の通りです。(税抜、年率表示)
		委託会社	0.90% 委託した資金の運用の対価
		販売会社	0.85% 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
		受託会社	0.03% 運用財産の管理、運用指図実行等の対価
		運用管理費用(信託報酬)は毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。	
	マザーファンドが投資対象とする投資信託証券	当ファンドの純資産総額に対して年率0.065%程度 (委託会社が試算した概算値)	
	実質的な負担	当ファンドの純資産総額に対して 年率1.9874%程度	
その他の費用・手数料	諸費用(日々の純資産総額に対して上限年率0.1%)として、原則毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われる主な費用		
	監査費用	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用	
	印刷費用等	法定開示書類作成の際に業者に支払う作成・印刷・交付等に係る費用(EDINET含む)等	
	実費として、原則発生の都度ファンドから支払われる主な費用		
	売買委託手数料	有価証券等を取引所で売買する際に売買仲介人に支払う手数料	
	保管費用	海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用	
	信託財産の規模、取引量等により変動しますので、事前に金額および計算方法を表示することができません。		

投資者の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することはできません。

[税金]

税金は表に記載の時期に適用されます。

以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

上記は平成28年3月末現在のものです。

少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(注)20歳未満の方の未成年者口座であっても、所定の手続きを経て非課税管理勘定を開設した場合には、年間80万円の非課税投資枠(「ジュニアNISA」)の適用を受けることができます。

法人の場合は上記と異なります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

原届出書「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」を以下の内容に更新いたします。

<更新後>

5【運用状況】

[UBSグローバル・アロケーション Cコース(年4回決算型・円ヘッジコース)]

(1)【投資状況】

(2016年3月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	999,530	101.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	13,999	1.42
合計(純資産総額)	-	985,531	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2016年3月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	UBSグローバル・アロケーシ ョン・マザーファンド 2015	1,084,678	0.9065	983,260	0.9215	999,530	101.42

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

種類別投資比率(2016年3月31日現在)

投資有価証券の種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	101.42
合計	101.42

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。(2016年3月31日現在)

【その他投資資産の主要なもの】

(2016年3月31日現在)

資産の種類	通貨	買建 / 売建	数量	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ユーロ	売建	7,400.00	935,952	944,980	95.89

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2016年3月31日および同日1年以内における各月末ならびに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1期特定期間末 (2016年3月17日)	0.979017	0.979017	0.9647	0.9647
2015年10月末日	1		1.0323	
2015年11月末日	1		1.0434	
2015年12月末日	1		1.0198	
2016年1月末日	0.974587		0.9651	
2016年2月末日	0.964554		0.9552	
2016年3月31日	0.985531		0.9711	

【分配の推移】

期間	1口当たりの分配金(円)
第1期特定期間	0.0000

【収益率の推移】

期間	収益率(%)
第1期特定期間	3.5

(注)「収益率」とは特定期間末の基準価額(当該特定期間中の分配金累計額を加算した額)から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」)を控除した額を前特定期間末基準価額で除して得た数値に100を乗じて得た数値です。

(4) 【設定及び解約の実績】

下記特定期間中の設定及び解約の実績は次の通りです。

期間	設定口数	解約口数
第1期特定期間	1,014,849	

(注1) 第1期特定期間の設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

(注2) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

[UBSグローバル・アロケーション Dコース(年4回決算型・ユーロコース)]

(1) 投資状況

(2016年3月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	91,228	99.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	186	0.20
合計(純資産総額)	-	91,414	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2016年3月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	UBSグローバル・アロケーシ ョン・マザーファンド 2015	99,000	0.9065	89,743	0.9215	91,228	99.80

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

種類別投資比率(2016年3月31日現在)

投資有価証券の種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.80
合計	99.80

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。(2016年3月31日現在)

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。(2016年3月31日現在)

2016年3月31日および同日1年以内における各月末ならびに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1期特定期間末 (2016年3月17日)	0.089989	0.089989	0.8999	0.8999
2015年10月末日	0.101438		1.0144	
2015年11月末日	0.100398		1.0040	
2015年12月末日	0.099386		0.9939	
2016年1月末日	0.094004		0.9400	
2016年2月末日	0.087545		0.8755	
2016年3月31日	0.091414		0.9141	

分配の推移

期間	1口当たりの分配金(円)
第1期特定期間	0.0000

収益率の推移

期間	収益率(%)
第1期特定期間	10.0

(注)「収益率」とは特定期間末の基準価額(当該特定期間中の分配金累計額を加算した額)から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」)を控除した額を前特定期間末基準価額で除して得た数値に100を乗じて得た数値です。

(4) 設定及び解約の実績

下記特定期間中の設定及び解約の実績は次の通りです。

期間	設定口数	解約口数
第1期特定期間	100,000	

(注1) 第1期特定期間の設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

(注2) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考) UBSグローバル・アロケーション・マザーファンド 2015

(1) 投資状況

(2016年3月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	9,998	0.45
投資証券	ルクセンブルク	2,121,250	96.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	70,910	3.22
合計(純資産総額)	-	2,202,158	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

主要銘柄の明細(2016年3月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
ルクセンブルク	投資証券	UBS(Lux)キー・セレクション・シ キャブ・グローバル・アロケーション (EUR) I-B-accクラス	149.853	14,486.73	2,170,881	14,155.53	2,121,250	96.33
日本	投資信託 受益証券	UBS短期円金利プラス・ファンド (適格機関投資家向け)	9,978	1.0022	10,000	1.0021	9,998	0.45

種類別投資比率(2016年3月31日現在)

投資有価証券の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.45
投資証券	96.33
合計	96.78

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。(2016年3月31日現在)

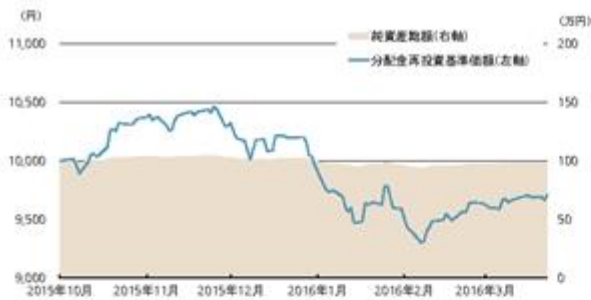
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。(2016年3月31日現在)

< 参考情報 >

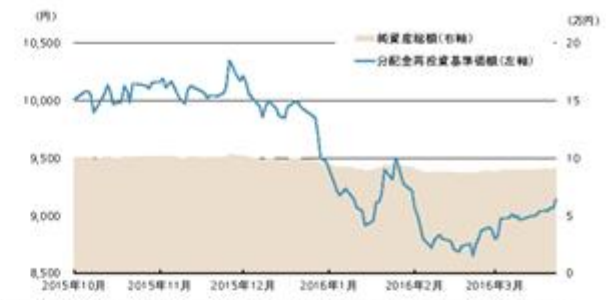
基準価額・純資産の推移 (2016年3月31日現在)

円ヘッジコース



※分配金再投資基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後で、収益分配が行われた場合には税引前の分配金を再投資したものととして算出。

ユーロコース

**分配の推移** (1万口当たり、税引前)

円ヘッジコース

2015年12月	0円
2016年3月	0円
設定来累計	0円

ユーロコース

2015年12月	0円
2016年3月	0円
設定来累計	0円

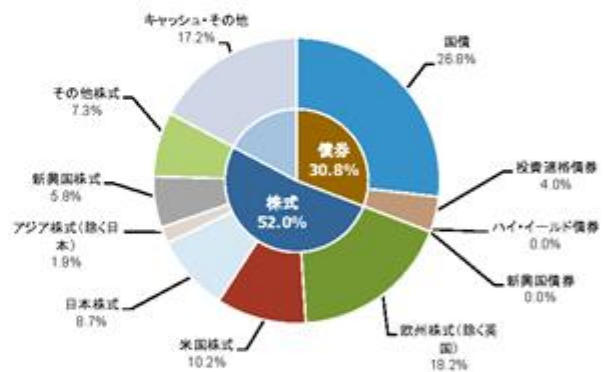
主要な資産の状況 (2016年3月31日現在)

組入上位銘柄

	銘柄名	国	投資比率
1	UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ・グロー バル・アロケーション (EUR) I-B-accクラス	ルクセンブルク	96.33%
2	UBS 短期円金利プラス・ファンド (適格機関投資家向け)	日本	0.45%

※投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に占める割合です。
※ファンドの純資産総額に対し、円ヘッジコースは 101.42%、ユーロコースは 99.80% マザーファンドを組入れています。

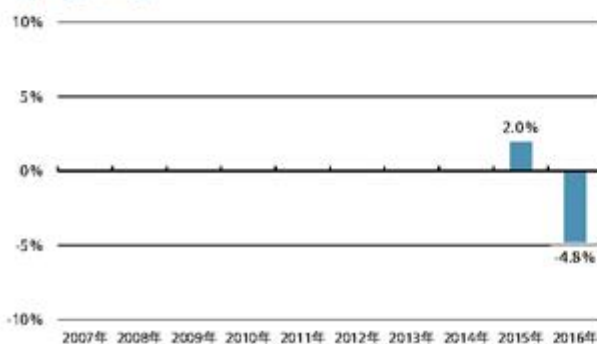
資産別比率



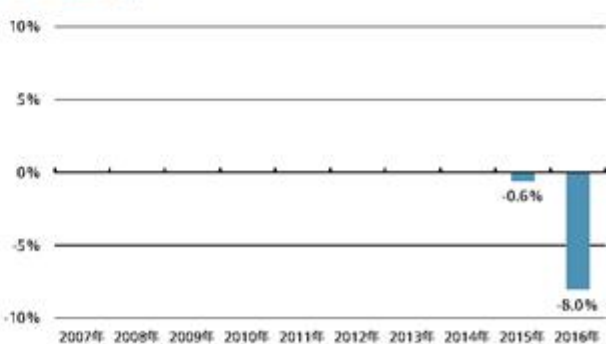
※資産別比率は、「UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ・グローバル・アロケーション (EUR)」の純資産総額に対する各資産への実投資割合です。

年間収益率の推移 (2016年3月31日現在)

円ヘッジコース



ユーロコース



※ 2015年については当初設定日(2015年10月9日)から年末まで、2016年は年初から3月末までの騰落率。
※ 税引前分配金を再投資したものととして算出。
※ ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（買付申込の受付け）

- ・ 当初申込期間中の購入の申込については、原則として、販売会社の指定する時間までに販売会社が受付けたものを申込受付分とします。
- ・ 継続申込期間中の購入の申込については、原則として、販売会社の営業日の午後3時までに、買付申込が行われ、かつ買付申込にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込分とします。
- ・ 「自動けいぞく投資コース」をご利用の場合、買付申込者は、販売会社と「自動けいぞく投資約款」に基づく分配金再投資に関する契約（同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を含みます。）を締結していただきます。

買付申込者は販売会社に買付申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該買付申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該買付申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該買付申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、当初設定および追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、当初設定については設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

（買付単位）

- ・ 販売会社が独自に定める単位とします。（当初元本1口＝1円）
「自動けいぞく投資コース」において収益分配金を再投資する場合には、1口単位とします。
詳しくは、販売会社または下記までお問い合わせください。
委託会社のホームページ <http://www.ubs.com/japanfunds/>
委託会社の電話番号 03-5293-3700（営業日の9：00～17：00）

（買付価額）

- ・ 当初申込期間：1口当たり1円
- ・ 継続申込期間：買付申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。
「自動けいぞく投資コース」において収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

（以下略）

<訂正後>

（買付申込の受付け）

- ・ 原則として、販売会社の営業日の午後3時までに、買付申込が行われ、かつ買付申込にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込分とします。
- ・ 「自動けいぞく投資コース」をご利用の場合、買付申込者は、販売会社と「自動けいぞく投資約款」に基づく分配金再投資に関する契約（同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を含みます。）を締結していただきます。

買付申込者は販売会社に買付申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該買付申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該買付申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該買付申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

（買付単位）

- ・ 販売会社が独自に定める単位とします。

「自動けいぞく投資コース」において収益分配金を再投資する場合には、1口単位とします。

詳しくは、販売会社または下記までお問い合わせください。

委託会社のホームページ <http://www.ubs.com/japanfunds/>

委託会社の電話番号 03-5293-3700（営業日の9：00～17：00）

（買付価額）

- ・ 買付申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

「自動けいぞく投資コース」において収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

（以下略）

3【資産管理等の概要】**(4)【計算期間】****<訂正前>**

原則として、3月18日から6月17日、6月18日から9月17日、9月18日から12月17日および12月18日から翌年3月17日までとします。ただし、計算期間終了日に該当する日が休業日の場合は翌営業日までとします。なお、第1期の計算期間は、信託契約締結日から平成27年12月17日までとします。

<訂正後>

原則として、3月18日から6月17日、6月18日から9月17日、9月18日から12月17日および12月18日から翌年3月17日までとします。ただし、計算期間終了日に該当する日が休業日の場合は翌営業日までとします。

原届出書「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」を以下の内容に更新いたします。

<更新後>

第3【ファンドの経理状況】

UBSグローバル・アロケーション Cコース(年4回決算型・円ヘッジコース)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款第30条により、平成27年10月9日から平成27年12月17日までとしており、当特定期間は第1期計算期間から第2期計算期間までをあわせて特定期間として報告しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成27年10月9日から平成28年3月17日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【UBSグローバル・アロケーション Cコース(年4回決算型・円ヘッジコース)】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	当期 平成28年 3月17日現在
	金額
資産の部	
流動資産	
預金	15,235
親投資信託受益証券	983,260
流動資産合計	998,495
資産合計	998,495
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,762
未払受託者報酬	91
未払委託者報酬	4,565
その他未払費用	60
流動負債合計	19,478
負債合計	19,478
純資産の部	
元本等	
元本	1,014,849
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	35,832
(分配準備積立金)	8,910
元本等合計	979,017
純資産合計	979,017
負債純資産合計	998,495

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当期	
	自 平成27年10月 9日	至 平成28年 3月17日
	金額	
営業収益		
有価証券売買等損益		92,240
為替差損益		65,180
営業収益合計		27,060
営業費用		
受託者報酬		160
委託者報酬		8,196
その他費用		98
営業費用合計		8,454
営業利益又は営業損失()		35,514
経常利益又は経常損失()		35,514
当期純利益又は当期純損失()		35,514
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		-
期首剰余金又は期首欠損金()		-
剰余金増加額又は欠損金減少額		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		318
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		318
分配金		-
期末剰余金又は期末欠損金()		35,832

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

親投資信託受益証券

移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

3. 収益及び費用の計上基準

為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

金融商品の時価に関する補足情報

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

項目	当期 平成28年 3月17日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数	1,014,849口
2. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は35,832円です。
3. 特定期間末日における1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9647円 (9,647円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期 自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
<p>分配金の計算過程</p> <p>(平成27年10月9日から平成27年12月17日までの計算期間) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(0円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(8,910円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より分配対象収益は、8,910円(1万口当たり89円)ですが、分配を行っておりません。 なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益および収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p> <p>(平成27年12月18日から平成28年3月17日までの計算期間) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(0円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(132円)、および分配準備積立金(8,910円)より分配対象収益は、9,042円(1万口当たり89円)ですが、分配を行っておりません。 なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益および収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託として、親投資信託受益証券等の金融商品を主要投資対象とし、信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき運用を行っております。</p>
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、親投資信託受益証券、為替予約取引、コール・ローン等の金銭債権および金銭債務です。また、当ファンドが親投資信託受益証券への投資を通じて保有する主な金融資産は、投資信託受益証券、投資証券です。これらは、金利変動リスク、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。なお、為替予約取引は、信託財産に属する有価証券、ならびに外貨建金銭債権債務の為替変動リスクを低減する目的で利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行については、投資対象、投資制限等を規定した運用ガイドラインに従って運用部門が執行します。</p> <p>管理部門は、運用ガイドラインに則って適切な運用がされているかおよび、運用結果の定期的な検証を通じて、下記に掲げる各種リスクが適切に管理されていることをモニタリングしています。</p> <p>また、それらの状況は定期的開催される各委員会に報告され、状況の把握・確認が行われるほか、適切な運営について検証が行われます。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場リスク <p>ファンドのパフォーマンスが一定の許容範囲内にあるかどうかモニタリングし、リターンの大きな変動を注視することで市場リスクが適切に管理されていることを確認しています。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・信用リスク、流動性リスク <p>運用ガイドラインに従って、証券格付や、証券や発行体への集中投資制限をモニタリングし、投資対象に関するこれらのリスクが適切に管理されていることを確認しています。</p> <p>また、取引先の信用リスクについては、グループポリシーで認められた相手に限定することで、これを管理しています。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成28年 3月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	<p>金融商品は原則として全て時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>

2. 金融商品時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、帳簿価額は時価と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	デリバティブ取引に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	当期 平成28年 3月17日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	89,229
合計	89,229

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

当期（平成28年 3月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売 建 ユーロ	921,190	-	935,952	14,762
	合計	921,190	-	935,952	14,762

(注1)時価の算定方法

為替予約の時価

1. 特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます。)の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。

特定期間末日において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は以下の方法によっております。

イ) 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後2つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

ロ) 特定期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。

2. 特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客電
信売買相場の仲値により評価しております。

(注2)デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期(自平成27年10月9日 至平成28年3月17日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	当期
	自平成27年10月9日 至平成28年3月17日
元本の推移	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	14,849円
期中一部解約元本額	-円

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	UBSグローバル・アロケーション・ マザーファンド 2015	1,084,678	983,260	
合計			983,260	

(注)親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

【UBSグローバル・アロケーション Dコース(年4回決算型・ユーロコース)】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款第30条により、平成27年10月9日から平成27年12月17日までとしており、当特定期間は第1期計算期間から第2期計算期間までをあわせて特定期間として報告しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成27年10月9日から平成28年3月17日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

UBSグローバル・アロケーション Dコース(年4回決算型・ユーロコース)

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	当期 平成28年 3月17日現在
	金額
資産の部	
流動資産	
預金	649
親投資信託受益証券	89,743
流動資産合計	90,392
資産合計	90,392
負債の部	
流動負債	
未払委託者報酬	403
流動負債合計	403
負債合計	403
純資産の部	
元本等	
元本	100,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	10,011
(分配準備積立金)	-
元本等合計	89,989
純資産合計	89,989
負債純資産合計	90,392

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当期
	自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
	金額
営業収益	
有価証券売買等損益	9,257
営業収益合計	9,257
営業費用	
委託者報酬	754
営業費用合計	754
営業利益又は営業損失()	10,011
経常利益又は経常損失()	10,011
当期純利益又は当期純損失()	10,011
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	-
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	10,011

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

親投資信託受益証券

移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

金融商品の時価に関する補足情報

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

項目	当期 平成28年 3月17日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数	100,000口
2. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は10,011円です。
3. 特定期間末日における1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8999円 (8,999円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期 自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
<p>分配金の計算過程</p> <p>(平成27年10月9日から平成27年12月17日までの計算期間) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(0円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より分配対象収益は、0円(1万口当たり0円)のため、分配を行っておりません。 なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益および収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p> <p>(平成27年12月18日から平成28年3月17日までの計算期間) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(0円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より分配対象収益は、0円(1万口当たり0円)のため、分配を行っておりません。 なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益および収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	当期 自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託として、親投資信託受益証券等の金融商品を主要投資対象とし、信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき運用を行っております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、親投資信託受益証券、コール・ローン等の金銭債権および金銭債務です。また、当ファンドが親投資信託受益証券への投資を通じて保有する主な金融資産は、投資信託受益証券、投資証券です。これらは、金利変動リスク、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行については、投資対象、投資制限等を規定した運用ガイドラインに従って運用部門が執行します。 管理部門は、運用ガイドラインに則って適切な運用がされているかおよび、運用結果の定期的な検証を通じて、下記に掲げる各種リスクが適切に管理されていることをモニタリングしています。 また、それらの状況は定期的開催される各委員会に報告され、状況の把握・確認が行われるほか、適切な運営について検証が行われます。 ・市場リスク ファンドのパフォーマンスが一定の許容範囲内にあるかどうかモニタリングし、リターンのおおきな変動を注視することで市場リスクが適切に管理されていることを確認しています。 ・信用リスク、流動性リスク 運用ガイドラインに従って、証券格付や、証券や発行体への集中投資制限をモニタリングし、投資対象に関するこれらのリスクが適切に管理されていることを確認しています。 また、取引先の信用リスクについては、グループポリシーで認められた相手に限定することで、これを管理しています。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成28年 3月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	金融商品は原則として全て時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。
2. 金融商品時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、帳簿価額は時価と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	当期 平成28年 3月17日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	8,969
合計	8,969

(デリバティブ取引等に関する注記)

当期(平成28年 3月17日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期(自平成27年10月 9日 至平成28年 3月17日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	当期 自平成27年10月 9日 至平成28年 3月17日
	元本の推移
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	UBSグローバル・アロケーション・ マザーファンド 2015	99,000	89,743	
合計			89,743	

(注)親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは「UBSグローバル・アロケーション・マザーファンド 2015」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は以下の通りです。

「UBSグローバル・アロケーション・マザーファンド 2015」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外です。

UBSグローバル・アロケーション・マザーファンド 2015

(1)貸借対照表

(単位：円)

	平成28年 3月17日現在
	金額
資産の部	
流動資産	
預金	197,359
投資信託受益証券	9,998
投資証券	2,085,492
流動資産合計	2,292,849
資産合計	2,292,849
負債の部	
流動負債	
未払金	126,449
流動負債合計	126,449
負債合計	126,449
純資産の部	
元本等	
元本	2,389,768
剰余金	
剰余金又は欠損金()	223,368
元本等合計	2,166,400
純資産合計	2,166,400
負債純資産合計	2,292,849

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

投資信託受益証券、投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び投資証券の基準価額で評価しております。

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4. 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益、為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 外貨建取引等の処理基準

外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定および外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(2) 金融商品の時価に関する補足情報

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年 3月17日現在
1. 計算期間末日における受益権の総数	2,389,768口
2. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は223,368円です。
3. 計算期間末日における1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9065円 (9,065円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託として、投資証券等の金融商品を主要投資対象とし、信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき運用を行っております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、投資信託受益証券、投資証券、コール・ローン等の金銭債権および金銭債務です。また、当ファンドが投資信託受益証券および投資証券への投資を通じて保有する主な金融資産は、株式、公社債、為替予約取引です。これらは、金利変動リスク、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、流動性リスクに晒されています。</p> <p>なお、為替予約取引は、外貨建金銭債権債務の為替変動リスクを低減する目的で利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>取引の執行については、投資対象、投資制限等を規定した運用ガイドラインに従って運用部門が執行します。</p> <p>管理部門は、運用ガイドラインに則って適切な運用がされているかおよび、運用結果の定期的な検証を通じて、下記に掲げる各種リスクが適切に管理されていることをモニタリングしています。</p> <p>また、それらの状況は定期的開催される各委員会に報告され、状況の把握・確認が行われるほか、適切な運営について検証が行われます。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場リスク <p>ファンドのパフォーマンスが一定の許容範囲内にあるかどうかモニタリングし、リターンの変動を注視することで市場リスクが適切に管理されていることを確認しています。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・信用リスク、流動性リスク <p>運用ガイドラインに従って、証券格付や、証券や発行体への集中投資制限をモニタリングし、投資対象に関するこれらのリスクが適切に管理されていることを確認しています。</p> <p>また、取引先の信用リスクについては、グループポリシーで認められた相手に限定することで、これを管理しています。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年 3月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	<p>金融商品は原則として全て時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、帳簿価額は時価と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年 3月17日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	2
投資証券	64,309
合計	64,311

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当該親投資信託の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額です。

(デリバティブ取引等に関する注記)

平成28年 3月17日現在

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	自 平成27年10月 9日 至 平成28年 3月17日
1. 元本の推移	
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,178,000円
期中追加設定元本額	211,768円
期中一部解約元本額	- 円
2. 計算期間末日における元本の内訳	
UBSグローバル・アロケーション Aコース (年1回決算型・円ヘッジコース)	1,107,090円
UBSグローバル・アロケーション Bコース (年1回決算型・ユーロコース)	99,000円
UBSグローバル・アロケーション Cコース (年4回決算型・円ヘッジコース)	1,084,678円
UBSグローバル・アロケーション Dコース (年4回決算型・ユーロコース)	99,000円
合計	2,389,768円

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	日本円	UBS 短期円金利プラス・ファン ド(適格機関投資家向け)	9,978	9,998	
		小計		9,998	
投資信託受益証券 合計				9,998	

投資証券	ユーロ	UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ-グローバル・アロケーション (EUR) I-B-accクラス	149.853	16,491.32	
		小計		16,491.32 (2,085,492)	
	投資証券 合計			2,085,492 (2,085,492)	
合計				2,095,490 (2,085,492)	

(注)

- 1.投資信託受益証券、投資証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。
- 2.通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額です。
- 3.合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に関わるもので内書きです。
- 4.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 5.外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入投資証券 時価比率	合計額に対する比率
ユーロ	投資証券	1銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

[次へ](#)

UBS(Lux)キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (E U R) I-Bクラス (ルクセンブルク籍
外国投資信託) の運用状況

< 参考情報 >

当ファンドは「UBSグローバル・アロケーション・マザーファンド 2015」が投資対象とする外国投資信託証券です。
ご参考として、掲載されている当ファンドの損益計算書及び投資有価証券明細表は、2015年9月30日現在の現地Annual Report
からの抜粋であり、現地の会計基準に基づき作成され、監査を受けたものです。

UBS(Lux)キー・セレクション・シキャブ - グローバル・アロケーション (E U R) I-Bクラス (ルクセンブルク籍
外国投資信託)

連結

Statement of Operations	損益計算書 (損益項目仮訳)	自 2014年10月1日 至 2015年9月30日 ユーロ
Income	収益	
Interest on liquid assets	流動資産等に係る受取利息	57,866.87
Interest on securities	有価証券に係る受取利息	10,509,228.74
Dividends	配当金	8,853,568.86
Interest received on swaps	スワップ取引に係る受取利息	1,870,344.17
Income on securities lending	有価証券の貸付に係る収益	889,416.61
Other income	その他収益	339,371.35
Total income	収益合計	22,519,796.60
Expenses	費用	
Interest paid on swaps	スワップ取引に係る支払利息	- 760,438.68
Flat fee	均一費用	- 17,344,362.43
Taxe d'abonnement	年次税	- 414,065.34
Cost on securities lending	有価証券の貸付に係る費用	- 355,766.62
Other commissions and fees	その他の手数料	- 18,368.09
Interest on cash and bank overdraft	現金および当座借越等に係る支払利息	- 32,670.57
Total expenses	費用合計	- 18,925,671.73
Net income (loss) on investments	投資純利益 (損失)	3,594,124.87
Realized gain (loss)	実現 (損) 益	
Realized gain (loss) on market-priced securities without options	無オプション市場価格証券に係る実現 (損) 益	60,639,274.80
Realized gain (loss) on options	オプション取引に係る実現 (損) 益	- 115,276.33
Realized gain (loss) on yield-evaluated securities and money market instruments	利回り評価有価証券および短期金融商品に係る実現 (損) 益	64,325.35
Realized gain (loss) on financial futures	金融先物取引に係る実現 (損) 益	- 22,954,018.33
Realized gain (loss) on forward foreign exchange contracts	為替予約取引に係る実現 (損) 益	- 58,725,731.91
Realized gain (loss) on swaps	スワップ取引に係る実現 (損) 益	327,729.65
Realized gain (loss) on foreign exchange	為替差 (損) 益	- 2,145,791.11
Total realized gain (loss)	実現 (損) 益合計	- 22,909,487.88
Net realized gain (loss) of the financial year	当期実現純 (損) 益	- 19,315,363.01
Changes in unrealized appreciation (depreciation)	未実現評価 (損) 益の変動	
Unrealized appreciation (depreciation) on market-priced securities without options	無オプション市場価格証券に係る未実現評価 (損) 益	- 24,729,772.31
Unrealized appreciation (depreciation) on yield-evaluated securities and money market instruments	利回り評価有価証券および短期金融商品に係る未実現評価 (損) 益	- 49,227.02
Unrealized appreciation (depreciation) on financial futures	金融先物取引に係る未実現評価 (損) 益	- 4,401,622.53
Unrealized appreciation (depreciation) on forward foreign exchange contracts	為替予約取引に係る未実現評価 (損) 益	21,226,629.40
Unrealized appreciation (depreciation) on swaps	スワップ取引に係る未実現評価 (損) 益	- 6,482,573.86
Total changes in unrealized appreciation (depreciation)	未実現評価 (損) 益の変動合計	- 14,436,566.32
Net increase (decrease) in net assets as a result of operations	純資産の純増 (減) 額	- 33,751,929.33

2015年9月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	株数/額面	ユーロ建評価額 先物/オプション/ 為替予約取引/スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および金融商品 無記名式株式			
オーストリア			
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	83,779.00	2,173,227.26	0.24
オーストリア合計		2,173,227.26	0.24
ベルギー			
EUR BPOST -PROMESSES NPV	69,155.00	1,468,160.65	0.17
EUR KBC GROUP NV NPV	48,983.00	2,761,171.71	0.31
ベルギー合計		4,229,332.36	0.48
カナダ			
USD CAN PACIFIC RYS COM NPV	23,432.00	3,013,780.28	0.34
CAD CANADIAN OIL SANDS COM NPV	206,495.00	870,654.44	0.10
CAD SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	66,571.00	1,587,590.70	0.18
USD ULTRA PETROLEUM CP COM NPV	70,300.00	402,434.04	0.04
カナダ合計		5,874,459.46	0.66
デンマーク			
DKK A.P. MOELLER-MAERSK SER 'B' DKK1000	1,690.00	2,326,526.31	0.26
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	130,256.00	3,518,224.98	0.39
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER 'B'	114,506.00	5,497,998.87	0.62
DKK TOPDANMARK AS DKK1	62,849.00	1,597,303.80	0.18
デンマーク合計		12,940,053.96	1.45
フィンランド			
EUR SAMPO OYJ SER 'A' NPV	188,236.00	8,146,854.08	0.92
フィンランド合計		8,146,854.08	0.92
フランス			
EUR ATOS SE EUR1	20,364.00	1,395,748.56	0.16
EUR DANONE EURO.25	46,823.00	2,641,753.66	0.30
EUR INGENICO GROUP EUR1	7,615.00	820,897.00	0.09
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	22,864.00	2,061,875.52	0.23
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	18,713.00	1,141,118.74	0.13
EUR SAFRAN EURO.20	62,978.00	4,238,419.40	0.48
EUR SANOFI EUR2	52,536.00	4,459,781.04	0.50
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	41,193.00	2,060,061.93	0.23
EUR THALES EUR3	27,894.00	1,734,169.98	0.19
EUR TOTAL EUR2.5	90,339.00	3,631,627.80	0.41
フランス合計		24,185,453.63	2.72
ドイツ			
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	12,624.00	2,399,822.40	0.27
EUR DEUTSCHE PFAND AG NPV	178,685.00	1,858,324.00	0.21
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	25,730.00	1,796,468.60	0.20
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	90,596.00	5,435,760.00	0.61
EUR SAP AG ORD NPV	33,945.00	1,967,112.75	0.22
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	89,722.00	1,406,840.96	0.16
ドイツ合計		14,864,328.71	1.67
香港			
HKD AIA GROUP LTD USD1.00	691,000.00	3,199,002.59	0.36
USD JARDINE MATHESON COM US\$0.25(BERMUDA REG)	34,000.00	1,439,193.73	0.16
香港合計		4,638,196.32	0.52
アイルランド			
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	48,454.00	2,203,815.97	0.25
GBP SHIRE ORD GB\$0.05	57,743.00	3,529,207.67	0.39
アイルランド合計		5,733,023.64	0.64
イスラエル			
USD CHECK POINT SOFTWARE ORD ILS0.01	48,300.00	3,432,599.33	0.39
USD MOBILEYE NV EURO.01	22,200.00	904,507.05	0.10
イスラエル合計		4,337,106.38	0.49
イタリア			
EUR INTESA SANPAOLO	1,560,113.00	4,923,716.63	0.55
EUR MEDIOLANUM EURO.1	209,001.00	1,335,516.39	0.15
イタリア合計		6,259,233.02	0.70

銘柄	株数 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / オプション / 為替予約取引 / スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
日本			
JPY HINO MOTORS NPV	203,000.00	1,841,897.44	0.21
JPY HITACHI NPV	458,000.00	2,058,620.47	0.23
JPY JAPAN AIRLINES CO NPV	108,200.00	3,411,406.29	0.38
JPY KDDI CORP NPV	168,700.00	3,365,477.60	0.38
JPY MITSUBISHI UFJ FIN NPV	352,900.00	1,891,105.86	0.21
JPY NGK SPARK PLUG CO NPV	85,600.00	1,747,374.15	0.20
JPY ORIX CORP NPV	249,300.00	2,856,864.54	0.32
JPY SONY CORP NPV	123,700.00	2,681,955.76	0.30
JPY SUMITOMO ELECTRIC NPV	182,000.00	2,074,065.43	0.23
JPY SUMITOMO RLTY&DEV NPV	100,000.00	2,835,713.76	0.32
JPY TOYOTA INDUSTRIES NPV	35,200.00	1,490,279.41	0.17
日本合計		26,254,760.71	2.95
オランダ			
EUR AHOLD(KON)NV EURO.01	152,509.00	2,655,181.69	0.30
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	24,435.00	1,416,985.65	0.16
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	88,825.00	6,416,718.00	0.72
EUR HUNTER DOUGLAS NV EURO.24	11,384.00	432,535.08	0.05
EUR KON KPN NV EURO.24	853,837.00	2,855,230.93	0.32
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	73,232.00	1,876,203.84	0.21
EUR ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	61,310.88	1,298,870.89	0.14
オランダ合計		16,951,726.08	1.90
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	63,007.00	732,530.85	0.08
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	60,070.00	722,989.10	0.08
ノルウェー合計		1,455,519.95	0.16
スウェーデン			
SEK ASSA ABLOY SER 'B' NPV (POST SPLIT)	185,457.00	2,969,437.30	0.33
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	383,525.00	3,818,026.05	0.43
SEK SVENSKA CELLULOSA SER 'B' NPV	88,210.00	2,202,883.98	0.25
SEK SWEDISH MATCH NPV	64,604.00	1,743,789.05	0.20
スウェーデン合計		10,734,136.38	1.21
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	411,473.00	511,186.27	0.06
スイス合計		511,186.27	0.06
イギリス			
GBP ARM HLDGS ORD GBPO.0005	116,461.00	1,497,404.81	0.17
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	158,765.00	2,003,628.52	0.23
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	70,156.00	3,179,733.89	0.36
GBP ASTRAZENECA ORD USDO.25	79,793.00	4,527,686.88	0.51
GBP AVIVA ORD GBPO.25	669,434.00	4,106,063.77	0.46
GBP BG GROUP ORD GBPO.10	238,377.00	3,076,269.33	0.35
GBP BP ORD USDO.25	317,432.00	1,438,721.26	0.16
GBP CAPITA PLC ORD GBPO.02066666	191,906.00	3,119,786.40	0.35
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	547,008.00	2,782,842.37	0.31
GBP HALMA ORD GBPO.10	163,743.00	1,603,166.28	0.18
GBP IMPERIAL TOBACCO ORD GBPO.10	59,608.00	2,760,707.07	0.31
GBP INDIVIOR PLC ORD USD2	64,384.00	197,978.18	0.02
GBP JARDINE LLOYD THOM ORD GBPO.05	83,812.00	1,158,937.13	0.13
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	843,801.00	2,726,333.12	0.31
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBPO.25	1,964,293.00	2,003,422.42	0.23
GBP NEXT ORD GBPO.10	45,999.00	4,750,207.01	0.53
GBP RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	63,775.00	5,181,305.68	0.58
GBP RIO TINTO ORD GBPO.10	98,753.00	2,961,570.40	0.33
GBP SMITH & NEPHEW ORD USDO.20	109,915.00	1,719,751.75	0.19
GBP STAGECOACH GROUP ORD GBPO.0054824(POST CONSO)	316,690.00	1,450,829.16	0.16
GBP STANDARD LIFE ORD GBPO.1222222	306,718.00	1,614,085.57	0.18
GBP UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	130,839.00	4,768,949.39	0.54
GBP WILLIAM HILL ORD GBPO.10	675,708.00	3,216,607.97	0.36
イギリス合計		61,845,988.36	6.95

銘柄	株数 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / オプション / 為替予約取引 / スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
アメリカ合衆国			
USD ABBVIE INC COM USD0.01	50,721.00	2,472,322.16	0.28
USD AFFILIATED MNGRS COM USD0.01	12,354.00	1,892,416.98	0.21
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	31,962.00	7,782,836.48	0.87
USD ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM	6,848.00	492,994.65	0.06
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	11,800.00	5,411,244.79	0.61
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	79,807.00	4,062,381.85	0.46
USD AMETEK INC COM USD0.01	49,101.00	2,301,423.80	0.26
USD APPLE INC COM NPV	141,017.00	13,934,311.40	1.57
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	332,682.00	4,643,391.32	0.52
USD BOEING CO COM USD5	22,224.00	2,607,151.44	0.29
USD CELGENE CORP COM USD0.01	70,392.00	6,821,323.75	0.77
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	30,858.00	2,180,585.93	0.25
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	30,445.00	1,730,830.64	0.19
USD DANAHER CORP COM USD0.01	32,613.00	2,489,544.21	0.28
USD DELTA AIR LINES INC	83,660.00	3,362,888.42	0.38
USD ECOLAB INC COM	39,003.00	3,833,737.21	0.43
USD ESTEE LAUDER COS CLASS ' A ' COM USD0.01	45,287.00	3,273,240.90	0.37
USD EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	39,916.00	2,895,049.82	0.33
USD FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL ' A '	84,486.00	6,804,292.41	0.76
USD GEN ELEC CO COM USD0.06	166,489.00	3,761,570.06	0.42
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	40,752.00	3,584,715.68	0.40
USD GOOGLE INC COM USD0.001 CL ' A '	14,840.00	8,486,818.19	0.95
USD HAIN CELESTIAL GROUP INC COM	34,132.00	1,577,792.79	0.18
USD HCA HLDGS INC COM USD0.01	66,927.00	4,638,273.43	0.52
USD HESS CORPORATION COM USD1	26,772.00	1,200,632.76	0.13
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	50,671.00	5,242,547.63	0.59
USD HORMEL FOODS CORP COM	78,973.00	4,479,086.79	0.50
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	8,693.00	859,214.95	0.10
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	5,929.00	2,441,074.87	0.27
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	60,036.00	2,042,165.21	0.23
USD LENNAR CORP COM CL ' A ' USD0.10	72,581.00	3,129,517.16	0.35
USD LINKEDIN CORP COM USD0.0001	10,662.00	1,816,050.22	0.20
USD LOWE ' S COS INC COM USD0.50	56,560.00	3,492,152.47	0.39
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	33,700.00	2,516,669.20	0.28
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS ' A '	57,587.00	4,649,263.55	0.52
USD MCGRAW HILL FINANCIAL INC COM	36,566.00	2,833,557.89	0.32
USD MDU RES GROUP INC COM USD1	78,989.00	1,217,120.54	0.14
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	136,403.00	5,408,462.96	0.61
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	110,082.00	3,106,457.33	0.35
USD MYLAN NV EURO.01	51,063.00	1,841,698.88	0.21
USD NIKE INC CLASS ' B ' COM NPV	41,717.00	4,595,690.47	0.52
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	38,699.00	2,293,338.28	0.26
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	47,495.00	4,012,343.56	0.45
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	1,958.00	2,169,560.47	0.24
USD ROCKET FUEL INC USD0.001	61,200.00	256,039.41	0.03
USD ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	42,916.00	3,425,206.22	0.38
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	53,307.00	3,315,659.58	0.37
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01	19,644.00	1,843,236.34	0.21
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	20,403.00	1,260,644.94	0.14
USD SCHWAB CHARLES CORP NEW COM	98,570.00	2,521,979.12	0.28
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	37,997.00	2,364,068.67	0.27
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	14,008.00	2,795,701.89	0.31
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	86,245.00	4,391,637.89	0.49
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	24,516.00	687,436.33	0.08
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	97,797.00	3,487,837.46	0.39
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	32,150.00	3,521,883.09	0.40
USD TIME WARNER CABLE USD0.01	18,574.00	2,984,652.52	0.34
USD TJX COS INC COM USD1	72,625.00	4,646,698.76	0.52
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	27,054.00	1,527,384.62	0.17
USD UGI CORP NEW COM	50,206.00	1,566,112.36	0.18
USD UNITED RENTALS INC COM	39,369.00	2,117,902.31	0.24
USD VEECO INSTRS INC DEL COM	61,318.00	1,126,658.17	0.13
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	31,504.00	2,939,150.33	0.33
USD VIACOM INC NEW CL ' B ' NON-VTG USD0.001	44,327.00	1,713,514.04	0.19
USD VISA INC COM STK USD0.0001	55,030.00	3,434,167.79	0.39

銘柄	株数 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / オプション / 為替予約取引 / スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS ' A '	45,675.00	3,223,949.16	0.36
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	76,658.00	2,662,513.47	0.30
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	88,249.00	4,059,651.65	0.46
USD WESTROCK CO COM USD0.01	55,781.00	2,570,548.39	0.29
USD WORKDAY INC COM USD0.001	33,316.00	2,055,220.39	0.23
USD ZIMMER HLDGS INC COM USD0.01	23,651.00	1,990,180.00	0.22
アメリカ合衆国合計		228,877,378.40	25.72
無記名株式合計		440,011,964.97	49.44
その他株式			
オランダ			
EUR ING GROEP NV CVA EURO.24	109,197.00	1,381,342.05	0.16
オランダ合計		1,381,342.05	0.16
その他株式合計		1,381,342.05	0.16
登録株式			
ドイツ			
EUR BAYER AG NPV (REGD)	64,160.00	7,343,112.00	0.83
EUR DAIMLER AG ORD NPV(REGD)	33,223.00	2,154,511.55	0.24
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)	173,087.00	2,749,487.00	0.31
GBP TUI AG NPV (REGD)	132,348.00	2,187,480.35	0.24
ドイツ合計		14,434,590.90	1.62
スペイン			
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	265,723.00	2,014,180.34	0.23
スペイン合計		2,014,180.34	0.23
スイス			
CHF ACTELION CHF0.50(REGD)	7,553.00	856,620.96	0.09
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	75,533.00	5,072,754.89	0.57
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	205,200.00	16,819,550.69	1.89
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER ' A '	36,978.00	2,566,485.48	0.29
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	5,184.00	1,136,908.94	0.13
スイス合計		26,452,320.96	2.97
登録株式合計		42,901,092.20	4.82
固定利付ノート			
オーストラリアドル			
AUD AUSTRALIA 5.50000% 11-21.04.23	17,100,000.00	13,021,221.10	1.46
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 4.00000% 13-20.04.23	7,400,000.00	5,054,891.44	0.57
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 10-21.04.16	10,830,000.00	6,959,873.64	0.78
オーストラリアドル合計		25,035,986.18	2.81
イギリスポンド			
GBP BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 5.75000% 99-07.12.28	1,000,000.00	1,631,194.07	0.18
イギリスポンド合計		1,631,194.07	0.18
米ドル			
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	1,000,000.00	868,249.94	0.10
USD E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 6.65000% 08-30.04.38	1,000,000.00	1,061,579.40	0.12
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL SA-REG-S 5.12500% 09-07.10.19	1,000,000.00	984,920.94	0.11
USD GDF SUEZ-REG-S 1.62500% 12-10.10.17	1,000,000.00	898,980.52	0.10
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.62500% 13-22.01.23	1,000,000.00	907,534.15	0.10
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.00000% 12-30.03.22	1,000,000.00	940,959.46	0.11
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.37500% 13-01.08.23	500,000.00	456,205.15	0.05
USD PETROLEOS MEXICANOS 3.50000% 13-30.01.23	1,000,000.00	808,510.64	0.09
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 3.62500% 12-12.01.23	1,000,000.00	879,032.48	0.10
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE IV LLC 2.25000% 12-18.03.20	1,000,000.00	884,430.01	0.10
USD TOTAL CAPITAL CANADA LTD 2.75000% 13-15.07.23	1,000,000.00	859,748.26	0.10
USD VALE OVERSEAS LTD 4.37500% 12-11.01.22	1,000,000.00	790,091.83	0.09
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.50000% 11-01.11.21	1,000,000.00	915,923.85	0.10
USD WAL-MART STORES INC 6.50000% 07-15.08.37	500,000.00	588,086.45	0.07
米ドル合計		11,844,253.08	1.34
固定利付ノート合計		38,511,433.33	4.33
固定利付メディアム・ターム・ノート			
オーストラリアドル			
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.50000% 12-21.09.17	7,880,000.00	5,096,484.78	0.57
オーストラリアドル合計		5,096,484.78	0.57

銘柄	株数/額面	ユーロ建評価額 先物/オプション/ 為替予約取引/スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
ユーロ			
EUR ABBEY NATIONAL TREASURY SERV PLC 3.37500% 10-20.10.15	3,000,000.00	3,004,620.00	0.34
EUR BMW US CAPITAL LLC 1.00000% 13-18.07.17	2,000,000.00	2,012,120.00	0.23
EUR CAISSE DE REFINANCEMENT DE L ' HABITAT 4.10000% 04-25.10.15	3,000,000.00	3,007,350.00	0.34
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 5.00000% 10-24.06.20	2,000,000.00	2,269,360.00	0.24
EUR GAS NATURAL CAPITAL MARKETS SA 6.00000% 12-27.01.20	1,000,000.00	1,202,440.00	0.13
EUR GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING-REG-S 1.25000% 12-15.10.15	3,000,000.00	3,000,660.00	0.34
EUR ORANGE-REG-S 1.87500% 13-02.10.19	2,000,000.00	2,085,640.00	0.23
EUR POHJOLA BANK PLC 1.75000% 13-29.08.18	1,000,000.00	1,035,160.00	0.12
EUR SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.62500% 14-24.03.21	1,000,000.00	1,030,060.00	0.12
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.25000% 15-16.01.23	2,000,000.00	1,942,140.00	0.22
EUR TEOLLISUUDEN VOIMA OY REG-S 2.50000% 14-17.03.21	500,000.00	492,340.00	0.06
EUR UNICREDIT SPA 3.37500% 12-11.01.18	500,000.00	526,695.00	0.06
EUR WELLS FARGO & CO-REG-S 2.62500% 12-16.08.22	1,000,000.00	1,078,330.00	0.12
ユーロ合計		22,686,915.00	2.55
イギリスポンド			
GBP ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC 6.87500% 10-17.05.25	1,000,000.00	1,723,917.80	0.19
イギリスポンド合計		1,723,917.80	0.19
米ドル			
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.25000% 13-12.03.19	1,000,000.00	917,133.25	0.11
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.45000% 13-09.09.16	2,000,000.00	1,804,298.32	0.20
USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 4.50000% 12-14.02.22	2,000,000.00	1,907,404.26	0.22
米ドル合計		4,628,835.83	0.53
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		34,136,153.41	3.84
変動利付メディアム・ターム・ノート			
ユーロ			
EUR DNB BANK ASA-REG-S-SUB 4.750%/12M EUSA5+325BP 12-08.03.22	1,000,000.00	1,049,460.00	0.12
EUR PACCAR FINANCIAL CORP-REG-S 3M EURIBOR+38BP 13-24.06.16	1,700,000.00	1,701,768.00	0.19
ユーロ合計		2,751,228.00	0.31
イギリスポンド			
GBP BARCLAYS BANK PLC-SUB 6.750%/3M LIBOR+249BP 07-16.01.23	1,000,000.00	1,458,081.72	0.17
GBP IMPERIAL TOBACCO FINANCE 9.00000%/RATING LINKED 09-17.02.22	500,000.00	899,439.22	0.10
イギリスポンド合計		2,357,520.94	0.27
米ドル			
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 12-17.10.22	2,000,000.00	1,806,369.54	0.20
米ドル合計		1,806,369.54	0.20
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		6,915,118.48	0.78
固定利付債券			
オーストラリアドル			
AUD AUSTRALIA 2.75000% 12-21.04.24	20,000,000.00	12,776,200.17	1.44
AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17	17,500,000.00	11,480,065.29	1.29
AUD AUSTRALIA 6.00000% 04-15.02.17	17,000,000.00	11,291,953.51	1.27
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 11-21.07.22	5,600,000.00	4,218,178.09	0.47
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23	6,300,000.00	4,310,424.65	0.48
AUD SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHORITY 5.75000% 10-20.09.17	7,410,000.00	4,995,525.60	0.56
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.75000% 04-15.11.16	7,135,000.00	4,673,494.42	0.53
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 03-17.10.22	4,700,000.00	3,591,912.66	0.40
オーストラリアドル合計		57,337,754.39	6.44
カナダドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.06.23	600,000.00	408,602.42	0.05
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21	1,400,000.00	1,053,293.93	0.12
CAD CANADA, GOVERNMENT 4.25000% 07-01.06.18	500,000.00	366,826.68	0.04
CAD CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 01-01.06.33	600,000.00	620,070.28	0.07
カナダドル合計		2,448,793.31	0.28

銘柄	株数/額面	ユーロ建評価額 先物/オプション/ 為替予約取引/スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
ユーロ			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 98-04.07.28	7,250,000.00	10,737,866.26	1.21
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37	2,850,000.00	4,343,707.80	0.49
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.75000% 08-04.01.19	13,000,000.00	14,670,500.00	1.65
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.00000% 10-04.07.20	6,800,000.00	7,790,080.00	0.87
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 2.25000% 11-04.09.21	7,000,000.00	7,900,200.00	0.89
EUR ITALY, REPUBLIC OF BTP 3.75000% 10-01.03.21	4,200,000.00	4,820,970.00	0.54
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.00000% 05-01.02.37	2,100,000.00	2,576,490.00	0.29
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BPT 3.75000% 06-01.08.16	8,600,000.00	8,864,450.00	1.00
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.00000% 06-01.02.17	8,600,000.00	9,047,406.40	1.01
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 3.50000% 12-01.11.17	9,150,000.00	9,782,265.00	1.10
EUR MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.37500% 13-26.01.21	2,000,000.00	2,097,580.00	0.24
ユーロ合計		82,631,515.46	9.29
イギリスポンド			
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 07-07.12.42	700,000.00	1,337,743.07	0.15
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.75000% 07-07.12.30	700,000.00	1,274,479.78	0.14
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 10-07.12.40	700,000.00	1,271,345.11	0.14
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 2.25000% 13-07.09.23	960,000.00	1,369,613.54	0.15
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.25000% 12-22.01.44	850,000.00	1,334,886.59	0.15
GBP UNITED KINGDOM TREASURY GILT 1.75000% 13-22.07.19	2,580,000.00	3,599,436.82	0.40
イギリスポンド合計		10,187,504.91	1.13
米ドル			
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN II-REG-S 5.50000% 10-10.11.20	1,000,000.00	964,255.32	0.11
USD PFIZER INC 7.20000% 09-15.03.39	1,000,000.00	1,231,150.73	0.14
米ドル合計		2,195,406.05	0.25
固定利付債券合計		154,800,974.12	17.39
変動利付債券			
米ドル			
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	1,000,000.00	1,280,785.66	0.14
米ドル合計		1,280,785.66	0.14
変動利付債券合計		1,280,785.66	0.14
固定利付トレジャリーノート			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 13-30.11.18	5,500,000.00	4,966,732.81	0.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 15-15.02.25	2,300,000.00	2,052,422.12	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 12-31.08.19	6,000,000.00	5,336,858.23	0.60
米ドル合計		12,356,013.16	1.39
固定利付トレジャリーノート合計		12,356,013.16	1.39
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および金融商品合計		732,294,877.38	82.29
他の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金融商品			
固定利付ノート			
米ドル			
USD 21ST CENTURY FOX AMERICA INC 3.00000% 13-15.09.22	1,000,000.00	882,872.12	0.10
USD ABBVIE INC 2.90000% 13-06.11.22	1,000,000.00	872,846.58	0.10
USD CITIGROUP INC 3.37500% 13-01.03.23	2,000,000.00	1,800,284.88	0.20
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.80000% 13-25.01.18	1,000,000.00	896,619.94	0.10
USD KRAFT FOODS GROUP INC 3.50000% 12-06.06.22	1,000,000.00	913,992.38	0.10
USD MORGAN STANLEY 3.75000% 13-25.02.23	1,000,000.00	917,566.85	0.10
USD MORGAN STANLEY 4.75000% 12-22.03.17	2,000,000.00	1,876,961.26	0.21
USD TIME WARNER CABLE INC 4.00000% 11-01.09.21	500,000.00	456,886.90	0.05
米ドル合計		8,618,030.91	0.96
固定利付ノート合計		8,618,030.91	0.96
固定利付メディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.30000% 13-11.01.23	2,000,000.00	1,778,013.88	0.20
USD GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 3.10000% 13-09.01.23	1,500,000.00	1,373,977.16	0.15
米ドル合計		3,151,991.04	0.35
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		3,151,991.04	0.35

銘柄	株数/額面	ユーロ建評価額 先物/オプション/ 為替予約取引/スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
固定利付債券			
米ドル			
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.12500% 12-16.07.22	1,000,000.00	869,787.24	0.10
USD UNILEVER CAPITAL CORP 2.20000% 13-06.03.19	1,000,000.00	913,708.39	0.10
米ドル合計		1,783,495.63	0.20
固定利付債券合計		1,783,495.63	0.20
固定利付トレジャリーノート			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 14-15.02.44	1,600,000.00	1,648,338.99	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 10-30.09.17	3,200,000.00	2,936,096.39	0.33
米ドル合計		4,584,435.38	0.52
固定利付トレジャリーノート合計		4,584,435.38	0.52
他の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金融商品合計		18,137,952.96	2.03
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および金融商品			
無記名株式			
アメリカ合衆国			
USD GOOGLE INC COM USD0.001 CL 'C'	12,928.00	7,046,498.33	0.79
アメリカ合衆国合計		7,046,498.33	0.79
無記名株式合計		7,046,498.33	0.79
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および金融商品合計		7,046,498.33	0.79
ルクセンブルグ2010年12月17日法規制41(1)e)に準拠するUCITSおよびその他のUCIs			
オープン・エンド型投資信託証券			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	129,295.00	16,122,348.08	1.81
アイルランド合計		16,122,348.08	1.81
ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	776.00	10,097,607.45	1.13
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X-ACC	1,104.00	10,051,172.05	1.13
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD)-U-X-ACC	808.00	13,057,236.57	1.47
USD UBS (LUX) INST FUND - EMERGING MARKETS EQUITY FA	1,683.00	25,553,013.50	2.87
ルクセンブルグ合計		58,759,029.57	6.60
オープン・エンド型投資信託証券合計		74,881,377.65	8.41
ルクセンブルグ2010年12月17日法規制41(1)e)に準拠するUCITSおよびその他のUCIs合計		74,881,377.65	8.41
投資有価証券合計		832,360,706.32	93.52
デリバティブ商品			
公認の証券取引所に上場されているデリバティブ商品			
債券に係る金融先物			
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.15	- 673.00	- 480,882.08	- 0.05
EUR EURO-BUND FUTURE 08.12.15	- 172.00	- 278,640.00	- 0.03
債券に係る金融先物合計		- 759,522.08	- 0.08
指数に係る金融先物			
SEK OMX 30 INDEX FUTURE 16.10.15	- 1,193.00	989,521.38	0.11
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.15	1,819.00	- 1,755,335.00	- 0.20
USD RUSSELL 2000 MINI INDEX FUTURE 18.12.15	460.00	- 1,885,330.35	- 0.21
EUR DAX INDEX FUTURE 18.12.15	132.00	- 1,564,200.00	- 0.18
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.15	- 562.00	732,128.04	0.08
CAD S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.15	105.00	- 202,063.89	- 0.02
USD NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 18.12.15	- 369.00	543,245.36	0.06
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.15	- 115.00	329,721.01	0.04
JPY NIKKEI 225 (SGX) INDEX FUTURE 10.12.15	1,416.00	- 2,280,375.72	- 0.26
AUD SPI 200 INDEX FUTURE 17.12.15	113.00	- 35,545.02	0.00
USD MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.12.15	- 455.00	41,171.14	0.00
EUR AMSTERDAM EXCHANGE INDEX FUTURE 16.10.15	221.00	- 448,630.00	- 0.05

銘柄		株数/額面	ユーロ建評価額 先物/オプション/ 為替予約取引/スワッ プに係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
SGD	MSCI SINGAPORE INDEX FUTURE 29.10.15	40.00	- 12,600.84	0.00
USD	S&P500 EMINI FUTURE 18.12.15	- 652.00	1,426,992.16	0.16
USD	MSCI TAIWAN INDEX FUTURE 29.10.15	335.00	50,901.99	0.01
HKD	HANG SENG CHINA ENTERPRISES INDEX FUTURE 29.10.15	162.00	- 80,522.55	-0.01
指数に係る金融先物合計			- 4,150,922.29	- 0.47

公認の証券取引所に上場されているデリバティブ商品合計 - 4,910,444.37 - 0.55

公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていないデリバティブ商品

クレジット・デフォルト・スワップ

USD	BARCLAYS/CDX.EM.23 JUN20 CDI REC 1.00000% 15-20.06.20	39,500,000.00	- 4,294,100.29	- 0.48
USD	CME/CDX.NA.HY.24 JUN20 CDI REC 5.00000% 15-20.06.20	42,570,000.00	1,118,322.00	0.12
クレジット・デフォルト・スワップ合計			- 3,175,778.29	- 0.36

公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていないデリバティブ商品合計 - 3,175,778.29 - 0.36

デリバティブ商品合計 - 8,086,222.66 - 0.91

為替予約取引

為替予約取引(購入/売却)

購入通貨	売却通貨	満期日		
USD	TWD	8.10.2015	260,000,000.00	106,335.29 0.01
USD	MYR	8.10.2015	128,000,000.00	1,585,735.75 0.18
MYR	USD	8.10.2015	5,470,885.93	- 291,345.60 - 0.03
USD	MXN	8.10.2015	45,500,000.00	62,659.88 0.01
USD	BRL	8.10.2015	17,500,000.00	477,362.16 0.05
MYR	USD	8.10.2015	5,476,602.55	- 296,466.87 - 0.03
USD	MXN	8.10.2015	45,500,000.00	63,246.08 0.01
MYR	USD	8.10.2015	5,487,264.21	- 306,018.19 - 0.03
USD	MXN	8.10.2015	45,500,000.00	63,646.60 0.01
EUR	AUD	8.10.2015	72,130,000.00	2,295,169.15 0.26
EUR	HKD	8.10.2015	103,250,000.00	85,181.96 0.01
EUR	JPY	8.10.2015	1,540,000,000.00	- 334,235.13 - 0.04
EUR	GBP	8.10.2015	32,275,000.00	1,576,906.68 0.18
EUR	SEK	8.10.2015	191,918.00	- 179.28 0.00
EUR	CHF	8.10.2015	19,502,893.00	154,683.61 0.02
EUR	DKK	8.10.2015	46,880,000.00	- 570.56 0.00
EUR	USD	8.10.2015	239,342,933.08	1,737,992.11 0.20
EUR	ILS	8.10.2015	6,900,000.00	50,807.79 0.01
EUR	THB	8.10.2015	70,000,000.00	32,097.58 0.00
EUR	NZD	8.10.2015	4,025,000.00	74,934.99 0.01
EUR	NOK	8.10.2015	17,570,000.00	78,446.21 0.01
MXN	EUR	8.10.2015	12,271,025.13	- 409,876.42 - 0.05
EUR	CAD	8.10.2015	11,300,000.00	230,939.75 0.03
EUR	ZAR	8.10.2015	40,500,000.00	203,049.51 0.02
EUR	DKK	8.10.2015	3,950,000.00	- 79.30 0.00
EUR	HKD	8.10.2015	2,550,000.00	2,531.92 0.00
USD	EUR	8.10.2015	6,734,218.36	- 15,845.10 0.00
EUR	HKD	8.10.2015	4,550,000.00	- 4,951.18 0.00
EUR	CHF	8.10.2015	650,000.00	7,381.39 0.00
EUR	CHF	8.10.2015	550,000.00	3,079.26 0.00
EUR	JPY	8.10.2015	75,000,000.00	- 18,964.53 0.00
USD	EUR	8.10.2015	3,089,299.02	90,730.99 0.01
JPY	CHF	8.10.2015	7,687,000.00	278,616.34 0.03
JPY	CHF	8.10.2015	7,687,000.00	283,782.84 0.03
EUR	CHF	8.10.2015	7,687,000.00	60,461.78 0.01
EUR	CHF	8.10.2015	7,687,000.00	40,002.68 0.00
CAD	EUR	8.10.2015	1,154,177.69	15,037.52 0.00
EUR	JPY	8.10.2015	340,000,000.00	- 78,044.42 - 0.01
GBP	EUR	8.10.2015	1,028,435.56	- 10,797.97 0.00
EUR	HKD	8.10.2015	3,000,000.00	- 10,151.63 0.00
EUR	SGD	8.10.2015	400,000.00	- 3,731.25 0.00
SEK	EUR	8.10.2015	785,389.74	15,747.86 0.00
USD	EUR	8.10.2015	3,654,423.77	107,865.25 0.01

銘柄	株数 / 額面	ユーロ建評価額 先物 / オプション / 為替予約取引 / スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
EUR	1,046,551.15	CHF 1,130,000.00	8.10.2015 10,424.90 0.00
EUR	686,069.62	HKD 6,100,000.00	8.10.2015 -18,978.28 0.00
USD	3,000,000.00	EUR 2,615,920.14	8.10.2015 71,429.16 0.01
EUR	1,752,797.17	JPY 240,000,000.00	8.10.2015 -42,396.90 0.00
EUR	2,246,732.62	SEK 21,500,000.00	8.10.2015 -49,861.83 -0.01
USD	2,250,000.00	EUR 1,991,398.93	8.10.2015 24,113.05 0.00
EUR	2,248,462.18	SEK 21,500,000.00	8.10.2015 -48,132.27 -0.01
EUR	2,247,158.36	SEK 21,500,000.00	8.10.2015 -49,436.09 -0.01
CAD	1,000,000.00	EUR 672,018.62	8.10.2015 -3,895.64 0.00
EUR	266,435.99	USD 300,000.00	8.10.2015 -2,298.94 0.00
CHF	1,000,000.00	EUR 921,327.82	8.10.2015 -4,401.93 0.00
JPY	140,000,000.00	EUR 1,027,105.31	8.10.2015 20,091.23 0.00
JPY	400,000,000.00	EUR 2,934,373.47	8.10.2015 57,616.64 0.01
EUR	739,629.77	GBP 540,000.00	8.10.2015 6,930.70 0.00
EUR	322,416.91	CHF 350,000.00	8.10.2015 1,492.85 0.00
EUR	629,544.66	SEK 6,000,000.00	8.10.2015 -11,365.42 0.00
EUR	241,236.32	DKK 1,800,000.00	8.10.2015 -53.11 0.00
JPY	65,000,000.00	EUR 478,302.01	8.10.2015 7,896.38 0.00
USD	2,250,000.00	EUR 2,004,490.06	8.10.2015 11,021.92 0.00
EUR	1,109,836.85	JPY 150,000,000.00	8.10.2015 -12,159.44 0.00
EUR	263,729.57	JPY 35,000,000.00	8.10.2015 1,930.44 0.00
JPY	490,000,000.00	EUR 3,693,324.43	8.10.2015 -28,136.55 0.00
EUR	1,015,538.49	JPY 135,000,000.00	8.10.2015 5,741.83 0.00
EUR	44,927,864.97	AUD 72,295,000.00	19.11.2015 -396,112.98 -0.04
EUR	979,400.75	THB 40,000,000.00	19.11.2015 -5,307.50 0.00
EUR	1,939,355.28	NOK 18,000,000.00	19.11.2015 51,949.78 0.01
EUR	233,329.66	PLN 990,000.00	19.11.2015 626.54 0.00
EUR	293,912.20	SGD 470,000.00	19.11.2015 -1,479.15 0.00
EUR	4,418,872.14	NZD 7,895,000.00	19.11.2015 -85,564.97 -0.01
EUR	5,537,744.68	SEK 52,250,000.00	19.11.2015 -45,079.87 -0.01
EUR	5,811,490.25	DKK 43,345,000.00	19.11.2015 -743.22 0.00
EUR	2,577,978.60	ZAR 40,500,000.00	19.11.2015 -21,268.86 0.00
EUR	43,105,102.70	GBP 31,445,000.00	19.11.2015 477,875.55 0.05
EUR	47,315,382.95	CHF 51,500,192.00	19.11.2015 53,570.32 0.01
JPY	482,335,226.00	EUR 3,591,379.72	19.11.2015 16,560.72 0.00
EUR	11,957,777.06	HKD 103,685,000.00	19.11.2015 -17,138.00 0.00
EUR	1,569,218.93	ILS 6,900,000.00	19.11.2015 -5,302.32 0.00
EUR	177,712,311.50	USD 199,035,834.04	19.11.2015 -447,278.46 -0.05
EUR	5,574,821.54	CAD 8,250,000.00	19.11.2015 67,912.10 0.01
MXN	111,220,000.00	EUR 5,875,192.98	19.11.2015 -24,095.71 0.00
EUR	387,299.42	SEK 3,650,000.00	8.10.2015 -2,587.54 0.00
EUR	3,193,797.73	GBP 2,330,000.00	8.10.2015 32,336.94 0.00
CHF	5,672,819.88	JPY 702,000,000.00	8.10.2015 -49,387.98 -0.01
CHF	5,614,835.50	JPY 695,000,000.00	8.10.2015 -50,195.56 -0.01
CHF	3,780,061.85	EUR 3,470,000.00	8.10.2015 -3,963.44 0.00
EUR	1,102,152.04	CHF 1,200,000.00	8.10.2015 1,840.98 0.00
EUR	1,370,535.85	JPY 185,000,000.00	8.10.2015 -13,259.58 0.00
CHF	3,784,329.95	EUR 3,470,000.00	8.10.2015 -49.91 0.00
EUR	690,332.79	DKK 5,150,000.00	8.10.2015 -23.08 0.00
EUR	387,428.55	SEK 3,650,000.00	19.11.2015 -2,567.81 0.00
EUR	3,190,814.84	GBP 2,330,000.00	19.11.2015 32,238.30 0.00
CHF	3,797,562.68	EUR 3,485,000.00	19.11.2015 29.64 0.00
EUR	1,103,038.50	CHF 1,200,000.00	19.11.2015 1,796.49 0.00
CHF	5,667,323.22	JPY 702,000,000.00	19.11.2015 -50,152.40 -0.01
EUR	690,536.34	DKK 5,150,000.00	19.11.2015 -39.33 0.00
CHF	5,609,372.80	JPY 695,000,000.00	19.11.2015 -50,972.55 -0.01
EUR	1,370,325.71	JPY 185,000,000.00	19.11.2015 -13,502.27 0.00
CHF	3,793,279.62	EUR 3,485,000.00	19.11.2015 -3,900.93 0.00
EUR	343,279.28	GBP 250,000.00	8.10.2015 4,066.75 0.00
EUR	342,959.99	GBP 250,000.00	19.11.2015 4,056.93 0.00
CAD	34,560,800.00	EUR 23,079,599.40	19.10.2015 6,940.22 0.00
SGD	15,019,900.00	EUR 9,387,484.44	19.10.2015 69,365.43 0.01
GBP	42,743,200.00	EUR 58,418,526.33	19.10.2015 -433,353.43 -0.05
USD	3,500,000.00	EUR 3,085,002.39	8.10.2015 50,238.46 0.01
USD	3,500,000.00	EUR 3,082,747.10	19.11.2015 50,148.88 0.01
USD	1,500,000.00	EUR 1,331,334.56	8.10.2015 12,340.09 0.00

銘柄				株数/額面	ユーロ建評価額 先物/オプション/ 為替予約取引/スワップ に係る未実現(損)益	純資産 比率 (%)
USD	1,500,000.00	EUR	1,330,343.90	19.11.2015	12,325.81	0.00
USD	750,000.00	EUR	661,309.76	19.11.2015	10,025.09	0.00
HKD	7,500,000.00	EUR	853,256.01	19.11.2015	12,943.18	0.00
HKD	7,500,000.00	EUR	853,919.72	8.10.2015	12,942.45	0.00
USD	750,000.00	EUR	661,802.86	8.10.2015	10,034.47	0.00
EUR	2,186,553.22	USD	2,500,000.00	8.10.2015	-52,904.53	-0.01
EUR	2,185,167.61	USD	2,500,000.00	19.11.2015	-52,615.23	-0.01
USD	1,300,000.00	EUR	1,148,784.37	19.11.2015	14,862.71	0.00
USD	1,300,000.00	EUR	1,149,577.75	8.10.2015	14,940.28	0.00
EUR	689,559.43	CHF	750,000.00	8.10.2015	1,865.02	0.00
EUR	690,112.71	CHF	750,000.00	19.11.2015	1,836.45	0.00
USD	2,600,000.00	EUR	2,338,175.76	8.10.2015	-9,139.70	0.00
USD	2,600,000.00	EUR	2,336,610.28	19.11.2015	-9,316.12	0.00
EUR	575,655.20	GBP	421,900.00	19.10.2015	3,308.15	0.00
EUR	164,726.79	SGD	264,500.00	19.10.2015	-1,808.06	0.00
EUR	555,716.51	JPY	75,000,000.00	8.10.2015	-5,281.64	0.00
EUR	555,653.10	JPY	75,000,000.00	19.11.2015	-5,358.24	0.00
USD	3,750,000.00	EUR	3,358,114.73	19.11.2015	-1,440.46	0.00
USD	3,750,000.00	EUR	3,360,293.34	8.10.2015	-1,106.71	0.00
EUR	338,832.13	CAD	506,100.00	19.10.2015	758.43	0.00
USD	7,670,000.00	EUR	6,820,936.63	19.11.2015	44,581.14	0.00
USD	7,680,000.00	EUR	6,834,077.84	8.10.2015	45,536.37	0.01
USD	940,000.00	EUR	838,404.64	8.10.2015	3,631.47	0.00
EUR	1,038,184.42	JPY	140,000,000.00	8.10.2015	-9,012.12	0.00
EUR	1,038,032.01	JPY	140,000,000.00	19.11.2015	-9,189.16	0.00
USD	940,000.00	EUR	837,871.06	19.11.2015	3,535.29	0.00
EUR	1,710,983.13	GBP	1,264,100.00	19.10.2015	-3,887.47	0.00
為替予約取引(購入/売却)合計					7,193,382.34	0.81
銀行預金、要求払い預金および貯蓄預金ならびにその他流動資産					61,447,364.19*	6.90
当座借越およびその他の短期負債					-2,007,078.60	-0.23
その他の資産および負債					-839,842.26	-0.09
純資産合計					890,068,309.33	100.00

* 2015年9月30日において、パークレーズに対してEUR 4,260,000の預金を担保として差し入れています。

[次へ](#)

国内投資信託「UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）」の状況

ご参考として第7期決算日（2016年1月20日）の状況をご報告申し上げます。

* 損益の状況 *
(自2015年1月21日 至2016年1月20日)

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	128,076円
売買益	86,295
売買損	41,781
(B) 信託報酬等	342,948
(C) 当期損益金(A+B)	214,872
(D) 前期繰越損益金	1,284,371
(E) 追加信託差損益金	228,934
(配当等相当額)	(270,247)
(売買損益相当額)	(41,313)
(F) 計 (C+D+E)	1,298,433
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	1,298,433
追加信託差損益金	228,934
(配当等相当額)	(270,247)
(売買損益相当額)	(41,313)
分配準備積立金	4,295,106
繰越損益金	3,225,607

* 組入資産の明細 *

親投資信託残高

(2016年1月20日現在)

項 目	期 首	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
UBS短期円金利プラス・マザーファンド	千口 888,108	千口 605,288	千円 608,375

UBS短期円金利プラス・マザーファンドの運用状況

当ファンドは、UBS短期円金利プラス・ファンド（適格機関投資家向け）が投資対象とする親投資信託で、信託財産の実質的な運用を行っております。

ご参考として、第7期決算日（2016年1月20日）の運用状況をご報告申し上げます。

* 損益の状況 *
(自2015年1月21日 至2016年1月20日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	63,398円
受取利息	63,398
(B) 有価証券売買損益	38,250
売買益	38,250
(C) 当期損益金(A+B)	101,648
(D) 前期繰越損益金	4,448,959
(E) 解約差損益金	1,440,037
(F) 計 (C+D+E)	3,110,570
次期繰越損益金(F)	3,110,570

* 組入資産明細表 * (2016年1月20日現在)

2016年1月20日現在、UBS短期円金利プラス・マザーファンドにおける組入資産はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成28年3月31日現在)

UBSグローバル・アロケーション Cコース(年4回決算型・円ヘッジコース)

資産総額	1,922,211 円
負債総額	936,680 円
純資産総額(-)	985,531 円
発行済口数	1,014,849 口
1口当たり純資産額(/)	0.9711 円

UBSグローバル・アロケーション Dコース(年4回決算型・ユーロコース)

資産総額	91,474 円
負債総額	60 円
純資産総額(-)	91,414 円
発行済口数	100,000 口
1口当たり純資産額(/)	0.9141 円

(参考) UBSグローバル・アロケーション・マザーファンド 2015

資産総額	2,202,158 円
負債総額	円
純資産総額(-)	2,202,158 円
発行済口数	2,389,768 口
1口当たり純資産額(/)	0.9215 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

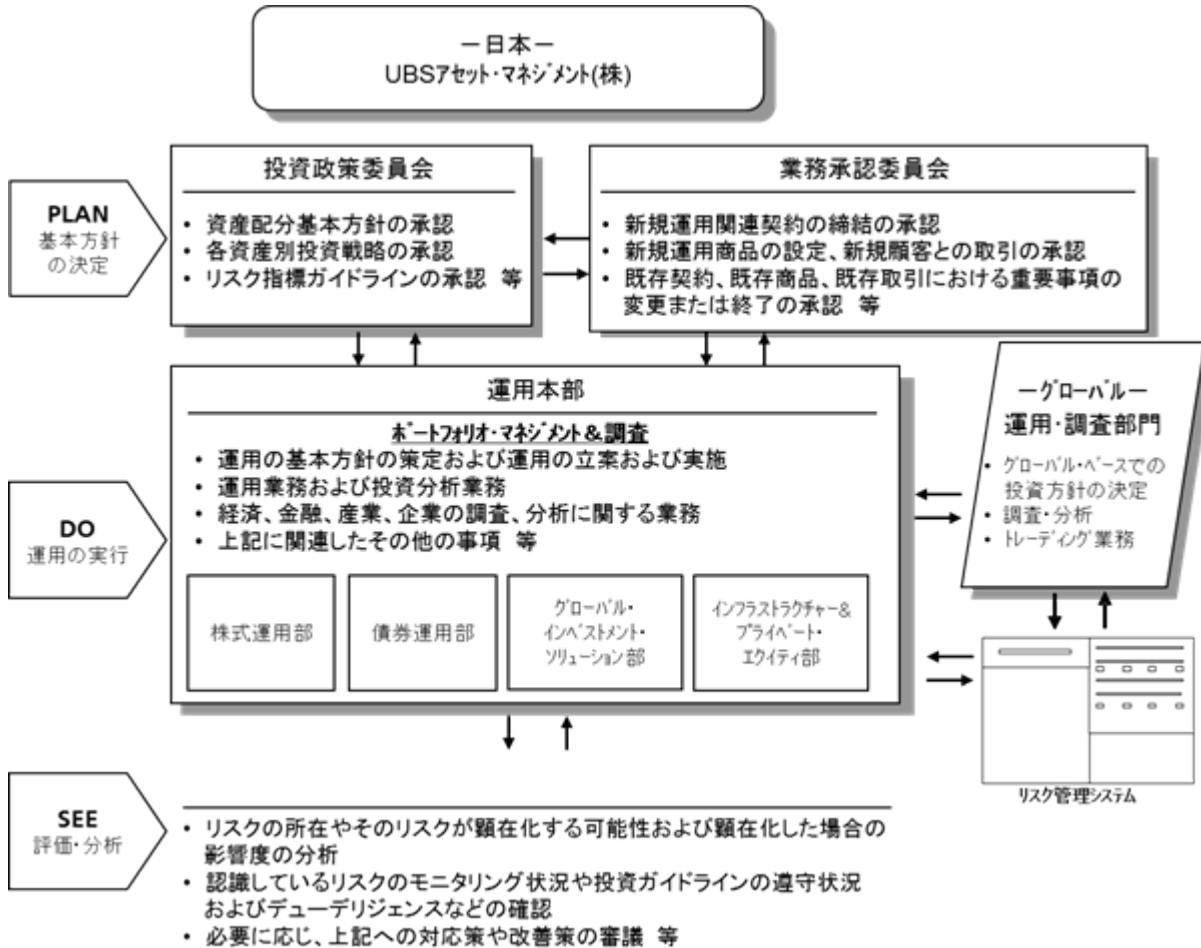
1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(平成27年7月末日現在)

(中略)

投資運用の意思決定機構



(平成27年5月末日現在)

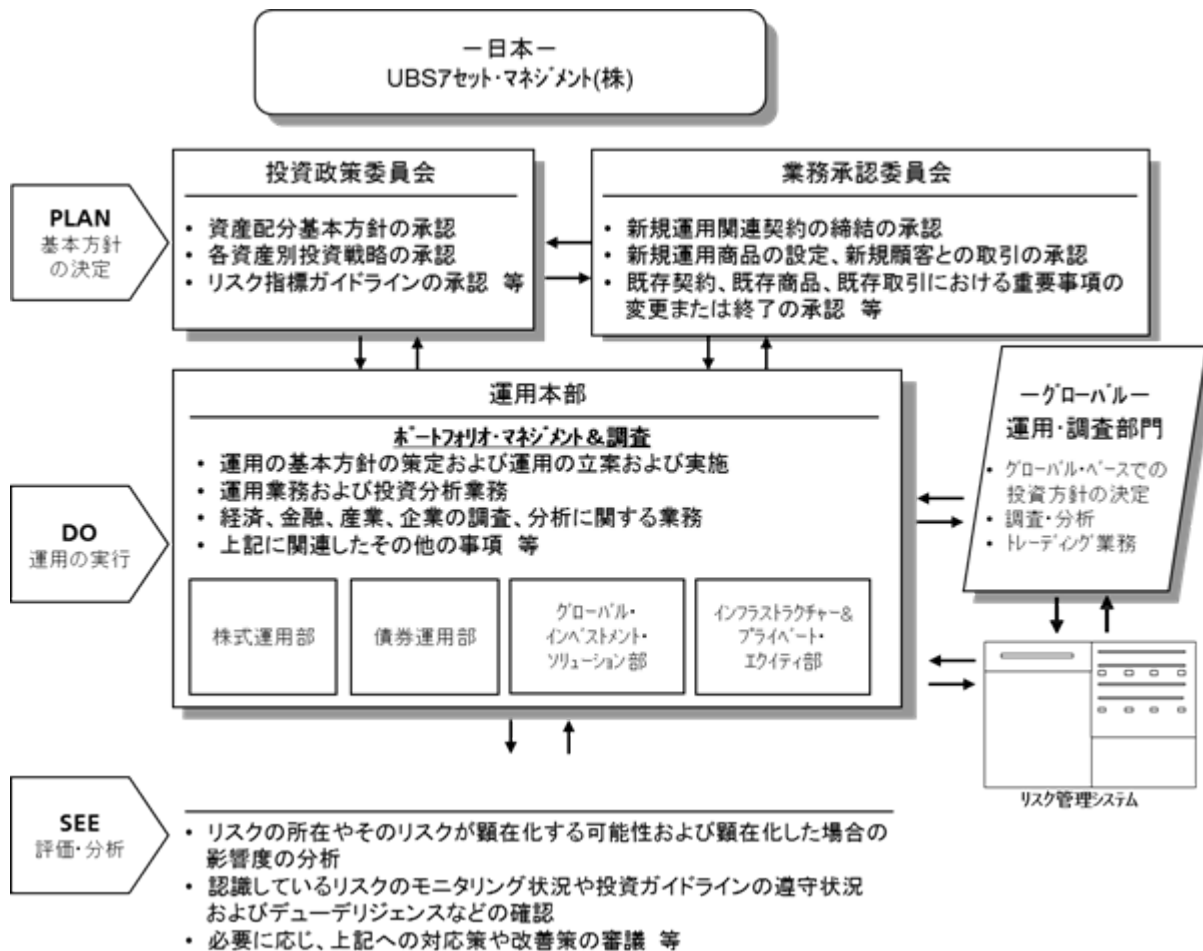
上記の体制は今後変更される場合があります。

< 訂正後 >

(平成28年5月13日現在)

(中略)

投資運用の意思決定機構



上記の体制は今後変更される場合があります。

原届出書「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」「3 委託会社等の経理状況」を以下の内容に更新いたします。

<更新後>

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用及び投資一任契約に基づき委任された資産の運用(投資運用業)を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業及び投資助言業を行っています。

委託会社の運用する証券投資信託は平成28年3月末日現在、以下のとおりです。(ただし、親投資信託は除きます。)

種類	ファンド本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	81	1,523,587
合計	81	1,523,587

3【委託会社等の経理状況】

1. 財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

当社は、「金融商品取引法」第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成27年4月1日から平成27年12月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

1. 財務諸表

(1)【貸借対照表】

期別	科目	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成27年12月31日)	
			内訳	金額 (千円)	内訳	金額 (千円)
	(資産の部)					
	流動資産					
	現金・預金	*1		3,627,221		2,461,060
	未収入金	*1		365,493		35,744
	未収委託者報酬			1,344,669		669,670
	未収運用受託報酬	*1		485,718		1,068,814
	その他未収収益	*1		956,895		985,696
	前払費用			10,799		15,484
	繰延税金資産			113,200		277,700
	その他			1,641		625
	流動資産計			6,905,640		5,514,794
	固定資産					
	投資その他の資産			349,128		352,325
	投資有価証券		11,241		2,538	
	繰延税金資産		317,886		329,787	
	ゴルフ会員権		20,000		20,000	
	固定資産計			349,128		352,325
	資産合計			7,254,769		5,867,120

期別	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成27年12月31日)	
		内訳	金額 (千円)	内訳	金額 (千円)
(負債の部)					
流動負債					
預り金			199,221		59,978
未払費用	*1		1,447,937		1,068,524
未払消費税			158,241		26,780
未払法人税等			718,078		148,723
賞与引当金			191,215		897,264
その他			20,114		8,572
			流動負債計		2,209,843
固定負債					
退職給付引当金			72,056		101,732
			固定負債計		101,732
負債合計					
			2,806,865		2,311,575
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			4,447,875		3,555,518
利益剰余金			2,247,875		1,355,518
利益準備金		550,000		550,000	
その他利益剰余金		1,697,875		805,518	
繰越利益剰余金		1,697,875		805,518	
評価・換算差額等					
その他有価証券評価差額金		28		25	
純資産合計					
			4,447,904		3,555,544
負債・純資産合計					
			7,254,769		5,867,120

(2) 【損益計算書】

期 別		前事業年度 〔自平成26年4月1日 至平成27年3月31日〕		当事業年度 〔自平成27年4月1日 至平成27年12月31日〕	
		内 訳	金 額 (千円)	内 訳	金 額 (千円)
科 目	注記 番号				
営業収益					
委託者報酬			8,887,301		5,553,570
運用受託報酬	*1*2		1,480,958		1,624,521
その他営業収益	*1*3		2,792,222		1,813,534
営業収益計			13,160,483		8,991,627
営業費用					
支払手数料			4,440,767		2,907,906
広告宣伝費			114,732		80,418
調査費			95,977		103,539
営業雑経費			187,450		139,777
通信費		9,060		8,818	
印刷費		54,330		66,460	
協会費		11,618		10,831	
その他		112,441		53,666	
営業費用計	*1		4,838,927		3,231,642
一般管理費					
給料			2,821,793		2,341,048
役員報酬		407,807		227,088	
給料・手当	*1	1,713,861		1,427,389	
賞与		700,125		686,570	
交際費			55,946		42,914
旅費交通費			100,577		93,339
租税公課			39,492		38,955
不動産賃借料			230,699		171,675
退職給付費用			125,024		162,671
事務委託費	*1		1,942,904		1,566,472
諸経費			70,858		61,351
一般管理費計			5,387,297		4,478,428
営業利益			2,934,258		1,281,556
営業外収益					
受取利息		394		135	
雑収入		188		154	
営業外収益計			582		290
営業外費用					
為替差損		55,300		26,139	
雑損失		122		3,029	
営業外費用計			55,423		29,168
経常利益			2,879,416		1,252,678
税引前当期純利益			2,879,416		1,252,678
法人税、住民税及び事業税			1,183,482		636,635
法人税等調整額			12,910		△ 176,400
当期純利益			1,683,023		792,443

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本					評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	利益剰余金			株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計				
			繰越利益剰余金					
当期首残高	2,200,000	550,000	1,537,651	2,087,651	4,287,651	-	-	4,287,651
当期中の変動額								
剰余金の配当			1,522,800	1,522,800	1,522,800			1,522,800
当期純利益			1,683,023	1,683,023	1,683,023			1,683,023
株主資本以外の項目の当期中の変動額（純額）						28	28	28
当期中の変動額合計			160,223	160,223	160,223	28	28	160,252
当期末残高	2,200,000	550,000	1,697,875	2,247,875	4,447,875	28	28	4,447,904

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）

(単位：千円)

	株主資本					評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	利益剰余金			株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計				
			繰越利益剰余金					
当期首残高	2,200,000	550,000	1,697,875	2,247,875	4,447,875	28	28	4,447,904
当期中の変動額								
剰余金の配当			1,684,800	1,684,800	1,684,800			1,684,800
当期純利益			792,443	792,443	792,443			792,443
株主資本以外の項目の当期中の変動額（純額）						2	2	2
当期中の変動額合計			892,356	892,356	892,356	2	2	892,359
当期末残高	2,200,000	550,000	805,518	1,355,518	3,555,518	25	25	3,555,544

[注 記 事 項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)

2. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員の賞与支払に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

退職給付引当金は役員及び従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務及び年金資産の見込み額に基づき、必要額を計上しております。

退職給付引当金のうち、役員分は次のとおりであります。

前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
2,528千円	4,069千円

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異の費用処理方法

数理計算上の差異は、発生年度に全額損益処理しております。

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 決算期変更

平成27年10月16日開催の臨時株主総会において、定款の一部変更を決議し、平成27年4月1日以後開始する当期の決算日を3月31日から12月31日に変更しております。これによりまして、当社の当事業年度は平成27年4月1日から平成27年12月31日までの9ヶ月となり、平成28年1月1日以後開始する事業年度より12ヶ月となります。

（貸借対照表関係）

*1 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれる関係会社に対する資産及び負債の内容は、次の通りであります。

（単位：千円）

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
現金・預金	1,305,956	654,515
未収入金	1,142	-
未収運用受託報酬	68,983	112,313
その他未収収益	221,501	185,464
未払費用	82,183	69,778

（損益計算書関係）

*1 関係会社との取引

各科目に含まれる関係会社に対する取引額は、次の通りであります。

（単位：千円）

	前事業年度 自平成26年4月1日 至平成27年3月31日	当事業年度 自平成27年4月1日 至平成27年12月31日
運用受託報酬	88,661	113,442
その他営業収益	419,532	277,883
営業雑経費 その他	59,889	42,371
人件費	18,538	5,675
事務委託費	288,634	309,330

*2 運用受託報酬には、次のものを含んでおります。

（単位：千円）

	前事業年度 自平成26年4月1日 至平成27年3月31日	当事業年度 自平成27年4月1日 至平成27年12月31日
投資助言報酬	63,133	40,571

*3 その他営業収益には、海外ファンドの販売資料及び運用報告書等の作成や翻訳など運用業務以外に関するサービスの提供に伴う報酬を計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	21,600	-	-	21,600

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,522,800	70,500	平成26年3月31日	平成26年6月28日

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

次のとおり、決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
第20期定時 株主総会	普通株式	利益剰余金	1,684,800	78,000	平成27年3月31日	第20期定時 株主総会の翌日

当事業年度（自平成27年4月1日至平成27年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	21,600	-	-	21,600

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,684,800	78,000	平成27年3月31日	平成27年6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

次のとおり、決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
第21期定時 株主総会	普通株式	利益剰余金	803,520	37,200	平成27年12月31日	第21期定時 株主総会の翌日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

現在、金融機関及びその他からの借入はありません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

未収委託者報酬は、既にファンドの純資産額に未払委託者報酬として織り込まれ、受託者によって分別保管された投資信託財産が裏付けとなっていることから、信用リスクはほとんどないものと考えています。

未収運用受託報酬につきましても、未収委託者報酬と同様に、年金信託勘定との投資一任契約により分別管理されている信託財産が裏付けとなっていることから、信用リスクはほとんどないものと考えています。

その他未収収益は、取引相手先を信用力の高い金融機関に限定しているため、信用リスクはほとんどないものと考えています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	3,627,221	3,627,221	-
未収入金	365,493	365,493	-
未収委託者報酬	1,344,669	1,344,669	-
未収運用受託報酬	485,718	485,718	-
その他未収収益	956,895	956,895	-
資産計	6,779,999	6,779,999	-
未払費用	1,447,937	1,447,937	-
未払法人税等	718,078	718,078	-
負債計	2,166,015	2,166,015	-

当事業年度（平成27年12月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

現金・預金	2,461,060	2,461,060	-
未収入金	35,744	35,744	-
未収委託者報酬	669,670	669,670	-
未収運用受託報酬	1,068,814	1,068,814	-
その他未収収益	985,696	985,696	-
資産計	5,220,985	5,220,985	-
未払費用	1,068,524	1,068,524	-
未払法人税等	148,723	148,723	-
負債計	1,217,247	1,217,247	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、すべて帳簿価額により表示しております。

(注) 2. 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度 (平成27年3月31日) (単位: 千円)

	1年以内	1年超
現金・預金	3,627,221	-
未収入金	365,493	-
未収委託者報酬	1,344,669	-
未収運用受託報酬	485,718	-
その他未収収益	956,895	-
合計	6,779,999	-

当事業年度 (平成27年12月31日) (単位: 千円)

	1年以内	1年超
現金・預金	2,461,060	-
未収入金	35,744	-
未収委託者報酬	669,670	-
未収運用受託報酬	1,068,814	-
その他未収収益	985,696	-
合計	5,220,985	-

(有価証券関係)

その他有価証券

前事業年度 (平成27年3月31日)

重要性がないため記載を省略しております。

当事業年度 (平成27年12月31日)

重要性がないため記載を省略しております。

(退職給付関係)

前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 採用している制度の概要

当社は規約型確定給付企業年金制度並びに確定拠出年金制度を採用しております。

当社の確定給付企業年金契約は、当社、UBS証券株式会社及びUBS銀行東京支店との共同結合契約であり、年金資産の計算は退職給付債務の比率によっております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位: 千円)

退職給付債務の期首残高	1,072,171
勤務費用	112,675
利息費用	6,298
数理計算上の差異の当期発生額	39,097
退職給付の支払額	157,163
過去勤務費用の当期発生額	-

退職給付債務の期末残高	1,073,079
-------------	-----------

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

年金資産の期首残高	948,351
期待運用収益	3,907
数理計算上の差異の当期発生額	65,966
事業主からの拠出額	139,960
退職給付の支払額	<u>157,163</u>
年金資産の期末残高	1,001,023

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

積立型制度の退職給付債務	1,073,079
年金資産	<u>1,001,023</u>
小計	72,056
非積立型制度の退職給付債務	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	72,056
退職給付引当金	<u>72,056</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	72,056

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

勤務費用	113,433
利息費用	5,540
期待運用収益	3,907
数理計算上の差異の費用処理額	26,869
過去勤務費用の費用処理額	-
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>88,196</u>

(注)上記の他、特別退職金20,456千円を退職給付費用として処理しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

債券	55%
株式	19%
その他	<u>26%</u>
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.68%

長期期待運用収益率 0.58%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、16,371千円でありました。

当事業年度（自平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）

1. 採用している制度の概要

当社は規約型確定給付企業年金制度並びに確定拠出年金制度を採用しております。

当社の確定給付企業年金契約は、当社、UBS証券株式会社及びUBS銀行東京支店との共同結合契約であり、年金資産の計算は退職給付債務の比率によっております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

退職給付債務の期首残高	1,073,079
勤務費用	92,794
利息費用	5,608
数理計算上の差異の当期発生額	23,166
退職給付の支払額	60,743
過去勤務費用の当期発生額	-
退職給付債務の期末残高	1,133,905

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

年金資産の期首残高	1,001,023
期待運用収益	3,329
数理計算上の差異の当期発生額	21,465
事業主からの拠出額	110,029
退職給付の支払額	60,743
年金資産の期末残高	1,032,173

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

積立型制度の退職給付債務	1,133,905
年金資産	1,032,173
小計	101,732
非積立型制度の退職給付債務	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	101,732
退職給付引当金	101,732
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	101,732

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：千円）

勤務費用	92,794
利息費用	5,608
期待運用収益	3,329
数理計算上の差異の費用処理額	44,631
過去勤務費用の費用処理額	-
確定給付制度に係る退職給付費用	139,705

(注) 上記の他、特別退職金8,175千円を退職給付費用として処理しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

債券	56%
株式	18%
その他	26%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.841%

長期期待運用収益率 0.58%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、14,790千円でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産の発生主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	4,465	-
未払事業所税	2,381	1,800
減価償却超過額	49,028	46,230
未払事業税	49,425	8,900
株式報酬費用	137,233	151,240
退職給付引当金	99,100	105,270
賞与引当金	56,927	266,960
その他	32,154	27,100
繰延税金資産小計	431,100	607,500
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	431,100	607,500
繰延税金負債		
その有価証券評価差額金	14	12
繰延税金負債合計	14	12
繰延税金資産純額	431,086	607,487

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	4.27%	4.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.36%	-%
その他	0.28%	0.99%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	41.55%	36.74%

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品・サービス区分は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域に関する情報

売上高

前事業年度（自平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

日本	米国	その他	合計
1,147,499千円	1,912,589千円	1,213,091千円	4,273,181千円

委託者報酬 8,887,301千円については、制度上顧客情報を知りえないため、含まれておりません。

当事業年度（自平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）

日本	米国	その他	合計
1,109,514千円	1,281,322千円	1,047,219千円	3,438,055千円

委託者報酬 5,553,570千円については、制度上顧客情報を知りえないため、含まれておりません。

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国または地域に分類しております。

(3) 主要な顧客に関する情報

前事業年度（自平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

相手先	売上高	関連するセグメント名
UBSグループ（*1）	2,966,974千円	投資運用

当事業年度（自平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）

相手先	売上高	関連するセグメント名
UBSグループ（*1）	2,132,091千円	投資運用

（注）委託者報酬については、制度上顧客情報を知りえないため、記載を省略しております。

（*1）UBSグループは、本店をスイスのパーゼルおよびチューリッヒに置き、世界の主要な金融センターを含む50カ国余で質の高い金融サービスを提供する、世界最大級の金融グループです。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

前事業年度（自平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(1) 親会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権の所 有(被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	UBS AG (ロンドン証券取引所 他上場)	スイス・ チューリッヒ	3.8億 スイス フラン	銀行、 証券業 務	(被所有) 直接 100%	金銭の預入 れ、資産運 用業務及び それに関す る事務委託 等、人件費	金銭の預入れ 増加 減少 運用受託報酬 その他営業収益 その他営業費用 事務委託費 人件費	5,824,070 4,718,854 88,661 419,532 59,889 288,634 18,538	現金・預金 未収入金 未収運用受託報酬 その他未収収益 未払費用	1,305,956 1,142 68,983 221,501 82,183

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 人件費は、出向者に対する実際支払額を基として決定しております。
- 取引条件の決定については、一般取引条件と同様に決定しております。

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(2) 兄弟会社等

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社の子会社等	UBS証券株式会社	東京都千代田区大手町	464億円	証券業	なし	人件費の立替 人件費、社会 保険料などの 立替	事務委託費 不動産関係費 人件費（受取）	309,864 202,840 80,974	未収入金 未払費用 その他流動資産	348,839 293,133 719
	UBS Global Asset Management (Australia) Ltd	オーストラリア・シドニー	20百万オーストラリアドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務 及び、それに関する事務委託等	その他営業収益 事務委託費	123,091 273,484	その他未収収益 未払費用	24,339 95,590
	UBS Global Asset Management (Singapore) Ltd	シンガポール	3.9百万シンガポールドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務 及び、それに関する事務委託等	その他営業収益 事務委託費	40,251 67,984	その他未収収益 未払費用	10,025 26,168
	UBS Global Asset Management (UK) Ltd	英国・ロンドン	125百万英国ポンド	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務 及び、それに関する事務委託等	運用受託報酬 その他営業収益 事務委託費	11,447 334,687 302,386	その他未収収益 未払費用	220,013 138,670
	UBS Global Asset Management Funds Ltd	英国・ロンドン	26百万英国ポンド	資産運用業	なし	兼業業務	その他営業収益	22,129	その他未収収益	22,129
	UBS Global Asset Management (Americas) Inc.	米国・ウィルミントン	1米国ドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務 及び、それに関する事務委託等	運用受託報酬 その他営業収益 事務委託費	24,381 336,829 263,312	未収運用受託報酬 その他未収収益 未払費用	6,490 104,027 68,625
	UBS Alternative and Quantitative Investments LLC	米国・ウィルミントン	10万米国ドル	資産運用業	なし	兼業業務	その他営業収益	948,954	その他未収収益	252,642
	UBS O'Connor LLC	米国・ドーバー	1百万米国ドル	資産運用業	なし	資産運用業務 及び兼業業務	その他営業収益	446,346	その他未収収益	53,466
	UBS Global Asset Management (HongKong) Limited	香港	150百万香港ドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務 及び、それに関する事務委託等	その他営業収益 事務委託費	108,575 34,482	その他未収収益 未払費用	38,950 9,033

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 事務所賃借料は、外部貸主への実際支払額を基に面積比で決定しております。
人件費は、出向者に対する実際支払額を基として決定しております。
- 立替費用は、第三者に支払われた実際支払額を基として決定しております。
- 取引条件の決定については、一般取引条件と同様に決定しております。

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

当事業年度（自平成27年4月1日至平成27年12月31日）

(1) 親会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
----	--------	-----	----------	-----------	---------------	-----------	-------	----------	----	----------

親会社	UBS AG	スイス・チューリッヒ	3.8億スイスフラン	銀行、証券業務	(被所有) 100%	金銭の預入れ、資産運用業務及びそれに関する事務委託等、人件費	金銭の預入れ 増加 減少	2,623,556 3,211,059	現金・預金	654,515
							運用受託報酬 その他営業収益 その他営業費用 事務委託費 人件費	113,442 277,883 42,371 309,330 5,675	未収運用受託報酬 その他未収収益 未払費用	112,313 185,464 69,778

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 人件費は、出向者に対する実際支払額を基として決定しております。
2. 取引条件の決定については、一般取引条件と同様に決定しております。

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(2) 兄弟会社等

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親	UBS Switzerland AG	スイス・チューリッヒ	10百万スイスフラン	銀行業務	なし	金銭の預入れ	金銭の預入れ 増加 減少	329,122 272,223	現金・預金	120,837
	UBS証券株式会社	東京都千代田区大手町	464億円	証券業	なし	人件費の立替 人件費、社会保険料などの立替	事務委託費 不動産関係費 人件費(受取)	206,399 147,389 37,079	未収入金 未払費用	11,145 249,590
会	UBS Asset Management (Australia) Ltd	オーストラリア・シドニー	20百万オーストラリアドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務及び、それに関する事務委託等	その他営業収益 事務委託費	91,255 189,342	その他未収収益 未払費用	28,514 101,333
	UBS Asset Management (Singapore) Ltd	シンガポール	3.9百万シンガポールドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務及び、それに関する事務委託等	運用受託報酬 その他営業収益 事務委託費 人件費(受取)	14,310 28,841 44,417 2,267	未収運用受託報酬 その他未収収益 未払費用	13,270 15,657 13,540
の	UBS Asset Management (UK) Ltd	英国・ロンドン	125百万英国ポンド	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務及び、それに関する事務委託等	その他営業収益 事務委託費	77,393 368,307	その他未収収益 未払費用	42,044 129,143
	UBS Asset Management Funds Ltd	英国・ロンドン	26百万英国ポンド	資産運用業	なし	兼業業務	その他営業収益	82,080	その他未収収益	101,760
子	UBS Asset Management (Americas) Inc.	米国・ウィルミントン	1米ドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務及び、それに関する事務委託等	運用受託報酬 その他営業収益 事務委託費	139,632 257,943 155,929	未収運用受託報酬 その他未収収益 未払費用	5,410 320,548 50,018
	UBS Alternative and Quantitative Investments LLC	米国・ウィルミントン	10万米ドル	資産運用業	なし	兼業業務	その他営業収益	766,672	その他未収収益	245,202
社	UBS O'Connor LLC	米国・ドーバー	1百万米ドル	資産運用業	なし	資産運用業務及び兼業業務	その他営業収益	110,513	その他未収収益	31,530
	UBS Asset Management (HongKong) Limited	香港	150百万香港ドル	資産運用業	なし	兼業業務 資産運用業務及び、それに関する事務委託等	その他営業収益 事務委託費	116,636 31,745	その他未収収益 未払費用	5,044 9,845

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 事務所賃借料は、外部貸主への実際支払額を基に面積比で決定しております。
人件費は、出向者に対する実際支払額を基として決定しております。
2. 立替費用は、第三者に支払われた実際支払額を基として決定しております。
3. 取引条件の決定については、一般取引条件と同様に決定しております。

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年12月31日)
1株当たり純資産額	205,921円48銭	164,608円54銭
1株当たり当期純利益金額	77,917円77銭	36,687円18銭

なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

(注) 1. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年12月31日)
当期純利益(千円)	1,683,023	792,443
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	1,683,023	792,443
普通株式の期中平均株式数(株)	21,600	21,600

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（後略）

<訂正後>

(1) 定款の変更

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

臨時株主総会の決議により、2015年10月16日付けで事業年度の変更に関する定款の変更を行いました。

（後略）

独立監査人の監査報告書

平成28年3月14日

UBSアセット・マネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているUBSアセット・マネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成27年12月31日までの第21期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、UBSアセット・マネジメント株式会社の平成27年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1 . 上記は、当社（本書提出会社）が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年 4月 28日

UBSアセット・マネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているUBSグローバル・アロケーション Cコース（年4回決算型・円ヘッジコース）の平成27年10月9日から平成28年3月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、UBSグローバル・アロケーション Cコース（年4回決算型・円ヘッジコース）の平成28年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

UBSアセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は、当社（本書提出会社）が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化した
ものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年 4月 28日

UBSアセット・マネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているUBSグローバル・アロケーション Dコース（年4回決算型・ユーロコース）の平成27年10月9日から平成28年3月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、UBSグローバル・アロケーション Dコース（年4回決算型・ユーロコース）の平成28年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

UBSアセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は、当社（本書提出会社）が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化した
ものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[前へ](#)