



# UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

ーワールド(米ドル)

クラスP-acc受益証券

クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券

ーグロース(米ドル)

クラスP-acc受益証券

クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券

---

ルクセンブルグ籍オープンエンド契約型追加型外国投資信託

## 運用報告書 (全体版)

作成対象期間 第26期  
(2016年2月1日～2017年1月31日)

### 受益者のみなさまへ

---

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

UBS(Lux)ストラテジー・ファンド(以下「ファンド」といいます。)は、このたび、第26期の決算を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

管理会社

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

代行協会員

UBS証券株式会社

ファンドの仕組みは、以下のとおりです。

ファンド形態	ルクセンブルグ籍オープンエンド契約型追加型外国投資信託
信託期間	無期限
繰上償還	<p>ー管理会社は、受益者の利益を考慮に入れた上で、管理会社もしくはファンドの保護のために、または投資方針を理由に、清算が適切または必要であるとみなされる場合に限り、ファンド、サブ・ファンドまたは受益証券クラスを清算する権限を有しています。また、法律に規定のある場合および管理会社が清算される場合には、ファンドを清算しなければなりません。</p> <p>ーあるサブ・ファンドまたはあるサブ・ファンドの受益証券クラスの純資産総額が、サブ・ファンドまたは受益証券クラスの経済的に効率的な運用に必要である最低額を割りこむか、もしくはその水準に満たない場合、政治、経済もしくは金融環境に著しい変化がある場合、または合理化の一環として、管理会社は、評価日または決定の効力発生時の純資産価額(実際の投資の換金率および費用を考慮します。)で、影響を受ける受益証券クラスの全ての受益証券を買い戻すか、または消却することを決定できます。</p>
運用方針	ファンドの投資目的は、元本の保全と純資産の流動性を十分考慮しながら、高い投資リターンを収めることです。
主な投資対象	<p>サブ・ファンドは、それぞれの純資産を、世界各国の株式、協同投資証券および利益参加証券等のその他の株式関連資本持分、米国預託証券(ADR)および海外預託証券(GDR)(参加証券および持分権)、コモディティ短期債、配当権証券、社債、債券、類似の固定利付証券および変動利付証券(債務証券および債権)、あらゆる種類の資産担保証券、転換社債、転換債券、ワラント連動債および有価証券のワラント、ならびに法的に認められるすべての資産に投資します。</p> <p>UBS(Lux)ストラテジー・ファンドーイールド(米ドル)は、利息が付される資産を中心として、世界中で幅広く分散投資を行い、投資方針に従い、ハイイールド債、新興市場債およびコモディティに投資することができます。UBS(Lux)ストラテジー・ファンドーグロース(米ドル)は、資産の大部分を基本的に株式に投資しながら債券および株式に対して幅広く分散投資を行い、投資方針に従い、ハイイールド債、新興市場債およびコモディティに投資することができます。</p>
ファンドの運用方法	各サブ・ファンドの投資は各サブ・ファンドのパフォーマンスに最適であると考えられる通貨で行われ、基準通貨に関してアクティブに運用されます。各サブ・ファンドは、先物(先物、先渡しおよびノンデリバブル・フォワード(NDF))ならびにオプションの売買、金融商品に対するスワップ取引(スワップ、トータル・リターン・スワップ、クレジット・デフォルト・スワップ)の締結、ならびに投資目的およびヘッジ目的で有価証券に対するオプションを含む取引を行うことができます。

<p>主な投資制限</p>	<p>○リスク分散の原則</p> <p>リスク分散の原則に従い、管理会社は、一サブ・ファンドの純資産額の10%を超えて同一金融機関の有価証券または短期金融商品に投資できず、また、一サブ・ファンドの純資産額の20%を超えて同一金融機関の預金に投資できない等の制限を課されています（ただし、一定の例外があります。）。</p> <p>○投資制限</p> <p>管理会社は、以下の行為をしてはなりません。また、管理会社は、受益者の利益に留意しつつ、いつでも投資制限を追加する権限を有しています。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>－継続的な販売が何らかの契約上の取決めにより制限される有価証券を、ファンドのために取得すること。</li> <li>－管理会社が、または、管理会社が運用する他の投資信託と共同で、当該発行体の経営に重大な影響を及ぼす権利を行使できるような議決権付の株式を取得すること。</li> <li>－以下の割合を超えて取得すること（一定の例外があります。）。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 同一発行体の議決権のない株式、債務証券または短期金融商品の10%</li> <li>・ 同一UCITSまたはUCIの受益証券の25%</li> </ul> </li> <li>－一定の商品の空売りをを行うこと。</li> <li>－貴金属またはそれに関連する証券を取得すること。</li> <li>－不動産への投資、および商品または商品契約の売買。</li> <li>－借入れを行うこと（一定の例外があります。）。</li> <li>－第三者のために借入れを認めること、または保証人になること。</li> </ul>
<p>分配方針</p>	<p>管理会社は、ファンドの約款第10条に従い、年次決算の終了後に、各サブ・ファンドまたは受益証券クラスが分配金を支払うか、およびその金額を決定します。ファンドの純資産が分配により2010年法の定めるファンド資産の最低額を下回ってはなりません。分配が行われる場合、会計年度の終了（決算期は毎年1月31日です。）から4か月以内に支払が行われます。分配の一部またはすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。</p>

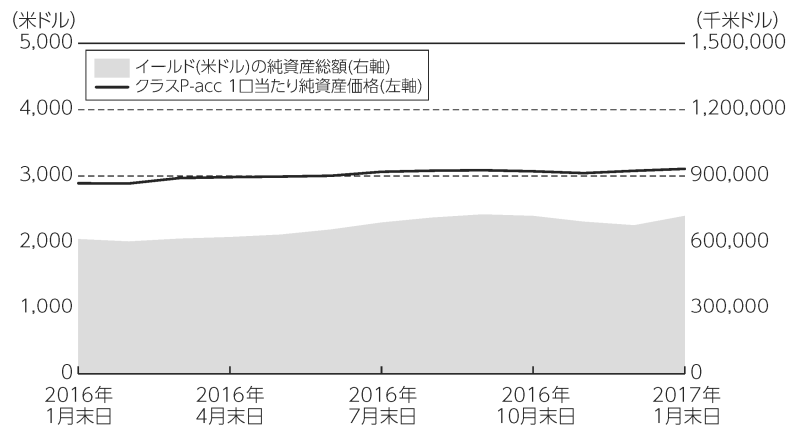
## I. 運用の経過等

### (1) 当期の運用の経過および今後の運用方針

#### ■当期の1口当たり純資産価格等の推移について

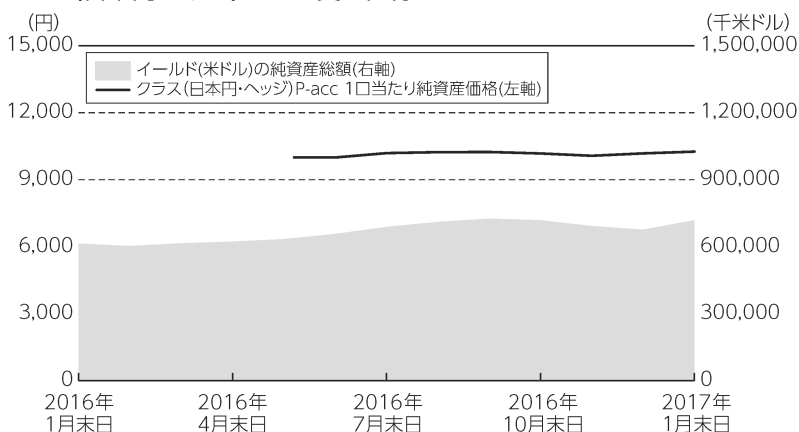
##### イールド(米ドル)

##### クラスP-acc受益証券



第25期末の1口当たり純資産価格	2,890.07米ドル
第26期末の1口当たり純資産価格	3,107.54米ドル
騰落率	7.52%

##### クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券



当初発行価格	10,000円
第26期末の1口当たり純資産価格	10,262円
騰落率	2.62%

(注1) 騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして算出しています。以下、同じです。

(注2) 日本においては、現在、「イールド(米ドル)」および「グロース(米ドル)」(以下、個別にまたは総称して「サブ・ファンド」といいます。)のクラスP-acc受益証券およびクラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券が販売されています。

(注3) クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券は、2017年6月6日に設定されました。クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券の第26期中の騰落率は、当初発行価格(10,000円)を基準に算出しています。以下、同じです。

(注4) 各サブ・ファンドのクラスP-acc受益証券およびクラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券については、分配金の支払いが行われていません。

(注5) サブ・ファンドの購入価額により課税条件は異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。以下、同じです。

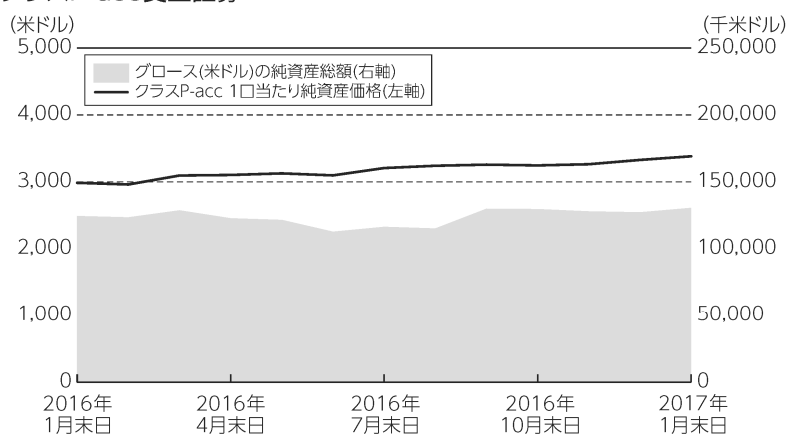
(注6) サブ・ファンドにベンチマークは設定されていません。以下、同じです。

#### 1口当たり純資産価格の主な変動要因

後記「投資環境およびポートフォリオについて」の<ポートフォリオ>をご参照ください。

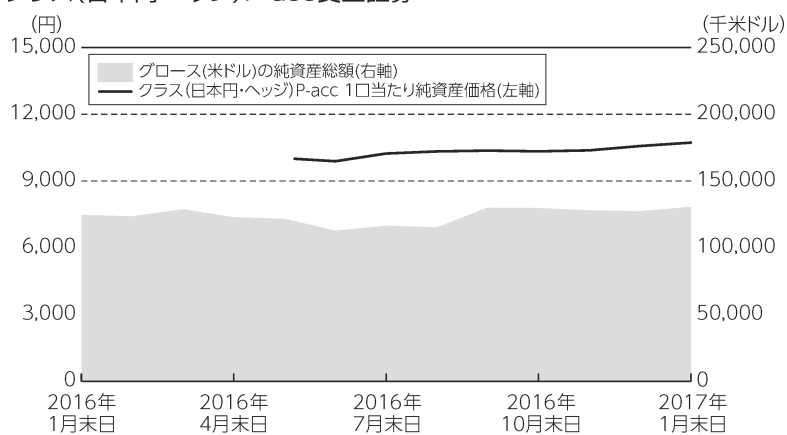
## グロース(米ドル)

### クラスP-acc受益証券



第25期末の1口当たり純資産価格	2,986.89米ドル
第26期末の1口当たり純資産価格	3,383.29米ドル
騰落率	13.27%

### クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券



当初発行価格	10,000円
第26期末の1口当たり純資産価格	10,727円
騰落率	7.27%

## 1口当たり純資産価格の主な変動要因

後記「投資環境およびポートフォリオについて」の<ポートフォリオ>をご参照ください。

## ■分配金について

該当事項はありません。

## ■投資環境およびポートフォリオについて

### イールド（米ドル）

#### <投資環境>

当期はサプライズが多くありました。当期期初は、中国の主要経済指標の低迷と、当期半ばに行われたイギリスの国民投票を巡る不透明感が響いて株式市場は不安定でした。また、11月に行われた米大統領選で、ドナルド・トランプ氏が勝利を収めたことを受けて、市場は値上がりし、多くの投資家が経済政策に期待を寄せました。主要市場が総じて値上がりした12月は、株式専門の投資家の運用実績が、特に好調でした。一方、債券市場は、非常に強弱交錯でした。

#### <ポートフォリオ>

当サブ・ファンドは、当期、プラスのリターンを収めました。ハイイールド債や株式等の高リスクの投資対象が、1口当たり純資産価格を押し上げました。スイス株式の投資配分のみが、マイナス寄与に終わりました。

### グロース（米ドル）

#### <投資環境>

当期はサプライズが多くありました。当期期初は、中国の主要経済指標の低迷と、当期半ばに行われたイギリスの国民投票を巡る不透明感が響いて株式市場は不安定でした。また、11月に行われた米大統領選で、ドナルド・トランプ氏が勝利を収めたことを受けて、市場は値上がりし、多くの投資家が経済政策に期待を寄せました。主要市場が総じて値上がりした12月は、株式専門の投資家の運用実績が、特に好調でした。一方、債券市場は、非常に強弱交錯でした。

#### <ポートフォリオ>

当サブ・ファンドは、当期、プラスのリターンを収めました。ハイイールド債や株式等の高リスクの投資対象が、1口当たり純資産価格を押し上げました。スイス株式の投資配分のみが、マイナス寄与に終わりました。

## ■投資の対象とする有価証券の主な銘柄

当期末現在における有価証券の主な銘柄については、後記「Ⅲ. ファンドの経理状況（3）投資有価証券明細表等」をご参照ください。

## ■今後の運用方針

### イールド（米ドル）

投資方針および投資手法を変更する予定はありません。

### グロース（米ドル）

投資方針および投資手法を変更する予定はありません。

## (2) 費用の明細

サブ・ファンド	上限報酬料率	その他の費用（当期）
イールド（米ドル）	年率 1.440%	0.07%
グロース（米ドル）	年率 1.800%	0.07%

上限定率管理報酬は、各サブ・ファンドの管理事務、ポートフォリオ運用および販売に関して、ならびに保管受託銀行のすべての職務の対価として、各サブ・ファンド資産から支払われます。

その他の費用には、資産の売買のための各サブ・ファンドの資産の管理に関する一切の追加費用、各サブ・ファンドの設立、変更、清算および合併に関する費用、その他の報酬および費用や各サブ・ファンドの収益および資産に課せられる一切の税金（ルクセンブルグの年次税）等が含まれます。

（注）報酬については、目論見書に定められている料率または金額を記しています。「その他の費用（当期）」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、その他の費用（当期）の金額を各サブ・ファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

## Ⅱ. 直近10期の運用実績

### (1) 純資産の推移

下記各会計年度末および第26会計年度中における各月末の純資産の推移は次のとおりです。

(注1) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」といいます。)の円貨換算は、2017年5月31日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=110.96円)によります。

(注2) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設定されていますが、ファンドの受益証券は、米ドル建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行います。

(注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してあります。したがって、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、それに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。したがって、本書中の同一の情報につき異なった円貨表示がなされている場合があります。

(イールド(米ドル))

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
第17会計年度末 (2008年1月31日)	443,644	49,227	P - a c c	2,430.65	269,705
第18会計年度末 (2009年1月31日)	328,683	36,471	P - a c c	2,185.38	242,490
第19会計年度末 (2010年1月31日)	328,713	36,474	P - a c c	2,441.97	270,961
第20会計年度末 (2011年1月31日)	327,195	36,306	P - a c c	2,597.06	288,170
第21会計年度末 (2012年1月31日)	304,507	33,788	P - a c c	2,632.53	292,106
第22会計年度末 (2013年1月31日)	331,008	36,729	P - a c c	2,750.29	305,172
第23会計年度末 (2014年1月31日)	486,350	53,965	P - a c c	2,836.21	314,706
第24会計年度末 (2015年1月31日)	667,100	74,021	P - a c c	3,009.79	333,966
第25会計年度末 (2016年1月31日)	614,299	68,163	P - a c c	2,890.07	320,682
第26会計年度末 (2017年1月31日)	719,205	79,803	P - a c c	3,107.54	344,813
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,262円	
2016年2月末日	603,500	66,964	P - a c c	2,887.12	320,355
3月末日	616,268	68,381	P - a c c	2,968.82	329,420
4月末日	623,358	69,168	P - a c c	2,982.50	330,938
5月末日	634,556	70,410	P - a c c	2,990.88	331,868
6月末日	657,672	72,975	P - a c c	3,003.44	333,262
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,000円	
7月末日	689,214	76,475	P - a c c	3,063.14	339,886
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,195円	



	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
8月末日	711,410	78,938	P - a c c	3,079.90	341,746
			(日本円・ヘッジ) P - a c c		10,238円
9月末日	726,013	80,558	P - a c c	3,087.03	342,537
			(日本円・ヘッジ) P - a c c		10,246円
10月末日	719,065	79,787	P - a c c	3,070.71	340,726
			(日本円・ヘッジ) P - a c c		10,180円
11月末日	693,006	76,896	P - a c c	3,043.09	337,661
			(日本円・ヘッジ) P - a c c		10,076円
12月末日	676,817	75,100	P - a c c	3,078.03	341,538
			(日本円・ヘッジ) P - a c c		10,183円
2017年1月末日	719,205	79,803	P - a c c	3,107.54	344,813
			(日本円・ヘッジ) P - a c c		10,262円

(注1) 本サブ・ファンドは、1991年9月13日から運用を開始しました。

(注2) クラス(日本円・ヘッジ) P - a c c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。

(注3) 2008年4月以降の各取引日に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合があります。以下同じです。

(注4) 「1口当たりの純資産価格」は日本で販売されるクラスのみ記載しています。以下同じです。

(グロース (米ドル) )

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
第17会計年度末 (2008年1月31日)	166,337	18,457	P - a c c	2,570.79	285,255
第18会計年度末 (2009年1月31日)	93,082	10,328	P - a c c	1,772.78	196,708
第19会計年度末 (2010年1月31日)	92,098	10,219	P - a c c	2,232.68	247,738
第20会計年度末 (2011年1月31日)	90,955	10,092	P - a c c	2,512.85	278,826
第21会計年度末 (2012年1月31日)	77,753	8,627	P - a c c	2,470.40	274,116
第22会計年度末 (2013年1月31日)	76,194	8,454	P - a c c	2,694.22	298,951
第23会計年度末 (2014年1月31日)	88,627	9,834	P - a c c	2,941.65	326,405
第24会計年度末 (2015年1月31日)	109,110	12,107	P - a c c	3,174.82	352,278
第25会計年度末 (2016年1月31日)	124,535	13,818	P - a c c	2,986.89	331,425
第26会計年度末 (2017年1月31日)	130,621	14,494	P - a c c	3,383.29	375,410
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,727円	
2016年2月末日	123,564	13,711	P - a c c	2,962.14	328,679
3月末日	128,783	14,290	P - a c c	3,096.22	343,557
4月末日	122,858	13,632	P - a c c	3,104.26	344,449
5月末日	121,628	13,496	P - a c c	3,127.89	347,071
6月末日	112,825	12,519	P - a c c	3,098.12	343,767
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	9,890円	
7月末日	116,463	12,923	P - a c c	3,207.56	355,911
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,237円	
8月末日	115,254	12,789	P - a c c	3,241.75	359,705
			(日本円・ヘッジ) P - a c c	10,332円	

	純資産総額		1口当たりの純資産価格		
	千米ドル	百万円	受益証券の クラス	米ドル	円
9月末日	129,987	14,423	P-a-c-c	3,258.21	361,531
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,368円	
10月末日	129,705	14,392	P-a-c-c	3,246.94	360,280
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,335円	
11月末日	128,019	14,205	P-a-c-c	3,264.61	362,241
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,380円	
12月末日	127,337	14,129	P-a-c-c	3,328.91	369,376
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,574円	
2017年1月末日	130,621	14,494	P-a-c-c	3,383.29	375,410
			(日本円・ヘッジ) P-a-c-c	10,727円	

(注1) 本サブ・ファンドは、1991年9月13日から運用を開始しました。

(注2) クラス(日本円・ヘッジ) P-a-c-c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。

## (2) 分配の推移

該当事項はありません。

## (3) 販売及び買戻しの実績

下記会計年度における販売および買戻しの実績ならびに下記会計年度末日現在の発行済口数は次のとおりです。

(イールド (米ドル) )

	受益証券のクラス	販売口数	買戻し口数	発行済口数
第17会計年度	P - a c c	11,924.692 (0)	46,462.329 (0)	158,745.854 (0)
第18会計年度	P - a c c	7,540.899 (0)	35,210.819 (0)	131,075.934 (0)
第19会計年度	P - a c c	16,273.121 (0)	29,072.662 (0)	118,276.393 (0)
第20会計年度	P - a c c	23,460.705 (0)	31,823.661 (0)	109,913.437 (0)
第21会計年度	P - a c c	14,331.469 (0)	23,365.962 (0)	100,878.944 (0)
第22会計年度	P - a c c	21,947.977 (0)	18,429.427 (0)	104,397.494 (0)
第23会計年度	P - a c c	61,876.909 (0)	18,224.731 (0)	148,049.672 (0)
第24会計年度	P - a c c	68,481.207 (0)	32,701.166 (0)	183,829.713 (0)
第25会計年度	P - a c c	34,060.365 (0)	45,635.732 (0)	172,254.346 (0)
第25会計年度	P - a c c	34,060.365 (0)	45,635.732 (0)	172,254.346 (0)
第26会計年度	P - a c c	54,884.074 (1,761)	59,364.155 (0)	167,774.265 (1,801)
	(日本円・ヘッジ) P - a c c	104,936 (63,460)	0 (0)	104,936 (63,460)

(注1) ( ) 内の数字は本邦内における販売、買戻しならびに発行済口数です。以下同じです。

(注2) クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。

(注3) 第26会計年度中に、クラス P - a c c 受益証券40口が海外から移管されました。

( グロース (米ドル) )

	受益証券のクラス	販売口数	買戻し口数	発行済口数
第17会計年度	P - a c c	4,823.326 (0)	13,124.195 (0)	64,702.604 (0)
第18会計年度	P - a c c	3,193.488 (0)	15,390.021 (0)	52,506.071 (0)
第19会計年度	P - a c c	3,193.694 (0)	14,449.569 (0)	41,250.196 (0)
第20会計年度	P - a c c	1,920.408 (0)	6,974.777 (0)	36,195.827 (0)
第21会計年度	P - a c c	2,074.714 (0)	6,796.664 (0)	31,473.877 (0)
第22会計年度	P - a c c	2,535.439 (0)	5,728.813 (0)	28,280.503 (0)
第23会計年度	P - a c c	7,957.208 (0)	6,109.401 (0)	30,128.310 (0)
第24会計年度	P - a c c	10,266.267 (0)	6,073.226 (0)	34,321.351 (0)
第25会計年度	P - a c c	16,514.335 (0)	9,963.544 (0)	40,872.142 (0)
第26会計年度	P - a c c	11,384.566 (47)	16,920.359 (0)	35,336.349 (47)
	(日本円・ヘッジ) P - a c c	17,768.153 (12,900)	0 (0)	17,768.153 (12,900)

(注) クラス (日本円・ヘッジ) P - a c c 受益証券は、2016年6月6日に設定されました。

### Ⅲ. ファンドの経理状況

#### 財務諸表

- a. ファンドの直近会計年度の日本語の財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の財務書類を翻訳したものである。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第131条第5項ただし書の規定の適用によるものである（ただし、円換算部分を除く。）。
- b. 原文の財務書類は、UBS (Lux) ストラテジー・ファンドおよびすべてのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において原文の財務書類については、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを記載し、日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。ただし、「財務書類に対する注記」については、原文は全文を記載し、日本語はイールド（米ドル）およびグロース（米ドル）に関連する部分のみを翻訳している。
- c. ファンドの原文の財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）であるアーンスト・アンド・ヤング・ソシエテ・アノニムから監査証明に相当すると認められる証明を受けており、当該監査証明に相当すると認められる証明に係る監査報告書に相当するもの（訳文を含む。）が当該財務書類に添付されている。
- d. ファンドの原文の財務書類は、ユーロおよび米ドルで表示されている。日本語の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2017年5月31日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝123.95円、1米ドル＝110.96円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

## 独立監査人の報告書

UBS (Lux) ストラテジー・ファンドの受益者各位  
ルクセンブルグ、L-1855、J. Fケネディ通り33A番

我々は、UBS (Lux) ストラテジー・ファンドおよびその各サブ・ファンドの、2017年1月31日現在の純資産計算書、投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表ならびに同日に終了した年度の運用計算書、純資産変動計算書ならびに重要な会計方針の概要、その他の財務書類に対する注記で構成される財務書類を監査した。

### 財務書類に対する管理会社の取締役会の責任

管理会社の取締役会は、財務書類の作成に関してのルクセンブルグの法律および規則の要件に従って、本財務書類の作成および公正な表示、ならびに不正または誤謬による重大な虚偽記載がない財務書類の作成および表示を可能にするために必要であると管理会社の取締役会が判断する内部統制について責任を負う。

### 公認の監査人の責任

我々の責任は、我々の監査に基づいて本財務書類に対し意見を表明することである。我々は、「金融監督委員会」により採用された国際監査基準に従って監査を行った。これらの基準は、倫理的な要求の遵守および財務書類についての重要な虚偽記載が無いことの合理的な確証を得るための監査計画の立案とその実施を要求している。

監査は、財務書類中の金額および開示に関する監査証拠を得るための手続の実施を含んでいる。選択された手続は公認の監査人の判断に依拠しており、不正または誤謬に関わらず財務書類の重要な虚偽記載のリスク評価を含む。これらのリスク評価を行うにあたり、公認の監査人は、現状において適切な監査手続を策定するため事業体の財務書類の作成と適正表示に関する内部統制を検討するが、事業体の内部統制の有効性に対して意見を述べることを目的としていない。また、監査は、採用された会計基準の適切性および管理会社の取締役会によって為された会計見積の合理性についての評価とともに財務書類の全体的な表示に関する評価も含んでいる。

我々は、我々が入手した監査証拠が、監査意見表明のための十分かつ適切な基礎を提供しているものと確信している。

### 意見

我々の意見によれば、本財務書類の作成に関してのルクセンブルグの法律および規則の要件に従って、財務書類がUBS (Lux) ストラテジー・ファンドおよびその各サブ・ファンドの、2017年1月31日現在の財政状態ならびに同日に終了した年度の運用成績および純資産の変動を真正かつ公正に表示している。

## その他

年次報告書に含まれている補足情報は、上記基準に従った特定の監査手続きの対象ではなく、我々の監査との関連においてのみ検討した。従って、我々にかかる情報についての意見を表明するものではない。だが、我々は、財務書類との関連で全体として見た場合、かかる情報に関して特に申し述べる意見はない。

ルクセンブルグ、2017年5月29日

アーンスト・アンド・ヤング・  
ソシエテ・アノニム  
公認の監査法人

[署名]

N. ファバー



# Independent auditor's report

To the Unitholders of

## **UBS (Lux) Strategy Fund**

33A, avenue J.F. Kennedy,  
L-1855 Luxembourg

We have audited the accompanying financial statements of UBS (Lux) Strategy Fund and of each of its subfunds, which comprise the statement of net assets and the statement of investments in securities and other net assets as of 31 January 2017 and the statement of operations and the statement of changes in net assets for the year then ended, and a summary of significant accounting policies and other explanatory notes to the financial statements.

### **Board of Directors of the Management Company's responsibility for the financial statements**

The Board of Directors of the Management Company is responsible for the preparation and fair presentation of these financial statements in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation of the financial statements and for such internal control as the Board of Directors of the Management Company determines is necessary to enable the preparation and presentation of financial statements that are free from material misstatement, whether due to fraud or error.

### **Responsibility of the réviseur d'entreprises agréé**

Our responsibility is to express an opinion on these financial statements based on our audit. We conducted our audit in accordance with International Standards on Auditing as adopted by the "Commission de Surveillance du Secteur Financier". Those standards require that we comply with ethical requirements and plan and perform the audit to obtain reasonable assurance whether the financial statements are free from material misstatement.

An audit involves performing procedures to obtain audit evidence about the amounts and disclosures in the financial statements. The procedures selected depend on the réviseur d'entreprises agréé's judgment, including the assessment of the risks of material misstatement of the financial statements, whether due to fraud or error. In making those risk assessments, the réviseur d'entreprises agréé considers internal control relevant to the entity's preparation and fair presentation of the financial statements in order to design audit procedures that are appropriate in the circumstances, but not for the purpose of expressing an opinion on the effectiveness of the entity's internal control. An audit also includes evaluating the appropriateness of accounting policies used and the reasonableness of accounting estimates made by the Board of Directors of the Management Company, as well as evaluating the overall presentation of the financial statements.

We believe that the audit evidence we have obtained is sufficient and appropriate to provide a basis for our audit opinion.

## **Opinion**

In our opinion, these financial statements give a true and fair view of the financial position of UBS (Lux) Strategy Fund and of each of its subfunds as of 31 January 2017, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation of the financial statements.

## **Others**

Supplementary information included in the annual report has been reviewed in the context of our mandate but has not been subject to specific audit procedures carried out in accordance with the standards described above. Consequently, we express no opinion on such information. However, we have no observation to make concerning such information in the context of the financial statements taken as a whole.

Luxembourg, 29 May 2017

ERNST & YOUNG  
Société Anonyme  
Cabinet de révision agréé

N. Faber

# Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilhaber des

## **UBS (Lux) Strategy Fund**

33A, avenue J.F. Kennedy,  
L-1855 Luxemburg

Wir haben den beigefügten Jahresabschluss des UBS (Lux) Strategy Fund und seiner jeweiligen Subfonds geprüft, der aus der Nettovermögensaufstellung, der Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 31. Januar 2017, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie aus einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden und den sonstigen Erläuterungen zum Jahresbericht besteht.

### **Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss**

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die er als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben ist, unabhängig davon, ob diese aus Unrichtigkeiten oder Verstößen resultieren.

### **Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé**

In unserer Verantwortung liegt es, auf der Grundlage unserer Abschlussprüfung über diesen Jahresabschluss ein Prüfungsurteil zu erteilen. Wir führten unsere Abschlussprüfung nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier angenommenen internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing) durch. Diese Standards verlangen, dass wir die beruflichen Verhaltensanforderungen einhalten und die Prüfung dahingehend planen und durchführen, dass mit hinreichender Sicherheit erkannt werden kann, ob der Jahresabschluss frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben ist.

Eine Abschlussprüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zum Erhalt von Prüfungsnachweisen für die im Jahresabschluss enthaltenen Wertansätze und Informationen. Die Auswahl der Prüfungshandlungen obliegt der Beurteilung des Réviseur d'entreprises agréé ebenso wie die Bewertung des Risikos, dass der Jahresabschluss wesentliche unzutreffende Angaben aufgrund von Unrichtigkeiten oder Verstößen enthält. Im Rahmen dieser Risikoeinschätzung berücksichtigt der Réviseur d'entreprises agréé das für die Aufstellung und die sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses eingerichtete interne Kontrollsystem, um die unter diesen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch um eine Beurteilung der Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Eine Abschlussprüfung umfasst auch die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und -methoden und der Vertretbarkeit der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ermittelten geschätzten Werte in der Rechnungslegung sowie die Beurteilung der Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

## Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des UBS (Lux) Strategy Fund und seiner jeweiligen Subfonds per 31. Januar 2017 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

## Sonstiges

Die im Jahresbericht enthaltenen ergänzenden Angaben wurden von uns im Rahmen unseres Auftrags durchgesehen, waren aber nicht Gegenstand besonderer Prüfungshandlungen nach den oben beschriebenen Standards. Unser Prüfungsurteil bezieht sich daher nicht auf diese Angaben. Im Rahmen der Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses haben uns diese Angaben keinen Anlass zu Anmerkungen gegeben.

Luxemburg, 29. Mai 2017

ERNST & YOUNG  
Société Anonyme  
Cabinet de révision agréé



N. Faber

## (1) 貸借対照表

### UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

#### 連結純資産計算書

	ユーロ	千 円
	2017年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	7,594,982,203.10	941,398,044
投資有価証券、未実現評価(損)益	862,172,107.98	106,866,233
投資有価証券合計(注1)	8,457,154,311.08	1,048,264,277
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	180,219,175.08*	22,338,167
その他の流動資産(委託証拠金)	28,462,528.15	3,527,930
有価証券売却未収金(注1)	22,116,529.66	2,741,344
発行受益証券未収金	24,751,351.99	3,067,930
有価証券に係る未収利息	24,284,051.77	3,010,008
流動資産に係る未収利息	559.56	69
未収分配金	580,795.48	71,990
その他の未収金	36,850.22	4,568
その他の資産	132,836.91	16,465
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	1,631,447.32	202,218
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	37,904,659.95	4,698,283
スワップに係る未実現(損)益(注1)	3,885,065.96	481,554
資産合計	8,781,160,163.13	1,088,424,802
負債		
当座借越	(1,275.26)	(158)
当座借越に係る未払利息	(18.32)	(2)
有価証券購入未払金(注1)	(20,975,186.71)	(2,599,874)
その他の短期負債(委託証拠金)	(33,736.31)	(4,182)
買戻受益証券未払金	(28,875,517.95)	(3,579,120)
報酬引当金(注2)	(5,655,044.67)	(700,943)
年次税引当金(注3)	(210,258.30)	(26,062)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(212,604.12)	(26,352)
引当金合計	(6,077,907.09)	(753,357)
負債合計	(55,963,641.64)	(6,936,693)
期末現在純資産額	8,725,196,521.49	1,081,488,109

\* 2017年1月31日現在、総額937,893.96ユーロの現金が取引相手方のユービーエス・エイ・ジー・ロンドンのための担保となっている。

注記は、財務書類と不可分のものである。

## (2) 損益計算書

### UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

#### 連結運用計算書

	ユーロ	千 円
	自2016年2月1日 至2017年1月31日	
収益		
流動資産に係る利息	138,474.20	17,164
有価証券に係る利息	73,775,387.23	9,144,459
分配金	37,911,274.68	4,699,102
スワップに係る受取利息 (注1)	4,377,646.54	542,609
貸付有価証券に係る収益 (注12)	2,574,853.28	319,153
その他の収益 (注4)	1,554,701.83	192,705
収益合計	120,332,337.76	14,915,193
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(2,171,874.12)	(269,204)
報酬 (注2)	(131,075,995.44)	(16,246,870)
年次税 (注3)	(2,501,237.78)	(310,028)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(1,029,941.25)	(127,661)
その他の手数料および報酬 (注2)	(1,156,474.20)	(143,345)
現金および当座借越に係る利息	(273,851.88)	(33,944)
費用合計	(138,209,374.67)	(17,131,052)
投資に係る純 (損) 益	(17,877,036.91)	(2,215,859)
実現 (損) 益 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 実現 (損) 益	187,206,683.28	23,204,268
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	(1,379,148.27)	(170,945)
金融先物に係る実現 (損) 益	9,426,238.99	1,168,382
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	(71,470,127.72)	(8,858,722)
スワップに係る実現 (損) 益	(1,998,018.57)	(247,654)
外国為替に係る実現 (損) 益	47,768,596.97	5,920,918
実現 (損) 益合計	169,554,224.68	21,016,246
当期実現純 (損) 益	151,677,187.77	18,800,387
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 未実現評価 (損) 益	273,671,277.38	33,921,555
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	(4,793.96)	(594)
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	8,183,056.14	1,014,290
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	69,411,463.26	8,603,551
スワップに係る未実現評価 (損) 益	3,840,501.01	476,030
未実現評価 (損) 益の変動合計	355,101,503.83	44,014,831
運用の結果による純資産の純増 (減)	506,778,691.60	62,815,219

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

3年度の比較

	ISIN	2017年1月31日	2016年1月31日	2015年1月31日
純資産額 (米ドル)		719,205,149.17	614,299,334.76	667,100,051.62
クラスK-1-a c c	LU0939686977			
発行済受益証券口数		5.5000	7.2000	7.5000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		5,666,824.31	5,241,674.79	5,429,461.30
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		5,666,824.31	5,241,674.79	5,429,461.30
クラスP-4%-m d i s t <sup>2</sup>	LU1417001382			
発行済受益証券口数		66,993.9190	—	—
1口当たり純資産価格 (米ドル)		1014.68	—	—
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		1014.68	—	—
クラスP-a c c	LU0033043885			
発行済受益証券口数		167,774.2650	172,254.3460	183,829.7130
1口当たり純資産価格 (米ドル)		3,107.54	2,890.07	3,009.79
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		3,107.54	2,890.07	3,009.79
クラス (日本円・ヘッジ) P-a c c <sup>3</sup>	LU1410364910			
発行済受益証券口数		104,936.0000	—	—
1口当たり純資産価格 (円)		10,262	—	—
1口当たり発行および買戻価格 (円) <sup>1</sup>		10,262	—	—
クラスP-d i s t	LU0033041590			
発行済受益証券口数		43,616.7640	52,283.4230	50,946.1820
1口当たり純資産価格 (米ドル)		1,439.22	1,360.53	1,433.49
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		1,439.22	1,360.53	1,433.49
クラスQ-a c c	LU0941351925			
発行済受益証券口数		185,294.2090	61,362.6390	564.0000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		111.59	103.17	106.70
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		111.59	103.17	106.70
クラスQ-d i s t <sup>4</sup>	LU1240800539			
発行済受益証券口数		55,139.3320	13,059.3780	—
1口当たり純資産価格 (米ドル)		102.98	97.14	—
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>1</sup>		102.98	97.14	—

<sup>1</sup> 注記1を参照のこと。

<sup>2</sup> 初回純資産価格計算日：2016年6月2日

<sup>3</sup> 初回純資産価格計算日：2016年6月7日

<sup>4</sup> 初回純資産価格計算日：2015年8月21日

パフォーマンス

	通貨	2016年/2017年	2015年/2016年	2014年/2015年
クラスK-1-a c c	米ドル	8.1%	-3.5%	6.6%
クラスP-4%-m d i s t <sup>1</sup>	米ドル	—	—	—
クラスP-a c c	米ドル	7.5%	-4.0%	6.0%
クラス (日本円・ヘッジ) P-a c c <sup>1</sup>	日本円	—	—	—
クラスP-d i s t	米ドル	7.5%	-4.0%	6.0%
クラスQ-a c c	米ドル	8.2%	-3.3%	—
クラスQ-d i s t	米ドル	8.2%	—	—

<sup>1</sup> 最近運用を開始したため、パフォーマンスの計算に関するデータはない。

過去の実績は、現在または将来のパフォーマンスの指標にはならない。

実績データは、受益証券の発行および買戻しの時に請求される手数料および費用を考慮していない。

実績データは、監査の対象ではなかった。

本サブ・ファンドはベンチマークを有していない。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

投資有価証券の構成

通貨別分類 (対純資産割合 (%))

米ドル	82.50
ユーロ	6.17
英ポンド	2.09
カナダ・ドル	1.95
豪ドル	1.91
日本円	0.66
スイス・フラン	0.25
スウェーデン・クローネ	0.08
香港ドル	0.08
デンマーク・クローネ	0.05
シンガポール・ドル	0.03
ノルウェー・クローネ	0.02
イスラエル・シケル	0.01
合計	95.80

商品別分類 (対純資産割合 (%))

投資信託、オープン・エンド型	53.40
固定利付債券	12.37
固定利付米国中期国債	10.70
無記名株	6.93
固定利付ノート	6.63
固定利付ミディアム・ターム・ノート	3.07
変動利付米国中期国債	1.93
記名株式	0.42
変動利付ミディアム・ターム・ノート	0.22
その他の株式	0.05
変動利付ノート	0.05
優先株式	0.02
預託証券	0.01
合計	95.80

注記は、財務書類と不可分のものである。



UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

純資産計算書

	米ドル	千 円
	2017年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	654,163,216.28	72,585,950
投資有価証券、未実現評価(損)益	34,816,565.88	3,863,246
投資有価証券合計(注1)	688,979,782.16	76,449,197
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	25,758,915.74	2,858,209
その他の流動資産(委託証拠金)	3,163,254.93	350,995
有価証券売却未収金(注1)	873,660.83	96,941
発行受益証券未収金	2,981,361.94	330,812
有価証券に係る未収利息	1,835,598.70	203,678
流動資産に係る未収利息	1.47	0
未収分配金	37,380.08	4,148
その他の未収金	2,605.59	289
その他の資産	13,880.39	1,540
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	123,512.29	13,705
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(1,929,435.03)	(214,090)
スワップに係る未実現(損)益(注1)	454,969.17	50,483
資産合計	722,295,488.26	80,145,907
負債		
有価証券購入未払金(注1)	(879,418.17)	(97,580)
買戻受益証券未払金	(1,743,676.59)	(193,478)
報酬引当金(注2)	(433,256.31)	(48,074)
年次税引当金(注3)	(15,521.65)	(1,722)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(18,466.37)	(2,049)
引当金合計	(467,244.33)	(51,845)
負債合計	(3,090,339.09)	(342,904)
期末現在純資産額	719,205,149.17	79,803,003

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

運用計算書

	米ドル	千 円
	自2016年2月1日	至2017年1月31日
収益		
流動資産に係る利息	13,788.11	1,530
有価証券に係る利息	6,029,219.33	669,002
分配金	1,695,239.08	188,104
スワップに係る受取利息 (注1)	300,081.00	33,297
貸付有価証券に係る収益 (注12)	196,774.58	21,834
その他の収益 (注4)	318,079.96	35,294
収益合計	8,553,182.06	949,061
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(167,391.11)	(18,574)
報酬 (注2)	(9,374,982.40)	(1,040,248)
年次税 (注3)	(170,159.93)	(18,881)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(78,709.83)	(8,734)
その他の手数料および報酬 (注2)	(84,084.24)	(9,330)
現金および当座借越に係る利息	(14,451.53)	(1,604)
費用合計	(9,889,779.04)	(1,097,370)
投資に係る純 (損) 益	(1,336,596.98)	(148,309)
実現 (損) 益 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 実現 (損) 益	5,266,255.31	584,344
金融先物に係る実現 (損) 益	2,988,100.41	331,560
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	5,188,523.82	575,719
スワップに係る実現 (損) 益	(217,213.50)	(24,102)
外国為替に係る実現 (損) 益	(1,434,217.73)	(159,141)
実現 (損) 益合計	11,791,448.31	1,308,379
当期実現純 (損) 益	10,454,851.33	1,160,070
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 未実現評価 (損) 益	37,764,947.40	4,190,399
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	277,262.33	30,765
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	(2,708,672.01)	(300,554)
スワップに係る未実現評価 (損) 益	453,812.53	50,355
未実現評価 (損) 益の変動合計	35,787,350.25	3,970,964
運用の結果による純資産の純増 (減)	46,242,201.58	5,131,035

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

純資産変動計算書

	米ドル	千 円
	自2016年2月1日 至2017年1月31日	
期首現在純資産額	614,299,334.76	68,162,654
受益証券発行	312,663,473.63	34,693,139
受益証券買戻し	(251,641,056.77)	(27,922,092)
受益証券発行 (買戻し) 純額合計	61,022,416.86	6,771,047
支払分配金	(2,358,804.03)	(261,733)
純投資 (損) 益	(1,336,596.98)	(148,309)
実現 (損) 益合計	11,791,448.31	1,308,379
未実現評価 (損) 益の変動合計	35,787,350.25	3,970,964
運用の結果による純資産の純増 (減)	46,242,201.58	5,131,035
期末現在純資産額	719,205,149.17	79,803,003

発行済受益証券口数の変動

	自2016年2月1日 至2017年1月31日	
クラス	K - 1 - a c c	
期首現在発行済受益証券口数	7.2000	
発行受益証券口数	2.5000	
買戻受益証券口数	(4.2000)	
期末現在発行済受益証券口数	5.5000	
クラス	P - 4 % - mdist	
期首現在発行済受益証券口数	0.0000	
発行受益証券口数	84,978.6170	
買戻受益証券口数	(17,984.6980)	
期末現在発行済受益証券口数	66,993.9190	
クラス	P - a c c	
期首現在発行済受益証券口数	172,254.3460	
発行受益証券口数	54,884.0740	
買戻受益証券口数	(59,364.1550)	
期末現在発行済受益証券口数	167,774.2650	
クラス	(日本円・ヘッジ) P - a c c	
期首現在発行済受益証券口数	0.0000	
発行受益証券口数	104,936.0000	
買戻受益証券口数	0.0000	
期末現在発行済受益証券口数	104,936.0000	
クラス	P - d i s t	
期首現在発行済受益証券口数	52,283.4230	
発行受益証券口数	7,669.9290	
買戻受益証券口数	(16,336.5880)	
期末現在発行済受益証券口数	43,616.7640	

クラス	Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数	61,362.6390
発行受益証券口数	199,668.9500
買戻受益証券口数	(75,737.3800)
期末現在発行済受益証券口数	185,294.2090

クラス	Q - d i s t
期首現在発行済受益証券口数	13,059.3780
発行受益証券口数	48,535.4130
買戻受益証券口数	(6,455.4590)
期末現在発行済受益証券口数	55,139.3320

#### 年間分配金

UBS (Lux) ストラテジー・ ファンド・イールド (米ドル)	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額	円
クラスP - d i s t	2016年4月1日	2016年4月6日	米ドル	22.59	2,507
クラスQ - d i s t	2016年4月1日	2016年4月6日	米ドル	1.98	220

#### 月間分配金

UBS (Lux) ストラテジー・ ファンド・イールド (米ドル)	権利落ち日	支払日	通貨	1口当たり金額	円
クラスP - 4% - m d i s t	2016年7月11日	2016年7月14日	米ドル	3.24	360
クラスP - 4% - m d i s t	2016年8月10日	2016年8月15日	米ドル	3.40	377
クラスP - 4% - m d i s t	2016年9月9日	2016年9月14日	米ドル	3.40	377
クラスP - 4% - m d i s t	2016年10月11日	2016年10月14日	米ドル	3.40	377
クラスP - 4% - m d i s t	2016年11月10日	2016年11月15日	米ドル	3.37	374
クラスP - 4% - m d i s t	2016年12月12日	2016年12月15日	米ドル	3.33	369
クラスP - 4% - m d i s t	2017年1月10日	2017年1月13日	米ドル	3.36	373

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・イールド (米ドル)

2017年1月31日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
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短期金融商品			
無記名株			
オーストラリア			
AUD AGL ENERGY NPV	1 580.00	27 107.73	0.01
AUD AMCOR LIMITED NPV	1 519.00	16 490.03	0.00
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	1 914.00	7 265.07	0.00
AUD APA GROUP NPV	3 345.00	21 381.38	0.00
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	1 453.00	16 854.53	0.00
AUD ASX LTD NPV	212.00	8 029.29	0.00
AUD AURIZON HOLDINGS NPV	3 049.00	11 596.39	0.00
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	4 257.00	94 656.54	0.01
AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	868.00	8 269.72	0.00
AUD BHP BILLITON LTD NPV	4 869.00	98 469.47	0.02
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	1 338.00	12 158.44	0.00
AUD BORAL LIMITED NPV	4 547.00	20 089.80	0.00
AUD BRAMBLES LTD NPV	3 483.00	27 525.28	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	294.00	6 383.24	0.00
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	2 269.00	18 982.08	0.00
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	131.00	3 411.09	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	2 832.00	175 561.88	0.03
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	651.00	4 818.51	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	74.00	7 031.69	0.00
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	571.00	5 587.49	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	661.00	5 720.50	0.00
AUD CSL NPV	841.00	71 697.39	0.01
AUD DEXUS PROPERTY GP NPV (STAPLED)	2 802.00	19 101.70	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	1 274.00	6 441.27	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	3 390.00	17 808.75	0.00
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 803.00	5 269.68	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	2 733.00	11 971.35	0.00
AUD LEND LEASE GROUP NPV	845.00	9 038.48	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	596.00	38 277.56	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	3 955.00	91 063.95	0.01
AUD NEWCREST MINING NPV	1 405.00	22 964.02	0.00
AUD ORICA LIMITED NPV	550.00	7 828.73	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	3 346.00	18 009.42	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	1 838.00	4 758.03	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	1 536.00	14 575.68	0.00
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	252.00	12 779.23	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	780.00	39 483.70	0.01
AUD SANTOS LIMITED NPV	3 195.00	9 701.94	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	8 430.00	28 158.39	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	752.00	8 243.52	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	516.00	8 155.64	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	4 869.00	10 164.83	0.00
GBP SOUTH32 LTD NPV	3 072.00	6 454.35	0.00
AUD STOCKLAND NPV (STAPLED)	5 144.00	16 987.04	0.00
AUD SUNCORP GROUP	1 571.00	15 539.90	0.00
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	3 077.00	13 665.04	0.00
AUD TELSTRA CORP NPV	3 888.00	14 757.88	0.00
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	4 247.00	32 885.92	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	2 082.00	18 381.80	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)	7 298.00	15 845.19	0.00
AUD WESFARMERS LTD NPV	1 631.00	49 848.87	0.01
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	3 970.00	26 491.53	0.01
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	4 974.00	119 737.34	0.02
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	1 210.00	28 990.12	0.01
AUD WOOLWORTHS LTD NPV	2 089.00	39 012.26	0.01
オーストラリア合計		1 451 480.65	0.20
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV (BR)	147.00	7 937.59	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	551.00	16 756.40	0.01
EUR OMV AG NPV (VAR)	186.00	6 505.70	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	179.00	7 583.06	0.00
オーストリア合計		38 782.75	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	267.00	11 420.69	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	1 239.00	128 743.63	0.02
EUR COLRUYT SA NPV	109.00	5 333.82	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	87.00	7 407.91	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	407.00	26 399.49	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	196.00	5 626.92	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	68.00	7 962.38	0.00
EUR UCB NPV	138.00	9 502.98	0.00
EUR UMICORE NPV	131.00	7 333.41	0.00
ベルギー合計		209 731.23	0.03
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	147.00	12 987.45	0.00
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	200.00	12 802.00	0.00
USD EVEREST RE GROUP COM USD0.01	100.00	21 993.00	0.01
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	500.00	7 435.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	100.00	13 632.00	0.00
USD SIGNET JEWELERS LT ORD USD0.18	179.00	13 902.93	0.00
USD XL GROUP LTD COM USD0.01	753.00	28 290.21	0.01
バミューダ合計		111 042.59	0.02
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	545.00	25 946.81	0.01
CAD AGRUM INC COM NPV	202.00	20 764.75	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	739.00	33 788.53	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	308.00	7 311.68	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	800.00	12 425.70	0.00
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	300.00	10 543.43	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	938.00	70 816.75	0.01
USD BANK MONTREAL QUE COM	50.00	3 781.50	0.00
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	1 809.00	107 894.80	0.02
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 851.00	34 045.62	0.00
CAD BCE INC COM NEW	301.00	13 542.98	0.00
CAD BLACKBERRY LTD NPV	400.00	2 816.49	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS' B' SUB-VTG NPV	1 500.00	2 864.81	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL' A'	1 464.00	50 531.16	0.01
CAD CAE INC COM	460.00	6 520.27	0.00
CAD CAMECO CORP COM	910.00	11 565.64	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	200.00	30 191.37	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	1 553.00	46 860.99	0.01
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	1 242.00	86 156.46	0.01
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	152.00	16 134.45	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
CAD	CANADIAN UTILS LTD CL A	403.00	11 449.37	0.00
CAD	CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	574.00	48 786.15	0.01
CAD	CENOVUS ENERGY INC COM NPV	1 115.00	15 188.80	0.00
CAD	CGI GROUP INC 'A' SUB-VTG NPV	232.00	11 134.22	0.00
CAD	CI FINANCIAL CORP COM NPV	271.00	5 653.84	0.00
CAD	CRESCENT POINT EN COM NPV	1 421.00	16 534.28	0.00
CAD	DOLLARAMA INC COM NPV	200.00	15 117.93	0.00
CAD	ELDORADO GOLD CORP NEW COM	500.00	1 764.14	0.00
CAD	ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	1 400.00	13 583.89	0.00
CAD	EMPIRE LTD CL A	630.00	7 852.35	0.00
CAD	ENBRIDGE INC COM	1 552.00	65 948.84	0.01
CAD	ENCANA CORP COM NPV	1 332.00	16 969.91	0.00
CAD	FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	37.00	17 254.84	0.00
CAD	FINNING INTL INC COM NEW	369.00	7 455.00	0.00
CAD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	1 284.00	16 161.41	0.00
CAD	FORTIS INC COM NPV	201.00	6 450.50	0.00
CAD	FRANCO NEVADA CORP COM NPV	209.00	13 568.37	0.00
CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	400.00	10 443.72	0.00
CAD	GOLDCORP INC COM NPV	1 523.00	24 578.27	0.01
CAD	GREAT WEST LIFE CO INC COM	293.00	8 014.10	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	765.00	9 851.85	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	300.00	9 843.91	0.00
CAD	INDUSTRIAL ALLNCE INS FIN SRVC COM	100.00	4 199.42	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	140.00	10 202.42	0.00
CAD	INTER PIPELINE LTD COM NPV	700.00	15 151.68	0.00
CAD	KEYERA CORPORATION COM NPV	506.00	14 825.85	0.00
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NPV	900.00	3 499.90	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	493.00	25 860.99	0.00
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	116.00	7 831.16	0.00
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	833.00	35 965.15	0.01
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	3 333.00	63 783.97	0.01
CAD	METHANEX CORP COM	200.00	9 980.44	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	300.00	9 096.07	0.00
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	406.00	17 491.87	0.00
CAD	ONEX CORP SUB VTG	262.00	18 299.31	0.00
CAD	OPEN TEXT CORP COM	532.00	18 174.71	0.00
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	526.00	16 287.34	0.00
CAD	PEYTO EXPLORATION COM NPV	300.00	6 516.59	0.00
CAD	POTASH CORP SASK INC COM	1 289.00	23 936.10	0.01
CAD	POWER CORP CDA COM	438.00	10 256.67	0.00
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	296.00	7 676.13	0.00
CAD	PRAIRIESKY ROYALTY COM NPV	31.00	725.22	0.00
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	160.00	7 852.80	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS' B' COM CAD1.62478	715.00	30 958.20	0.01
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	2 387.00	171 296.43	0.03
CAD	SAPUTO INC COM	400.00	14 699.14	0.00
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	561.00	12 078.44	0.00
CAD	SILVER WHEATON COR COM NPV	918.00	20 257.61	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	200.00	8 602.88	0.00
CAD	SUN LIFE FINL INC COM	901.00	35 494.04	0.01
CAD	SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	2 797.00	86 586.32	0.01
CAD	TECK RESOURCES LTD CLASS' B' SUB-VTG COM NPV	1 002.00	24 509.13	0.01
CAD	TORONTO-DOMINION COM NPV	3 025.00	156 406.71	0.02
CAD	TOURMALINE OIL CP COM NPV	600.00	13 999.62	0.00
CAD	TRANSCANADA CORP COM NPV	1 087.00	51 183.84	0.01
CAD	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV	432.00	5 951.08	0.00
CAD	VERMILION ENERGY I COM NPV	248.00	10 211.04	0.00
USD	WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	300.00	24 090.00	0.01
CAD	YAMANA GOLD INC COM	700.00	2 308.72	0.00
カナダ合計			1 944 356.87	0.27

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
デンマーク			
DKK A. P. MOELLER-MAERSK SER' B' DKK1000	15.00	25 044.32	0.00
DKK CARLSBERG SER' B' DKK20	228.00	20 607.40	0.00
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	239.00	14 586.30	0.00
DKK COLOPLAST DKK1 B	150.00	10 741.38	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	1 292.00	43 049.14	0.01
DKK DSV DKK1	325.00	15 792.38	0.00
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	94.00	18 139.44	0.00
DKK ISS A/S DKK1	407.00	14 471.93	0.00
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER' B'	2 907.00	104 506.35	0.02
DKK NOVOZYMES A/S SER' B' DKK2 (POST CONS)	536.00	20 896.97	0.00
DKK PANDORA A/S DKK1	209.00	27 378.52	0.01
DKK TDC A/S DKK1	1 120.00	5 899.62	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK1	401.00	28 062.66	0.01
デンマーク合計		349 176.41	0.05
フィンランド			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	137.00	4 623.79	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	957.00	15 296.26	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	630.00	28 527.24	0.01
EUR METSO OYJ NPV	137.00	4 213.67	0.00
EUR NESTE OIL OYJ NPV	423.00	14 747.21	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	9 522.00	42 705.26	0.01
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	153.00	5 740.85	0.00
EUR ORION CORP SER' B' NPV	371.00	17 288.52	0.00
EUR SAMPO OYJ SER' A' NPV	787.00	36 486.92	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER' R'	673.00	7 651.31	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	507.00	11 506.21	0.00
EUR WARTSILA OYJ ABP SER' B' EUR3.50	182.00	9 136.13	0.00
フィンランド合計		197 923.37	0.03
フランス			
EUR ACCOR EUR3	169.00	6 849.85	0.00
EUR ADP EUR3	118.00	13 096.57	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L' ) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	586.00	63 329.02	0.01
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	875.00	59 346.64	0.01
EUR ALSTOM EUR7.00	394.00	11 177.14	0.00
EUR ARKEMA EUR10	88.00	8 692.29	0.00
EUR ATOS SE EUR1	112.00	11 921.07	0.00
EUR AXA EUR2.29	3 273.00	80 363.62	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	1 766.00	112 945.99	0.02
EUR BOUYGUES EUR1	151.00	5 492.02	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	295.00	5 776.77	0.00
EUR CAP GEMINI EUR8	334.00	27 205.09	0.00
EUR CARREFOUR EUR2.50	940.00	23 014.28	0.00
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	77.00	4 152.37	0.00
EUR CHRISTIAN DIOR EUR2	45.00	9 665.51	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	899.00	44 205.49	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	956.00	12 671.57	0.00
EUR DANONE EURO.25	905.00	56 716.16	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	152.00	11 774.62	0.00
EUR EDENRED EUR2	398.00	8 673.34	0.00
EUR EDF EURO.5	184.00	1 813.50	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	213.00	15 325.99	0.00
EUR ENGIE SA EUR 1	1 822.00	21 787.38	0.00
EUR ESSILOR INTL EURO.18	306.00	35 847.25	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	156.00	2 659.49	0.00
EUR HERMES INTL NPV	57.00	24 790.88	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR ICADÉ NPV	152.00	10 762.73	0.00
EUR ILIAD NPV	38.00	8 129.13	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	128.00	10 798.01	0.00
EUR KERING EUR4	66.00	15 706.03	0.00
EUR KLEPIERRE EUR1.40	325.00	12 345.65	0.00
EUR L' OREAL EURO.20	318.00	57 855.60	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	494.00	28 711.30	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	445.00	89 738.09	0.01
EUR NATIXIS EUR1.6	1 625.00	9 632.42	0.00
EUR ORANGE EUR4	2 827.00	43 764.87	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	334.00	39 109.34	0.01
EUR PEUGEOT SA EUR1	1 274.00	23 681.16	0.00
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	400.00	27 475.72	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	327.00	29 465.57	0.01
EUR REXEL EUR5	615.00	10 703.88	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	441.00	29 882.11	0.01
EUR SANOFI EUR2	1 879.00	151 262.02	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	800.00	57 251.16	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 049.00	51 303.53	0.01
EUR SODEXO EUR4	91.00	10 065.48	0.00
EUR SUEZ EUR4	336.00	5 094.51	0.00
EUR THALES EUR3	147.00	13 786.12	0.00
EUR TOTAL EUR2.5	3 378.00	170 337.21	0.02
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	175.00	40 273.64	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	360.00	21 989.22	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	370.00	6 295.78	0.00
EUR VINCI EUR2.50	901.00	63 193.82	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 793.00	32 824.55	0.01
EUR WENDEL EUR4	64.00	7 573.55	0.00
EUR ZODIAC AEROSPACE	380.00	11 539.71	0.00
フランス合計		1 769 845.81	0.25
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	516.00	46 936.66	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	117.00	10 360.65	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	915.00	7 923.58	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	165.00	32 221.61	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	623.00	20 292.54	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	420.00	34 173.68	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV	759.00	59 820.93	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	208.00	8 595.80	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	157.00	15 124.37	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	241.00	25 378.12	0.01
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	66.00	4 229.64	0.00
EUR LANXESS AG NPV	129.00	9 361.40	0.00
EUR LINDE AG NPV	263.00	42 761.52	0.01
EUR MAN SE ORD NPV	122.00	12 650.57	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	160.00	17 576.50	0.00
EUR METRO AG ORD NPV	125.00	4 270.12	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	828.00	10 966.01	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	1 658.00	151 640.08	0.02
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	313.00	18 824.12	0.00
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	862.00	21 752.01	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	62.00	9 893.05	0.00
ドイツ合計		564 752.96	0.08

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>香港</b>			
HKD AIA GROUP LTD NPV	17 800.00	110 800.52	0.02
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	3 000.00	12 062.87	0.00
HKD CHEUNG KONG INFSTR HKD1	2 000.00	16 122.48	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	4 736.00	57 038.18	0.01
HKD CK PROPERTY LTD HKD1	4 736.00	31 372.52	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	3 500.00	34 213.56	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	4 000.00	19 151.09	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	1 700.00	34 813.48	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 340.00	7 434.51	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	2 084.00	50 680.89	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	2 400.00	16 200.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	9 875.00	18 657.17	0.00
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	500.00	30 860.00	0.01
HKD LI & FUNG HKD0.0125	6 000.00	2 613.62	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	367.00	15 711.27	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	7 728.00	8 963.64	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	3 000.00	28 823.29	0.00
HKD SINO LAND CO HKD1	4 773.00	7 935.16	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	2 054.00	28 430.16	0.00
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	2 000.00	20 401.19	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4 500.00	30 824.10	0.00
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	2 000.00	15 091.47	0.00
HKD WHEELOCK & COMPANY HKD0.50	2 000.00	12 204.63	0.00
<b>香港合計</b>		<b>610 405.80</b>	<b>0.08</b>
<b>アイルランド</b>			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	922.00	104 988.14	0.02
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	300.00	16 233.00	0.00
EUR CRH ORD EURO.32	648.00	22 580.97	0.00
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	677.00	47 918.06	0.01
GBP EXPERTIAN ORD USD0.10	900.00	17 312.71	0.00
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	468.00	37 135.80	0.01
USD MALLINCKRODT PLC USD0.20	200.00	9 746.00	0.00
EUR PADDY POWER BETFAI ORD EURO.09	43.00	4 498.31	0.00
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	356.00	20 872.28	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	400.00	18 060.00	0.00
GBP SHIRE ORD GBP0.05	1 450.00	79 892.81	0.01
<b>アイルランド合計</b>		<b>379 238.08</b>	<b>0.05</b>
<b>イスラエル</b>			
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	2 062.00	12 453.01	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	7 392.00	12 911.96	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	2 295.00	9 485.84	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	234.00	23 112.18	0.01
ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1	1 534.00	7 044.92	0.00
USD MOBILEYE NV EURO.01	300.00	12 888.00	0.00
ILS NICE SYSTEMS ILS1	232.00	16 228.30	0.00
<b>イスラエル合計</b>		<b>94 124.21</b>	<b>0.01</b>
<b>イタリア</b>			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	1 283.00	20 437.57	0.00
EUR ATLANTIA SPA EUR1	909.00	20 678.60	0.01
EUR ENEL EUR1	12 757.00	53 271.00	0.01
EUR ENI SPA EUR1	3 513.00	53 948.25	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	49.00	3 055.46	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR INTESA SANPAOLO	17 722.00	41 560.20	0.01
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	817.00	10 524.55	0.00
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	178.00	9 558.60	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	646.00	5 553.64	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	349.00	9 074.57	0.00
EUR SAIPEM EUR1	5 336.00	2 724.73	0.00
EUR SNAM EUR1	4 095.00	15 577.64	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	6 634.00	5 699.64	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 570.00	6 885.20	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	680.70	18 508.51	0.00
イタリア合計		277 058.16	0.04
日本			
JPY イオン	1 600.00	23 180.99	0.00
JPY イオンフィナンシャルサービス	300.00	5 388.41	0.00
JPY イオンモール	220.00	3 203.02	0.00
JPY アイシン精機	300.00	13 777.48	0.00
JPY 味の素	1 000.00	19 795.69	0.00
JPY アルフレッサ ホールディングス	700.00	11 534.53	0.00
JPY 旭硝子	1 000.00	7 461.69	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	500.00	17 632.69	0.00
JPY 旭化成	3 000.00	28 114.59	0.01
JPY アステラス製薬	4 000.00	53 777.48	0.01
JPY パンダイナムコホールディングス	400.00	11 050.41	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	2 918.05	0.00
JPY ブリヂストン	1 100.00	40 482.35	0.01
JPY ブラザー工業	400.00	7 419.05	0.00
JPY キヤノン	1 700.00	50 512.99	0.01
JPY カシオ計算機	500.00	6 946.48	0.00
JPY 東海旅客鉄道	200.00	32 458.36	0.01
JPY 千葉銀行	2 000.00	13 164.56	0.00
JPY 中部電力	1 500.00	20 026.65	0.00
JPY 中外製薬	400.00	11 725.52	0.00
JPY 中国電力	600.00	6 768.82	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	1 000.00	5 313.79	0.00
JPY クレディセゾン	200.00	3 663.34	0.00
JPY 大日本印刷	1 000.00	10 206.53	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	2 300.00	42 128.36	0.01
JPY 第一三共	1 400.00	31 395.07	0.01
JPY ダイキン工業	400.00	39 884.52	0.01
JPY 大東建託	100.00	14 026.20	0.00
JPY 大和ハウス工業	1 000.00	27 217.41	0.01
JPY 大和証券グループ本社	2 000.00	12 853.65	0.00
JPY デンソー	800.00	34 828.34	0.01
JPY 電通	200.00	9 273.82	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	600.00	54 523.65	0.01
JPY エーザイ	300.00	16 562.29	0.00
JPY 電源開発	600.00	13 980.01	0.00
JPY ファナック	300.00	59 067.29	0.01
JPY ファーストリテイリング	100.00	31 605.60	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	700.00	27 204.09	0.01
JPY 富士重工業	1 200.00	48 394.40	0.01
JPY 富士通	2 000.00	11 700.64	0.00
JPY 阪急阪神ホールディングス	600.00	20 413.06	0.00
JPY 日野自動車	1 000.00	10 615.15	0.00
JPY ヒロセ電機	105.00	13 729.51	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 久光製薬	100.00	5 205.42	0.00
JPY 日立化成	300.00	8 554.30	0.00
JPY 日立建機	200.00	4 624.47	0.00
JPY 日立製作所	7 000.00	40 268.27	0.01
JPY 北陸電力	200.00	2 019.99	0.00
JPY 本田技研工業	2 600.00	78 225.18	0.01
JPY HOYA	900.00	39 349.77	0.01
JPY ヒューリック	600.00	5 873.41	0.00
JPY IHI	3 000.00	8 127.91	0.00
JPY 国際石油開発帝石	1 100.00	10 850.99	0.00
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	800.00	9 408.84	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	6 759.94	0.00
JPY 伊藤忠商事	2 500.00	34 554.74	0.01
JPY J. フロント リテイリング	1 000.00	14 505.89	0.00
JPY 日本取引所グループ	800.00	11 974.24	0.00
JPY ゆうちょ銀行	1 300.00	15 878.30	0.00
JPY 日本郵政	1 200.00	15 136.58	0.00
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	2.00	11 405.73	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	4.00	8 584.50	0.00
JPY 日本たばこ産業	1 900.00	61 434.60	0.01
JPY J F Eホールディングス	1 000.00	17 606.04	0.00
JPY JSR	300.00	5 169.89	0.00
JPY ジェイテクト	500.00	8 261.16	0.00
JPY J Xホールディングス	3 600.00	17 031.85	0.00
JPY 関西電力	1 800.00	19 259.16	0.00
JPY 関西ペイント	1 000.00	19 489.23	0.00
JPY 花王	700.00	34 715.52	0.01
JPY KDDI	3 200.00	86 129.25	0.01
JPY 京浜急行電鉄	1 000.00	11 769.93	0.00
JPY 京王電鉄	1 000.00	8 243.39	0.00
JPY キーエンス	200.00	77 939.15	0.01
JPY キリンホールディングス	1 800.00	29 548.30	0.01
JPY 小松製作所	1 700.00	40 682.21	0.01
JPY コナミホールディングス	200.00	8 030.20	0.00
JPY コニカミノルタ	500.00	5 205.42	0.00
JPY クボタ	2 000.00	31 978.68	0.01
JPY クラレ	800.00	12 734.62	0.00
JPY 京セラ	400.00	20 906.95	0.00
JPY 協和発酵キリン	800.00	10 808.79	0.00
JPY 九州電力	600.00	6 704.86	0.00
JPY ローソン	100.00	7 319.56	0.00
JPY LIXILグループ	300.00	7 035.31	0.00
JPY エムスリー	400.00	10 766.16	0.00
JPY マキタ	100.00	6 973.13	0.00
JPY 丸紅	2 000.00	12 215.86	0.00
JPY マツダ	1 000.00	14 816.79	0.00
JPY メディパルホールディングス	400.00	6 498.78	0.00
JPY 明治ホールディングス	400.00	31 054.85	0.01
JPY 三菱ケミカルホールディングス	2 000.00	14 029.76	0.00
JPY 三菱商事	2 500.00	56 617.81	0.01
JPY 三菱電機	3 000.00	45 876.08	0.01
JPY 三菱地所	2 000.00	38 418.83	0.01
JPY 三菱重工業	5 000.00	22 602.71	0.00
JPY 三菱自動車工業	800.00	4 356.21	0.00
JPY 田辺三菱製薬	600.00	12 039.97	0.00
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	20 400.00	132 448.24	0.02
JPY 三菱UFJリース	2 400.00	12 855.43	0.00
JPY 三井物産	1 900.00	27 957.81	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 三井不動産	2 000.00	46 484.57	0.01
JPY 商船三井	1 000.00	3 197.87	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	39 400.00	73 602.67	0.01
JPY MS&ADインシュアランス グループ ホールディングス	1 000.00	33 710.86	0.01
JPY 村田製作所	300.00	40 652.90	0.01
JPY 日本碍子	1 000.00	19 720.19	0.00
JPY 日本特殊陶業	1 000.00	22 598.27	0.00
JPY 日本電産	400.00	37 699.31	0.01
JPY ニコン	500.00	8 105.71	0.00
JPY 任天堂	200.00	41 074.84	0.01
JPY 日本ビルファンド投資法人	2.00	11 512.33	0.00
JPY 日本通運	3 000.00	15 962.69	0.00
JPY 日本ペイントホールディングス	600.00	17 588.27	0.00
JPY 新日鐵住金	1 420.00	34 517.70	0.01
JPY 日本電信電話	1 400.00	61 919.61	0.01
JPY 日産自動車	4 200.00	41 748.17	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	603.00	9 196.99	0.00
JPY ニトリホールディングス	100.00	11 210.30	0.00
JPY 日東電工	200.00	15 888.07	0.00
JPY NOK	200.00	4 071.95	0.00
JPY 野村ホールディングス	5 100.00	31 870.75	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	200.00	3 455.47	0.00
JPY 日本精工	1 000.00	12 205.20	0.00
JPY エヌ・ティ・ティ・データ	400.00	20 253.16	0.00
JPY NTTドコモ	2 700.00	64 912.73	0.01
JPY 大林組	2 000.00	19 116.14	0.00
JPY 小田急電鉄	500.00	9 935.60	0.00
JPY オリンパス	200.00	6 919.83	0.00
JPY オムロン	200.00	8 234.51	0.00
JPY 小野薬品工業	500.00	10 244.28	0.00
JPY オリエンタルランド	400.00	21 983.57	0.00
JPY オリックス	2 300.00	34 875.42	0.01
JPY 大阪ガス	4 000.00	15 019.32	0.00
JPY 大塚ホールディングス	600.00	27 709.53	0.01
JPY パナソニック	3 300.00	34 546.30	0.01
JPY 楽天	2 200.00	22 034.20	0.00
JPY りそなホールディングス	3 100.00	16 885.81	0.00
JPY リコー	1 000.00	8 962.91	0.00
JPY ローム	200.00	12 862.54	0.00
JPY SANKYO	100.00	3 353.32	0.00
JPY 参天製薬	1 000.00	12 578.28	0.00
JPY SBIホールディングス	170.00	2 361.80	0.00
JPY セコム	500.00	36 269.15	0.01
JPY セガサミーホールディングス	200.00	3 155.23	0.00
JPY 積水化学工業	1 000.00	16 380.19	0.00
JPY 積水ハウス	1 000.00	16 242.51	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	1 300.00	52 069.29	0.01
JPY シマノ	100.00	15 820.56	0.00
JPY 信越化学工業	700.00	60 607.60	0.01
JPY 塩野義製薬	400.00	19 276.04	0.00
JPY 資生堂	500.00	14 026.20	0.00
JPY 静岡銀行	1 000.00	8 749.72	0.00
JPY 昭和シェル石油	500.00	4 916.72	0.00
JPY SMC	100.00	27 457.25	0.01
JPY ソフトバンクグループ	1 700.00	131 394.18	0.02
JPY SOMP Oホールディングス	750.00	27 301.80	0.01
JPY ソニー	1 800.00	54 731.51	0.01
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 380.86	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
JPY	スタンレー電気	400.00	11 316.90	0.00
JPY	住友商事	2 300.00	28 930.05	0.01
JPY	住友電気工業	700.00	10 244.28	0.00
JPY	住友金属鉱山	1 000.00	13 608.71	0.00
JPY	三井住友フィナンシャルグループ	2 000.00	79 076.17	0.01
JPY	三井住友トラスト・ホールディングス	800.00	30 074.17	0.01
JPY	住友不動産	1 000.00	27 217.41	0.01
JPY	住友ゴム工業	300.00	4 703.53	0.00
JPY	サントリー食品インターナショナル	300.00	12 778.15	0.00
JPY	スルガ銀行	700.00	16 042.64	0.00
JPY	スズキ	800.00	31 047.75	0.01
JPY	シスメックス	200.00	12 009.77	0.00
JPY	T&Dホールディングス	1 500.00	22 431.71	0.00
JPY	大成建設	2 000.00	14 248.28	0.00
JPY	武田薬品工業	1 300.00	54 552.08	0.01
JPY	TDK	200.00	14 443.70	0.00
JPY	テルモ	400.00	14 816.79	0.00
JPY	THK	300.00	7 437.71	0.00
JPY	東武鉄道	3 000.00	15 269.82	0.00
JPY	東宝	300.00	8 674.22	0.00
JPY	東北電力	400.00	4 889.19	0.00
JPY	東京海上ホールディングス	1 200.00	50 430.38	0.01
JPY	東京電力	800.00	3 077.06	0.00
JPY	東京エレクトロン	200.00	20 803.91	0.00
JPY	東京ガス	3 000.00	13 319.12	0.00
JPY	東京建物	500.00	6 653.34	0.00
JPY	東京急行電鉄	1 000.00	7 381.75	0.00
JPY	東急不動産ホールディングス	900.00	5 284.48	0.00
JPY	凸版印刷	1 000.00	9 851.21	0.00
JPY	東レ	3 000.00	26 051.97	0.00
JPY	東芝	8 000.00	17 218.74	0.00
JPY	TOTO	500.00	20 230.96	0.00
JPY	東洋製罐グループホールディングス	300.00	5 548.30	0.00
JPY	豊田自動織機	200.00	9 700.20	0.00
JPY	トヨタ自動車	4 230.00	247 393.47	0.04
JPY	豊田通商	500.00	13 813.01	0.00
JPY	トレンドマイクロ	400.00	15 580.72	0.00
JPY	ユニ・チャーム	600.00	13 537.64	0.00
JPY	ユナイテッド・アーバン投資法人	6.00	9 598.93	0.00
JPY	ユー・エス・エス	500.00	8 798.58	0.00
JPY	西日本旅客鉄道	300.00	19 613.59	0.00
JPY	ヤフー	1 700.00	7 157.89	0.00
JPY	ヤクルト本社	200.00	10 304.24	0.00
JPY	ヤマダ電機	1 000.00	5 525.21	0.00
JPY	ヤマハ	300.00	9 193.87	0.00
JPY	ヤマハ発動機	400.00	8 364.20	0.00
JPY	ヤマトホールディングス	500.00	10 124.36	0.00
JPY	安川電機	1 000.00	18 130.14	0.00
JPY	横河電機	500.00	8 021.32	0.00
日本合計			4 731 851.86	0.66
ジャージー島				
GBP	RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	123.00	10 453.11	0.00
ジャージー島合計			10 453.11	0.00
マカオ				
HKD	SANDS CHINA LTD USD0.01 REG' S'	4 400.00	19 563.49	0.00
HKD	WYNN MACAU LTD HKD0.10	2 000.00	3 675.57	0.00
マカオ合計			23 239.06	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>オランダ</b>			
EUR AEGON NV EURO. 12	4 019.00	21 768.79	0.00
USD AERCAP HOLDINGS NV	400.00	17 708.00	0.00
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	420.00	28 500.00	0.01
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	1 055.00	23 122.00	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	561.00	68 145.05	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	755.00	6 690.61	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	431.00	19 637.36	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	494.00	5 392.04	0.00
EUR GEMALTO EUR1	75.00	4 357.38	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	136.00	9 550.45	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	450.00	33 667.59	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	5 666.00	81 133.01	0.01
EUR KON KPN NV EURO.24	5 572.00	16 041.71	0.00
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	2 184.00	46 485.10	0.01
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.01	207.00	7 663.02	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	457.00	29 138.91	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	1 748.00	51 259.74	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	580.00	20 515.36	0.00
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	545.00	53 328.25	0.01
EUR QIAGEN NV EURO.01	544.07	15 690.26	0.00
EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	158.00	9 186.38	0.00
EUR RELX NV EURO.07	1 536.00	25 936.80	0.00
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	5 710.00	160 664.59	0.02
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	6 960.00	188 043.17	0.03
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	200.00	8 390.00	0.00
EUR VOPAK (KON) EURO.50	79.00	3 390.69	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	691.00	26 401.84	0.01
<b>オランダ合計</b>		<b>981 808.10</b>	<b>0.14</b>
<b>ニュージーランド</b>			
NZD AUCKLAND INTL NPV	2 931.00	14 699.22	0.00
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	3 098.00	7 972.80	0.00
<b>ニュージーランド合計</b>		<b>22 672.02</b>	<b>0.00</b>
<b>ノルウェー</b>			
NOK DNB ASA NOK10	2 228.00	37 260.83	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	692.00	11 934.59	0.00
NOK MARINE HARVEST ASA NOK7.50	890.00	15 771.26	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	2 055.00	11 736.43	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	873.00	8 159.42	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	1 665.00	31 042.63	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	1 304.00	20 698.54	0.00
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	176.00	7 435.52	0.00
<b>ノルウェー合計</b>		<b>144 039.22</b>	<b>0.02</b>
<b>パプアニューギニア</b>			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	2 833.00	14 775.12	0.00
<b>パプアニューギニア合計</b>		<b>14 775.12</b>	<b>0.00</b>
<b>ポルトガル</b>			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	467.00	6 873.84	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	438.00	7 410.24	0.00
<b>ポルトガル合計</b>		<b>14 284.08</b>	<b>0.00</b>
<b>シンガポール</b>			
USD BROADCOM LIMITED COM NPV	585.00	116 707.50	0.02
SGD CAPITALAND SGD1	6 000.00	14 011.93	0.00
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	1 000.00	6 551.68	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	3 562.00	47 963.61	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD FLEX LTD COM USD0.01	900.00	14 103.00	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	3 100.00	13 576.80	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	4 353.00	29 013.82	0.00
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGD0.25 (POST REORG)	2 000.00	4 471.89	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 000.00	7 027.26	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 000.00	5 266.89	0.00
SGD SINGAPORE PRESS HD SGD0.20	3 000.00	7 346.68	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV (POST RE-ORG)	11 000.00	30 217.21	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	2 275.00	33 782.65	0.01
シンガポール合計		330 040.92	0.05
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	844.00	18 592.76	0.00
南アフリカ合計		18 592.76	0.00
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	1 451.00	20 769.43	0.01
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	197.00	6 063.33	0.00
EUR AENA SA EUR10	136.00	19 746.12	0.00
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	916.00	42 314.18	0.01
EUR BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)	3 106.00	3 208.97	0.00
EUR BANKIA S.A. EUR1	5 792.00	6 102.93	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	10 796.00	16 264.12	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	3 926.00	14 345.00	0.00
EUR DISTRIBUIDORA INTL EURO.01	403.00	2 131.01	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	275.00	6 746.27	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	988.00	20 334.95	0.00
EUR FERROVIAL SA EURO.2	762.00	13 793.51	0.00
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	408.00	7 857.29	0.00
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	434.00	9 296.05	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	8 993.00	56 699.10	0.01
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	1 570.00	51 808.70	0.01
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	1 543.00	9 254.74	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	544.00	9 718.00	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	1 740.00	25 686.51	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	7 377.00	71 152.99	0.01
スペイン合計		413 293.20	0.06
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	373.00	6 963.67	0.00
SEK ASSA ABLOY SER' B' NPV (POST SPLIT)	1 953.00	36 997.44	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' A' NPV (POST SPLIT)	1 159.00	37 163.41	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	329.00	9 544.52	0.00
USD AUTOLIV INC COM	157.00	18 158.62	0.00
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	607.00	17 713.66	0.00
SEK ELECTROLUX AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	335.00	8 909.98	0.00
SEK ERICSSON SER' B' NPV	4 717.00	27 870.53	0.00
SEK GETINGE AB SER' B' NPV	273.00	4 415.92	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER' B' NPV	1 368.00	39 123.27	0.01
SEK HEXAGON AB SER' B' NPV	306.00	12 111.74	0.00
SEK INVESTOR AB SER' B' NPV	920.00	36 719.59	0.01
SEK KINNEVIK INV AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	240.00	6 158.14	0.00
SEK LUNDIN PETROLEUM A NPV	405.00	8 737.87	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV (SEK QUOTE)	5 828.00	70 469.89	0.01
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	1 773.00	23 933.15	0.00
SEK SECURITAS SER' B' NPV	1 274.00	20 287.00	0.00
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER' A' NPV	2 279.00	25 614.50	0.00
SEK SKANSKA AB SER' B' NPV	454.00	11 114.21	0.00
SEK SKF AB SER' B' NPV	827.00	16 650.50	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
SEK SVENSKA CELLULOSA SER' B' NPV	1 011.00	30 416.97	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER' A' NPV (P/S)	1 818.00	27 161.02	0.00
SEK SWEDBANK AB SER' A' NPV	1 474.00	37 281.66	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV	250.00	8 139.24	0.00
SEK TELE2 AB SHS	390.00	3 441.99	0.00
SEK TELIASONERA AB NPV	6 158.00	24 986.76	0.00
SEK VOLVO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	3 212.00	41 079.62	0.01
スウェーデン合計		611 164.87	0.08
スイス			
GPB GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	22 173.00	91 066.01	0.01
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR) (POST SUBD)	54.00	3 593.25	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	3.00	15 766.27	0.00
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	608.00	8 012.91	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	79.00	27 985.51	0.01
CHF SWISS RE AG CHF0.10	537.00	50 129.43	0.01
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	1 449.00	7 549.29	0.00
GBP WOLSELEY ORD GBP0.108030303 (POST CON)	286.00	17 656.20	0.00
スイス合計		221 758.87	0.03
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	1 212.00	10 673.72	0.00
GBP ABERDEEN ASSET MGT ORD GBP0.10	1 305.00	4 303.22	0.00
GBP ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001	258.00	5 764.71	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	1 954.00	33 384.09	0.01
GBP ANTOFAGASTA ORD GBP0.05	1 002.00	10 526.15	0.00
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	425.00	47 897.50	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	1 080.00	21 821.49	0.00
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBP0.0568	810.00	24 314.80	0.00
GBP ASTRAZENCA ORD USD0.25	2 026.00	106 901.31	0.02
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	3 470.00	17 462.43	0.00
GBP AVIVA ORD GBP0.25	5 643.00	33 857.32	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	4 641.00	33 982.06	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	22 051.00	60 880.62	0.01
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	3 072.00	55 557.70	0.01
GBP BP ORD USD0.25	30 158.00	179 407.70	0.03
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	3 045.00	187 695.66	0.03
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	1 342.00	9 843.20	0.00
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	14 606.00	55 834.89	0.01
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	491.00	12 904.32	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	406.00	8 376.93	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBP0.02066666	672.00	4 231.44	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	179.00	9 543.97	0.00
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	8 139.00	22 967.60	0.00
GBP COBHAM ORD GBP0.025	2 539.00	4 331.49	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.10625	2 355.00	41 835.10	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10357143	207.00	8 719.09	0.00
USD DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01	523.00	36 641.38	0.01
GBP DIAGEO ORD GBX28.935185	3 744.00	103 792.04	0.02
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	3 391.00	15 145.07	0.00
GBP DIXONS CARPHONE ORD GBP0.001	3 836.00	15 245.56	0.00
GBP EASYJET ORD GBP0.27285714 (POST CONS)	498.00	5 952.07	0.00
GBP G4S ORD GBP0.25	1 687.00	5 416.40	0.00
GBP GKN ORD GBP0.50	3 554.00	15 354.41	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	7 085.00	136 200.40	0.02
GBP HAMMERSON PLC REIT	1 529.00	10 512.67	0.00
GBP HARGREAVES LANSLOW ORD GBP0.004 (WI)	536.00	9 123.84	0.00
GBP HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10	447.00	10 257.64	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50 (UK REG)	32 105.00	273 206.76	0.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	IHS MARKIT LTD COM	462.00	18 225.90	0.00
GBP	IMI ORD GBPO.2857	308.00	4 518.19	0.00
GBP	IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10	1 426.00	65 904.45	0.01
GBP	INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.1896656535	245.00	11 343.03	0.00
GBP	INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	211.00	9 004.37	0.00
GBP	INTU PROPERTIES PLC GBPO.50	1 170.00	3 978.75	0.00
GBP	INVESTEC ORD GBPO.0002	1 252.00	8 844.42	0.00
GBP	ITV ORD GBPO.10	8 108.00	20 727.78	0.00
GBP	JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	211.00	8 630.08	0.00
GBP	KINGFISHER ORD GBPO.157142857	4 730.00	20 006.63	0.00
GBP	LAND SECURITIES GROUP PLC REIT	857.00	10 717.23	0.00
GBP	LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	9 450.00	27 927.37	0.01
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	1 114.00	39 134.82	0.01
USD	LIBERTY GLOBAL PLC LILAC SHS CL C USD	138.00	3 080.16	0.00
GBP	LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBPO.25	94 340.00	77 064.87	0.01
GBP	LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	568.00	22 659.99	0.00
GBP	MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	1 801.00	7 601.89	0.00
GBP	MERLIN ENTERTAINME ORD GBPO.01 (WI)	2 512.00	15 078.01	0.00
GBP	MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	5 339.00	15 858.83	0.00
GBP	NATIONAL GRID ORD GBPO.11395	5 094.00	59 454.08	0.01
GBP	NEXT ORD GBPO.10	178.00	8 576.97	0.00
GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBPO.114285714(POST CON	3 938.00	10 290.29	0.00
GBP	PEARSON ORD GBPO.25	1 406.00	10 949.42	0.00
GBP	PERSIMMON ORD GBPO.10	640.00	15 532.00	0.00
GBP	PETROFAC ORD USD0.02	692.00	7 983.45	0.00
GBP	PROVIDENT FINL ORD GBX20.727272	475.00	16 284.53	0.00
GBP	PRUDENTIAL ORD GBPO.05	4 276.00	82 416.02	0.01
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	943.00	80 721.86	0.01
GBP	RELX PLC GBPO.1444	2 040.00	36 521.64	0.01
GBP	RIO TINTO ORD GBPO.10	1 828.00	80 286.26	0.01
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	2 484.00	20 860.18	0.00
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	3 770.00	10 520.06	0.00
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	1 064.00	7 676.98	0.00
GBP	SAGE GROUP GBPO.01051948	1 490.00	11 491.11	0.00
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	1 622.00	5 262.81	0.00
GBP	SCHROEDERS VTG SHS GBP1	210.00	7 751.66	0.00
GBP	SEGRO PLC ORD GBPO.10	1 656.00	9 614.95	0.00
GBP	SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	286.00	8 167.84	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBPO.50	1 945.00	24 494.52	0.01
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	1 452.00	21 610.58	0.00
GBP	SSE PLC ORD GBPO.50	1 715.00	32 127.28	0.01
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	4 731.00	46 074.98	0.01
GBP	STANDARD LIFE ORD GBPO.1222222	3 603.00	15 670.35	0.00
GBP	TATE & LYLE ORD GBPO.25	708.00	5 972.38	0.00
GBP	TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	6 288.00	13 219.17	0.00
USD	TECHNIPFMC LIMITED COM USD1	470.00	15 801.40	0.00
EUR	TECHNIPFMC PLC COM USD1	204.00	6 693.25	0.00
GBP	TESCO ORD GBPO.05	12 025.00	29 440.36	0.01
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBPO.10	303.00	5 538.90	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	2 169.00	88 072.64	0.01
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	770.00	8 883.32	0.00
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	42 632.00	104 240.24	0.02
GBP	WEIR GROUP ORD GBPO.125	233.00	5 877.40	0.00
GBP	WHITBREAD ORD GBPO.76797385	223.00	11 011.83	0.00
GBP	WILLIAM HILL ORD GBPO.10	1 286.00	4 188.78	0.00
USD	WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	191.00	23 899.83	0.00
GBP	WORLDPAY GRP PLC ORD GBPO.03 (WI)	4 315.00	15 520.66	0.00
GBP	WPP PLC ORD GBPO.10	1 762.00	40 877.28	0.01
イギリス合計			3 049 750.78	0.42

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
アメリカ合衆国			
USD 3M CO COM	914.00	159 785.48	0.02
USD ABBOTT LABS COM	2 561.00	106 972.97	0.02
USD ABBVIE INC COM USD0.01	2 486.00	151 919.46	0.02
USD ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	966.00	38 842.86	0.01
USD ACUITY BRANDS INC COM STK USD0.01	58.00	12 019.34	0.00
USD ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	719.00	81 520.22	0.01
USD ADVANCE AUTO PARTS INC COM	100.00	16 424.00	0.00
USD AES CORP COM	1 573.00	17 995.12	0.00
USD AETNA INC COM USD0.01	591.00	70 098.51	0.01
USD AFLAC INC COM USD0.10	646.00	45 213.54	0.01
USD AGCO CORP COM USD0.01	100.00	6 280.00	0.00
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	598.00	29 284.06	0.01
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	400.00	7 468.00	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	325.00	45 422.00	0.01
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	200.00	13 718.00	0.00
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	9 264.00	0.00
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	392.00	51 226.56	0.01
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	588.00	128 707.32	0.02
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	56.00	12 789.28	0.00
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	200.00	7 530.00	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	728.00	54 752.88	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	900.00	19 008.00	0.00
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	477.00	380 068.83	0.05
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	447.00	366 624.93	0.05
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	3 090.00	219 946.20	0.03
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	618.00	508 910.64	0.07
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	781.00	50 030.86	0.01
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	1 385.00	105 786.30	0.02
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 960.00	125 949.60	0.02
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	609.00	63 031.50	0.01
USD AMEREN CORP COM	595.00	31 326.75	0.01
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	210.00	15 422.40	0.00
USD AMERIPRISE FINL INC COM	325.00	36 487.75	0.01
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	300.00	26 184.00	0.00
USD AMETEK INC COM USD0.01	506.00	25 856.60	0.00
USD AMGEN INC COM USD0.0001	1 178.00	184 569.04	0.03
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	400.00	26 996.00	0.00
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	691.00	48 045.23	0.01
USD ANALOG DEVICES INC COM	382.00	28 627.08	0.00
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	1 866.00	19 070.52	0.00
USD ANSYS INC COM	200.00	18 652.00	0.00
USD ANTERO RES CORP USD0.01	600.00	14 646.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	454.00	69 979.56	0.01
USD APACHE CORP COM USD0.625	537.00	32 123.34	0.01
USD APPLE INC COM NPV	8 573.00	1 040 333.55	0.15
USD APPLIED MATLS INC COM	1 677.00	57 437.25	0.01
USD ARAMARK COM USD0.01	400.00	13 536.00	0.00
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	966.00	42 755.16	0.01
USD ARCONIC INC COM USD1.00	655.00	14 927.45	0.00
USD ARROW ELECTRS INC COM	100.00	7 352.00	0.00
USD ASHLAND GLOBAL HLD COM USD0.01	100.00	11 903.00	0.00
USD ASSURANT INC COM	100.00	9 713.00	0.00
USD AT&T INC COM USD1	9 068.00	382 306.88	0.05
USD ATMOS ENERGY CORP COM	200.00	15 236.00	0.00
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	655.00	66 148.45	0.01
USD AUTODESK INC COM USD0.01	465.00	37 823.10	0.01
USD AUTONATION INC COM	303.00	16 095.36	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	21.00	15 224.58	0.00
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	218.00	37 781.58	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	227.00	16 575.54	0.00
USD AVNET INC COM	100.00	4 644.00	0.00
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	600.00	17 400.00	0.00
USD BAKER HUGHES INC COM USD1	726.00	45 796.08	0.01
USD BALL CORP COM	246.00	18 759.96	0.00
USD BARD(CR)INC COM USD0.25	100.00	23 733.00	0.00
USD BAXTER INTL INC COM USD1	812.00	38 902.92	0.01
USD BB&T CORP COM USD5	1 386.00	64 019.34	0.01
USD BE AEROSPACE COM USD0.01	200.00	12 294.00	0.00
USD BECTON DICKINSON COM USD1	319.00	56 555.51	0.01
USD BED BATH & BEYOND INC COM	407.00	16 422.45	0.00
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	6 721.00	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1 854.00	304 315.56	0.04
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	683.00	30 407.16	0.01
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	318.00	88 162.32	0.01
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	300.00	26 289.00	0.00
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	16 158.00	365 817.12	0.05
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	1 605.00	71 791.65	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	163.00	60 958.74	0.01
USD BLOCK(H&R)INC COM NPV	675.00	14 485.50	0.00
USD BOEING CO COM USD5	1 018.00	166 361.56	0.02
USD BORG WARNER INC COM	448.00	18 291.84	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	227.00	29 714.30	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	2 400.00	57 744.00	0.01
USD BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	2 582.00	126 931.12	0.02
USD BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	554.00	13 368.02	0.00
USD BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	225.00	14 969.25	0.00
USD BROWN FORMAN CORP CL B	344.00	15 686.40	0.00
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	208.00	14 395.68	0.00
USD CA INC COM USD0.10	709.00	22 170.43	0.00
USD CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	737.00	15 830.76	0.00
USD CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	600.00	15 618.00	0.00
USD CALPINE CORP COM STK USD0.001	400.00	4 720.00	0.00
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	421.00	26 198.83	0.00
USD CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	850.00	74 281.50	0.01
USD CARDINAL HEALTH INC COM	559.00	41 902.64	0.01
USD CARMAX INC COM USD0.50	447.00	29 819.37	0.01
USD CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	641.00	35 498.58	0.01
USD CATERPILLAR INC DEL COM	937.00	89 633.42	0.01
USD CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	377.00	11 445.72	0.00
USD CBS CORP NEW CL B	860.00	55 461.40	0.01
USD CDW CORP COM USD0.01	400.00	20 604.00	0.00
USD CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	200.00	16 880.00	0.00
USD CELGENE CORP COM USD0.01	1 286.00	149 368.90	0.02
USD CENTENE CORP DEL COM	300.00	18 981.00	0.00
USD CENTERPOINT ENERGY INC COM	411.00	10 772.31	0.00
USD CENTURYLINK INC COM	1 058.00	27 359.88	0.00
USD CERNER CORP COM	515.00	27 660.65	0.00
USD CF INDS HLDGS INC COM	315.00	11 116.35	0.00
USD CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	246.00	18 710.76	0.00
USD CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	288.00	93 297.60	0.01
USD CHENIERE ENERGY INC COM NEW	200.00	9 530.00	0.00
USD CHEVRON CORP COM USD0.75	2 890.00	321 801.50	0.05
USD CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	61.00	25 707.84	0.00
USD CHURCH & DWIGHT INC COM	278.00	12 571.16	0.00
USD CIGNA CORP COM USD0.25	403.00	58 926.66	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01	100.00	13 521.00	0.00
USD CINCINNATI FINL CORP COM	405.00	28 584.90	0.00
USD CINTAS CORP COM	100.00	11 611.00	0.00
USD CISCO SYSTEMS COM USD0.001	7 614.00	233 902.08	0.03
USD CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	437.00	18 000.03	0.00
USD CITIGROUP INC COM USD0.01	4 700.00	262 401.00	0.04
USD CITIZENS FINL GP COM USD0.01	971.00	35 121.07	0.01
USD CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	200.00	18 238.00	0.00
USD CLOROX CO DEL COM	254.00	30 480.00	0.01
USD CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS' A'	436.00	52 790.88	0.01
USD CMS ENERGY CORP COM	300.00	12 780.00	0.00
USD COACH INC COM USD0.01	473.00	17 666.55	0.00
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	6 282.00	261 142.74	0.04
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL' A' USD0.01	876.00	46 068.84	0.01
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	1 323.00	85 439.34	0.01
USD COMCAST CORP COM CLS' A' USD0.01	3 753.00	283 051.26	0.04
USD COMERICA INC COM	307.00	20 731.71	0.00
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	808.00	31 584.72	0.01
USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001	94.00	13 107.36	0.00
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	1 963.00	95 715.88	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	558.00	41 487.30	0.01
USD CONSTELLATION BRDS CLASS' A' COM USD0.01	289.00	43 280.64	0.01
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	146.00	7 089.76	0.00
USD COOPER COS INC COM USD0.10	100.00	18 461.00	0.00
USD CORNING INC COM USD0.50	1 991.00	52 741.59	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	669.00	109 682.55	0.02
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	503.00	44 178.49	0.01
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	242.00	13 109.14	0.00
USD CSX CORP COM USD1	1 412.00	65 502.68	0.01
USD CUMMINS INC COM	169.00	24 844.69	0.00
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	1 667.00	131 376.27	0.02
USD D R HORTON INC COM	839.00	25 094.49	0.00
USD DANAHER CORP COM USD0.01	843.00	70 744.56	0.01
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	338.00	24 768.64	0.00
USD DAVITA INC COM USD0.001	200.00	12 750.00	0.00
USD DEERE & CO COM USD1	560.00	59 948.00	0.01
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V	326.00	20 534.74	0.00
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	352.00	16 628.48	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	391.00	22 169.70	0.00
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	608.00	27 688.32	0.00
USD DICKS SPORTING GOO COM USD0.01	200.00	10 320.00	0.00
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	156.00	16 790.28	0.00
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	811.00	56 186.08	0.01
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	150.00	4 252.50	0.00
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	450.00	12 469.50	0.00
USD DISH NETWORK CORPO CLASS' A' COM USD0.01	444.00	26 271.48	0.00
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	473.00	34 916.86	0.01
USD DOLLAR TREE INC	324.00	25 009.56	0.00
USD DOMINION RES(VIR) COM STK NPV	854.00	65 143.12	0.01
USD DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01	100.00	17 454.00	0.00
USD DOVER CORP COM	200.00	15 550.00	0.00
USD DOW CHEMICAL CO COM USD2.50	1 703.00	101 549.89	0.02
USD DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	352.00	32 102.40	0.01
USD DTE ENERGY CO COM	230.00	22 687.20	0.00
USD DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30	1 300.00	98 150.00	0.01
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	1 038.00	81 524.52	0.01
USD DUKE REALTY CORP COM USD0.01	537.00	13 065.21	0.00
USD DUN & BRADSTREET CORP DEL NEW COM	134.00	16 431.08	0.00
USD E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	600.00	22 470.00	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD EASTMAN CHEM CO COM	200.00	15 500.00	0.00
USD EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	4 193.00	0.00
USD EBAY INC COM USDO.001	1 713.00	54 524.79	0.01
USD ECOLAB INC COM	354.00	42 526.02	0.01
USD EDGEWELL PERSONAL COM USDO.01	92.00	7 253.28	0.00
USD EDISON INTL COM	382.00	27 840.16	0.00
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	366.00	35 223.84	0.01
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	493.00	41 130.99	0.01
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	1 621.00	124 865.63	0.02
USD EMERSON ELEC CO COM	1 030.00	60 419.80	0.01
USD ENERGY CORP NEW COM	232.00	16 620.48	0.00
USD ENVISION HEALTHCAR COM USDO.01	200.00	13 600.00	0.00
USD EOG RESOURCES INC COM USDO.01	875.00	88 882.50	0.01
USD EQT CORPORATION	247.00	14 975.61	0.00
USD EQUIFAX INC COM	100.00	11 728.00	0.00
USD EQUINIX INC COM USDO.001 NEW	104.00	40 037.92	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USDO.01	606.00	36 826.62	0.01
USD ESSEX PROP TRUST COM USDO.0001	68.00	15 252.40	0.00
USD ESTEE LAUDER COS CLASS' A' COM USDO.01	361.00	29 316.81	0.01
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	407.00	22 515.24	0.00
USD EXELON CORP COM NPV	1 267.00	45 459.96	0.01
USD EXPEDIA INC COM USDO.001 (POST-SPLIT)	237.00	28 816.83	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USDO.01	200.00	10 416.00	0.00
USD EXPRESS SCRIPTS HL COM USDO.01	1 192.00	82 104.96	0.01
USD EXTRA SPACE STORAG COM USDO.01	198.00	14 265.90	0.00
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	6 416.00	538 238.24	0.08
USD F M C CORP COM NEW	200.00	12 032.00	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	97.00	13 000.91	0.00
USD FACEBOOK INC COM USDO.000006 CL 'A'	3 560.00	463 939.20	0.07
USD FASTENAL CO COM	376.00	18 679.68	0.00
USD FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	81.00	11 374.83	0.00
USD FEDEX CORP COM USDO.10	421.00	79 615.31	0.01
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USDO.0001	325.00	11 492.00	0.00
USD FIDELITY NATL INF COM STK USDO.01	498.00	39 551.16	0.01
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	1 141.00	29 780.10	0.01
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USDO.01	200.00	18 866.00	0.00
USD FIRSTENERGY CORP COM USDO.10	757.00	22 952.24	0.00
USD FISERV INC COM USDO.01	437.00	46 946.91	0.01
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USDO.001	100.00	14 749.00	0.00
USD FLIR SYS INC COM	303.00	10 704.99	0.00
USD FLOWSERVE CORP COM	300.00	14 748.00	0.00
USD FLUOR CORP NEW COM	216.00	11 988.00	0.00
USD FOOT LOCKER INC COM USDO.01	267.00	18 300.18	0.00
USD FORD MOTOR CO COM STK USDO.01	4 974.00	61 478.64	0.01
USD FORTINET INC COM USDO.001	500.00	16 630.00	0.00
USD FORTIVE CORP COM USDO.01	421.00	23 285.51	0.00
USD FORTUNE BRANDS HOME USDO.01 WI	261.00	14 388.93	0.00
USD FRANKLIN RES INC COM	714.00	28 374.36	0.00
USD FREEPORT-MCMOR C&G COM STK USDO.10	1 447.00	24 092.55	0.00
USD FRONTIER COMMUNICA COM USDO.25	848.00	2 959.52	0.00
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	333.00	17 925.39	0.00
USD GAP INC DEL COM	432.00	9 948.96	0.00
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	311.00	56 315.88	0.01
USD GEN ELEC CO COM USDO.06	14 216.00	422 215.20	0.06
USD GENERAL MLS INC COM	973.00	60 793.04	0.01
USD GENERAL MOTORS CO COM USDO.01	1 860.00	68 094.60	0.01
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	262.00	25 364.22	0.00
USD GGP INC COM USDO.01	1 144.00	28 416.96	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	2 116.00	153 304.20	0.02
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	250.00	19 320.00	0.00
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	601.00	137 821.32	0.02
USD GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	577.00	18 689.03	0.00
USD GRACE W R & CO DEL NEW COM	200.00	13 868.00	0.00
USD GRAINGER W W INC COM	53.00	13 386.21	0.00
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	1 205.00	68 166.85	0.01
USD HANESBRANDS INC COM	700.00	16 597.00	0.00
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	408.00	23 272.32	0.00
USD HARMAN INTL INDS INC COM	207.00	23 010.12	0.00
USD HARRIS CORP COM STK USD1	280.00	28 758.80	0.00
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	556.00	27 082.76	0.00
USD HASBRO INC COM	100.00	8 251.00	0.00
USD HCA HLDGS INC COM USD0.01	543.00	43 592.04	0.01
USD HCP INC COM USD1	850.00	25 772.00	0.00
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	255.00	18 145.80	0.00
USD HERSHEY CO COM	191.00	20 144.77	0.00
USD HESS CORPORATION COM USD1	479.00	25 952.22	0.00
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	2 736.00	62 052.48	0.01
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01 WI	266.00	15 316.28	0.00
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	199.00	5 765.03	0.00
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	600.00	24 318.00	0.00
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	1 896.00	260 851.68	0.04
USD HONEYWELL INTL INC COM	1 073.00	126 957.36	0.02
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	400.00	14 520.00	0.00
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	1 436.00	25 948.52	0.00
USD HP INC COM USD0.01	2 736.00	41 176.80	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	247.00	49 029.50	0.01
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	9 908.00	0.00
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	200.00	24 466.00	0.00
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	418.00	53 169.60	0.01
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	196.00	31 379.60	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	200.00	24 242.00	0.00
USD INGREDION INC COM USD0.01	100.00	12 819.00	0.00
USD INTEL CORP COM USD0.001	6 941.00	255 567.62	0.04
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	670.00	39 101.20	0.01
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	157.00	18 401.97	0.00
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	600.00	14 118.00	0.00
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	1 485.00	259 162.20	0.04
USD INTL PAPER CO COM	784.00	44 374.40	0.01
USD INTUIT INC COM USD0.01	347.00	41 147.26	0.01
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	50.00	34 634.50	0.01
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	568.00	16 426.56	0.00
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	515.00	18 437.00	0.00
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	312.00	18 267.60	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	4 275.00	484 143.75	0.07
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	1 513.00	66 541.74	0.01
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	5 672.00	480 021.36	0.07
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	881.00	23 593.18	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	100.00	8 591.00	0.00
USD KELLOGG CO COM USD0.25	292.00	21 231.32	0.00
USD KEYCORP NEW COM	700.00	12 579.00	0.00
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	536.00	64 925.68	0.01
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	400.00	9 956.00	0.00
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	2 864.00	63 981.76	0.01
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	100.00	8 511.00	0.00
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	261.00	10 395.63	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	876.00	78 218.04	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD KROGER CO COM USD1	1 556.00	52 841.76	0.01
USD L BRANDS INC COM USD0.50	454.00	27 335.34	0.00
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	100.00	13 421.00	0.00
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	360.00	41 349.60	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	573.00	30 128.34	0.01
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	4 772.00	0.00
USD LENNAR CORP COM CL' A' USD0.10	300.00	13 395.00	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	687.00	16 384.95	0.00
USD LEVEL 3 COMMUNICAT COM USD0.01 (POST REV SPLIT)	616.00	36 627.36	0.01
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	446.00	16 270.08	0.00
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	985.00	18 892.30	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	100.00	3 624.00	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	200.00	7 178.00	0.00
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	479.00	32 337.29	0.01
USD LINEAR TECHNOLOGY COM USD0.001	498.00	31 438.74	0.01
USD LKQ CORP COM	300.00	9 573.00	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	378.00	95 002.74	0.01
USD LOEWS CORP COM	377.00	17 560.66	0.00
USD LOWE' S COS INC COM USD0.50	1 505.00	109 985.40	0.02
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	586.00	54 656.22	0.01
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	261.00	42 430.77	0.01
USD MACERICH CO COM USD0.01	149.00	10 234.81	0.00
USD MACY' S INC COM STK USD0.01	592.00	17 487.68	0.00
USD MANPOWER GROUP COM USD0.01	243.00	23 196.78	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	1 109.00	18 575.75	0.00
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	972.00	46 704.60	0.01
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	665.00	56 259.00	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	879.00	59 789.58	0.01
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	128.00	29 388.80	0.01
USD MASCO CORP COM	922.00	30 379.90	0.01
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	1 452.00	154 391.16	0.02
USD MATTEL INC COM USD1	610.00	15 988.10	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	287.00	12 765.76	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	300.00	28 665.00	0.00
USD MCDONALD' S CORP COM USD0.01	1 437.00	176 133.09	0.03
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	329.00	45 780.35	0.01
USD MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01	222.00	15 642.12	0.00
USD MEDNAX INC COM USD0.01	200.00	13 670.00	0.00
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	2 142.00	162 834.84	0.02
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	4 130.00	256 018.70	0.04
USD METLIFE INC COM USD0.01	1 284.00	69 862.44	0.01
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	415.00	11 952.00	0.00
USD MICROCHIP TECHNLY COM USD0.001	200.00	13 470.00	0.00
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	1 482.00	35 731.02	0.01
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	11 626.00	751 620.90	0.11
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	136.00	12 913.20	0.00
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	94.00	20 288.96	0.00
USD MOLSON COORS BREWI COM CLS' B' COM NON-V USD0.01	353.00	34 071.56	0.01
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	2 346.00	103 880.88	0.02
USD MONSANTO COM STK USD0.01	752.00	81 449.12	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005 (NEW)	600.00	25 560.00	0.00
USD MOODYS CORP COM USD0.01	200.00	20 734.00	0.00
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	2 067.00	87 826.83	0.01
USD MOSAIC CO COM USD0.01	585.00	18 351.45	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	443.00	35 754.53	0.01
USD MSCI INC COM STK USS0.01	200.00	16 550.00	0.00
USD MURPHY OIL CORP COM USD1	238.00	6 880.58	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD MYLAN NV EURO.01	601.00	22 868.05	0.00
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	100.00	7 054.00	0.00
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	615.00	23 253.15	0.00
USD NAVIENT CORP COM USD0.01	500.00	7 520.00	0.00
USD NETAPP INC COM USD0.001	677.00	25 942.64	0.00
USD NETFLIX INC COM USD0.001	729.00	102 577.59	0.02
USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	1 095.00	16 633.05	0.00
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	631.00	29 865.23	0.01
USD NEWFIELD EXPL CO COM	358.00	14 348.64	0.00
USD NEWMONT MINING CORP COM	946.00	34 320.88	0.01
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL' A'	325.00	3 994.25	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	700.00	86 604.00	0.01
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	575.00	23 523.25	0.00
USD NIKE INC CLASS' B' COM NPV	2 020.00	106 858.00	0.02
USD NISOURCE INC COM NPV	568.00	12 706.16	0.00
USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	756.00	30 058.56	0.01
USD NORDSTROM INC COM NPV	329.00	14 548.38	0.00
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	474.00	55 676.04	0.01
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	256.00	21 237.76	0.00
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	267.00	61 164.36	0.01
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	400.00	18 800.00	0.00
USD NUANCE COMMUNICATI COM USD0.001	494.00	7 834.84	0.00
USD NUCOR CORP COM	666.00	38 687.94	0.01
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	1 258.00	137 348.44	0.02
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	1 125.00	76 241.25	0.01
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	200.00	6 708.00	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	333.00	28 521.45	0.00
USD ONEOK INC	209.00	11 517.99	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	4 916.00	197 180.76	0.03
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	198.00	51 929.46	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	401.00	26 991.31	0.00
USD PACKAGING CORP AMER COM	200.00	18 436.00	0.00
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	134.00	19 773.04	0.00
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	216.00	31 780.08	0.01
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	100.00	4 161.00	0.00
USD PAYCHEX INC COM	409.00	24 658.61	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	1 713.00	68 143.14	0.01
USD PEOPLE' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	576.00	10 800.00	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	2 182.00	226 447.96	0.03
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	137.00	10 432.55	0.00
USD PFIZER INC COM USD0.05	9 587.00	304 195.51	0.04
USD PG&E CORP COM	786.00	48 645.54	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	2 315.00	222 540.95	0.03
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	795.00	64 887.90	0.01
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	100.00	7 763.00	0.00
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	276.00	49 743.48	0.01
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	744.00	89 622.24	0.01
USD POLARIS INDS INC COM	100.00	8 407.00	0.00
USD PPG INDS INC COM	346.00	34 603.46	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	1 086.00	37 836.24	0.01
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	402.00	47 612.88	0.01
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	69.00	108 683.97	0.02
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	504.00	28 773.36	0.01
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	4 179.00	366 080.40	0.05
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	1 038.00	38 862.72	0.01
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	855.00	41 766.75	0.01
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	630.00	66 219.30	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	200.00	43 000.00	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	889.00	39 338.25	0.01
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	537.00	11 550.87	0.00
USD PVH CORP COM USD1	100.00	9 381.00	0.00
USD QORVO INC COM USD 0.0001	300.00	19 263.00	0.01
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	2 492.00	133 147.56	0.02
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	246.00	22 612.32	0.00
USD QUINTILES IMS HOLD COM USD0.01	430.00	33 750.70	0.01
USD RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	100.00	8 843.00	0.00
USD RANGE RES CORP COM USD0.01	206.00	6 662.04	0.00
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	200.00	14 986.00	0.00
USD RAYTHEON CO COM NEW	457.00	65 881.12	0.01
USD REALTY INCOME CORP	437.00	26 058.31	0.00
USD RED HAT INC COM	411.00	31 186.68	0.01
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	318.00	22 174.14	0.00
USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM	70.00	25 150.30	0.00
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	900.00	12 969.00	0.00
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	695.00	39 879.10	0.01
USD RESMED INC COM USD0.004	200.00	13 508.00	0.00
USD REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001	1 516.00	91 157.08	0.01
USD RITE AID CORP COM	2 028.00	11 397.36	0.00
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	100.00	4 706.00	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	218.00	32 261.82	0.01
USD ROCKWELL COLLINS INC COM	299.00	27 137.24	0.00
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	198.00	37 986.30	0.01
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	661.00	43 698.71	0.01
USD ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	383.00	35 860.29	0.01
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	382.00	45 908.76	0.01
USD SABRE CORP COM USD0.01	500.00	12 250.00	0.00
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	1 006.00	79 574.60	0.01
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	234.00	24 630.84	0.00
USD SCANA CORP NEW COM	299.00	20 541.30	0.00
USD SCHEIN HENRY INC COM	100.00	15 986.00	0.00
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	2 165.00	181 232.15	0.03
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	1 600.00	65 984.00	0.01
USD SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	105.00	7 996.80	0.00
USD SEALED AIR CORP NEW COM	200.00	9 700.00	0.00
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	269.00	13 049.19	0.00
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	372.00	38 089.08	0.01
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	200.00	18 124.00	0.00
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	100.00	30 381.00	0.01
USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	444.00	81 593.88	0.01
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	200.00	18 348.00	0.00
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	132.00	17 932.20	0.00
USD SNAP-ON INC COM USD1	94.00	17 063.82	0.00
USD SOUTHERN CO COM	1 290.00	63 764.70	0.01
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	679.00	35 518.49	0.01
USD SPECTRA ENERGY COR COM USD0.001	929.00	38 692.85	0.01
USD SPLUNK INC COM USD0.001	300.00	17 358.00	0.00
USD SPRINT CORPORATION COM USD0.01	668.00	6 165.64	0.00
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	272.00	33 728.00	0.01
USD STAPLES INC COM STK USD0.0006	1 387.00	12 760.40	0.00
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	2 168.00	119 716.96	0.02
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	645.00	49 149.00	0.01
USD STERICYCLE INC COM	100.00	7 714.00	0.00
USD STHWESTN ENERGY CO COM USD0.01	432.00	3 892.32	0.00
USD STRYKER CORP COM USD0.10	495.00	61 147.35	0.01
USD SUNTRUST BKS INC COM	905.00	51 422.10	0.01
USD SYMANTEC CORP COM	1 174.00	32 343.70	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	1 046.00	37 467.72	0.01
USD SYNOPSIS INC COM USD0.01	200.00	12 578.00	0.00
USD SYSCO CORP COM USD1	959.00	50 309.14	0.01
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	486.00	32 775.84	0.01
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	400.00	24 908.00	0.00
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	907.00	58 483.36	0.01
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	409.00	18 875.35	0.00
USD TEGNA INC COM USD1	700.00	16 037.00	0.00
USD TESLA MOTORS INC COM USD0.001	200.00	50 386.00	0.01
USD TESORO CORP COM	200.00	16 170.00	0.00
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	1 557.00	117 615.78	0.02
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	601.00	91 586.39	0.01
CAD THOMSON-REUTERS CO COM NPV	674.00	30 154.88	0.01
USD TIFFANY & CO NEW COM	261.00	20 545.92	0.00
USD TIME WARNER INC COM USD0.01	1 391.00	134 718.35	0.02
USD TJX COS INC COM USD1	1 032.00	77 317.44	0.01
USD TOLL BROS INC COM USD0.01	475.00	14 896.00	0.00
USD TORCHMARK CORP COM	225.00	16 546.50	0.00
USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	213.00	10 794.84	0.00
USD TRACTOR SUPPLY CO COM	200.00	14 734.00	0.00
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	56.00	12 118.40	0.00
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	516.00	60 774.48	0.01
USD TRIMBLE INC COM NPV	300.00	8 886.00	0.00
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	100.00	5 290.00	0.00
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' A'	2 121.00	66 556.98	0.01
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' B'	500.00	15 505.00	0.00
USD TWITTER INC COM USD0.000005	900.00	15 858.00	0.00
USD TYSON FOODS INC CL A	510.00	32 022.90	0.01
USD UDR INC	351.00	12 267.45	0.00
USD UGI CORP NEW COM	300.00	13 911.00	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	200.00	4 298.00	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL C	201.00	3 863.22	0.00
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	1 280.00	136 422.40	0.02
USD UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	289.00	20 365.83	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	1 033.00	112 731.29	0.02
USD UNITED RENTALS INC COM	200.00	25 302.00	0.00
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	1 475.00	239 097.50	0.03
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS' B' COM USD0.01	200.00	22 526.00	0.00
USD UNUM GROUP COM USD0.10	615.00	27 939.45	0.00
USD US BANCORP COM USD0.01	2 907.00	153 053.55	0.02
USD UTD TECHNOLOGIES COM USD1	1 248.00	136 868.16	0.02
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	903.00	59 381.28	0.01
USD VANTIV INC COM USD0.00001 A	500.00	31 120.00	0.01
USD VAREX IMAGING CORP COM USD0.01 WI	40.00	1 150.00	0.00
USD VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	100.00	7 765.00	0.00
USD VENTAS INC COM USD0.25	550.00	33 918.50	0.01
USD VEREIT INC COM USD0.001	1 092.00	9 314.76	0.00
USD VERISIGN INC COM	200.00	16 042.00	0.00
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	142.00	11 734.88	0.00
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	6 198.00	303 763.98	0.04
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	367.00	31 514.29	0.01
USD VF CORP COM NPV	636.00	32 741.28	0.01
USD VIACOM INC NEW CL' B' NON-VTG USD0.001	600.00	25 284.00	0.00
USD VISA INC COM STK USD0.0001	2 892.00	239 197.32	0.03
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	110.00	9 629.40	0.00
USD VORNADO REALTY TR COM USD0.04	263.00	27 959.53	0.00
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	700.00	28 154.00	0.00
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	324.00	41 578.92	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD WABCO HOLDINGS INC COM STK USD0.01	200.00	21 806.00	0.00
USD WABTEC CORP COM	200.00	17 328.00	0.00
USD WAL-MART STORES IN COM USD0.10	2 503.00	167 050.22	0.02
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	1 478.00	121 107.32	0.02
USD WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	2 382.00	263 568.30	0.04
USD WASTE MGMT INC DEL COM	816.00	56 712.00	0.01
USD WATERS CORP COM	100.00	14 165.00	0.00
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	712.00	42 043.60	0.01
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	7 433.00	418 700.89	0.06
USD WELLTOWER INC COM USD1	533.00	35 337.90	0.01
USD WESTAR ENERGY INC COM	300.00	16 407.00	0.00
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	305.00	24 317.65	0.00
USD WESTERN UN CO COM	1 348.00	26 393.84	0.00
USD WESTROCK CO COM USD0.01	434.00	23 158.24	0.00
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	1 807.00	56 613.31	0.01
USD WHIRLPOOL CORP COM	100.00	17 489.00	0.00
USD WHITEWAVE FOODS CO COM USD0.01 CL' A'	300.00	16 518.00	0.00
USD WHOLE FOODS MKT INC COM	337.00	10 184.14	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	1 021.00	29 445.64	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	8 309.00	0.00
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	286.00	22 611.16	0.00
USD WYNN RESORTS LTD COM	100.00	10 143.00	0.00
USD XCEL ENERGY INC COM	894.00	36 940.08	0.01
USD XEROX CORP COM	1 200.00	8 316.00	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	485.00	28 227.00	0.00
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	496.00	24 457.76	0.00
USD YAHOO INC COM STK USD0.001	1 457.00	64 209.99	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	646.00	42 332.38	0.01
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	198.00	23 429.34	0.00
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	920.00	50 544.80	0.01
アメリカ合衆国合計		31 153 196.45	4.34
無記名株合計		49 738 839.31	6.92
参加証書			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	3.00	16 663.29	0.00
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	89.00	16 959.25	0.00
スイス合計		33 622.54	0.00
参加証書合計		33 622.54	0.00
その他の株式			
オランダ			
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	2 554.00	103 214.23	0.01
オランダ合計		103 214.23	0.01
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	1 083.00	255 766.27	0.04
スイス合計		255 766.27	0.04
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	270.00	22 563.90	0.00
アメリカ合衆国合計		22 563.90	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
その他の株式合計		381 544.40	0.05
<b>優先株式</b>			
ドイツ			
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	284.00	12 979.60	0.00
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	322.00	39 217.95	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	141.00	8 457.02	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	310.00	48 208.95	0.01
ドイツ合計		108 863.52	0.02
優先株式合計		108 863.52	0.02
<b>記名株式</b>			
フランス			
EUR LAGARDERE SCA EUR6.10(REGD)	250.00	6 270.76	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	292.00	31 360.79	0.01
フランス合計		37 631.55	0.01
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	358.00	56 350.62	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV (REGD) (VINKULIERT)	773.00	130 987.76	0.02
EUR BASF SE NPV	1 390.00	133 873.66	0.02
EUR BAYER AG NPV (REGD)	1 345.00	148 697.30	0.02
EUR BRENTAG AG	159.00	9 234.21	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV (REGD)	1 615.00	121 038.67	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV (REGD)	2 013.00	40 006.51	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV (ASD UK HLDC0123 PLC)	351.00	32 333.72	0.00
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	229.00	3 052.67	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV (REGD)	1 540.00	51 517.73	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV (REGD)	5 475.00	95 616.01	0.01
EUR E. ON SE NPV	2 861.00	21 961.64	0.00
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	512.00	16 588.49	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV (REGD)	96.00	10 545.90	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	2 202.00	40 431.13	0.01
EUR K&S AG NPV	133.00	3 369.10	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV (REGD)	300.00	56 347.70	0.01
EUR OSRAM LICHT AG NPV	54.00	3 129.73	0.00
EUR PROSIEBENSAT1 MED. NPV	294.00	12 480.27	0.00
EUR SIEMENS AG NPV (REGD)	1 183.00	148 621.92	0.02
GBP TUI AG NPV (REGD)	372.00	5 438.31	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV (REGD)	215.00	8 990.81	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	654.00	21 394.16	0.00
ドイツ合計		1 172 008.02	0.16
日本			
JPY 浜松ホトニクス	500.00	14 501.44	0.00
日本合計		14 501.44	0.00
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV	2 222.00	17 263.06	0.01
EUR TENARIS S. A. USD1	961.00	16 793.40	0.00
ルクセンブルグ合計		34 056.46	0.01
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	2 139.00	6 213.63	0.00
ポルトガル合計		6 213.63	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)	25 354.00	141 082.95	0.02
EUR BANKINTER SA EURO.3(REGD)	2 649.00	21 284.73	0.00
EUR BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49	9 960.00	67 542.67	0.01
EUR MAPFRE SA EURO.10	3 639.00	11 011.47	0.00
スペイン合計		240 921.82	0.03
スイス			
CHF ABB LTD CHF1.03(REGD)	3 386.00	80 411.49	0.01
CHF ACTELION CHF0.50(REGD)	205.00	53 400.57	0.01
CHF ADECCO SA CHF1(REGD)	291.00	20 764.65	0.00
CHF ARYZTA AG CHF0.02(REGD)	124.00	3 413.58	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)	139.00	17 892.76	0.00
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	660.00	86 783.40	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)	2 695.00	40 946.74	0.01
CHF GALENICA AG CHF0.10(REGD)	11.00	12 063.65	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	4 829.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	83.00	35 468.07	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	17.00	30 653.76	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02(REGD)	483.00	22 637.26	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)	57.00	7 787.96	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2(REGD)	383.00	20 535.88	0.00
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2(REGD)	321.00	17 163.12	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	70.00	12 834.99	0.00
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	4 962.00	363 625.18	0.05
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	3 543.00	260 176.72	0.04
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01(REGD)	35.00	17 693.34	0.00
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00(REG) SER 'A'	754.00	58 617.27	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)	89.00	16 778.84	0.00
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	7.00	14 842.89	0.00
CHF SONOVA HOLDING AG	96.00	12 688.42	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	68.00	4 755.73	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	41.00	12 429.66	0.00
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3(REGD)	187.00	15 599.13	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	34.00	14 990.88	0.00
CHF SYNGENTA CHF0.1(REGD)	157.00	66 835.60	0.01
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	699.00	51 970.65	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10(REGD)	5 173.00	83 734.86	0.01
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	219.00	62 929.76	0.01
スイス合計		1 525 255.81	0.21
記名株式合計		3 030 588.73	0.42
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUPS EURO.5	850.00	13 344.34	0.00
アイルランド合計		13 344.34	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	1 274.00	42 589.82	0.01
イスラエル合計		42 589.82	0.01
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	81.00	4 008.49	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	317.00	6 169.90	0.00
ルクセンブルグ合計		10 178.39	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
オランダ			
EUR ABN AMRO GROUP NV DR EACH REP SHS	922.00	21 671.82	0.00
オランダ合計		21 671.82	0.00
預託証券合計		87 784.37	0.01
投資ファンド、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	193.00	3 850.38	0.00
カナダ合計		3 850.38	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND MALL TRUST	5 000.00	6 885.29	0.00
シンガポール合計		6 885.29	0.00
アメリカ合衆国			
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	232.00	8 906.48	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	92.00	10 025.24	0.00
アメリカ合衆国合計		18 931.72	0.00
投資ファンド、クローズド・エンド型合計		29 667.39	0.00
新株引受権			
スペイン			
EUR ACS ACTIV DE CONST Y SER SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 03.02.17	197.00	88.56	0.00
EUR IBERDROLA SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 19.01.17	8 955.00	1 267.78	0.00
スペイン合計		1 356.34	0.00
新株引受権合計		1 356.34	0.00
固定利付ノート			
豪ドル			
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 09-15.06.20	430 000.00	367 199.64	0.05
豪ドル合計		367 199.64	0.05
米ドル			
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	1 765 000.00	1 615 133.85	0.22
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 3.65000% 16-01.02.26	1 150 000.00	1 153 294.75	0.16
USD APPLE INC 2.25000% 16-23.02.21	1 350 000.00	1 350 228.15	0.19
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	675 000.00	660 341.03	0.09
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	2 050 000.00	2 110 060.90	0.29
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 11-23.10.18	1 500 000.00	1 512 720.00	0.21
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 1.15000% 16-15.08.18	150 000.00	149 311.80	0.02
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22	2 150 000.00	2 103 276.20	0.29
USD CISCO SYSTEMS INC 2.20000% 16-28.02.21	1 700 000.00	1 695 729.60	0.24
USD CONOCOPHILLIPS CO 3.35000% 14-15.11.24	475 000.00	474 893.60	0.07
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 13-15.03.18	2 500 000.00	2 492 705.00	0.35
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	2 100 000.00	2 089 869.60	0.29
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 1.75000% 13-27.02.18	1 500 000.00	1 499 160.00	0.21
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	850 000.00	1 172 051.40	0.16
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 13-15.03.18	2 000 000.00	1 991 788.00	0.28
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 14-15.10.19	1 500 000.00	1 504 230.00	0.21
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.25000% 16-19.02.21	1 650 000.00	1 648 750.95	0.23
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	650 000.00	683 462.00	0.10
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.50000% 16-06.02.19	2 375 000.00	2 374 881.25	0.33
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 12-12.09.17	2 200 000.00	2 197 030.00	0.31
USD MICROSOFT CORP 2.65000% 15-03.11.22	1 575 000.00	1 576 534.05	0.22

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	900 000.00	892 107.00	0.12
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	1 000 000.00	939 912.00	0.13
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	375 000.00	372 381.75	0.05
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	1 200 000.00	1 183 500.00	0.16
USD SOUTHERN POWER CO 1.95000% 16-15.12.19	425 000.00	422 348.85	0.06
USD WELLS FARGO & CO 2.15000% 13-15.01.19	500 000.00	502 886.50	0.07
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	2 650 000.00	2 724 610.75	0.38
米ドル合計		39 093 198.98	5.44
固定利付ノート合計		39 460 398.62	5.49
変動利付ノート			
米ドル			
USD CITIGROUP INC 3M LIBOR+143BP 16-01.09.23	350 000.00	355 896.45	0.05
米ドル合計		355 896.45	0.05
変動利付ノート合計		355 896.45	0.05
固定利付メディアム・ターム・ノート			
英ポンド			
GBP GENERAL ELECTRIC CO 6.25000% 02-15.12.17	110 000.00	144 963.19	0.02
英ポンド合計		144 963.19	0.02
米ドル			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.30000% 16-01.06.21	1 700 000.00	1 672 698.00	0.23
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	525 000.00	495 612.60	0.07
USD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.37500% 13-29.01.18	1 000 000.00	999 070.00	0.14
USD HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 1.50000% 16-13.09.19	796 000.00	791 940.40	0.11
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 12-12.09.19	3 000 000.00	2 963 256.00	0.41
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 1.00000% 12-24.10.17	2 500 000.00	2 495 375.00	0.35
USD KOREA GAS CORP-REG-S 1.87500% 16-18.07.21	1 200 000.00	1 152 250.80	0.16
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.37500% 12-21.06.17	350 000.00	350 206.50	0.05
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.00000% 14-30.09.19	1 625 000.00	1 631 678.75	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	1 400 000.00	1 398 712.00	0.19
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	1 000 000.00	996 340.00	0.14
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	1 170 000.00	1 174 632.03	0.16
米ドル合計		16 121 772.08	2.24
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		16 266 735.27	2.26
変動利付メディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD CENTRAL NIPPON EXPRESSWAY CO-REG-S 3M LIBOR+85BP 16-14.09.21	700 000.00	699 399.40	0.10
米ドル合計		699 399.40	0.10
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		699 399.40	0.10
固定利付債券			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 1.75000% 15-21.11.20	6 275 000.00	4 718 697.23	0.65
AUD AUSTRALIA 2.75000% 14-21.10.19	4 000 000.00	3 108 749.61	0.43
AUD AUSTRALIA 3.25000% 13-21.10.18	2 750 000.00	2 140 689.13	0.30
AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17	2 500 000.00	1 920 877.24	0.27
豪ドル合計		11 889 013.21	1.65

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄		数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>カナダ・ドル</b>				
CAD	CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.09.17	1 750 000.00	1 349 378.84	0.19
CAD	CANADA, GOVERNMENT 1.25000% 14-01.02.18	1 500 000.00	1 157 769.98	0.16
CAD	CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 08-01.06.19	2 690 000.00	2 203 785.56	0.31
CAD	CANADA, GOVERNMENT 3.50000% 09-01.06.20	3 200 000.00	2 659 070.65	0.37
CAD	CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21	3 800 000.00	3 179 972.70	0.44
カナダ・ドル合計			10 549 977.73	1.47
<b>ユーロ</b>				
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 2.00000% 13-15.08.23	2 500 000.00	3 077 725.53	0.43
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 07-04.01.18	3 300 000.00	3 721 722.65	0.52
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19	7 000 000.00	8 342 496.07	1.16
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 09-04.01.20	7 500 000.00	9 042 541.11	1.25
ユーロ合計			24 184 485.36	3.36
<b>英ポンド</b>				
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19	1 500 000.00	2 058 314.51	0.29
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 1.25000% 13-22.07.18	650 000.00	831 029.14	0.11
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 2.00000% 14-22.07.20	3 750 000.00	4 966 695.73	0.69
GBP	UNITED KINGDOM TREASURY GILT 1.75000% 13-22.07.19	2 750 000.00	3 586 125.98	0.50
英ポンド合計			11 442 165.36	1.59
<b>米ドル</b>				
USD	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	1 800 000.00	2 277 000.00	0.32
USD	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 12-04.10.17	2 250 000.00	2 255 310.00	0.32
USD	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	3 000 000.00	3 044 250.00	0.42
USD	BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	2 550 000.00	2 523 505.50	0.35
USD	EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 1.00000% 13-15.06.18	1 250 000.00	1 243 903.75	0.17
USD	FANNIE MAE 1.62500% 15-21.01.20	1 775 000.00	1 780 172.35	0.25
USD	ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	1 150 000.00	1 144 606.50	0.16
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	1 350 000.00	1 435 004.10	0.20
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	3 750 000.00	3 708 960.00	0.52
USD	ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	2 150 000.00	2 519 950.50	0.35
USD	MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	925 000.00	863 103.63	0.12
USD	MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	1 300 000.00	1 419 991.30	0.20
USD	ONTARIO, PROVINCE OF 1.65000% 12-27.09.19	1 250 000.00	1 243 695.00	0.17
USD	ONTARIO, PROVINCE OF 1.10000% 12-25.10.17	450 000.00	449 541.45	0.06
USD	UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	500 000.00	519 365.00	0.07
米ドル合計			26 428 359.08	3.68
固定利付債券合計			84 494 000.74	11.75
<b>固定利付米国中期国債</b>				
<b>米ドル</b>				
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30	4 550 000.00	6 432 739.95	0.90
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	2 500 000.00	3 330 762.50	0.46
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38	2 500 000.00	3 106 347.50	0.43
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39	4 000 000.00	4 374 844.00	0.61
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 11-15.05.41	6 500 000.00	8 050 607.50	1.12
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 15-15.05.45	4 500 000.00	4 448 146.50	0.62
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 15-31.01.22	1 175 000.00	1 150 673.98	0.16
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 08-15.05.18	1 500 000.00	1 555 605.00	0.22
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 09-15.02.19	8 250 000.00	8 501 047.50	1.18
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20	18 000 000.00	19 134 846.00	2.66
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.09.18	2 250 000.00	2 259 756.00	0.31
USD	AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	15 000 000.00	14 625 584.99	2.03
米ドル合計			76 970 961.42	10.70
固定利付米国中期国債合計			76 970 961.42	10.70

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>変動利付米国中期国債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	750 000.00	1 113 081.86	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	725 000.00	846 174.42	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	950 000.00	1 025 572.83	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	950 000.00	1 010 486.02	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 14-15.04.19	1 225 000.00	1 285 426.46	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	950 000.00	961 869.24	0.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 15-15.04.20	1 125 000.00	1 180 774.24	0.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	900 000.00	932 164.14	0.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	950 000.00	1 010 541.64	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	950 000.00	996 173.99	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI INDEX 13-15.04.18	1 550 000.00	1 639 881.22	0.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	950 000.00	1 004 942.84	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	825 000.00	844 061.96	0.12
米ドル合計		13 851 150.86	1.93
<b>変動利付米国中期国債合計</b>		13 851 150.86	1.93
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短期金融商品合計		285 510 809.36	39.70
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短期金融商品			
<b>固定利付ノート</b>			
米ドル			
USD BANK OF NEW YORK MELLON CO 1.30000% 12-25.01.18	2 550 000.00	2 550 051.00	0.35
USD CHEVRON CORP 1.71800% 13-24.06.18	650 000.00	652 209.35	0.09
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	2 400 000.00	2 411 421.60	0.33
USD HEINEKEN NV-REG-S 1.40000% 12-01.10.17	350 000.00	349 949.95	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	650 000.00	700 627.85	0.10
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.25000% 12-05.10.17	1 550 000.00	1 550 310.00	0.22
米ドル合計		8 214 569.75	1.14
<b>固定利付ノート合計</b>		8 214 569.75	1.14
<b>固定利付メディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 2.00000% 13-11.01.18	900 000.00	903 068.10	0.13
USD FREDDIE MAC 2.37500% 12-13.01.22	250 000.00	254 105.25	0.03
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.50000% 13-16.01.18	1 800 000.00	1 800 464.40	0.25
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.37500% 13-10.01.18	2 900 000.00	2 901 458.70	0.40
米ドル合計		5 859 096.45	0.81
<b>固定利付メディアム・ターム・ノート合計</b>		5 859 096.45	0.81
<b>変動利付メディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 3M LIBOR+61BP 16-09.09.21	325 000.00	326 076.08	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP 3M LIBOR+160BP 13-29.11.23	525 000.00	540 114.75	0.07
米ドル合計		866 190.83	0.12
<b>変動利付メディアム・ターム・ノート合計</b>		866 190.83	0.12

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>固定利付債券</b>			
カナダ・ドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 0.25000% 15-01.11.17	2 000 000.00	1 530 245.43	0.21
カナダ・ドル合計		1 530 245.43	0.21
米ドル			
USD NATIONAL BANK OF CANADA 2.10000% 15-14.12.18	750 000.00	752 785.50	0.11
USD NOVARTIS SECURITIES INVESTMENT LTD 5.12500% 09-10.02.19	500 000.00	534 470.50	0.07
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.25000% 12-15.12.17	1 650 000.00	1 647 607.50	0.23
米ドル合計		2 934 863.50	0.41
固定利付債券合計		4 465 108.93	0.62
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短期金融商品合計		19 404 965.96	2.69
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短期金融商品			
<b>無記名株</b>			
カナダ			
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	419.00	13 938.28	0.00
カナダ合計		13 938.28	0.00
アメリカ合衆国			
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	100.00	27 228.00	0.01
アメリカ合衆国合計		27 228.00	0.01
無記名株合計		41 166.28	0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		41 166.28	0.01
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条(1) e) に準拠した投資信託／その他の投資信託			
<b>投資ファンド、オープン・エンド型</b>			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	143 784.00	25 318 924.56	3.52
アイルランド合計		25 318 924.56	3.52
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	113 822.00	14 369 728.60	1.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-ACC	6 130.00	64 532 226.40	8.96
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	4 847.00	64 472 370.50	8.96
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	1 723.00	28 736 693.67	4.00
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	137 659.00	14 352 327.34	2.00
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	1 860.00	21 468 659.40	2.99
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD)-U-X-ACC	551.00	11 638 166.90	1.62
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	427.00	7 752 821.23	1.08
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	4 814.00	58 150 664.86	8.09
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	3 087.00	58 156 332.57	8.09
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMERG. MARKETS EQUITY PASSIVE XA USD	7 303.00	716 205.21	0.10
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	1 372.00	14 357 719.32	2.00
ルクセンブルグ合計		358 703 916.00	49.88
投資ファンド、オープン・エンド型合計		384 022 840.56	53.40
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条(1) e) に準拠した投資信託／その他の投資信託合計		384 022 840.56	53.40
投資有価証券合計		688 979 782.16	95.80

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>派生商品</b>			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
指数に係る金融先物			
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.03.17	550.00	130 211.75 0.02
JPY	NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 09.03.17	-79.00	-402 056.22 -0.06
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 17.03.17	212.00	370 746.70 0.05
USD	S&P500 EMINI FUTURE 17.03.17	53.00	24 610.06 0.01
指数に係る金融先物合計			123 512.29 0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			123 512.29 0.02
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派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD	CME/CDX.NA.HY.27 DEC21 CDI REC 5.00000% 16-20.12.21	6 600 000.00	454 969.17 0.06
クレジット・デフォルト・スワップ合計			454 969.17 0.06
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派生商品合計			454 969.17 0.06
派生商品合計			578 481.46 0.08
<b>先渡為替契約</b>			
先渡為替契約（購入／売却）			
INR	119 740 000.00	USD 1 741 938.77	9.2.2017 31 199.14 0.00
RUB	115 360 000.00	USD 1 763 679.11	9.2.2017 152 245.13 0.02
USD	1 145 982.24	AUD 1 560 000.00	9.2.2017 -38 088.96 -0.01
USD	1 145 982.24	AUD 1 560 000.00	9.2.2017 -38 088.96 -0.01
BRL	5 860 000.00	USD 1 702 396.17	9.2.2017 156 858.86 0.02
ZAR	12 190 000.00	USD 848 122.90	9.2.2017 55 127.76 0.01
USD	1 125 953.56	SEK 10 360 000.00	9.2.2017 -59 527.95 -0.01
ZAR	12 190 000.00	USD 848 122.90	9.2.2017 55 127.76 0.01
USD	1 125 953.56	SEK 10 360 000.00	9.2.2017 -59 527.95 -0.01
USD	1 185 509.94	CAD 1 590 000.00	9.2.2017 -34 105.15 0.00
USD	1 185 509.94	CAD 1 590 000.00	9.2.2017 -34 105.15 0.00
USD	1 483 649.86	HKD 11 500 000.00	23.2.2017 1 211.92 0.00
USD	914 239.96	SEK 8 240 000.00	23.2.2017 -29 217.66 0.00
USD	7 666 256.92	AUD 10 437 111.80	23.2.2017 -253 075.17 -0.04
USD	8 017 764.65	JPY 928 183 741.00	23.2.2017 -231 833.23 -0.03
USD	12 822 395.52	GBP 10 560 000.00	23.2.2017 -467 962.43 -0.07
USD	564 158.78	SGD 810 000.00	23.2.2017 -10 914.29 0.00
USD	563 797.79	DKK 3 950 000.00	23.2.2017 -10 641.97 0.00
USD	28 618 111.68	EUR 26 958 010.44	23.2.2017 -537 691.48 -0.07
USD	2 218 968.74	CHF 2 241 719.83	23.2.2017 -55 557.34 -0.01
USD	8 032 280.72	CAD 10 621 357.90	23.2.2017 -116 077.59 -0.02
JPY	970 723 300.00	USD 8 360 521.82	21.2.2017 266 175.18 0.04
SEK	9 399 797.43	CAD 1 410 000.00	23.2.2017 -5 453.41 0.00
USD	2 325 900.73	SGD 3 320 000.00	9.2.2017 -30 898.85 0.00
SEK	20 720 000.00	USD 2 325 792.06	9.2.2017 45 170.96 0.01
SEK	9 392 332.89	CAD 1 410 000.00	23.2.2017 -6 307.91 0.00
SEK	9 386 630.85	CAD 1 410 000.00	23.2.2017 -6 960.65 0.00
SEK	9 377 245.89	CAD 1 410 000.00	23.3.2017 -6 797.46 0.00

\* 額面がプラスの場合：サブ・ファンドは「受取側」であり、額面がマイナスの場合：サブ・ファンドは「支払側」である。

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
先渡為替契約（続き）			
先渡為替契約（購入／売却）			
SEK	9 382 942.29	CAD 1 410 000.00 23.3.2017	-6 144.61 0.00
SEK	9 390 399.78	CAD 1 410 000.00 23.3.2017	-5 289.93 0.00
USD	1 056 472.69	SGD 1 500 000.00 23.3.2017	-8 738.24 0.00
USD	28 926 441.52	EUR 26 892 182.38 23.3.2017	-196 557.18 -0.03
USD	1 482 084.96	HKD 11 490 000.00 23.3.2017	504.56 0.00
USD	1 406 442.91	CHF 1 400 000.00 23.3.2017	-16 409.50 0.00
USD	7 866 898.35	AUD 10 423 833.41 23.3.2017	-37 249.28 -0.01
USD	11 852 095.50	GBP 9 500 000.00 23.3.2017	-112 343.93 -0.02
USD	8 181 770.57	JPY 927 181 968.00 23.3.2017	-68 834.95 -0.01
USD	615 343.18	DKK 4 250 000.00 23.3.2017	-3 591.25 0.00
USD	963 644.58	SEK 8 501 790.00 23.3.2017	-11 205.22 0.00
USD	8 988 697.60	CAD 11 967 156.48 23.3.2017	-194 916.67 -0.03
USD	128 317.33	JPY 14 500 000.00 23.2.2017	-557.12 0.00
USD	225 538.13	CAD 300 000.00 23.3.2017	-4 682.33 0.00
SEK	2 950 000.00	USD 334 428.94 23.3.2017	3 830.05 0.00
USD	128 436.91	JPY 14 500 000.00 23.3.2017	-592.54 0.00
USD	387 309.35	GBP 310 000.00 23.3.2017	-3 109.20 0.00
USD	217 955.31	CAD 290 000.00 23.2.2017	-4 523.20 0.00
USD	387 086.77	GBP 310 000.00 23.2.2017	-3 065.78 0.00
SEK	2 950 000.00	USD 333 988.78 23.2.2017	3 778.21 0.00
JPY	106 225 400.00	USD 934 031.96 21.2.2017	9 979.93 0.00
先渡為替契約（購入／売却）合計			-1 929 435.03 -0.27
銀行預金、要求払預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産			28 922 170.67 4.02
その他の資産および負債			2 654 149.91 0.37
純資産合計			719 205 149.17 100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

## UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

### 3年度の比較

	ISIN	2017年1月31日	2016年1月31日	2015年1月31日
純資産額 (米ドル)		130,620,895.23	124,535,278.13	109,110,267.35
クラスF-a-c <sup>1</sup>	LU1317082466			
発行済受益証券口数		23,639.6900	240.2770	—
1口当たり純資産価格 (米ドル)		115.56	100.74	—
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>2</sup>		115.56	100.74	—
クラスP-a-c	LU0033040865			
発行済受益証券口数		35,336.3490	40,872.1420	34,321.3510
1口当たり純資産価格 (米ドル)		3,383.29	2,986.89	3,174.82
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>2</sup>		3,383.29	2,986.89	3,174.82
クラス (日本円・ヘッジ) P-a-c <sup>3</sup>	LU1410364837			
発行済受益証券口数		17,768.1530	—	—
1口当たり純資産価格 (円)		10,727	—	—
1口当たり発行および買戻価格 (円) <sup>2</sup>		10,727	—	—
クラスQ-a-c	LU0941351685			
発行済受益証券口数		56,397.2490	23,548.2680	1,344.0000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		117.79	103.21	108.73
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) <sup>2</sup>		117.79	103.21	108.73

<sup>1</sup> 初回純資産価格計算日：2016年1月14日

<sup>2</sup> 注記1を参照のこと。

<sup>3</sup> 初回純資産価格計算日：2016年6月7日

### パフォーマンス

	通貨	2016年/2017年	2015年/2016年	2014年/2015年
クラスF-a-c	米ドル	14.7%	—	—
クラスP-a-c	米ドル	13.3%	-5.9%	7.6%
クラス (日本円・ヘッジ) P-a-c <sup>1</sup>	日本円	—	—	—
クラスQ-a-c	米ドル	14.1%	-5.1%	—

<sup>1</sup> 最近運用を開始したため、パフォーマンスの計算に関するデータはない。

過去の実績は、現在または将来のパフォーマンスの指標にはならない。

実績データは、受益証券の発行および買戻しの時に請求される手数料および費用を考慮していない。

実績データは、監査の対象ではなかった。

本サブ・ファンドはベンチマークを有していない。

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

投資有価証券の構成

通貨別分類 (対純資産割合 (%))

米ドル	83.35
ユーロ	5.34
英ポンド	1.86
日本円	1.61
カナダ・ドル	1.35
豪ドル	1.19
スイス・フラン	0.58
香港ドル	0.21
スウェーデン・クローネ	0.20
デンマーク・クローネ	0.12
シンガポール・ドル	0.07
ノルウェー・クローネ	0.05
イスラエル・シケル	0.02
ニュージーランド・ドル	0.01
合計	95.96

商品別分類 (対純資産割合 (%))

投資信託、オープン・エンド型	62.42
無記名株	17.03
固定利付債券	5.17
固定利付米国中期国債	4.20
固定利付ノート	2.71
変動利付米国中期国債	1.92
固定利付メディアム・ターム・ノート	1.23
記名株式	0.99
その他の株式	0.13
変動利付メディアム・ターム・ノート	0.06
預託証券	0.03
優先株式	0.03
変動利付ノート	0.02
投資信託、クローズド・エンド型	0.01
参加証券	0.01
合計	95.96

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

純資産計算書

	米ドル	千 円
	2017年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	110,771,977.70	12,291,259
投資有価証券、未実現評価(損)益	14,576,767.70	1,617,438
投資有価証券合計(注1)	125,348,745.40	13,908,697
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	5,109,626.56	566,964
その他の流動資産(委託証拠金)	490,714.68	54,450
有価証券売却未収金(注1)	4,006.89	445
発行受益証券未収金	79,735.28	8,847
有価証券に係る未収利息	133,035.51	14,762
流動資産に係る未収利息	5.54	1
未収分配金	16,357.14	1,815
その他の未収金	698.07	77
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	33,136.47	3,677
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	(473,889.77)	(52,583)
スワップに係る未実現(損)益(注1)	82,721.67	9,179
資産合計	130,824,893.44	14,516,330
負債		
買戻受益証券未払金	(99,413.18)	(11,031)
報酬引当金(注2)	(98,870.43)	(10,971)
年次税引当金(注3)	(2,431.72)	(270)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(3,282.88)	(364)
引当金合計	(104,585.03)	(11,605)
負債合計	(203,998.21)	(22,636)
期末現在純資産額	130,620,895.23	14,493,695

注記は、財務書類と不可分のものである。



UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

運用計算書

	米ドル	千円
	自2016年2月1日	至2017年1月31日
収益		
流動資産に係る利息	2,060.57	229
有価証券に係る利息	498,241.47	55,285
分配金	467,420.25	51,865
スワップに係る受取利息 (注1)	59,823.86	6,638
貸付有価証券に係る収益 (注12)	29,705.92	3,296
その他の収益 (注4)	97,345.91	10,802
収益合計	1,154,597.98	128,114
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(32,562.78)	(3,613)
報酬 (注2)	(2,162,831.72)	(239,988)
年次税 (注3)	(27,601.59)	(3,063)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(11,882.37)	(1,318)
その他の手数料および報酬 (注2)	(16,328.14)	(1,812)
現金および当座借越に係る利息	(2,873.07)	(319)
費用合計	(2,254,079.67)	(250,113)
投資に係る純 (損) 益	(1,099,481.69)	(121,998)
実現 (損) 益 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 実現 (損) 益	2,552,366.84	283,211
金融先物に係る実現 (損) 益	693,321.88	76,931
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	1,026,275.09	113,875
スワップに係る実現 (損) 益	(34,839.38)	(3,866)
外国為替に係る実現 (損) 益	(393,484.47)	(43,661)
実現 (損) 益合計	3,843,639.96	426,490
当期実現純 (損) 益	2,744,158.27	304,492
未実現評価 (損) 益の変動 (注1)		
オプション無し時価評価有価証券に係る 未実現評価 (損) 益	13,300,066.64	1,475,775
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	111,035.82	12,321
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	(757,004.74)	(83,997)
スワップに係る未実現評価 (損) 益	82,490.34	9,153
未実現評価 (損) 益の変動合計	12,736,588.06	1,413,252
運用の結果による純資産の純増 (減)	15,480,746.33	1,717,744

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

純資産変動計算書

	米ドル	千 円
	自2016年2月1日 至2017年1月31日	
期首現在純資産額	124,535,278.13	13,818,434
受益証券発行	45,453,738.93	5,043,547
受益証券買戻し	(54,848,868.16)	(6,086,030)
受益証券発行 (買戻し) 純額合計	(9,395,129.23)	(1,042,484)
純投資 (損) 益	(1,099,481.69)	(121,998)
実現 (損) 益合計	3,843,639.96	426,490
未実現評価 (損) 益の変動合計	12,736,588.06	1,413,252
運用の結果による純資産の純増 (減)	15,480,746.33	1,717,744
期末現在純資産額	130,620,895.23	14,493,695

発行済受益証券口数の変動

	自2016年2月1日 至2017年1月31日	
クラス		F - a c c
期首現在発行済受益証券口数		240.2770
発行受益証券口数		23,399.4130
買戻受益証券口数		0.0000
期末現在発行済受益証券口数		23,639.6900
クラス		P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		40,872.1420
発行受益証券口数		11,384.5660
買戻受益証券口数		(16,920.3590)
期末現在発行済受益証券口数		35,336.3490
クラス	(日本円・ヘッジ)	P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		0.0000
発行受益証券口数		17,768.1530
買戻受益証券口数		0.0000
期末現在発行済受益証券口数		17,768.1530
クラス		Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数		23,548.2680
発行受益証券口数		48,168.1150
買戻受益証券口数		(15,319.1340)
期末現在発行済受益証券口数		56,397.2490

注記は、財務書類と不可分のものである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

2017年1月31日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
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短期金融商品			
無記名株			
オーストラリア			
AUD AGL ENERGY NPV	424.00	7 274.48	0.01
AUD AMCOR LIMITED NPV	1 173.00	12 733.91	0.01
AUD AMP LIMITED NPV(POST RECON)	807.00	3 063.17	0.00
AUD APA GROUP NPV	1 080.00	6 903.41	0.01
AUD ARISTOCRAT LEISURE NPV	314.00	3 642.34	0.00
AUD ASX LTD NPV	153.00	5 794.72	0.01
AUD AUST & NZ BANK GRP NPV	2 023.00	44 982.42	0.03
AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	415.00	3 953.84	0.00
AUD BHP BILLITON LTD NPV	2 598.00	52 541.32	0.04
AUD BK OF QUEENSLAND NPV	648.00	5 888.39	0.01
AUD BRAMBLES LTD NPV	1 289.00	10 186.65	0.01
AUD CALTEX AUSTRALIA NPV	211.00	4 581.17	0.00
AUD CHALLENGER LIMITED NPV	1 099.00	9 194.05	0.01
AUD CIMIC GROUP LTD NPV	94.00	2 447.65	0.00
AUD CMNWLTH BK OF AUST NPV	1 144.00	70 919.06	0.05
AUD COCA-COLA AMATIL NPV	396.00	2 931.08	0.00
AUD COCHLEAR LTD NPV	82.00	7 791.87	0.01
AUD COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	413.00	4 041.39	0.00
AUD CROWN RESORTS LTD NPV	368.00	3 184.79	0.00
AUD CSL NPV	341.00	29 071.12	0.02
AUD DEXUS PROPERTY GP NPV (STAPLED)	1 245.00	8 487.37	0.01
AUD DOMINOS PIZZA ENT NPV	137.00	6 183.01	0.01
AUD FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	67.00	1 522.84	0.00
AUD FORTESCUE METALS G NPV	916.00	4 631.24	0.00
AUD GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 456.00	7 648.83	0.01
AUD INCITEC PIVOT NPV	1 297.00	3 790.78	0.00
AUD INSURANCE AUST GRP NPV	1 873.00	8 204.29	0.01
AUD LEND LEASE GROUP NPV	435.00	4 652.94	0.00
AUD MACQUARIE GP LTD NPV	202.00	12 973.27	0.01
AUD NATL AUSTRALIA BK NPV	1 838.00	42 319.99	0.03
AUD NEWCREST MINING NPV	864.00	14 121.65	0.01
AUD ORICA LIMITED NPV	256.00	3 643.92	0.00
AUD ORIGIN ENERGY NPV	1 036.00	5 576.14	0.00
AUD QANTAS AIRWAYS NPV	1 322.00	3 422.26	0.00
AUD QBE INS GROUP NPV	773.00	7 335.29	0.01
AUD RAMSAY HEALTH CARE NPV	107.00	5 426.10	0.00
AUD REA GROUP LIMITED NPV	54.00	2 154.65	0.00
AUD RIO TINTO LIMITED NPV	389.00	19 691.23	0.02
AUD SANTOS LIMITED NPV	934.00	2 836.18	0.00
AUD SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	3 990.00	13 327.64	0.01
AUD SEEK LIMITED NPV	272.00	2 981.70	0.00
AUD SONIC HEALTHCARE NPV	283.00	4 472.96	0.00
AUD SOUTH32 LTD NPV	2 095.00	4 373.65	0.00
GBP SOUTH32 LTD NPV	1 100.00	2 311.13	0.00
AUD SUNCORP GROUP	943.00	9 327.90	0.01
AUD SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	1 635.00	7 261.08	0.01
AUD TELSTRA CORP NPV	2 795.00	10 609.12	0.01
AUD TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	1 239.00	9 593.99	0.01
AUD TREASURY WINE ESTA NPV	1 122.00	9 906.04	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD WESFARMERS LTD NPV	768.00	23 472.68	0.02
AUD WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	1 240.00	8 274.43	0.01
AUD WESTPAC BKG CORP NPV	2 298.00	55 318.94	0.04
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	474.00	11 356.46	0.01
AUD WOOLWORTHS LTD NPV	1 115.00	20 822.73	0.02
オーストラリア合計		649 159.26	0.50
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV (BR)	72.00	3 887.80	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	108.00	3 284.38	0.00
EUR OMV AG NPV (VAR)	77.00	2 693.22	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	96.00	4 066.89	0.01
オーストリア合計		13 932.29	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	97.00	4 149.09	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH IN NPV	530.00	55 071.93	0.04
EUR COLRUYT SA NPV	78.00	3 816.86	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	63.00	5 364.35	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	153.00	9 924.13	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	98.00	2 813.46	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	35.00	4 098.28	0.00
EUR TELENET GRP HLDG NPV	70.00	3 753.70	0.00
EUR UCB NPV	130.00	8 952.09	0.01
EUR UMICORE NPV	98.00	5 486.07	0.01
ベルギー合計		103 429.96	0.08
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	100.00	8 835.00	0.01
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	100.00	6 401.00	0.00
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	300.00	4 461.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	52.00	7 088.64	0.01
USD SIGNET JEWELERS LT ORD USD0.18	29.00	2 252.43	0.00
USD XL GROUP LTD COM USD0.01	200.00	7 514.00	0.01
バミューダ合計		36 552.07	0.03
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	103.00	4 903.71	0.00
CAD AGRUM INC COM NPV	99.00	10 176.78	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	341.00	15 591.19	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	100.00	2 373.92	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	164.00	2 547.27	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	462.00	34 879.89	0.03
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	846.00	50 458.26	0.04
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 010.00	18 577.03	0.01
CAD BCE INC COM NEW	87.00	3 914.42	0.00
CAD BLACKBERRY LTD NPV	300.00	2 112.37	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS' B' SUB-VTG NPV	1 100.00	2 100.86	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET M LTD VTG SHS NPV CL' A'	664.00	22 918.50	0.02
CAD CAE INC COM	322.00	4 564.19	0.00
CAD CAMECO CORP COM	187.00	2 376.67	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	112.00	16 907.17	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	782.00	23 596.46	0.02
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	537.00	37 251.22	0.03
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	46.00	4 882.79	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	119.00	3 380.83	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	267.00	22 693.21	0.02
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	951.00	12 954.75	0.01
CAD CGI GROUP INC 'A' SUB-VTG NPV	112.00	5 375.14	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
CAD	CI FINANCIAL CORP COM NPV	139.00	2 899.94	0.00
CAD	CRESCENT POINT EN COM NPV	195.00	2 268.95	0.00
CAD	DOLLARAMA INC COM NPV	100.00	7 558.96	0.01
CAD	ELDORADO GOLD CORP NEW COM	400.00	1 411.31	0.00
CAD	ELEMENT FLEET MGMT COM NPV	600.00	5 821.67	0.01
CAD	ENBRIDGE INC COM	747.00	31 742.13	0.02
CAD	ENCANA CORP COM NPV	411.00	5 236.21	0.00
CAD	FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	13.00	6 062.51	0.01
CAD	FINNING INTL INC COM NEW	156.00	3 151.71	0.00
CAD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	321.00	4 040.35	0.00
CAD	FORTIS INC COM NPV	134.00	4 300.33	0.00
CAD	FRANCO NEVADA CORP COM NPV	93.00	6 037.60	0.01
CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	200.00	5 221.86	0.00
CAD	GOLDCORP INC COM NPV	702.00	11 328.92	0.01
CAD	GREAT WEST LIFE CO INC COM	167.00	4 567.76	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	204.00	2 627.16	0.00
CAD	HYDRO ONE INC COM NPV	400.00	7 378.72	0.01
CAD	IGM FINANCIAL INC COM	72.00	2 208.46	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	321.00	10 532.99	0.01
CAD	INDUSTRIAL ALLNCE INS FIN SRVC COM	111.00	4 661.36	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	68.00	4 955.46	0.00
CAD	INTER PIPELINE LTD COM NPV	200.00	4 329.05	0.00
CAD	KEYERA CORPORATION COM NPV	200.00	5 860.02	0.01
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NPV	666.00	2 589.93	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	143.00	7 501.26	0.01
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	89.00	6 008.39	0.01
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	248.00	10 707.51	0.01
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	1 460.00	27 940.17	0.02
CAD	METHANEX CORP COM	100.00	4 990.22	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	135.00	4 093.23	0.00
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	194.00	8 358.18	0.01
CAD	OPEN TEXT CORP COM	200.00	6 832.60	0.01
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	219.00	6 781.23	0.01
CAD	PEYTO EXPLORATION COM NPV	100.00	2 172.20	0.00
CAD	POTASH CORP SASK INC COM	506.00	9 396.17	0.01
CAD	POWER CORP CDA COM	213.00	4 987.84	0.00
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	195.00	5 056.91	0.00
CAD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	200.00	9 791.75	0.01
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	50.00	2 454.00	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS' B' COM CAD1.62478	215.00	9 309.11	0.01
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	1 068.00	76 642.06	0.06
CAD	SAPUTO INC COM	200.00	7 349.57	0.01
CAD	SEVEN GENERATIONS COM NPV 'WI'	300.00	5 985.04	0.01
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	266.00	5 727.03	0.01
CAD	SILVER WHEATON COR COM NPV	106.00	2 339.11	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	100.00	4 301.44	0.00
CAD	SUN LIFE FINL INC COM	576.00	22 690.98	0.02
CAD	SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	1 291.00	39 965.30	0.03
CAD	TECK RESOURCES LTD CLASS' B' SUB-VTG COM NPV	382.00	9 343.80	0.01
CAD	TORONTO-DOMINION COM NPV	1 298.00	67 112.70	0.05
CAD	TRANSCANADA CORP COM NPV	681.00	32 066.42	0.03
CAD	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV	183.00	2 520.94	0.00
USD	WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)	100.00	8 030.00	0.01
CAD	YAMANA GOLD INC COM	500.00	1 649.09	0.00
カナダ合計			863 434.24	0.66
デンマーク				
DKK	A. P. MOELLER-MAERSK SER' B' DKK1000	5.00	8 348.11	0.01
DKK	A. P. MOLLER-MAERSK 'A' DKK1000	3.00	4 786.54	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
DKK CARLSBERG SER' B' DKK20	71.00	6 417.22	0.00
DKK CHR. HANSEN HLDG DKK10	106.00	6 469.24	0.01
DKK COLOPLAST DKK1 B	61.00	4 368.16	0.00
DKK DANSKE BANK A/S DKK10	426.00	14 194.22	0.01
DKK DSV DKK1	127.00	6 171.18	0.00
DKK GENMAB AS DKK1 (BEARER)	48.00	9 262.69	0.01
DKK ISS A/S DKK1	208.00	7 395.97	0.01
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER' B'	1 270.00	45 656.37	0.04
DKK NOVOZYMES A/S SER' B' DKK2 (POST CONS)	284.00	11 072.28	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	74.00	9 693.83	0.01
DKK TDC A/S DKK1	457.00	2 407.26	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK1	155.00	10 847.16	0.01
DKK WILLIAM DEMANT HOL DKK0.20	255.00	4 772.59	0.00
デンマーク合計		151 862.82	0.12
フィンランド			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	163.00	5 501.29	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	187.00	2 988.92	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	170.00	7 697.83	0.01
EUR NESTE OIL OYJ NPV	12.00	418.36	0.00
EUR NOKIA OYJ NPV	4 898.00	21 967.06	0.02
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	91.00	3 414.49	0.00
EUR ORION CORP SER' B' NPV	192.00	8 947.16	0.01
EUR SAMPO OYJ SER' A' NPV	220.00	10 199.65	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER' R'	649.00	7 378.46	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	365.00	8 283.57	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER' B' EUR3.50	130.00	6 525.81	0.00
フィンランド合計		83 322.60	0.06
フランス			
EUR ACCOR EUR3	121.00	4 904.34	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L' ) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	288.00	31 124.16	0.02
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	382.00	25 909.05	0.02
EUR ALSTOM EUR7.00	96.00	2 723.36	0.00
EUR ARKEMA EUR10	46.00	4 543.70	0.00
EUR ATOS SE EUR1	47.00	5 002.59	0.00
EUR AXA EUR2.29	1 512.00	37 124.90	0.03
EUR BNP PARIBAS EUR2	797.00	50 972.79	0.04
EUR BOUYGUES EUR1	135.00	4 910.08	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	142.00	2 780.68	0.00
EUR CAP GEMINI EUR8	163.00	13 276.73	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	331.00	8 103.96	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	37.00	1 995.30	0.00
EUR CHRISTIAN DIOR EUR2	36.00	7 732.41	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	379.00	18 636.13	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	527.00	6 985.28	0.01
EUR DANONE EURO.25	419.00	26 258.64	0.02
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	70.00	5 422.52	0.00
EUR EDENRED EUR2	173.00	3 770.08	0.00
EUR EDF EURO.5	133.00	1 310.85	0.00
EUR EIFFAGE EUR4	96.00	6 907.49	0.01
EUR ESSILOR INTL EURO.18	135.00	15 814.96	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	111.00	1 892.34	0.00
EUR ENGIE SA EUR 1	712.00	8 514.06	0.01
EUR GPE EUROTUNNEL SE EURO.40	386.00	3 590.41	0.00
EUR HERMES INTL NPV	23.00	10 003.34	0.01
EUR ILIAD NPV	25.00	5 348.11	0.00
EUR INGENICO GROUP EUR1	54.00	4 555.41	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR KERING EUR4	40.00	9 518.81	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	239.00	9 078.80	0.01
EUR L' OREAL EURO.20	177.00	32 202.64	0.03
EUR LEGRAND SA EUR4	274.00	15 924.89	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	206.00	41 541.68	0.03
EUR NATIXIS EUR1.6	590.00	3 497.31	0.00
EUR ORANGE EUR4	1 654.00	25 605.62	0.02
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	181.00	21 193.99	0.02
EUR PEUGEOT SA EUR1	414.00	7 695.45	0.01
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	112.00	7 693.20	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	116.00	10 452.62	0.01
EUR REXEL EUR5	171.00	2 976.20	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	234.00	15 855.81	0.01
EUR SANOFI EUR2	786.00	63 274.06	0.05
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	425.00	30 414.68	0.02
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	184.00	6 234.90	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	544.00	26 605.45	0.02
EUR SODEXO EUR4	51.00	5 641.09	0.00
EUR SUEZ EUR4	241.00	3 654.10	0.00
EUR THALES EUR3	105.00	9 847.23	0.01
EUR TOTAL EUR2.5	1 541.00	77 705.64	0.06
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	62.00	14 268.37	0.01
EUR VALEO EUR1 (POST SUBD)	122.00	7 451.90	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	253.00	4 304.96	0.00
EUR VINCI EUR2.50	323.00	22 654.39	0.02
EUR VIVENDI SA EUR5.50	770.00	14 096.43	0.01
EUR ZODIAC AEROSPACE	214.00	6 498.68	0.01
フランス合計		816 002.57	0.62
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	217.00	19 738.87	0.02
EUR BEIERSDORF AG NPV	59.00	5 224.60	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	863.00	7 473.28	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	103.00	20 114.10	0.02
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	232.00	7 556.77	0.01
EUR FRAPORT AG NPV	52.00	3 105.41	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	139.00	11 309.86	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO.KGAA NPV	329.00	25 930.28	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	226.00	9 339.67	0.01
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	160.00	15 413.38	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	43.00	4 528.05	0.00
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	56.00	3 588.79	0.00
EUR LANXESS AG NPV	68.00	4 934.69	0.00
EUR LINDE AG NPV	150.00	24 388.70	0.02
EUR MAN SE ORD NPV	34.00	3 525.57	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	70.00	7 689.72	0.01
EUR METRO AG ORD NPV	90.00	3 074.48	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	255.00	3 377.22	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	684.00	62 558.39	0.05
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	109.00	6 555.36	0.00
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	463.00	11 683.50	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	27.00	4 308.26	0.00
EUR ZALANDO SE NPV	187.00	7 377.33	0.01
ドイツ合計		272 796.28	0.21
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	9 200.00	57 267.68	0.04
HKD ASM PACIFIC TECH HKD0.10	700.00	8 525.20	0.01
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	2 500.00	10 052.39	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
HKD CHEUNG KONG INFSTR HKD1	1 000.00	8 061.24	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	1 684.00	20 281.31	0.02
HKD CK PROPERTY LTD HKD1	1 684.00	11 155.26	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	1 000.00	9 775.30	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	1 000.00	4 787.77	0.00
HKD HANG LUNG PROP HKD1	3 000.00	7 423.30	0.01
HKD HANG SENG BANK HKD5	500.00	10 239.26	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 218.00	6 757.64	0.01
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	846.00	20 573.91	0.02
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	1 000.00	6 750.00	0.00
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	5 240.00	9 900.11	0.01
USD JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)	300.00	18 516.00	0.01
HKD LI & FUNG HKD0.0125	2 000.00	871.21	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	85.00	3 638.85	0.00
HKD MTR CORP HKD1	1 533.00	7 823.70	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	5 147.00	5 969.96	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 500.00	14 411.65	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	2 554.00	4 246.05	0.00
HKD SJM HOLDINGS LTD. HKD1.00	2 000.00	1 598.07	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP NPV	1 047.00	14 491.91	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	5 100.30	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2 000.00	13 699.60	0.01
HKD WHARF(HLDGS) HKD1	1 000.00	7 545.74	0.01
HKD WHEELLOCK & COMPANY HKD0.50	1 000.00	6 102.32	0.00
香港合計		295 565.73	0.23
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	417.00	47 483.79	0.04
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	100.00	5 411.00	0.00
EUR BK OF IRELAND ORD STK EURO.1	17 655.00	4 731.78	0.00
EUR CRH ORD EURO.32	465.00	16 203.94	0.01
GBP DCC ORD EURO.25	83.00	6 677.81	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	274.00	19 393.72	0.02
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	682.00	13 119.19	0.01
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	184.00	14 600.40	0.01
USD MALLINCKRODT PLC USD0.20	100.00	4 873.00	0.00
EUR PADDY POWER BETFAI ORD EURO.09	21.00	2 196.85	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	181.00	8 172.15	0.01
GBP SHIRE ORD GBP0.05	572.00	31 516.34	0.02
アイルランド合計		174 379.97	0.13
イスラエル			
ILS BANK HAPOALIM B.M. ILS1	799.00	4 825.39	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	2 427.00	4 239.36	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 087.00	4 492.86	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	79.00	7 802.83	0.01
USD MOBILEYE NV EURO.01	200.00	8 592.00	0.01
ILS NICE SYSTEMS ILS1	113.00	7 904.30	0.01
イスラエル合計		37 856.74	0.03
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	606.00	9 653.29	0.01
EUR ATLANTIA SPA EUR1	240.00	5 459.70	0.00
EUR ENEL EUR1	4 640.00	19 375.83	0.01
EUR ENI SPA EUR1	1 481.00	22 743.34	0.02
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	60.00	3 741.38	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	9 021.00	21 155.32	0.02

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR LEONARDO SPA EUR4.40	384.00	4 946.67	0.00
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	214.00	11 491.80	0.01
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	395.00	3 395.81	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	306.00	7 956.50	0.01
EUR SAIPEM EUR1	3 841.00	1 961.33	0.00
EUR SNAM EUR1	1 899.00	7 223.92	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	8 925.00	7 667.98	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 129.00	4 951.21	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)	330.60	8 989.16	0.01
イタリア合計		140 713.24	0.11
日本			
JPY イオン	400.00	5 795.25	0.00
JPY イオンフィナンシャルサービス	100.00	1 796.14	0.00
JPY イオンモール	220.00	3 203.02	0.00
JPY アイシン精機	100.00	4 592.49	0.00
JPY 味の素	400.00	7 918.28	0.01
JPY アルフレッサ ホールディングス	400.00	6 591.16	0.01
JPY アルプス電気	100.00	2 678.21	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	400.00	14 106.15	0.01
JPY 旭化成	1 000.00	9 371.53	0.01
JPY アステラス製薬	1 900.00	25 544.30	0.02
JPY バンダイナムコホールディングス	100.00	2 762.60	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	2 918.05	0.00
JPY ブリヂストーン	400.00	14 720.85	0.01
JPY ブラザー工業	300.00	5 564.29	0.00
JPY キヤノン	800.00	23 770.82	0.02
JPY 東海旅客鉄道	100.00	16 229.18	0.01
JPY 中部電力	400.00	5 340.44	0.00
JPY 中外製薬	100.00	2 931.38	0.00
JPY 中国電力	300.00	3 384.41	0.00
JPY コンコルディア・フィナンシャルグループ	1 000.00	5 313.79	0.00
JPY クレディセゾン	200.00	3 663.34	0.00
JPY 第一生命ホールディングス	900.00	16 485.01	0.01
JPY ダイセル	600.00	6 672.88	0.01
JPY 第一三共	400.00	8 970.02	0.01
JPY ダイキン工業	200.00	19 942.26	0.02
JPY 大東建託	100.00	14 026.20	0.01
JPY 大和ハウス工業	400.00	10 886.96	0.01
JPY 大和証券グループ本社	1 000.00	6 426.83	0.01
JPY デンソー	500.00	21 767.71	0.02
JPY 電通	100.00	4 636.91	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	200.00	18 174.55	0.01
JPY エーザイ	200.00	11 041.53	0.01
JPY 電源開発	300.00	6 990.01	0.01
JPY ユニー・ファミリーマートホールディングス	100.00	6 360.20	0.01
JPY ファナック	100.00	19 689.10	0.02
JPY 富士フイルムホールディングス	300.00	11 658.89	0.01
JPY 富士重工業	500.00	20 164.34	0.02
JPY 富士通	1 000.00	5 850.32	0.00
JPY 日野自動車	300.00	3 184.54	0.00
JPY 久光製薬	100.00	5 205.42	0.00
JPY 日立建機	200.00	4 624.47	0.00
JPY 日立製作所	4 000.00	23 010.44	0.02
JPY 北陸電力	200.00	2 019.99	0.00
JPY 本田技研工業	1 300.00	39 112.59	0.03
JPY HOYA	300.00	13 116.59	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 国際石油開発帝石	1 100.00	10 850.99	0.01
JPY 三越伊勢丹ホールディングス	400.00	4 704.42	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	6 759.94	0.01
JPY 伊藤忠商事	1 200.00	16 586.28	0.01
JPY J. フロント リテイリング	500.00	7 252.94	0.01
JPY 日本取引所グループ	400.00	5 987.12	0.00
JPY ゆうちょ銀行	500.00	6 107.04	0.00
JPY 日本郵政	400.00	5 045.53	0.00
JPY 日本プライムリアルティ投資法人	2.00	8 047.97	0.01
JPY ジャパンリアルエステイト投資法人	1.00	5 702.86	0.00
JPY 日本リートファンド投資法人	2.00	4 292.25	0.00
JPY 日本たばこ産業	800.00	25 867.20	0.02
JPY J F Eホールディングス	300.00	5 281.81	0.00
JPY 日揮	500.00	8 718.63	0.01
JPY JSR	100.00	1 723.30	0.00
JPY ジェイテクト	400.00	6 608.93	0.01
JPY J Xホールディングス	2 400.00	11 354.56	0.01
JPY カカクコム	200.00	3 631.36	0.00
JPY 関西電力	400.00	4 279.81	0.00
JPY 関西ペイント	400.00	7 795.69	0.01
JPY 花王	400.00	19 837.44	0.02
JPY KDDI	1 400.00	37 681.55	0.03
JPY 京成電鉄	200.00	4 743.50	0.00
JPY キリンホールディングス	600.00	9 849.43	0.01
JPY 小松製作所	800.00	19 144.57	0.01
JPY コニカミノルタ	500.00	5 205.42	0.00
JPY クボタ	1 000.00	15 989.34	0.01
JPY クラレ	400.00	6 367.31	0.01
JPY 栗田工業	200.00	4 761.27	0.00
JPY 京セラ	200.00	10 453.48	0.01
JPY 協和発酵キリン	500.00	6 755.50	0.01
JPY 九州電力	300.00	3 352.43	0.00
JPY ローソン	100.00	7 319.56	0.01
JPY LIXILグループ	200.00	4 690.21	0.00
JPY エムスリー	300.00	8 074.62	0.01
JPY マキタ	100.00	6 973.13	0.01
JPY 丸紅	1 000.00	6 107.93	0.00
JPY マツダ	700.00	10 371.75	0.01
JPY 日本マクドナルドホールディングス	200.00	5 274.71	0.00
JPY メディパルホールディングス	300.00	4 874.08	0.00
JPY 明治ホールディングス	100.00	7 763.71	0.01
JPY 三菱ケミカルホールディングス	1 200.00	8 417.85	0.01
JPY 三菱商事	1 200.00	27 176.55	0.02
JPY 三菱電機	1 400.00	21 408.84	0.02
JPY 三菱地所	1 000.00	19 209.42	0.01
JPY 三菱重工業	2 000.00	9 041.08	0.01
JPY 三菱自動車工業	400.00	2 178.10	0.00
JPY 田辺三菱製薬	300.00	6 019.99	0.00
JPY 三菱UFJフィナンシャル・グループ	9 000.00	58 433.05	0.04
JPY 三井物産	1 500.00	22 071.95	0.02
JPY 三井不動産	1 000.00	23 242.28	0.02
JPY 商船三井	1 000.00	3 197.87	0.00
JPY みずほフィナンシャルグループ	18 800.00	35 120.05	0.03
JPY MS&ADインシュアランス グループ ホールディングス	400.00	13 484.34	0.01
JPY 村田製作所	100.00	13 550.97	0.01
JPY 日本碍子	300.00	5 916.06	0.00
JPY 日本特殊陶業	100.00	2 259.83	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
JPY 日本電産	200.00	18 849.66	0.01
JPY ニコン	200.00	3 242.28	0.00
JPY 任天堂	100.00	20 537.42	0.02
JPY 日本ビルファンド投資法人	1.00	5 756.16	0.00
JPY 日本プロロジスリート投資法人	3.00	6 289.14	0.01
JPY 新日鐵住金	847.00	20 589.08	0.02
JPY 日本電信電話	400.00	17 691.32	0.01
JPY 日産自動車	1 700.00	16 898.07	0.01
JPY 日清製粉グループ本社	400.00	6 100.82	0.00
JPY ニトリホールディングス	100.00	11 210.30	0.01
JPY 日東電工	100.00	7 944.04	0.01
JPY NOK	200.00	4 071.95	0.00
JPY 野村ホールディングス	2 600.00	16 247.83	0.01
JPY 野村不動産マスターファンド投資法人	5.00	7 812.57	0.01
JPY 野村不動産ホールディングス	100.00	1 727.74	0.00
JPY 日本精工	500.00	6 102.60	0.00
JPY NTTドコモ	1 100.00	26 445.93	0.02
JPY 大林組	700.00	6 690.65	0.01
JPY 小田急電鉄	500.00	9 935.60	0.01
JPY オリンパス	100.00	3 459.92	0.00
JPY オムロン	100.00	4 117.26	0.00
JPY 小野薬品工業	400.00	8 195.43	0.01
JPY オリエンタルランド	200.00	10 991.78	0.01
JPY オリックス	700.00	10 614.26	0.01
JPY 大阪ガス	2 000.00	7 509.66	0.01
JPY 大塚ホールディングス	400.00	18 473.02	0.01
JPY パナソニック	1 900.00	19 890.30	0.02
JPY パーク 2 4	200.00	5 534.09	0.00
JPY 楽天	700.00	7 010.88	0.01
JPY リクルートホールディングス	200.00	8 785.25	0.01
JPY りそなホールディングス	2 000.00	10 894.07	0.01
JPY リコー	400.00	3 585.17	0.00
JPY SANKYO	100.00	3 353.32	0.00
JPY 参天製薬	500.00	6 289.14	0.01
JPY SBIホールディングス	150.00	2 083.94	0.00
JPY セコム	200.00	14 507.66	0.01
JPY セガサミーホールディングス	100.00	1 577.61	0.00
JPY セイコーエプソン	400.00	8 282.48	0.01
JPY 積水化学工業	500.00	8 190.10	0.01
JPY 積水ハウス	300.00	4 872.75	0.00
JPY セブン&アイ・ホールディングス	500.00	20 026.65	0.02
JPY シマノ	100.00	15 820.56	0.01
JPY 清水建設	1 000.00	9 229.40	0.01
JPY 信越化学工業	300.00	25 974.68	0.02
JPY 塩野義製薬	200.00	9 638.02	0.01
JPY 資生堂	300.00	8 415.72	0.01
JPY 昭和シェル石油	300.00	2 950.03	0.00
JPY ソフトバンクグループ	700.00	54 103.49	0.04
JPY SOMPOホールディングス	275.00	10 010.66	0.01
JPY ソニー	900.00	27 365.76	0.02
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 380.86	0.00
JPY スタンレー電気	200.00	5 658.45	0.00
JPY 住友商事	700.00	8 804.80	0.01
JPY 住友電気工業	500.00	7 317.34	0.01
JPY 住友金属鉱山	1 000.00	13 608.71	0.01
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	900.00	35 584.28	0.03
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	300.00	11 277.81	0.01
JPY 住友ゴム工業	100.00	1 567.84	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY サントリー食品インターナショナル	200.00	8 518.77	0.01
JPY スルガ銀行	300.00	6 875.42	0.01
JPY スズキ	200.00	7 761.94	0.01
JPY シスメックス	100.00	6 004.89	0.00
JPY T&Dホールディングス	300.00	4 486.34	0.00
JPY 大成建設	1 000.00	7 124.14	0.01
JPY 武田薬品工業	500.00	20 981.57	0.02
JPY TDK	100.00	7 221.85	0.01
JPY テルモ	200.00	7 408.39	0.01
JPY 東宝	200.00	5 782.81	0.00
JPY 東北電力	300.00	3 666.89	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	600.00	25 215.19	0.02
JPY 東京電力	700.00	2 692.43	0.00
JPY 東京エレクトロン	100.00	10 401.95	0.01
JPY 東京ガス	2 000.00	8 879.41	0.01
JPY 東京急行電鉄	1 000.00	7 381.75	0.01
JPY 東急不動産ホールディングス	500.00	2 935.82	0.00
JPY 凸版印刷	1 000.00	9 851.21	0.01
JPY 東レ	1 000.00	8 683.99	0.01
JPY 東芝	2 000.00	4 304.69	0.00
JPY 東洋製罐グループホールディングス	200.00	3 698.87	0.00
JPY 豊田自動織機	100.00	4 850.10	0.00
JPY トヨタ自動車	1 852.00	108 315.06	0.08
JPY 豊田通商	200.00	5 525.21	0.00
JPY ユニ・チャーム	300.00	6 768.82	0.01
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	5.00	7 999.11	0.01
JPY ユー・エス・エス	300.00	5 279.15	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	100.00	6 537.86	0.01
JPY ヤフー	700.00	2 947.37	0.00
JPY ヤクルト本社	100.00	5 152.12	0.00
JPY ヤマハ	300.00	9 193.87	0.01
JPY ヤマハ発動機	100.00	2 091.05	0.00
JPY ヤマトホールディングス	300.00	6 074.62	0.00
JPY 安川電機	500.00	9 065.07	0.01
JPY 横河電機	300.00	4 812.79	0.00
日本合計		2 108 718.07	1.62
ジャージー島			
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	62.00	5 269.05	0.00
ジャージー島合計		5 269.05	0.00
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG' S'	1 200.00	5 335.50	0.01
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	1 200.00	2 205.34	0.00
マカオ合計		7 540.84	0.01
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	1 709.00	9 256.75	0.01
USD AERCAP HOLDINGS NV	200.00	8 854.00	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	149.00	10 110.72	0.01
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	186.00	4 076.49	0.00
EUR ALTICE NV EURO.25 (COMMON SHARES B)	62.00	1 365.53	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	243.00	29 517.38	0.02
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	233.00	2 064.79	0.00
EUR EXOR NV EURO.01	78.00	3 553.86	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	606.00	6 614.53	0.01
EUR GEMALTO EUR1	37.00	2 149.64	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	69.00	4 845.45	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	151.00	11 297.35	0.01
EUR ING GROEP N.V. EURO.01	3 051.00	43 688.11	0.03
EUR KON KPN NV EURO.24	4 073.00	11 726.10	0.01
EUR KONINKLIJKE AHOLD EURO.01	904.00	19 241.09	0.02
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.01	169.00	6 256.28	0.01
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	108.00	6 886.22	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	548.00	16 069.99	0.01
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	267.00	9 444.14	0.01
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	244.00	23 875.40	0.02
EUR QIAGEN NV EURO.01	267.70	7 720.14	0.01
EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	83.00	4 825.76	0.00
EUR RELX NV EURO.07	699.00	11 803.28	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	2 531.00	71 215.78	0.05
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	3 037.00	82 052.75	0.06
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	100.00	4 195.00	0.00
EUR VOPAK(KON) EURO.50	70.00	3 004.40	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	124.00	4 737.81	0.00
オランダ合計		420 448.74	0.32
ニュージーランド			
NZD AUCKLAND INTL NPV	1 489.00	7 467.47	0.01
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	2 227.00	5 731.26	0.00
ニュージーランド合計		13 198.73	0.01
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	928.00	15 519.77	0.01
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	417.00	7 191.80	0.01
NOK MARINE HARVEST ASA NOK7.50	488.00	8 647.61	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	854.00	4 877.33	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	590.00	5 514.39	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	838.00	15 623.86	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	392.00	6 222.26	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	147.00	6 210.35	0.00
ノルウェー合計		69 807.37	0.05
パプアニューギニア			
AUD OIL SEARCH LTD PGK0.10	1 527.00	7 963.86	0.01
パプアニューギニア合計		7 963.86	0.01
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	262.00	3 856.41	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	106.00	1 793.35	0.00
ポルトガル合計		5 649.76	0.00
シンガポール			
USD BROADCOM LIMITED COM NPV	289.00	57 655.50	0.04
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	900.00	5 896.51	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	1 632.00	21 975.47	0.02
USD FLEX LTD COM USD0.01	600.00	9 402.00	0.01
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	222.00	6 515.97	0.01
SGD KEPPEL CORP NPV	1 000.00	4 379.61	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	1 985.00	13 230.52	0.01
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 000.00	7 027.26	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01	1 000.00	5 266.89	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV (POST RE-ORG)	5 000.00	13 735.09	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 048.00	15 562.29	0.01
シンガポール合計		160 647.11	0.12

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
南アフリカ			
GBP MONDI ORD EURO.20	344.00	7 578.09	0.01
南アフリカ合計		7 578.09	0.01
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	760.00	10 878.54	0.01
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	141.00	4 339.75	0.00
EUR AENA SA EUR10	56.00	8 130.75	0.01
EUR AMADEUS IT GROUP EURO.01	326.00	15 059.41	0.01
EUR BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)	3 901.00	4 030.32	0.00
EUR BANKIA S.A. EUR1	2 457.00	2 588.90	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	2 403.00	3 620.11	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	3 019.00	11 030.97	0.01
EUR DISTRIBUIDORA INTL EURO.01	309.00	1 633.95	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	198.00	4 857.31	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	321.00	6 606.81	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	605.00	10 951.54	0.01
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	298.00	5 738.91	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	132.00	2 827.37	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	3 010.00	18 977.46	0.02
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	816.00	26 927.33	0.02
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	584.00	3 502.76	0.00
EUR RED ELECTRICA CORP EURO.5	316.00	5 645.01	0.00
EUR REPSOL SA EUR1	940.00	13 876.62	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	2 965.00	28 598.16	0.02
スペイン合計		189 821.98	0.14
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	261.00	4 872.70	0.00
SEK ASSA ABLOY SER' B' NPV (POST SPLIT)	770.00	14 586.80	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' A' NPV (POST SPLIT)	438.00	14 044.50	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	163.00	4 728.75	0.00
USD AUTOLIV INC COM	47.00	5 436.02	0.01
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	207.00	6 040.74	0.01
SEK ELECTROLUX AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	123.00	3 271.43	0.00
SEK ERICSSON SER' B' NPV	2 259.00	13 347.37	0.01
SEK GETINGE AB SER' B' NPV	196.00	3 170.40	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER' B' NPV	620.00	17 731.31	0.01
SEK HEXAGON AB SER' B' NPV	297.00	11 755.51	0.01
SEK HUSQVARNA AB SER' B' NPV	882.00	7 385.65	0.01
SEK INVESTOR AB SER' B' NPV	472.00	18 838.75	0.02
SEK KINNEVIK INV AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	106.00	2 719.85	0.00
SEK LUNDIN PETROLEUM A NPV	212.00	4 573.90	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV (SEK QUOTE)	2 017.00	24 388.77	0.02
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	637.00	8 598.65	0.01
SEK SECURITAS SER' B' NPV	437.00	6 958.73	0.01
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER' A' NPV	910.00	10 227.82	0.01
SEK SKANSKA AB SER' B' NPV	310.00	7 589.00	0.01
SEK SKF AB SER' B' NPV	158.00	3 181.11	0.00
SEK SVENSKA CELLULOZA SER' B' NPV	401.00	12 064.50	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER' A' NPV (P/S)	858.00	12 818.57	0.01
SEK SWEDBANK AB SER' A' NPV	676.00	17 097.97	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV	136.00	4 427.75	0.00
SEK TELE2 AB SHS	281.00	2 480.00	0.00
SEK TELIASONERA AB NPV	1 030.00	4 179.34	0.00
SEK VOLVO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	941.00	12 034.84	0.01
スウェーデン合計		258 550.73	0.20

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	8 489.00	34 864.89	0.03
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)(POST SUBD)	39.00	2 595.12	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	2.00	10 510.85	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	468.00	6 167.84	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	19.00	6 730.69	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	217.00	20 257.15	0.02
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	400.00	2 084.00	0.00
GBP WOLSELEY ORD GBP0.108030303(POST CON	254.00	15 680.68	0.01
スイス合計		98 891.22	0.07
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBP0.738636	872.00	7 679.44	0.01
GBP ABERDEEN ASSET MGT ORD GBP0.10	606.00	1 998.28	0.00
GBP ANGL0 AMERICAN USD0.54945	933.00	15 940.30	0.01
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	169.00	19 046.30	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBP0.10	438.00	8 849.83	0.01
GBP ASSOCD BRIT FOODS ORD GBP0.0568	287.00	8 615.24	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	818.00	43 161.54	0.03
GBP AUTO TRADER GROUP ORD GBP0.01	1 428.00	7 186.27	0.01
GBP AVIVA ORD GBP0.25	3 360.00	20 159.59	0.02
GBP BAE SYSTEMS ORD GBP0.025	1 870.00	13 692.41	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBP0.25	12 675.00	34 994.42	0.03
GBP BARRATT DEVEL ORD GBP0.10	709.00	4 261.05	0.00
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	1 487.00	26 892.68	0.02
GBP BP ORD USD0.25	13 047.00	77 615.64	0.06
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25	1 283.00	79 084.91	0.06
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	730.00	5 354.35	0.00
GBP BT GROUP ORD GBP0.05	6 722.00	25 696.44	0.02
GBP BUNZL ORD GBP0.32142857	163.00	4 283.92	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBP0.0005	175.00	3 610.75	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBP0.02066666	484.00	3 047.65	0.00
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	99.00	5 278.51	0.00
GBP CENTRICA ORD GBP0.061728395	2 534.00	7 150.74	0.01
GBP COBHAM ORD GBP0.025	1 825.00	3 113.42	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBP0.10625	1 052.00	18 688.12	0.01
GBP CRODA INTL ORD GBP0.10357143	99.00	4 170.00	0.00
USD DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01	200.00	14 012.00	0.01
GBP DIAGEO ORD GBX28.935185	1 901.00	52 699.97	0.04
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	1 323.00	5 908.86	0.00
GBP DIXONS CARPHONE ORD GBP0.001	1 116.00	4 435.36	0.00
GBP G4S ORD GBP0.25	982.00	3 152.87	0.00
GBP GKN ORD GBP0.50	787.00	3 400.09	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25	3 228.00	62 054.32	0.05
GBP HAMMERSON PLC REIT	674.00	4 634.10	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	13 798.00	117 418.06	0.09
USD IHS MARKIT LTD COM	202.00	7 968.90	0.01
GBP IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10	742.00	34 292.50	0.03
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBP0.1896656535	103.00	4 768.70	0.00
GBP INTERTEK GROUP ORD GBP0.01	84.00	3 584.68	0.00
GBP INTU PROPERTIES PLC GBP0.50	1 353.00	4 601.07	0.00
GBP INVESTEC ORD GBP0.0002	541.00	3 821.76	0.00
GBP ITV ORD GBP0.10	2 633.00	6 731.16	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245	152.00	6 216.93	0.01
GBP KINGFISHER ORD GBP0.157142857	2 352.00	9 948.33	0.01
GBP LAND SECURITIES GROUP PLC REIT	614.00	7 678.39	0.01
GBP LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025	2 799.00	8 271.82	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	592.00	20 796.96	0.02
GBP	LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBP0.25	50 559.00	41 300.86	0.03
GBP	LONDON STOCK EXCH ORD GBP0.06918604	200.00	7 978.87	0.01
GBP	MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25	1 771.00	7 475.27	0.01
GBP	MEGGITT ORD GBP0.05	519.00	2 728.69	0.00
GBP	MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBP0.10	1 110.00	3 297.12	0.00
GBP	NATIONAL GRID ORD GBP0.11395	2 270.00	26 494.06	0.02
GBP	NEXT ORD GBP0.10	52.00	2 505.63	0.00
GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBP0.114285714(POST CON	4 884.00	12 762.25	0.01
GBP	PEARSON ORD GBP0.25	514.00	4 002.85	0.00
GBP	PERSIMMON ORD GBP0.10	215.00	5 217.78	0.00
GBP	PROVIDENT FINL ORD GBX20.727272	134.00	4 593.95	0.00
GBP	PRUDENTIAL ORD GBP0.05	1 837.00	35 406.51	0.03
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	404.00	34 582.85	0.03
GBP	RELX PLC GBP0.1444	823.00	14 733.97	0.01
GBP	RIO TINTO ORD GBP0.10	875.00	38 430.24	0.03
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	1 073.00	9 010.86	0.01
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	2 678.00	7 472.86	0.01
GBP	ROYAL MAIL PLC ORD GBP0.01 (WI)	1 040.00	5 385.47	0.00
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	581.00	4 192.04	0.00
GBP	SAGE GROUP GBP0.01051948	1 072.00	8 267.43	0.01
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	700.00	2 271.25	0.00
GBP	SCHROEDERS VTG SHS GBP1	142.00	5 241.60	0.00
GBP	SEGRO PLC ORD GBP0.10	1 276.00	7 408.62	0.01
GBP	SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	142.00	4 055.36	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBP0.50	716.00	9 017.00	0.01
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	656.00	9 763.46	0.01
GBP	SMITHS GROUP ORD GBP0.375	486.00	9 177.66	0.01
GBP	SSE PLC ORD GBP0.50	626.00	11 726.93	0.01
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	2 185.00	21 279.62	0.02
GBP	STANDARD LIFE ORD GBP0.1222222	2 018.00	8 776.79	0.01
GBP	TAYLOR WIMPEY ORD GBP0.01	2 200.00	4 625.03	0.00
USD	TECHNIPFMC LIMITED COM USD1	112.00	3 765.44	0.00
EUR	TECHNIPFMC PLC COM USD1	148.00	4 855.89	0.00
GBP	TESCO ORD GBP0.05	5 452.00	13 347.93	0.01
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBP0.10	139.00	2 540.95	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	986.00	40 036.71	0.03
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	554.00	6 391.37	0.01
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	20 153.00	49 276.46	0.04
GBP	WEIR GROUP ORD GBP0.125	119.00	3 001.76	0.00
GBP	WHITBREAD ORD GBP0.76797385	174.00	8 592.19	0.01
GBP	WILLIAM HILL ORD GBP0.10	748.00	2 436.40	0.00
USD	WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635	86.00	10 761.18	0.01
GBP	WORLDPAY GRP PLC ORD GBP0.03 (WI)	1 919.00	6 902.47	0.01
GBP	WPP PLC ORD GBP0.10	1 076.00	24 962.52	0.02
イギリス合計			1 382 022.78	1.06
アメリカ合衆国				
USD	3M CO COM	403.00	70 452.46	0.05
USD	ABBOTT LABS COM	1 198.00	50 040.46	0.04
USD	ABBVIE INC COM USD0.01	1 126.00	68 809.86	0.05
USD	ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	510.00	20 507.10	0.02
USD	ACUTY BRANDS INC COM STK USD0.01	28.00	5 802.44	0.00
USD	ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	346.00	39 229.48	0.03
USD	AES CORP COM	400.00	4 576.00	0.00
USD	AETNA INC COM USD0.01	244.00	28 940.84	0.02
USD	AFLAC INC COM USD0.10	325.00	22 746.75	0.02
USD	AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	198.00	9 696.06	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD AGNC INV CORP COM USD0.01	200.00	3 734.00	0.00
USD AIR PRODS & CHEMS COM USD1	154.00	21 523.04	0.02
USD AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	100.00	6 859.00	0.01
USD ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	9 264.00	0.01
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM	71.00	7 868.22	0.01
USD ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	155.00	20 255.40	0.02
USD ALLERGAN PLC COM USD0.0001	323.00	70 701.47	0.05
USD ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	51.00	11 647.38	0.01
USD ALLIANT ENERGY CORP COM	156.00	5 873.40	0.00
USD ALLSTATE CORP COM	229.00	17 223.09	0.01
USD ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	300.00	6 336.00	0.00
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	215.00	171 309.85	0.13
USD ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	205.00	168 138.95	0.13
USD ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	1 322.00	94 099.96	0.07
USD AMAZON COM INC COM USD0.01	281.00	231 397.88	0.18
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	281.00	18 000.86	0.01
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	512.00	39 106.56	0.03
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	739.00	47 488.14	0.04
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	329.00	34 051.50	0.03
USD AMEREN CORP COM	267.00	14 057.55	0.01
USD AMERICAN AIRLINES COM USD1	200.00	8 850.00	0.01
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	101.00	7 417.44	0.01
USD AMERIPRISE FINL INC COM	166.00	18 636.82	0.01
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	173.00	15 099.44	0.01
USD AMETEK INC COM USD0.01	118.00	6 029.80	0.00
USD AMGEN INC COM USD0.0001	520.00	81 473.60	0.06
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	200.00	13 498.00	0.01
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	411.00	28 576.83	0.02
USD ANALOG DEVICES INC COM	192.00	14 388.48	0.01
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	500.00	5 110.00	0.00
USD ANSYS INC COM	78.00	7 274.28	0.01
USD ANTERO RES CORP USD0.01	200.00	4 882.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	226.00	34 835.64	0.03
USD APACHE CORP COM USD0.625	347.00	20 757.54	0.02
USD APPLE INC COM NPV	3 733.00	452 999.55	0.35
USD APPLIED MATLS INC COM	742.00	25 413.50	0.02
USD ARAMARK COM USD0.01	200.00	6 768.00	0.01
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	487.00	21 554.62	0.02
USD ARCONIC INC COM USD1.00	276.00	6 290.04	0.00
USD ARROW ELECTRS INC COM	113.00	8 307.76	0.01
USD ASSURANT INC COM	63.00	6 119.19	0.00
USD AT&T INC COM USD1	4 241.00	178 800.56	0.14
USD ATMOS ENERGY CORP COM	100.00	7 618.00	0.01
USD AUTO DATA PROCESS COM USD0.10	273.00	27 570.27	0.02
USD AUTODESK INC COM USD0.01	130.00	10 574.20	0.01
USD AUTONATION INC COM	107.00	5 683.84	0.00
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	10.00	7 249.80	0.01
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	103.00	17 850.93	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	81.00	5 914.62	0.00
USD AVNET INC COM	95.00	4 411.80	0.00
USD AXALTA COATING SYS COM USD1.00	200.00	5 800.00	0.00
USD BAKER HUGHES INC COM USD1	309.00	19 491.72	0.01
USD BALL CORP COM	111.00	8 464.86	0.01
USD BARD(CR)INC COM USD0.25	63.00	14 951.79	0.01
USD BAXTER INTL INC COM USD1	299.00	14 325.09	0.01
USD BB&T CORP COM USD5	626.00	28 914.94	0.02
USD BE AEROSPACE COM USD0.01	100.00	6 147.00	0.00
USD BECTON DICKINSON COM USD1	162.00	28 720.98	0.02

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	BED BATH & BEYOND INC COM	100.00	4 035.00	0.00
USD	BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	6 721.00	0.01
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	818.00	134 266.52	0.10
USD	BEST BUY CO INC COM USD0.10	159.00	7 078.68	0.01
USD	BIOGEN INC COM STK USD0.0005	163.00	45 190.12	0.03
USD	BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	100.00	8 763.00	0.01
USD	BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	7 179.00	162 532.56	0.12
USD	BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	686.00	30 684.78	0.02
USD	BLACKROCK INC COM STK USD0.01	79.00	29 544.42	0.02
USD	BLOCK(H&R)INC COM NPV	200.00	4 292.00	0.00
USD	BOEING CO COM USD5	409.00	66 838.78	0.05
USD	BORG WARNER INC COM	104.00	4 246.32	0.00
USD	BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	117.00	15 315.30	0.01
USD	BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	1 000.00	24 060.00	0.02
USD	BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10	1 132.00	55 649.12	0.04
USD	BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	263.00	6 346.19	0.00
USD	BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01	109.00	7 251.77	0.01
USD	BROWN FORMAN CORP CL B	140.00	6 384.00	0.00
USD	BUNGE LIMITED COM USD0.01	131.00	9 066.51	0.01
USD	CA INC COM USD0.10	182.00	5 691.14	0.00
USD	CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	497.00	10 675.56	0.01
USD	CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01	300.00	7 809.00	0.01
USD	CALPINE CORP COM STK USD0.001	200.00	2 360.00	0.00
USD	CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	204.00	12 694.92	0.01
USD	CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	345.00	30 149.55	0.02
USD	CARDINAL HEALTH INC COM	262.00	19 639.52	0.01
USD	CARMAX INC COM USD0.50	117.00	7 805.07	0.01
USD	CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	212.00	11 740.56	0.01
USD	CATERPILLAR INC DEL COM	372.00	35 585.52	0.03
USD	CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	302.00	9 168.72	0.01
USD	CBS CORP NEW CL B	333.00	21 475.17	0.02
USD	CDK GLOBAL INC COM USD0.01	100.00	6 255.00	0.00
USD	CDW CORP COM USD0.01	200.00	10 302.00	0.01
USD	CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	100.00	8 440.00	0.01
USD	CELGENE CORP COM USD0.01	541.00	62 837.15	0.05
USD	CENTENE CORP DEL COM	100.00	6 327.00	0.00
USD	CENTERPOINT ENERGY INC COM	178.00	4 665.38	0.00
USD	CENTURYLINK INC COM	310.00	8 016.60	0.01
USD	CERNER CORP COM	198.00	10 634.58	0.01
USD	CF INDS HLDGS INC COM	100.00	3 529.00	0.00
USD	CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	100.00	7 606.00	0.01
USD	CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	137.00	44 381.15	0.03
USD	CHENIERE ENERGY INC COM NEW	100.00	4 765.00	0.00
USD	CHEVRON CORP COM USD0.75	1 303.00	145 089.05	0.11
USD	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	24.00	10 114.56	0.01
USD	CHURCH & DWIGHT INC COM	287.00	12 978.14	0.01
USD	CIGNA CORP COM USD0.25	213.00	31 144.86	0.02
USD	CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01	36.00	4 867.56	0.00
USD	CINCINNATI FINL CORP COM	100.00	7 058.00	0.01
USD	CINTAS CORP COM	100.00	11 611.00	0.01
USD	CISCO SYSTEMS COM USD0.001	3 445.00	105 830.40	0.08
USD	CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	100.00	4 119.00	0.00
USD	CITIGROUP INC COM USD0.01	2 021.00	112 832.43	0.09
USD	CITIZENS FINL GP COM USD0.01	400.00	14 468.00	0.01
USD	CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	100.00	9 119.00	0.01
USD	CLOROX CO DEL COM	100.00	12 000.00	0.01
USD	CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS' A'	232.00	28 090.56	0.02
USD	CMS ENERGY CORP COM	184.00	7 838.40	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD COACH INC COM USD0.01	187.00	6 984.45	0.01
USD COCA-COLA CO COM USD0.25	2 742.00	113 984.94	0.09
USD COGNIZANT TECHNOLO COM CL' A' USD0.01	410.00	21 561.90	0.02
USD COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	619.00	39 975.02	0.03
USD COMCAST CORP COM CLS' A' USD0.01	1 634.00	123 236.28	0.09
USD COMERICA INC COM	85.00	5 740.05	0.00
USD CONAGRA BRANDS IN COM USD5	212.00	8 287.08	0.01
USD CONCHO RES INC COM STK USD0.001	102.00	14 222.88	0.01
USD CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	821.00	40 031.96	0.03
USD CONSOLIDATED EDISON INC COM	277.00	20 594.95	0.02
USD CONSTELLATION BRDS CLASS' A' COM USD0.01	124.00	18 570.24	0.01
USD CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	144.00	6 992.64	0.01
USD CORNING INC COM USD0.50	708.00	18 754.92	0.01
USD COSTCO WHSL CORP NEW COM	288.00	47 217.60	0.04
USD CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	257.00	22 572.31	0.02
USD CROWN HOLDINGS INC COM USD5	100.00	5 417.00	0.00
USD CSX CORP COM USD1	594.00	27 555.66	0.02
USD CUMMINS INC COM	95.00	13 965.95	0.01
USD CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	721.00	56 822.01	0.04
USD D R HORTON INC COM	344.00	10 289.04	0.01
USD DANAHER CORP COM USD0.01	433.00	36 337.36	0.03
USD DARDEN RESTAURANTS INC COM	132.00	9 672.96	0.01
USD DAVITA INC COM USD0.001	100.00	6 375.00	0.00
USD DEERE & CO COM USD1	214.00	22 908.70	0.02
USD DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V	145.00	9 133.55	0.01
USD DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	107.00	5 054.68	0.00
USD DENTSPLY SIRONA IN COM NPV	200.00	11 340.00	0.01
USD DEVON ENERGY CORP NEW COM	286.00	13 024.44	0.01
USD DICKS SPORTING GOO COM USD0.01	100.00	5 160.00	0.00
USD DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	160.00	17 220.80	0.01
USD DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	251.00	17 389.28	0.01
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	55.00	1 559.25	0.00
USD DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	155.00	4 295.05	0.00
USD DISH NETWORK CORPO CLASS' A' COM USD0.01	199.00	11 774.83	0.01
USD DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	232.00	17 126.24	0.01
USD DOLLAR TREE INC	145.00	11 192.55	0.01
USD DOMINION RES(VIR) COM STK NPV	457.00	34 859.96	0.03
USD DOVER CORP COM	100.00	7 775.00	0.01
USD DOW CHEMICAL CO COM USD2.50	720.00	42 933.60	0.03
USD DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	162.00	14 774.40	0.01
USD DTE ENERGY CO COM	110.00	10 850.40	0.01
USD DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30	563.00	42 506.50	0.03
USD DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT	428.00	33 615.12	0.03
USD DUKE REALTY CORP COM USD0.01	280.00	6 812.40	0.01
USD E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	200.00	7 490.00	0.01
USD EASTMAN CHEM CO COM	90.00	6 975.00	0.01
USD EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	4 193.00	0.00
USD EBAY INC COM USD0.001	721.00	22 949.43	0.02
USD ECOLAB INC COM	205.00	24 626.65	0.02
USD EDGEWELL PERSONAL COM USD0.01	100.00	7 884.00	0.01
USD EDISON INTL COM	307.00	22 374.16	0.02
USD EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	132.00	12 703.68	0.01
USD ELECTRONIC ARTS INC COM	200.00	16 686.00	0.01
USD ELI LILLY AND CO COM NPV	642.00	49 453.26	0.04
USD EMERSON ELEC CO COM	409.00	23 991.94	0.02
USD ENDO INTERNATIONAL COM USD0.0001	127.00	1 554.48	0.00
USD ENTERGY CORP NEW COM	118.00	8 453.52	0.01
USD ENVISION HEALTHCAR COM USD0.01	100.00	6 800.00	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD EOG RESOURCES INC COM USD0.01	436.00	44 288.88	0.03
USD EQT CORPORATION	100.00	6 063.00	0.00
USD EQUIFAX INC COM	59.00	6 919.52	0.01
USD EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	43.00	16 554.14	0.01
USD EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01	302.00	18 352.54	0.01
USD ESTEE LAUDER COS CLASS' A' COM USD0.01	148.00	12 019.08	0.01
USD EVERSOURCE ENERGY COM USD5	193.00	10 676.76	0.01
USD EXELON CORP COM NPV	792.00	28 416.96	0.02
USD EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)	116.00	14 104.44	0.01
USD EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	100.00	5 208.00	0.00
USD EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	402.00	27 689.76	0.02
USD EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	95.00	6 844.75	0.01
USD EXXON MOBIL CORP COM NPV	2 868.00	240 596.52	0.18
USD F M C CORP COM NEW	56.00	3 368.96	0.00
USD F5 NETWORK INC COM STK NPV	43.00	5 763.29	0.00
USD FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL 'A'	1 605.00	209 163.60	0.16
USD FASTENAL CO COM	175.00	8 694.00	0.01
USD FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	42.00	5 898.06	0.00
USD FEDEX CORP COM USD0.10	170.00	32 148.70	0.02
USD FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	200.00	7 072.00	0.01
USD FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	271.00	21 522.82	0.02
USD FIFTH THIRD BANCORP COM	640.00	16 704.00	0.01
USD FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	100.00	9 433.00	0.01
USD FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	451.00	13 674.32	0.01
USD FISERV INC COM USD0.01	200.00	21 486.00	0.02
USD FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	64.00	9 439.36	0.01
USD FLIR SYS INC COM	100.00	3 533.00	0.00
USD FLOWSERVE CORP COM	66.00	3 244.56	0.00
USD FLUOR CORP NEW COM	100.00	5 550.00	0.00
USD FOOT LOCKER INC COM USD0.01	111.00	7 607.94	0.01
USD FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	2 510.00	31 023.60	0.02
USD FORTINET INC COM USD0.001	200.00	6 652.00	0.01
USD FORTIVE CORP COM USD0.01	200.00	11 062.00	0.01
USD FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	139.00	7 663.07	0.01
USD FRANKLIN RES INC COM	176.00	6 994.24	0.01
USD FREEPORT-MCMOR C&G COM STK USD0.10	583.00	9 706.95	0.01
USD FRONTIER COMMUNICA COM USD0.25	536.00	1 870.64	0.00
USD GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	164.00	8 828.12	0.01
USD GAP INC DEL COM	104.00	2 395.12	0.00
USD GARTNER INC COM	100.00	9 936.00	0.01
USD GEN DYNAMICS CORP COM USD1	184.00	33 318.72	0.03
USD GEN ELEC CO COM USD0.06	6 162.00	183 011.40	0.14
USD GENERAL MLS INC COM	358.00	22 367.84	0.02
USD GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	1 012.00	37 049.32	0.03
USD GENUINE PARTS CO COM STK USD1	100.00	9 681.00	0.01
USD GGP INC COM USD0.01	443.00	11 004.12	0.01
USD GILEAD SCIENCES COM USD0.001	922.00	66 798.90	0.05
USD GLOBAL PAYMENTS COM NPV	100.00	7 728.00	0.01
USD GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	252.00	57 788.64	0.04
USD GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	200.00	6 478.00	0.00
USD GRACE W R & CO DEL NEW COM	100.00	6 934.00	0.01
USD GRAINGER W W INC COM	49.00	12 375.93	0.01
USD HALLIBURTON COM STK USD2.50	622.00	35 186.54	0.03
USD HANESBRANDS INC COM	200.00	4 742.00	0.00
USD HARLEY DAVIDSON INC COM	100.00	5 704.00	0.00
USD HARMAN INTL INDS INC COM	72.00	8 003.52	0.01
USD HARRIS CORP COM STK USD1	142.00	14 584.82	0.01
USD HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	240.00	11 690.40	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD HASBRO INC COM	105.00	8 663.55	0.01
USD HCA HLDGS INC COM USD0.01	219.00	17 581.32	0.01
USD HCP INC COM USD1	314.00	9 520.48	0.01
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	100.00	7 116.00	0.01
USD HERSHEY CO COM	130.00	13 711.10	0.01
USD HESS CORPORATION COM USD1	308.00	16 687.44	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	1 177.00	26 694.36	0.02
USD HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01 WI	133.00	7 658.14	0.01
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	88.00	2 549.36	0.00
USD HOLOGIC INC COM USD0.01	195.00	7 903.35	0.01
USD HOME DEPOT INC COM USD0.05	836.00	115 016.88	0.09
USD HONEYWELL INTL INC COM	473.00	55 965.36	0.04
USD HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586	196.00	7 114.80	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	376.00	6 794.32	0.01
USD HP INC COM USD0.01	977.00	14 703.85	0.01
USD HUMANA INC COM USD0.166	122.00	24 217.00	0.02
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	9 908.00	0.01
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC COM	747.00	10 106.91	0.01
USD IDEXX LABORATORIES COM USD0.10	100.00	12 233.00	0.01
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	204.00	25 948.80	0.02
USD ILLUMINA INC COM USD0.01	81.00	12 968.10	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USD0.001	100.00	12 121.00	0.01
USD INGREDION INC COM USD0.01	100.00	12 819.00	0.01
USD INTEL CORP COM USD0.001	3 258.00	119 959.56	0.09
USD INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	380.00	22 176.80	0.02
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	100.00	11 721.00	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	400.00	9 412.00	0.01
USD INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	622.00	108 551.44	0.08
USD INTL PAPER CO COM	236.00	13 357.60	0.01
USD INTUIT INC COM USD0.01	184.00	21 818.72	0.02
USD INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	24.00	16 624.56	0.01
USD INVESCO LTD COM STK USD0.20	406.00	11 741.52	0.01
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	315.00	11 277.00	0.01
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	100.00	5 855.00	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	1 865.00	211 211.25	0.16
USD JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01	559.00	24 584.82	0.02
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	2 492.00	210 897.96	0.16
USD JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001	200.00	5 356.00	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	48.00	4 123.68	0.00
USD KELLOGG CO COM USD0.25	170.00	12 360.70	0.01
USD KEYCORP NEW COM	400.00	7 188.00	0.01
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	271.00	32 826.23	0.03
USD KIMCO REALTY COM USD0.01	300.00	7 467.00	0.01
USD KINDER MORGAN INC USD0.01	1 478.00	33 018.52	0.03
USD KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	103.00	8 766.33	0.01
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	100.00	3 983.00	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	459.00	40 984.11	0.03
USD KROGER CO COM USD1	798.00	27 100.08	0.02
USD L BRANDS INC COM USD0.50	174.00	10 476.54	0.01
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	101.00	13 555.21	0.01
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	163.00	18 722.18	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	358.00	18 823.64	0.01
USD LEAR CORP COM USD0.01	100.00	14 209.00	0.01
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	4 772.00	0.00
USD LENNAR CORP COM CL' A' USD0.10	112.00	5 000.80	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	488.00	11 638.80	0.01
USD LEVEL 3 COMMUNICAT COM USD0.01 (POST REV SPLIT)	200.00	11 892.00	0.01
USD LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'C'	100.00	8 534.00	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	348.00	12 695.04	0.01
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	300.00	5 754.00	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM	169.00	6 124.56	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM	200.00	7 178.00	0.01
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	187.00	12 624.37	0.01
USD LINEAR TECHNOLOGY COM USD0.001	134.00	8 459.42	0.01
USD LKQ CORP COM	200.00	6 382.00	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	191.00	48 004.03	0.04
USD LOEWS CORP COM	202.00	9 409.16	0.01
USD LOWE' S COS INC COM USD0.50	583.00	42 605.64	0.03
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	238.00	22 198.26	0.02
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	110.00	17 882.70	0.01
USD MACERICH CO COM USD0.01	100.00	6 869.00	0.01
USD MACY' S INC COM STK USD0.01	196.00	5 789.84	0.00
USD MANPOWER GROUP COM USD0.01	37.00	3 532.02	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	571.00	9 564.25	0.01
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	340.00	16 337.00	0.01
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	185.00	15 651.00	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	347.00	23 602.94	0.02
USD MASCO CORP COM	200.00	6 590.00	0.00
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	658.00	69 965.14	0.05
USD MATTEL INC COM USD1	228.00	5 975.88	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	143.00	6 360.64	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	100.00	9 555.00	0.01
USD MCDONALD' S CORP COM USD0.01	575.00	70 477.75	0.05
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	167.00	23 238.05	0.02
USD MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01	126.00	8 877.96	0.01
USD MEDNAX INC COM USD0.01	100.00	6 835.00	0.01
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	998.00	75 867.96	0.06
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	1 890.00	117 161.10	0.09
USD METLIFE INC COM USD0.01	713.00	38 794.33	0.03
USD MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01	230.00	6 624.00	0.00
USD MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001	116.00	7 812.60	0.01
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	608.00	14 658.88	0.01
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	5 113.00	330 555.45	0.25
USD MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01	80.00	7 596.00	0.01
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	29.00	6 259.36	0.00
USD MOLSON COORS BREWI COM CLS' B' COM NON-V USD0.01	111.00	10 713.72	0.01
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	1 014.00	44 899.92	0.03
USD MONSANTO COM STK USD0.01	353.00	38 233.43	0.03
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	250.00	10 650.00	0.01
USD MOODYS CORP COM USD0.01	92.00	9 537.64	0.01
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	894.00	37 986.06	0.03
USD MOSAIC CO COM USD0.01	251.00	7 873.87	0.01
USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	107.00	8 635.97	0.01
USD MSCI INC COM STK USS0.01	100.00	8 275.00	0.01
USD MURPHY OIL CORP COM USD1	100.00	2 891.00	0.00
USD MYLAN NV EURO.01	300.00	11 415.00	0.01
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	100.00	7 054.00	0.01
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	250.00	9 452.50	0.01
USD NAVIENT CORP COM USD0.01	303.00	4 557.12	0.00
USD NETAPP INC COM USD0.001	219.00	8 392.08	0.01
USD NETFLIX INC COM USD0.001	296.00	41 650.16	0.03
USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	501.00	7 610.19	0.01
USD NEWELL BRANDS INC COM USD1	286.00	13 536.38	0.01
USD NEWFIELD EXPL CO COM	175.00	7 014.00	0.01
USD NEWMONT MINING CORP COM	431.00	15 636.68	0.01
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL' A'	123.00	1 511.67	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	309.00	38 229.48	0.03
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	274.00	11 209.34	0.01
USD NIKE INC CLASS' B' COM NPV	857.00	45 335.30	0.03
USD NISOURCE INC COM NPV	387.00	8 657.19	0.01
USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	339.00	13 478.64	0.01
USD NORDSTROM INC COM NPV	100.00	4 422.00	0.00
USD NORFOLK STHN CORP COM USD1	186.00	21 847.56	0.02
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	207.00	17 172.72	0.01
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	129.00	29 551.32	0.02
USD NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	100.00	4 700.00	0.00
USD NUANCE COMMUNICATI COM USD0.001	329.00	5 217.94	0.00
USD NUCOR CORP COM	203.00	11 792.27	0.01
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	423.00	46 183.14	0.04
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	552.00	37 409.04	0.03
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	100.00	3 354.00	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	199.00	17 044.35	0.01
USD ONEOK INC	116.00	6 392.76	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	2 097.00	84 110.67	0.06
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	70.00	18 358.90	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	215.00	14 471.65	0.01
USD PACKAGING CORP AMER COM	100.00	9 218.00	0.01
USD PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001	70.00	10 329.20	0.01
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	100.00	14 713.00	0.01
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	102.00	4 244.22	0.00
USD PAYCHEX INC COM	204.00	12 299.16	0.01
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	721.00	28 681.38	0.02
USD PEOPLE' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	414.00	7 762.50	0.01
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	954.00	99 006.12	0.08
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	120.00	9 138.00	0.01
USD PFIZER INC COM USD0.05	4 202.00	133 329.46	0.10
USD PG&E CORP COM	343.00	21 228.27	0.02
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	1 060.00	101 897.80	0.08
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	282.00	23 016.84	0.02
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	139.00	10 790.57	0.01
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	122.00	21 988.06	0.02
USD PNC FINANCIAL SVCS COM USD5	311.00	37 463.06	0.03
USD POLARIS INDS INC COM	100.00	8 407.00	0.01
USD PPG INDS INC COM	183.00	18 301.83	0.01
USD PPL CORP COM USD0.01	485.00	16 897.40	0.01
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	189.00	22 385.16	0.02
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	32.00	50 404.16	0.04
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	195.00	11 132.55	0.01
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	1 755.00	153 738.00	0.12
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	351.00	13 141.44	0.01
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	318.00	15 534.30	0.01
USD PRUDENTIAL FINL COM USD0.01	291.00	30 587.01	0.02
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	106.00	22 790.00	0.02
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	441.00	19 514.25	0.01
USD PULTE GROUP INC COM USD0.01	160.00	3 441.60	0.00
USD PVH CORP COM USD1	34.00	3 189.54	0.00
USD QORVO INC COM USD 0.0001	100.00	6 421.00	0.00
USD QUALCOMM INC COM USD0.0001	1 006.00	53 750.58	0.04
USD QUEST DIAGNOSTICS INC COM	114.00	10 478.88	0.01
USD QUINTILES IMS HOLD COM USD0.01	138.00	10 831.62	0.01
USD RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	27.00	2 387.61	0.00
USD RANGE RES CORP COM USD0.01	100.00	3 234.00	0.00
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	100.00	7 493.00	0.01
USD RAYTHEON CO COM NEW	221.00	31 859.36	0.02
USD REALTY INCOME CORP	244.00	14 549.72	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD RED HAT INC COM	113.00	8 574.44	0.01
USD REGENCY CENTERS COM USD0.01	103.00	7 182.19	0.01
USD REGENERON PHARMACEUTICALS COM	65.00	23 353.85	0.02
USD REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	500.00	7 205.00	0.01
USD REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	200.00	11 476.00	0.01
USD RESMED INC COM USD0.004	100.00	6 754.00	0.01
USD REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001	607.00	36 498.91	0.03
USD RITE AID CORP COM	800.00	4 496.00	0.00
USD ROBERT HALF INTL COM USD0.001	100.00	4 706.00	0.00
USD ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1	124.00	18 350.76	0.01
USD ROCKWELL COLLINS INC COM	100.00	9 076.00	0.01
USD ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	100.00	19 185.00	0.01
USD ROSS STORES INC COM USD0.01	319.00	21 089.09	0.02
USD ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	110.00	10 299.30	0.01
USD S&P GLOBAL INC COM USD1	140.00	16 825.20	0.01
USD SABRE CORP COM USD0.01	200.00	4 900.00	0.00
USD SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	437.00	34 566.70	0.03
USD SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A	122.00	12 841.72	0.01
USD SCANA CORP NEW COM	100.00	6 870.00	0.01
USD SCHEIN HENRY INC COM	67.00	10 710.62	0.01
USD SCHLUMBERGER COM USD0.01	997.00	83 458.87	0.06
USD SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01	831.00	34 270.44	0.03
USD SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	57.00	4 341.12	0.00
USD SEALED AIR CORP NEW COM	128.00	6 208.00	0.00
USD SEI INVESTMENT COM USD0.01	120.00	5 821.20	0.00
USD SEMPRA ENERGY COM NPV	170.00	17 406.30	0.01
USD SERVICENOW INC COM USD0.001	100.00	9 062.00	0.01
USD SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	64.00	19 443.84	0.01
USD SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	226.00	41 532.02	0.03
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	100.00	9 174.00	0.01
USD SMUCKER(JM)CO COM NPV	94.00	12 769.90	0.01
USD SNAP-ON INC COM USD1	50.00	9 076.50	0.01
USD SOUTHERN CO COM	690.00	34 106.70	0.03
USD SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	100.00	5 231.00	0.00
USD SPECTRA ENERGY COR COM USD0.001	423.00	17 617.95	0.01
USD SPLUNK INC COM USD0.001	100.00	5 786.00	0.00
USD SPRINT CORPORATION COM USD0.01	307.00	2 833.61	0.00
USD STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	126.00	15 624.00	0.01
USD STAPLES INC COM STK USD0.0006	300.00	2 760.00	0.00
USD STARBUCKS CORP COM USD0.001	952.00	52 569.44	0.04
USD STATE STREET CORP COM STK USD1	311.00	23 698.20	0.02
USD STERICYCLE INC COM	61.00	4 705.54	0.00
USD STHWESTN ENERGY CO COM USD0.01	194.00	1 747.94	0.00
USD STRYKER CORP COM USD0.10	241.00	29 770.73	0.02
USD SUNTRUST BKS INC COM	351.00	19 943.82	0.02
USD SYMANTEC CORP COM	436.00	12 011.80	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIA COM USD0.001	600.00	21 492.00	0.02
USD SYNOPSIS INC COM USD0.01	200.00	12 578.00	0.01
USD SYSCO CORP COM USD1	341.00	17 888.86	0.01
USD T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	210.00	14 162.40	0.01
USD T-MOBILE US INC COM USD0.0001	255.00	15 878.85	0.01
USD TARGET CORP COM STK USD0.0833	348.00	22 439.04	0.02
USD TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	136.00	6 276.40	0.00
USD TEGNA INC COM USD1	300.00	6 873.00	0.01
USD TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	662.00	50 007.48	0.04
USD THERMO FISHER SCIE COM USD1	287.00	43 735.93	0.03
CAD THOMSON-REUTERS CO COM NPV	231.00	10 334.98	0.01
USD TIFFANY & CO NEW COM	129.00	10 154.88	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD TIME WARNER INC COM USD0.01	526.00	50 943.10	0.04
USD TJX COS INC COM USD1	474.00	35 512.08	0.03
USD TOLL BROS INC COM USD0.01	115.00	3 606.40	0.00
USD TORCHMARK CORP COM	82.00	6 030.28	0.00
USD TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USD0.10	132.00	6 689.76	0.01
USD TRACTOR SUPPLY CO COM	100.00	7 367.00	0.01
USD TRANSDIGM GROUP INC COM	32.00	6 924.80	0.01
USD TRAVELERS CO INC COM NPV	228.00	26 853.84	0.02
USD TRIMBLE INC COM NPV	100.00	2 962.00	0.00
USD TRIPADVISOR INC COM USD0.001	51.00	2 697.90	0.00
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' A'	763.00	23 942.94	0.02
USD TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL' B'	370.00	11 473.70	0.01
USD TWITTER INC COM USD0.000005	500.00	8 810.00	0.01
USD TYSON FOODS INC CL A	272.00	17 078.88	0.01
USD UDR INC	175.00	6 116.25	0.00
USD UGI CORP NEW COM	200.00	9 274.00	0.01
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A	237.00	5 093.13	0.00
USD UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.0003333 CL C	201.00	3 863.22	0.00
USD UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	569.00	60 644.02	0.05
USD UNITED CONTINENTAL COM USD0.01	46.00	3 241.62	0.00
USD UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	448.00	48 890.24	0.04
USD UNITED RENTALS INC COM	100.00	12 651.00	0.01
USD UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01	644.00	104 392.40	0.08
USD UNIVERSAL HEALTH S CLASS' B' COM USD0.01	100.00	11 263.00	0.01
USD UNUM GROUP COM USD0.10	309.00	14 037.87	0.01
USD US BANCORP COM USD0.01	1 133.00	59 652.45	0.05
USD UTD TECHNOLOGIES COM USD1	520.00	57 028.40	0.04
USD VALERO ENERGY CORP NEW COM	377.00	24 791.52	0.02
USD VANTIV INC COM USD0.00001 A	100.00	6 224.00	0.00
USD VAREX IMAGING CORP COM USD0.01 WI	18.00	517.50	0.00
USD VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	45.00	3 494.25	0.00
USD VENTAS INC COM USD0.25	262.00	16 157.54	0.01
USD VEREIT INC COM USD0.001	218.00	1 859.54	0.00
USD VERISIGN INC COM	100.00	8 021.00	0.01
USD VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001	100.00	8 264.00	0.01
USD VERIZON COMMUN COM USD0.10	2 792.00	136 835.92	0.10
USD VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01	156.00	13 395.72	0.01
USD VF CORP COM NPV	220.00	11 325.60	0.01
USD VIACOM INC NEW CL' B' NON-VTG USD0.001	210.00	8 849.40	0.01
USD VISA INC COM STK USD0.0001	1 288.00	106 530.48	0.08
USD VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	43.00	3 764.22	0.00
USD VORNADO REALTY TR COM USD0.04	111.00	11 800.41	0.01
USD VOYA FINL INC COM USD0.01	200.00	8 044.00	0.01
USD VULCAN MATERIALS COM STK USD1	71.00	9 111.43	0.01
USD WABCO HOLDINGS INC COM STK USD0.01	100.00	10 903.00	0.01
USD WABTEC CORP COM	100.00	8 664.00	0.01
USD WAL-MART STORES IN COM USD0.10	1 066.00	71 144.84	0.05
USD WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01	658.00	53 916.52	0.04
USD WALT DISNEY CO.DISNEY COM USD0.01	1 023.00	113 194.95	0.09
USD WASTE MGMT INC DEL COM	335.00	23 282.50	0.02
USD WATERS CORP COM	40.00	5 666.00	0.00
USD WEC ENERGY GROUP COM USD0.01	235.00	13 876.75	0.01
USD WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	3 325.00	187 297.25	0.14
USD WELLTOWER INC COM USD1	303.00	20 088.90	0.02
USD WESTAR ENERGY INC COM	100.00	5 469.00	0.00
USD WESTERN DIGITAL CORP COM	163.00	12 995.99	0.01
USD WESTERN UN CO COM	221.00	4 327.18	0.00
USD WESTROCK CO COM USD0.01	178.00	9 498.08	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	442.00	13 847.86	0.01
USD WHIRLPOOL CORP COM	73.00	12 766.97	0.01
USD WHITEWAVE FOODS CO COM USD0.01 CL' A'	100.00	5 506.00	0.00
USD WHOLE FOODS MKT INC COM	205.00	6 195.10	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	438.00	12 631.92	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	8 309.00	0.01
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	132.00	10 435.92	0.01
USD WYNN RESORTS LTD COM	82.00	8 317.26	0.01
USD XCEL ENERGY INC COM	309.00	12 767.88	0.01
USD XEROX CORP COM	700.00	4 851.00	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	178.00	10 359.60	0.01
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	100.00	4 931.00	0.00
USD YAHOO INC COM STK USD0.001	695.00	30 628.65	0.02
USD YUM BRANDS INC COM	307.00	20 117.71	0.02
USD ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI	200.00	7 076.00	0.01
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01	159.00	18 814.47	0.01
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	290.00	15 932.60	0.01
アメリカ合衆国合計		13 861 204.21	10.61
無記名株合計		22 236 320.31	17.02
参加証書			
スイス			
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)	41.00	7 812.69	0.01
スイス合計		7 812.69	0.01
参加証書合計		7 812.69	0.01
その他の株式			
オランダ			
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	1 072.00	43 322.50	0.03
オランダ合計		43 322.50	0.03
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	486.00	114 776.00	0.09
スイス合計		114 776.00	0.09
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	69.00	5 766.33	0.01
アメリカ合衆国合計		5 766.33	0.01
その他の株式合計		163 864.83	0.13
優先株式			
ドイツ			
EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV	114.00	13 884.62	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	72.00	4 318.48	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	157.00	24 415.50	0.02
ドイツ合計		42 618.60	0.03
優先株式合計		42 618.60	0.03

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>記名株式</b>			
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2	181.00	19 439.39	0.02
フランス合計		19 439.39	0.02
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	170.00	26 758.67	0.02
EUR ALLIANZ SE NPV (REGD) (VINKULIERT)	299.00	50 666.67	0.04
EUR BASF SE NPV	634.00	61 061.80	0.05
EUR BAYER AG NPV (REGD)	566.00	62 574.48	0.05
EUR BRENTAG AG	72.00	4 181.53	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV (REGD)	612.00	45 867.29	0.03
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV (REGD)	913.00	18 145.03	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV (ASD UK HLDC0123 PLC)	121.00	11 146.38	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	208.00	2 772.73	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV (REGD)	784.00	26 227.21	0.02
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV (REGD)	2 050.00	35 801.43	0.03
EUR E. ON SE NPV	933.00	7 161.91	0.01
EUR EVONIK INDUSTRIES NPV	224.00	7 257.46	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV (REGD)	26.00	2 856.18	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	665.00	12 210.13	0.01
EUR K&S AG NPV	95.00	2 406.50	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV (REGD)	117.00	21 975.60	0.02
EUR OSRAM LICHT AG NPV	26.00	1 506.91	0.00
EUR PROSIEBENSATI MED. NPV	215.00	9 126.73	0.01
EUR SIEMENS AG NPV (REGD)	568.00	71 358.62	0.05
GBP TUI AG NPV (REGD)	341.00	4 985.12	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV (REGD)	97.00	4 056.32	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	287.00	9 388.57	0.01
ドイツ合計		499 493.27	0.38
イスラエル			
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	237.00	3 647.17	0.00
イスラエル合計		3 647.17	0.00
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV	1 026.00	7 971.15	0.01
EUR TENARIS S. A. USD1	198.00	3 460.03	0.00
ルクセンブルグ合計		11 431.18	0.01
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	1 538.00	4 467.77	0.00
ポルトガル合計		4 467.77	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50 (REGD)	10 154.00	56 502.18	0.04
EUR BANKINTER SA EURO.3 (REGD)	926.00	7 440.41	0.01
EUR BBVA (BILB-VIZ-ARG) EURO.49	4 435.00	30 075.48	0.02
スペイン合計		94 018.07	0.07
スイス			
CHF ABB LTD CHF1.03 (REGD)	1 526.00	36 239.79	0.03
CHF ACTELION CHF0.50 (REGD)	63.00	16 410.91	0.01
CHF ADECCO SA CHF1 (REGD)	91.00	6 493.41	0.00
CHF ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)	50.00	1 376.44	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1 (REGD)	50.00	6 436.25	0.00
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	304.00	39 972.96	0.03
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04 (REGD)	1 350.00	20 511.35	0.02
CHF DUFREY AG CHF5 (REGD)	57.00	8 128.83	0.01
CHF GALENICA AG CHF0.10 (REGD)	4.00	4 386.78	0.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	4 829.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10(REGD)	23.00	9 828.50	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	6.00	10 818.97	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	155.00	7 264.54	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD) (POST-SUBD)	41.00	5 601.86	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	150.00	8 042.77	0.01
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	160.00	8 554.82	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1(REGD)	50.00	9 167.85	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10(REGD)	2 201.00	161 293.63	0.12
CHF NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)	1 587.00	116 539.78	0.09
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	18.00	9 099.43	0.01
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	360.00	27 987.03	0.02
CHF SGS LTD CHF1(REGD)	6.00	12 722.48	0.01
CHF SONOVA HOLDING AG	51.00	6 740.73	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)	49.00	3 426.92	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)	29.00	8 791.71	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	54.00	4 504.56	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1(REGD)	15.00	6 613.62	0.00
CHF SYNGENTA CHF0.1(REGD)	58.00	24 690.86	0.02
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	172.00	12 788.20	0.01
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	2 447.00	39 609.36	0.03
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	94.00	27 010.95	0.02
スイス合計		665 884.29	0.51
記名株式合計		1 298 381.14	0.99
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUF5 EURO.5	330.00	5 180.74	0.00
アイルランド合計		5 180.74	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	691.00	23 100.13	0.02
イスラエル合計		23 100.13	0.02
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	58.00	2 870.28	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	228.00	4 437.66	0.00
ルクセンブルグ合計		7 307.94	0.00
オランダ			
EUR ABN AMRO GROUP NV DR EACH REP SHS	360.00	8 461.88	0.01
オランダ合計		8 461.88	0.01
預託証券合計		44 050.69	0.03
投資ファンド、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	139.00	2 773.07	0.00
カナダ合計		2 773.07	0.00
アメリカ合衆国			
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	119.00	4 568.41	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	45.00	4 903.65	0.01
アメリカ合衆国合計		9 472.06	0.01
投資ファンド、クローズド・エンド型合計		12 245.13	0.01

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>新株引受権</b>			
スペイン			
EUR ACS ACTIV DE CONST Y SER SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 03.02.17	141.00	63.39	0.00
EUR IBERDROLA SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 19.01.17	2 970.00	420.47	0.00
スペイン合計		483.86	0.00
<b>新株引受権合計</b>			
		483.86	0.00
<b>固定利付ノート</b>			
豪ドル			
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 09-15.06.20	30 000.00	25 618.58	0.02
豪ドル合計		25 618.58	0.02
米ドル			
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	150 000.00	137 263.50	0.10
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 3.65000% 16-01.02.26	100 000.00	100 286.50	0.08
USD APPLE INC 1.70000% 16-22.02.19	100 000.00	100 246.00	0.08
USD APPLE INC 2.25000% 16-23.02.21	100 000.00	100 016.90	0.08
USD APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23	50 000.00	48 914.15	0.04
USD APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24	25 000.00	25 732.45	0.02
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 1.15000% 16-15.08.18	25 000.00	24 885.30	0.02
USD CISCO SYSTEMS INC 2.20000% 16-28.02.21	100 000.00	99 748.80	0.08
USD CONOCOPHILLIPS CO 3.35000% 14-15.11.24	50 000.00	49 988.80	0.04
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 13-15.03.18	500 000.00	498 541.00	0.38
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	75 000.00	103 416.30	0.08
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 13-15.03.18	150 000.00	149 384.10	0.11
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 14-15.10.19	75 000.00	75 211.50	0.06
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.25000% 16-19.02.21	150 000.00	149 886.45	0.11
USD JOHNSON & JOHNSON 3.37500% 13-05.12.23	50 000.00	52 574.00	0.04
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.50000% 08-16.07.18	250 000.00	261 363.00	0.20
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.50000% 16-06.02.19	175 000.00	174 991.25	0.13
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 12-12.09.17	200 000.00	199 730.00	0.15
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	50 000.00	49 561.50	0.04
USD ORACLE CORP 2.65000% 16-15.07.26	50 000.00	46 995.60	0.03
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.85000% 16-02.02.21	100 000.00	99 301.80	0.08
USD QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21	200 000.00	197 250.00	0.15
USD SOUTHERN POWER CO 1.95000% 16-15.12.19	35 000.00	34 781.67	0.03
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	125 000.00	128 519.37	0.10
米ドル合計		2 908 589.94	2.23
<b>固定利付ノート合計</b>			
		2 934 208.52	2.25
<b>変動利付ノート</b>			
米ドル			
USD CITIGROUP INC 3M LIBOR+143BP 16-01.09.23	25 000.00	25 421.18	0.02
米ドル合計		25 421.18	0.02
<b>変動利付ノート合計</b>			
		25 421.18	0.02
<b>固定利付メディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.24800% 16-21.10.27	50 000.00	47 201.20	0.03
USD HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 1.50000% 16-13.09.19	50 000.00	49 745.00	0.04

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 1.00000% 12-24.10.17	350 000.00	349 352.50	0.27
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.37500% 12-21.06.17	75 000.00	75 044.25	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.00000% 14-30.09.19	150 000.00	150 616.50	0.11
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-18.01.22	100 000.00	99 908.00	0.08
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	200 000.00	199 268.00	0.15
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	145 000.00	145 574.06	0.11
米ドル合計		1 116 709.51	0.85
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		1 116 709.51	0.85
固定利付債券			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 1.75000% 15-21.11.20	430 000.00	323 352.97	0.24
AUD AUSTRALIA 2.75000% 14-21.10.19	300 000.00	233 156.22	0.18
AUD AUSTRALIA 3.25000% 13-21.10.18	200 000.00	155 686.48	0.12
AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17	200 000.00	153 670.18	0.12
豪ドル合計		865 865.85	0.66
カナダ・ドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.09.17	50 000.00	38 553.68	0.03
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.25000% 14-01.02.18	150 000.00	115 777.00	0.09
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 08-01.06.19	200 000.00	163 850.23	0.12
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.50000% 09-01.06.20	400 000.00	332 383.83	0.25
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21	200 000.00	167 366.99	0.13
カナダ・ドル合計		817 931.73	0.62
ユーロ			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 2.00000% 13-15.08.23	100 000.00	123 109.02	0.09
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 07-04.01.18	175 000.00	197 364.08	0.15
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19	500 000.00	595 892.57	0.46
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 09-04.01.20	650 000.00	783 686.89	0.60
ユーロ合計		1 700 052.56	1.30
英ポンド			
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19	100 000.00	137 220.97	0.11
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 1.25000% 13-22.07.18	50 000.00	63 925.32	0.05
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 2.00000% 14-22.07.20	250 000.00	331 113.05	0.25
GBP UNITED KINGDOM TREASURY GILT 1.75000% 13-22.07.19	250 000.00	326 011.46	0.25
英ポンド合計		858 270.80	0.66
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	150 000.00	189 750.00	0.15
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 12-04.10.17	300 000.00	300 708.00	0.23
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	180 000.00	182 655.00	0.14
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	250 000.00	247 402.50	0.19
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 1.00000% 13-15.06.18	200 000.00	199 024.60	0.15
USD FANNIE MAE 1.62500% 15-21.01.20	150 000.00	150 437.10	0.12
USD ING BANK NV-REG-S 2.62500% 12-05.12.22	250 000.00	248 827.50	0.19
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	200 000.00	212 593.20	0.16
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	125 000.00	123 632.00	0.10
USD ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	150 000.00	175 810.50	0.13
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	50 000.00	46 654.25	0.04
USD MORGAN STANLEY 5.50000% 10-24.07.20	100 000.00	109 230.10	0.08
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.10000% 12-25.10.17	200 000.00	199 796.20	0.15
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	50 000.00	51 936.50	0.04
米ドル合計		2 438 457.45	1.87
固定利付債券合計		6 680 578.39	5.11

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>固定利付米国中期国債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30	200 000.00	282 757.80	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	150 000.00	199 845.75	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38	250 000.00	310 634.75	0.24
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39	100 000.00	109 371.10	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 11-15.05.41	480 000.00	594 506.40	0.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 15-15.05.45	100 000.00	98 847.70	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 08-15.05.18	100 000.00	103 707.00	0.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 09-15.02.19	550 000.00	566 736.50	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20	1 550 000.00	1 647 722.85	1.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.09.18	150 000.00	150 650.40	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 13-30.04.18	250 000.00	248 896.50	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	1 200 000.00	1 170 046.80	0.90
米ドル合計		5 483 723.55	4.20
<b>固定利付米国中期国債合計</b>		5 483 723.55	4.20
<b>変動利付米国中期国債</b>			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.375%/CPI LINKED 04-15.01.25	145 000.00	215 195.82	0.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.125%/CPI LINKED 11-15.01.21	165 000.00	192 577.63	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22	160 000.00	172 728.06	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 14-15.01.24	160 000.00	170 187.12	0.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125% CPI LINKED 14-15.04.19	190 000.00	199 372.26	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.250%/CPI LINKED 15-15.01.25	170 000.00	172 123.97	0.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 15-15.04.20	220 000.00	230 906.96	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 16-15.01.26	160 000.00	165 718.07	0.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.07.22	180 000.00	191 471.04	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23	180 000.00	188 748.75	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI INDEX 13-15.04.18	230 000.00	243 337.21	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI INDEX 13-15.07.23	180 000.00	190 410.23	0.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.375%/CPI LINKED 15-15.07.25	160 000.00	163 696.86	0.12
米ドル合計		2 496 473.98	1.92
<b>変動利付米国中期国債合計</b>		2 496 473.98	1.92
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 短期金融商品合計		42 542 892.38	32.57
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短期金融商品			
<b>固定利付ノート</b>			
米ドル			
USD BANK OF NEW YORK MELLON CO 1.30000% 12-25.01.18	200 000.00	200 004.00	0.15
USD CHEVRON CORP 1.71800% 13-24.06.18	50 000.00	50 169.95	0.04
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	175 000.00	175 832.83	0.13
USD HEINEKEN NV-REG-S 1.40000% 12-01.10.17	25 000.00	24 996.43	0.02
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.87500% 11-14.01.22	50 000.00	53 894.45	0.04
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.25000% 12-05.10.17	100 000.00	100 020.00	0.08
米ドル合計		604 917.66	0.46
<b>固定利付ノート合計</b>		604 917.66	0.46

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
<b>固定利付メディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 2.0000% 13-11.01.18	75 000.00	75 255.68	0.06
USD FREDDIE MAC 2.3750% 12-13.01.22	25 000.00	25 410.52	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.5000% 13-16.01.18	200 000.00	200 051.60	0.15
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.3750% 13-10.01.18	200 000.00	200 100.60	0.15
米ドル合計		500 818.40	0.38
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		500 818.40	0.38
<b>変動利付メディアム・ターム・ノート</b>			
米ドル			
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 3M LIBOR+61BP 16-09.09.21	25 000.00	25 082.77	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP 3M LIBOR+160BP 13-29.11.23	50 000.00	51 439.50	0.04
米ドル合計		76 522.27	0.06
変動利付メディアム・ターム・ノート合計		76 522.27	0.06
<b>固定利付債券</b>			
カナダ・ドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 0.2500% 15-01.11.17	100 000.00	76 512.27	0.06
カナダ・ドル合計		76 512.27	0.06
固定利付債券合計		76 512.27	0.06
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 短期金融商品合計		1 258 770.60	0.96
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短期金融商品			
<b>無記名株</b>			
カナダ			
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	119.00	3 958.60	0.00
カナダ合計		3 958.60	0.00
アメリカ合衆国			
USD ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01	42.00	11 435.76	0.01
アメリカ合衆国合計		11 435.76	0.01
無記名株合計		15 394.36	0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも 取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		15 394.36	0.01
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条（1）e）に準拠した投資信託／その他の投資信託			
<b>投資ファンド、オープン・エンド型</b>			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	47 420.00	8 350 187.80	6.39
アイルランド合計		8 350 187.80	6.39

注記は、財務書類と不可分のものである。



銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	20 982.00	2 648 922.40	2.03
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-ACC	244.00	2 568 656.32	1.97
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	193.00	2 567 189.50	1.96
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	312.00	5 203 626.48	3.99
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD) U-X-ACC	336.00	3 878 209.44	2.97
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA GRWTH (USD) U-X-ACC	53.00	1 357 885.44	1.04
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD) U-X-ACC	235.54	4 974 988.96	3.81
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	287.00	5 210 912.63	3.99
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV-GLOBAL QUANTITATIVE (USD) U-X-ACC	1 848.21	22 325 397.97	17.09
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	1 115.00	21 005 607.65	16.08
USD UBS (LUX) INST SICAV - EMERG. MARKETS EQUITY PASSIVE XA USD	1 346.00	132 002.22	0.10
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	125.00	1 308 101.25	1.00
ルクセンブルグ合計		73 181 500.26	56.03
投資ファンド、オープン・エンド型合計		81 531 688.06	62.42
2010年12月17日のルクセンブルグ投信法第41条（1）e）に準拠した 投資信託／その他の投資信託合計		81 531 688.06	62.42
投資有価証券合計		125 348 745.40	95.96
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
指数に係る金融先物			
CHF SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.03.17	-16.00	-42 975.88	-0.03
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.03.17	117.00	31 190.34	0.03
JPY NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 09.03.17	-7.00	-35 625.24	-0.03
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 17.03.17	46.00	81 807.25	0.06
USD S&P500 EMINI FUTURE 17.03.17	-4.00	-1 260.00	0.00
指数に係る金融先物合計		33 136.47	0.03
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		33 136.47	0.03
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派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ *			
USD CME/CDX.NA.HY.27 DEC21 CDI REC 5.00000% 16-20.12.21	1 200 000.00	82 721.67	0.06
クレジット・デフォルト・スワップ合計		82 721.67	0.06
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 取引されていない派生商品合計		82 721.67	0.06
派生商品合計		115 858.14	0.09

\* 額面がプラスの場合：サブ・ファンドは「受取側」であり、額面がマイナスの場合：サブ・ファンドは「支払側」である。

注記は、財務書類と不可分のものである。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 割合 （%）
先渡為替契約			
先渡為替契約（購入／売却）			
INR	21 480 000.00	USD 312 484.09 9.2.2017	5 596.77 0.00
RUB	20 700 000.00	USD 316 471.55 9.2.2017	27 318.60 0.02
BRL	1 060 000.00	USD 307 941.97 9.2.2017	28 373.79 0.02
USD	205 689.12	AUD 280 000.00 9.2.2017	-6 836.48 -0.01
USD	205 689.12	AUD 280 000.00 9.2.2017	-6 836.48 -0.01
USD	201 063.13	SEK 1 850 000.00 9.2.2017	-10 630.00 -0.01
ZAR	2 190 000.00	USD 152 369.91 9.2.2017	9 904.00 0.01
ZAR	2 190 000.00	USD 152 369.91 9.2.2017	9 904.00 0.01
USD	201 063.13	SEK 1 850 000.00 9.2.2017	-10 630.00 -0.01
USD	208 769.05	CAD 280 000.00 9.2.2017	-6 005.94 -0.01
USD	208 769.05	CAD 280 000.00 9.2.2017	-6 005.94 -0.01
USD	216 241.43	DKK 1 515 000.00 23.2.2017	-4 081.67 0.00
USD	208 947.70	SGD 300 000.00 23.2.2017	-4 042.32 0.00
USD	2 775 757.21	GBP 2 286 000.00 23.2.2017	-101 303.23 -0.08
USD	554 110.97	HKD 4 295 000.00 23.2.2017	452.62 0.00
USD	6 381 222.11	EUR 6 011 055.31 23.2.2017	-119 893.61 -0.09
USD	1 025 333.92	AUD 1 395 925.66 23.2.2017	-33 847.88 -0.03
USD	3 015 682.93	JPY 349 113 248.00 23.2.2017	-87 198.30 -0.07
USD	369 468.34	SEK 3 330 000.00 23.2.2017	-11 807.61 -0.01
USD	888 281.24	CHF 897 388.79 23.2.2017	-22 240.31 -0.02
USD	1 325 848.51	CAD 1 753 214.57 23.2.2017	-19 160.35 -0.02
JPY	189 115 900.00	USD 1 628 436.78 21.2.2017	52 212.66 0.04
SEK	3 700 000.00	USD 415 320.01 9.2.2017	8 066.24 0.01
SEK	1 730 868.10	CAD 260 000.00 23.2.2017	-1 283.53 0.00
USD	427 349.23	SGD 610 000.00 9.2.2017	-5 677.20 0.00
SEK	1 733 295.98	CAD 260 000.00 23.2.2017	-1 005.60 0.00
SEK	1 731 919.54	CAD 260 000.00 23.2.2017	-1 163.16 0.00
SEK	1 730 187.94	CAD 260 000.00 23.3.2017	-1 133.05 0.00
SEK	1 731 563.08	CAD 260 000.00 23.3.2017	-975.45 0.00
SEK	1 729 137.54	CAD 260 000.00 23.3.2017	-1 253.43 0.00
USD	3 099 131.57	JPY 351 202 577.00 23.3.2017	-26 073.64 -0.02
USD	2 975 499.77	GBP 2 385 000.00 23.3.2017	-28 204.23 -0.02
USD	6 380 097.96	EUR 5 931 416.00 23.3.2017	-43 353.21 -0.03
USD	1 147 199.21	AUD 1 520 067.11 23.3.2017	-5 431.92 0.00
USD	379 369.34	SEK 3 347 000.00 23.3.2017	-4 411.29 0.00
USD	514 356.27	CHF 512 000.00 23.3.2017	-6 001.18 0.00
USD	219 351.75	DKK 1 515 000.00 23.3.2017	-1 280.17 0.00
USD	348 635.99	SGD 495 000.00 23.3.2017	-2 883.62 0.00
USD	557 232.99	HKD 4 320 000.00 23.3.2017	189.71 0.00
USD	1 453 304.88	CAD 1 934 866.17 23.3.2017	-31 514.39 -0.02
EUR	130 000.00	USD 139 697.87 23.2.2017	900.58 0.00
SEK	500 000.00	USD 56 608.27 23.2.2017	640.37 0.00
USD	56 365.48	DKK 390 000.00 23.2.2017	-351.36 0.00
USD	112 735.50	CAD 150 000.00 23.2.2017	-2 339.59 0.00
USD	74 920.02	GBP 60 000.00 23.2.2017	-593.38 0.00
USD	56 439.85	DKK 390 000.00 23.3.2017	-356.49 0.00
USD	37 818.00	AUD 50 000.00 23.3.2017	-95.82 0.00
USD	30 274.72	AUD 40 000.00 23.2.2017	-75.95 0.00
USD	87 456.95	GBP 70 000.00 23.3.2017	-702.08 0.00
EUR	130 000.00	USD 139 861.28 23.3.2017	922.75 0.00
USD	112 769.07	CAD 150 000.00 23.3.2017	-2 341.16 0.00
SEK	500 000.00	USD 56 682.87 23.3.2017	649.16 0.00
先渡為替契約（購入／売却）合計			-473 889.77 -0.36
銀行預金、要求払預金および貯蓄預金ならびにその他の流動資産			5 600 341.24 4.29
その他の資産および負債			29 840.22 0.02
純資産合計			130 620 895.23 100.00

注記は、財務書類と不可分のものである。

## 財務書類に対する注記

2017年1月31日現在

### 注1. 重要な会計方針の概要

当財務書類は、投資信託としてルクセンブルグで一般に公認されている会計原則に従って作成されている。重要な会計方針の概要は、以下のとおりである。

#### a) 純資産価格の計算

各サブ・ファンドの異なるクラス受益証券1口当たりの純資産価格、発行価格、買戻価格および転換価格は、サブ・ファンドまたは受益証券クラスの勘定通貨で表示され、毎ファンド営業日に、クラス受益証券がそれぞれに帰属する各サブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの各クラス受益証券の受益証券口数で除することにより決定される。

本書において「営業日」とは、ルクセンブルグにおける個々の法定外休日およびサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日を除く、ルクセンブルグにおける通常の銀行営業日（即ち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日）をいう。

各サブ・ファンドのクラス受益証券に帰属する純資産価額の割合は、かかるクラス受益証券に課せられる手数料および各サブ・ファンドの受益証券の発行・買戻しによる変動を考慮して、各クラス受益証券の流通している受益証券とサブ・ファンドの流通している受益証券の総口数との比率により決定される。

一取引日に、サブ・ファンドのすべてのクラス受益証券の発行受益証券または買戻受益証券の総額が純資本に流入または純資本から流出した場合、各サブ・ファンドの純資産価額はそれに応じて増加または減少することがある（いわゆるシングル・スウィング・プライシング）。その際の最大の調整額は、純資産価額の2%となる。サブ・ファンドが支出する見積り取引費用および税金、ならびにサブ・ファンドが投資する資産の見積り呼値スプレッドが考慮されることになる。純変動がファンドの全受益証券の増加につながる場合、かかる調整によって純資産価額は増加する。純変動が受益証券の減少につながる場合、純資産価額は減少する。取締役会は、各サブ・ファンドの閾値を設定することができる。かかる閾値は、取引日におけるファンド資産純価額または当該サブ・ファンドの通貨の絶対額に関する純変動に基づく。純資産価額は、取引日にかかる閾値を超えた場合に調整される。

#### b) 評価原則

一 流動資産は、現金、預金、為替手形、要求払約束手形、要求払債券、前払費用、配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息、いずれの形においても全額で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる控除が考慮された上で、価格が決定される。

一 証券取引所に上場されている有価証券、派生商品およびその他の資産は、その最終市場価格で評価される。当該有価証券、派生商品またはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合、当該投資対象の主要市場である証券取引所の直近の表示価格が適用される。有価証券、派生商品およびその他の資産について、証券取引所において一般に取引されておらず、かつ市場の市価決定方法を使用する流通市場において証券ディーラー間で取引されている場合、管理会社は、かかる価格

に基づき、当該有価証券、派生商品およびその他の投資対象を評価することができる。証券取引所に上場されていない、または公認かつ公開で定期的に運営されている他の規制ある市場で取引されている有価証券、派生商品および他の投資対象は、当該市場における最終の入手可能価格で評価される。

- － 証券取引所に上場されておらず、また別の規制された市場でも取引されていない、適正価格が入手できない有価証券、派生商品およびその他の投資対象は、予想売却価格に基づき誠実に決定される他の原則に従って、管理会社により評価される。
- － 証券取引所に上場されていない派生商品（O T C 派生商品）の評価は、独立価格決定ソースを参照して行われる。派生商品の独立価格決定ソースが一つしか利用できない場合、入手した評価の妥当性は、派生商品が発生した裏付けとなる証書の市場価額に基づき管理会社およびその監査人に認められた評価方法によって確認される。
- － 他の譲渡性のある有価証券を投資対象とする投資信託（U C I T S）および／または投資信託（U C I）の受益証券は、それらの直近純資産価格で評価される。
- － 証券取引所に上場されていないまたは公開されている他の規制ある市場で取引されていない短期金融商品の価額は、関連するカーブを元に評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの要素を参照する。この過程で以下の原則が適用される。各短期金融商品は、満期までの残存期間にもっとも近い金利が補間される。かかる方法により計算された金利は、原借主を反映する信用スプレッドを加算することで市場価格に転換される。借主の信用格付けが大幅に変更された場合、かかる信用スプレッドは調整が行われる。

関連する注文日から当該評価日の間のサブ・ファンドの受取利息は、当該サブ・ファンドの資産の評価に含まれる。そのため、特定の評価日における一口当たり資産価格は、推定利息収益を含む。

- － 外国為替取引によりヘッジされない当該サブ・ファンドの勘定通貨以外の通貨建ての証券、派生商品およびその他の資産は、当該通貨のルクセンブルグにおける中間の市場取引レート（売買価格の仲値）またはこれが提供されない場合は当該通貨を最も代表する市場におけるレートで評価される。
- － 定期預金および信託投資は、これらの額面額に発生利息を付して評価される。
- － スワップの価値は、外部サービス・プロバイダーにより計算され、第2次の独立した評価が他の外部サービス・プロバイダーにより提供されている。かかる計算は、イン・フローおよびアウト・フローの両方のすべてのキャッシュ・フローの純現在価値に基づくものである。特定の場合に、内部計算（ブルームバーグにより提供されたモデルおよび市場データに基づく。）および／またはブローカーの報告評価が利用される。評価方法は、各有価証券に依拠し、U B S の評価指針に従い決定される。

異常事態のため上記規則に基づく評価が実行不可能または不正確になった場合、管理会社は、純資産額の適切な評価を実行するため誠実に他の一般に認められ監査可能な評価基準を適用する権限を付与される。

異常事態においては、追加評価は一日繰り延べることができる。これらの新評価は、受益証券の爾後の発行および買戻しについて正式なものである。

**c) 先渡為替契約の評価**

未決済の先渡為替契約に係る未実現（損）益は、評価日の実勢先物為替レートに基づいて評価される。

**d) 金融先物契約の評価**

金融先物契約は、評価日に適用される入手可能な直近の公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は運用計算書に計上される。実現損益は、（最初に取得された契約が、最初に販売されるものとみなされる）先入れ先出し法に従って計算される。

**e) 有価証券売却に係る実現純利益（損失）**

有価証券売却に係る実現純利益（損失）は、売却投資証券の平均原価に基づいて計算されている。

**f) 外貨換算**

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての銀行口座、その他の純資産額および有価証券の評価額は、評価日の現行のスポット・レート終値の仲値で換算されている。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建ての収益および費用は支払日の現行のスポット・レート終値の仲値で換算されている。外国為替に係る損益は財務書類に含まれている。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、取得日の現行のスポット・レート終値の仲値で換算されている。

**g) 投資有価証券取引の計上**

投資有価証券取引は、取引日の翌銀行営業日に計上される。

**h) 連結財務書類**

ファンドの連結財務書類はユーロで設定されている。ファンドの2017年1月31日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書の様々な項目は、決算日のユーロの為替レートに換算された各サブ・ファンドの財務書類中の対応する項目の金額に等しい。

以下の為替レートが外国為替の換算および2017年1月31日現在の連結財務書類に使用された。

為替レート

1ユーロ = 1.066219 スイス・フラン

1ユーロ = 1.080700 米ドル

**i) モーゲージ・バック証券**

ファンドは、その投資方針に従い、モーゲージ・バック証券に投資することができる。モーゲージ・バック証券は、証券の形態で統合された住居モーゲージの資金プールに対する参加権である。裏付であるモーゲージに関する元本および利息の支払は、元本が証券の原価を減少させるモーゲージ・バック証券の保有者に対して行われる。元本および利息の支払は、アメリカ合衆国の政府機関に類似する機関により保証される。損益は、元本の各支払に関連する各頭金の支払について計算される。

この損益は、運用計算書の証券の売却にかかる純実現損益に含まれる。さらに、モーゲージへの期

前弁済は、証券の存続期間を短縮することがあり、従って、ファンドの予想利回りに影響する。

#### j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」の勘定には、外国為替取引からの未収金も含まれることがある。「有価証券購入未払金」の勘定には、外国為替取引からの未払金も含まれることがある。

#### k) 利益の認識

源泉徴収税控除後の分配金は、関連する有価証券が最初に「配当落ち」を認定した日に利益として認識される。利息収入は、日次ベースで発生する。

#### l) スワップ

ファンドは、当該種類の取引を専門とする一流金融機関との間で取交わされる、金利スワップ契約、金利スワップションにかかる金利先渡契約およびクレジット・デフォルト・スワップを締結することができる。

未実現損益の変動は、運用計算書において「スワップに係る未実現評価（損）益」の変動として反映されている。手仕舞い時または満期時に発生するスワップに係る利益または損失は、運用計算書において「スワップに係る実現（損）益」として記録される。

### 注2. 報酬

ファンドは、各サブ・ファンドの各クラス受益証券に、各サブ・ファンドの各クラス受益証券の平均純資産額に基づいて下表のとおり計算される報酬を毎月支払う。

#### UBS (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド (米ドル)

	上限年率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.440%
名称に「N」が付くクラス受益証券	1.500%
名称に「K-1」が付くクラス受益証券	0.900%
名称に「K-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「F」が付くクラス受益証券	0.500%
名称に「Q」が付くクラス受益証券	1.050%*
名称に「I-A1」が付くクラス受益証券	0.640%
名称に「I-A2」が付くクラス受益証券	0.580%
名称に「I-A3」が付くクラス受益証券	0.500%
名称に「I-B」が付くクラス受益証券	0.065%
名称に「I-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「U-X」が付くクラス受益証券	0.000%

\* 上限1.05%、実効0.85%

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド・グロース (米ドル)

	上限年率報酬
名称に「P」が付くクラス受益証券	1.800%
名称に「N」が付くクラス受益証券	1.980%
名称に「K-1」が付くクラス受益証券	1.100%
名称に「K-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「F」が付くクラス受益証券	0.560%
名称に「Q」が付くクラス受益証券	1.250%*
名称に「I-A1」が付くクラス受益証券	0.720%
名称に「I-A2」が付くクラス受益証券	0.660%
名称に「I-A3」が付くクラス受益証券	0.560%
名称に「I-B」が付くクラス受益証券	0.065%
名称に「I-X」が付くクラス受益証券	0.000%
名称に「U-X」が付くクラス受益証券	0.000%

\* 上限1.25%、実効1.05%

上記の報酬から、以下の費用が支払われる。

1. ファンドの運用、管理、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（ファンド資産の保管および監督、決済取引の取扱いならびに英文目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されるその他一切の職務等）に関して、以下の条項に従ってファンドの純資産価額に基づく上限報酬がファンド資産から支払われる。当該報酬は、純資産価額の計算毎に比例按分ベースでファンド資産に対し請求され、毎月支払われる（上限報酬）。
2. 上限報酬には、ファンドに請求される以下の報酬および追加の費用は含まれない。
  - a) 資産の売買のためのファンド資産の管理に関する一切の追加の費用（市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値のスプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に記載されているシングル・スウィング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
  - b) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
  - c) ファンドの設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査人に支払われるか、または法律によって許可される一切のその他の報酬。
  - d) ファンドの設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、ファンドおよびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
  - e) ファンドの純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト

(翻訳コストを含む。)

- f) ファンドの法的文書に関するコスト(目論見書、K I I D、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
  - g) 外国の監督官庁へのファンドの登録に関するコスト(該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む。)
  - h) ファンドによる議決権または債権者の権利の使用により発生した費用(外部顧問報酬を含む。)
  - i) ファンドの名義で登録された知的財産またはファンドの利用者の権利に関するコストおよび手数料。
  - j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
  - k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じた費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)をファンドの資産に対して請求することができる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、かかるすべての管理事務コストは、証明可能かつ開示されており、ファンドの総費用率(T E R)の開示において考慮される。
3. 管理会社は、ファンドの販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。

管理会社は、ファンドの販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。ファンドの収益および資産につき徴収されるすべての税金(特に年次税)はファンドが負担する。

報酬制度を用いていない他のファンド・プロバイダーとの報酬規定を全般的に比較するという目的上、「上限管理報酬」は報酬の80%と定められている。

個々のサブ・ファンドに割当てられ得る費用はすべて、それらのサブ・ファンドに請求される。クラス受益証券に割当てられ得る費用は、それらのクラス受益証券に請求される。ただし、費用が複数またはすべてのサブ・ファンド/クラス受益証券にそれぞれ関連する場合には、これらの費用について当該サブ・ファンド/クラス受益証券がその純資産額に比例して負担する。

各サブ・ファンドの投資方針の規定により、他のU C I sまたはU C I T Sへ投資するサブ・ファンドについて、関連する投資ファンドおよびサブ・ファンドの両レベルで報酬が生じることがある。

以下のサブ・ファンドは、2017年1月31日現在その純資産価額の50%以上をその他のU C I T Sに投資した。

U B S (Lux) ストラテジー・ファンドーイールド(米ドル)

U B S (Lux) ストラテジー・ファンドーグロース(米ドル)

或るサブ・ファンドが保有する保有対象ファンドであるUBS-ETF MSCI EMU I-DIS(年率0.18%)を除き、その他のすべての保有対象ファンドの上限報酬は年率0.00%であった。

管理会社自ら、あるいは共同経営もしくは支配または実質的な直接もしくは間接の保有を通じ、直接もしくは間接に運用している投資信託の受益証券への投資の場合、投資を行うサブ・ファンドに対して、対象ファンドの発行または買戻手数料が請求されないことがある。

管理会社が前段落の記載に従い関連ファンドの受益証券に投資する場合、投資するサブ・ファンドの実質的な報酬に満たない実質的な報酬が適用され、管理会社は、関連ファンドへの投資高における上記の減額された実質的な報酬の代わりに、サブ・ファンドが支払う管理報酬総額が常に、関



連ファンド以外のファンドに適用される販売目論見書に規定される金額を超えないようにするため、一方では投資を行うサブ・ファンドの実質的な報酬と他方では関連ファンドの実質的な報酬との間の差額を請求することができる。

サブ・ファンドの継続費用の詳細は、主要な投資家向け資料（K I I D s）に記載されている。

### 注3. 年次税

現在施行されている法令に従い、ファンドはルクセンブルグにおいて、各四半期末日におけるファンドの純資産総額に基づき計算され、四半期毎に支払われる年率0.05%の発行税、または、一定のクラス受益証券については、0.01%の軽減年率の年次税の対象となっている。

ルクセンブルグ法の法定条項に従い年次税を既に支払っている他の投資信託の受益証券または株式へ投資された純資産部分に関し、年次税は放棄された。

### 注4. その他の収益

その他の収益は主にシングル・スウィング・プライシングによる収益で構成される。

### 注5. 利益分配

約款第10条に従い、年次決算の終了とともに、管理会社は、各サブ・ファンドまたは受益証券クラスが分配金を支払う程度を決定する。分配金は、ファンドの純資産が法の規定が定めるファンド資産の最低額を下回るほどの金額であってはならない。分配が行われる場合、支払は会計年度の終了から4か月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金の支払および分配金の支払停止を行う権限を有している。

分配が実際の収益を受ける権利に対応するよう収益平準化額が計算される。

### 注6. 金融先物およびスワップに係る契約債務

2017年1月31日現在のサブ・ファンドおよび各通貨当たりの金融先物およびスワップに係る契約債務は、以下のとおり要約される。

#### a) 金融先物

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド	指数に係る金融先物 (買い)	指数に係る金融先物 (売り)
－イールド (米ドル)	44,041,396.22 米ドル	13,319,298.38 米ドル
－グロース (米ドル)	8,166,545.08 米ドル	2,967,667.53 米ドル

#### b) スワップ

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド	クレジット・デフォルト・スワップ (買い)	クレジット・デフォルト・スワップ (売り)
－イールド (米ドル)	－ 米ドル	7,016,469.17 米ドル
－グロース (米ドル)	－ 米ドル	1,275,721.67 米ドル

**注7. ソフト・コミッション・アレンジメント**

2016年2月1日から2017年1月31日までの期間、いかなる「ソフト・コミッション・アレンジメント」もUBS (Lux) ストラテジー・ファンドに代わって締結されておらず、「ソフト・コミッション・アレンジメント」の金額はなかった。

**注8. 総経費率 (TER)**

当比率は、今期版のスイス・ファンズ・アンド・アセット・マネジメント・アソシエーション (SFAMA) による「TERの計算および公表に係る指針」に従って計算されており、遡及的に把握される、純資産中における、純資産が負担するすべての経常費用および手数料 (運営経費) の合計の割合を表示するものである。

過去12か月におけるTER

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド	総経費率 (TER)
－イールド (米ドル) クラスK-1-a c c 受益証券	0.96%
－イールド (米ドル) クラスP-4%-m d i s t 受益証券	1.49%
－イールド (米ドル) クラスP-a c c 受益証券	1.51%
－イールド (米ドル) クラス (日本円・ヘッジ) P-a c c 受益証券	1.51%
－イールド (米ドル) クラスP-d i s t 受益証券	1.51%
－イールド (米ドル) クラスQ-a c c 受益証券	0.92%
－イールド (米ドル) クラスQ-d i s t 受益証券	0.91%
－グロース (米ドル) クラスF-a c c 受益証券	0.62%
－グロース (米ドル) クラスP-a c c 受益証券	1.88%
－グロース (米ドル) クラス (日本円・ヘッジ) P-a c c 受益証券	1.88%
－グロース (米ドル) クラスQ-a c c 受益証券	1.12%

取引費用および為替ヘッジに関連して発生したその他の費用は、TERに含まれない。  
運用期間が12か月に満たないクラス受益証券のTERについては、年率換算されている。

**注9. 取引費用**

取引費用は、当期に発生したブローカー報酬、印紙税、地方税およびその他の海外手数料を含む。取引費用は、有価証券の購入および売却に係る費用に含まれる。

2017年1月31日に終了した会計年度において、ファンドにおいて発生した投資有価証券の購入および売却に関連する取引費用は、以下のとおりである。

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド	取引費用
－イールド (米ドル)	70,597.11米ドル
－グロース (米ドル)	15,929.08米ドル

すべての取引費用が個別に特定されるわけではない。固定利付証券、先渡為替契約およびその他の派

生商品契約について、取引費用は投資有価証券の売買価格に含まれる。個別に特定はされないが、これらの取引費用は各ファンドの運用成績において表示される。

#### 注10. 取締役会によりゼロと値付けされた有価証券

UBSの評価委員会による提案に基づき、管理会社の取締役会は、以下の有価証券をゼロまたはほぼゼロと評価することを決定した。

I S I N	有価証券
PTBES0AM0007	BCO ESPIRITO SANTO EUR

#### 注11. 準拠法、営業地域および言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、受益者、管理会社および保管受託銀行との間のすべての法律上の紛争の管轄地である。ルクセンブルグの法律が適用される。しかし、外国の投資家からの請求に関する事項については、管理会社および／または保管受託銀行は、ファンド受益証券が売買された国の管轄に服し、代理人を選定することが出来る。

本財務書類は、ドイツ語版が正式書類であり、かかるドイツ語版のみが公認の監査人により監査された。しかし、ファンドの受益証券が売買されているその他の国の投資者に売却された受益証券の場合、管理会社および保管受託銀行は、両者およびファンドを拘束する関連言語に翻訳された承認済の翻訳を認知することができる（即ち、管理会社および保管受託銀行がこれを承認する。）。

#### 注12. O T C派生商品および貸付有価証券

ファンドがO T C派生商品取引を締結する場合、O T Cの取引相手方の信用力に関するリスクに晒されることがある。ファンドが先物契約、オプションおよびスワップ取引を締結する、またはその他のデリバティブ技法を用いる場合、特定のまたは複数の契約に基づき、O T Cの取引相手方が債務を履行しない（またはできない）リスクに晒される。取引相手方リスクは、有価証券の預け入れにより軽減され得る。適用される契約に従い、ファンドが有価証券を受け取る場合、当該有価証券は、ファンドを受取人として保管受託銀行の保護管理下に置かれる。O T Cの取引相手方に破産および支払不能、またはその他の信用事由が生じた場合、保管受託銀行または副保管人／コルレス銀行のネットワーク内において、有価証券に関連するファンドの権利または認識が遅延、制限または排除される可能性があり、その結果、そのような債務をカバーするために過去において利用可能であった有価証券があるにも関わらず、O T C取引の枠組みにおいて債務の履行をファンドが強いられる可能性がある。

ファンドは第三者に組入証券の一部を貸付けることができる。一般的に、貸付はクリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介により、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。貸付有価証券の収益およびコストは、運用計算書に別個に表示される。担保は、貸付有価証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた有価証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付け証券から構成される。

UBS（ルクセンブルグ）エス・エイは、有価証券貸付代理人としての役割を担う。

OTC派生商品\*

取引相手方が、ユービーエス・エイ・ジー以外の場合、店頭派生商品を無担保で保有する以下のサブ・ファンドは、その代わりにマージン勘定を設けている。

サブ・ファンド 取引相手方	未実現（損）益	受領担保
UBS (Lux) ストラテジー・ファンド ーイールド (米ドル)		
CMEクリアリング	454,969.17米ドル	0.00米ドル
J Pモルガン	266,175.18米ドル	0.00米ドル
ユービーエス・エイ・ジー	-2,195,610.21米ドル	0.00米ドル
UBS (Lux) ストラテジー・ファンド ーグロース (米ドル)		
CMEクリアリング	82,721.67米ドル	0.00米ドル
ユービーエス・エイ・ジー	-473,889.77米ドル	0.00米ドル

\*公認の証券取引所に上場されている派生商品は、決済機関により保証されているため、かかる表には含まれていない。取引相手方に債務不履行が生じた場合、当該決済機関が損失にかかるリスクを負う。

貸付有価証券

	2017年1月31日現在の貸付有価証券からの 取引相手方エクスポージャー		2017年1月31日現在の 担保の内訳 (%)		
	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・ スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
UBS (Lux) ストラテジー・ ファンド					
ーイールド (米ドル)	162,462,127.84米ドル	171,758,098.88米ドル	42.07	57.93	0.00
ーグロース (米ドル)	18,536,079.74米ドル	19,596,701.46米ドル	42.07	57.93	0.00

(3) 投資有価証券明細表等

「(2) 損益計算書」の「2017年1月31日現在の投資有価証券明細表およびその他の純資産明細表」を参照のこと。

#### IV. お知らせ

- ファンドの保管受託銀行／主支払事務代行会社が、UBS（ルクセンブルグ）エス・エイからUBS ヨーロッパSE ルクセンブルグ支店に変更されました。

（変更適用日：2016年12月1日）

- 保管信託銀行の変更、販売および買戻し時のファンドへの支払および決済の方法、ファンドの費用・報酬体系の変更を行うため、約款変更を行いました。

（変更適用日：2017年4月28日）