



UBS (Lux) ストラテジー・ファンド

ーイールド(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25期
(2015年2月1日～2016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25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
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参加証券、米国預託証券（ADR）および海外預託証券（GDR）（株式および持分権）、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、ワラント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、ハイイールド債および新興市場に投資する場合があります。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、ハイイールド債および新興市場に投資する場合があります。</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、会計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、投資目的およびヘッジ目的で、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、ならびに有価証券に対するオプションを含む取引を実施する場合があります。
主な投資制限	<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%を超えて単一の発行体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%を超えて単一の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"> －ファンドのために継続販売について契約書による制限を遵守しなければならない有価証券を取得すること。 －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力の行使を可能とする議決権付株式を取得すること。 －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"> ・単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% ・単一UCITSまたはUCIの受益証券の25% －一定の商品の空売りをを行うこと。 －貴金属またはそれに関連する証券を取得すること。 －不動産に投資すること、商品または商品契約を購入し、販売すること。 －貸付金を受け取ること（一定の例外があります。）。 －第三者のために貸付を認めまたは保証人になること。
分配方針	ファンドの約款第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します。分配により、ファンドの純資産が法律の定めるファンド資産の最低額を下回ることができません。分配が行われる場合、支払は会計年度の終了（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。

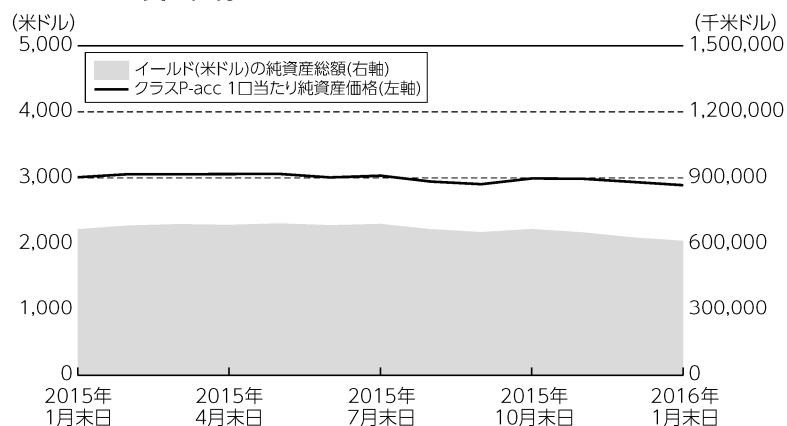
I. 運用の経過等

(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24期末の1口当たり純資産価格	3,009.79米ドル
第25期末の1口当たり純資産価格	2,890.07米ドル
騰落率	-3.98%

(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が、クラス(日本円・ヘッジ)P-acc受益証券は、本書の作成対象期間以後に運用を開始したため、本書に情報を記載していません。

(注3) クラスP-acc受益証券については、分配が行われません。

(注4) 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。

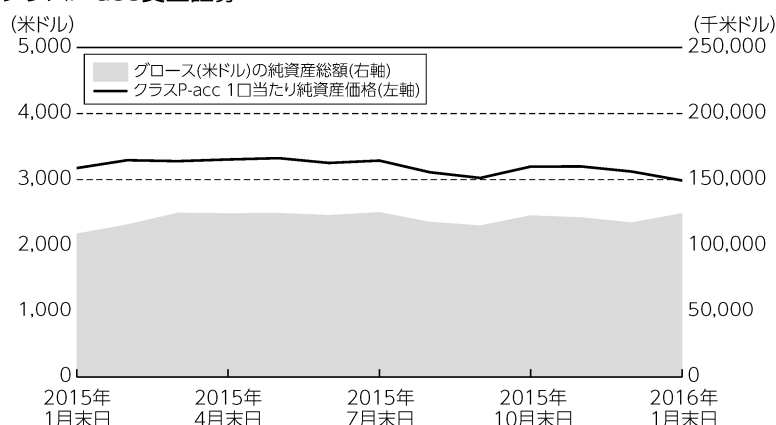
(注5) サブ・ファンドにベンチマークは設定されていません。以下、同じです。

1口当たり純資産価格の主な変動要因

当期のリターンは、マイナスでした。米ドル債券がプラスに寄与したのに対し、新興国市場の株式と債券や、ハイイールド債券等、リスクのポジションの価格が、値下がりしました。これらの資産は、中国を巡る不透明感、原油価格の急落や、景気見通しの悪化により、苦戦を強いられました。

グロース(米ドル)

クラスP-acc受益証券



第24期末の1口当たり純資産価格	3,174.82 米ドル
第25期末の1口当たり純資産価格	2,986.89 米ドル
騰落率	-5.92%

1口当たり純資産価格の主な変動要因

当期のリターンは、マイナスでした。米ドル債券がプラスに寄与したのに対し、新興国市場の株式と債券や、ハイイールド債券等、リスクのポジションの価格が、値下がりしました。これらの資産は、中国を巡る不透明感、原油価格の急落や、景気見通しの悪化により、苦戦を強いられました。

■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。市場は、当期半ばまでは、ボラティリティが概ね低く、若干のプラスを計上しました。8月に、中国の経済費用が予想外に悪化すると、先行き不透明感が強まりました。米連邦準備制度理事会が、7年間の金融緩和政策の後、初の利上げを行うと決定すると、市場は落ち着きました。一方、中国の株価が下落し、2016年1月に、グローバルな株式市場は、再び調整しました。

<ポートフォリオ>

当期期初は、米国株式に代えて、欧州株式のエクスポージャーを引き上げ、当期末まで、かかるスタンスを維持しました。確定利付き債券では、その他の確定利付の持分に代えて、欧州ハイイールド債を引き上げました。さらに、第2四半期の市場のボラティリティの上昇を踏まえ、米国ハイイールド債券を引き下げ、高格付債券を引き上げました。

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。市場は、当期半ばまでは、ボラティリティが概ね低く、若干のプラスを計上しました。8月に、中国の経済費用が予想外に悪化すると、先行き不透明感が強まりました。米連邦準備制度理事会が、7年間の金融緩和政策の後、初の利上げを行うと決定すると、市場は落

ち着きました。一方、中国の株価が下落し、2016年1月に、グローバルな株式市場は、再び調整しました。

<ポートフォリオ>

当期期初は、米国株式に代えて、欧州株式のエクスポージャーを引き上げ、当期末まで、かかるスタンスを維持しました。確定利付き債券では、その他の確定利付の持分に代えて、欧州ハイールド債を引き上げました。さらに、第2四半期の市場のボラティリティの上昇を踏まえ、米国ハイールド債券を引き下げ、高格付債券を引き上げました。

■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）

当期末現在、確定利付債券に対する株式のオーバーウエイトを続けています。株式では、欧州と日本をオーバーウエイトとし、英国をアンダーウエイトとしています。確定利付債券では、高格付債券に代えて、投資適格債券とハイールド債券に対して強気な姿勢を維持しています。ユーロ圏を中心に、金融緩和策が続き、全般的な信用力を支えることが期待されるからです。また、通貨では、ノルウェー・クローネをユーロより高い水準に維持しています。

グロース（米ドル）

当期末現在、確定利付債券に対する株式のオーバーウエイトを続けています。株式では、欧州と日本をオーバーウエイトとし、英国をアンダーウエイトとしています。確定利付債券では、高格付債券に代えて、投資適格債券とハイールド債券に対して強気な姿勢を維持しています。ユーロ圏を中心に、金融緩和策が続き、全般的な信用力を支えることが期待されるからです。また、通貨では、ノルウェー・クローネをユーロより高い水準に維持しています。

（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%	0.06%
グロース（米ドル）	年率 1.800%	0.07%

上限報酬は、ファンド管理（管理会社、管理事務および保管受託銀行の費用を含みます。）、資産運用およびサブ・ファンドの販売についての対価として、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、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、当期のその他の費用の金額を各サブ・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25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、平成28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=110.94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、豪ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建てまた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豪ドル、ユーロ、英ポンドまたは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16会計年度末 (2007年1月31日)	507,040.58	56,251	P - a c c	2,301.09	255,283
第17会計年度末 (2008年1月31日)	443,643.50	49,218	P - a c c	2,430.65	269,656
第18会計年度末 (2009年1月31日)	328,683.22	36,464	P - a c c	2,185.38	242,446
第19会計年度末 (2010年1月31日)	328,712.68	36,467	P - a c c	2,441.97	270,912
第20会計年度末 (2011年1月31日)	327,194.83	36,299	P - a c c	2,597.06	288,118
第21会計年度末 (2012年1月31日)	304,507.03	33,782	P - a c c	2,632.53	292,053
第22会計年度末 (2013年1月31日)	331,008.41	36,722	P - a c c	2,750.29	305,117
第23会計年度末 (2014年1月31日)	486,349.87	53,956	P - a c c	2,836.21	314,649
第24会計年度末 (2015年1月31日)	667,100.05	74,008	P - a c c	3,009.79	333,906
第25会計年度末 (2016年1月31日)	614,299.33	68,150	P - a c c	2,890.07	320,624
2015年2月末日	683,695.18	75,849	P - a c c	3,056.56	339,095
3月末日	689,982.44	76,547	P - a c c	3,056.35	339,071
4月末日	686,735.88	76,186	P - a c c	3,058.74	339,337
5月末日	693,397.03	76,925	P - a c c	3,060.63	339,546
6月末日	685,276.94	76,025	P - a c c	3,007.60	333,663
7月末日	690,887.13	76,647	P - a c c	3,034.25	336,620
8月末日	667,038.02	74,001	P - a c c	2,944.77	326,693
9月末日	653,732.26	72,525	P - a c c	2,905.27	322,311
10月末日	667,834.40	74,090	P - a c c	2,991.89	331,920

	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
11月末日	652,894.26	72,432	P - a c c	2,987.57	331,441
12月末日	629,957.00	69,887	P - a c c	2,939.27	326,083
2016年1月末日	614,299.33	68,150	P - a c c	2,890.07	320,624

(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16会計年度末 (2007年1月31日)	191,568.08	21,253	P - a c c	2,624.10	291,118
第17会計年度末 (2008年1月31日)	166,336.96	18,453	P - a c c	2,570.79	285,203
第18会計年度末 (2009年1月31日)	93,081.87	10,327	P - a c c	1,772.78	196,672
第19会計年度末 (2010年1月31日)	92,098.32	10,217	P - a c c	2,232.68	247,694
第20会計年度末 (2011年1月31日)	90,954.74	10,091	P - a c c	2,512.85	278,776
第21会計年度末 (2012年1月31日)	77,753.16	8,626	P - a c c	2,470.40	274,066
第22会計年度末 (2013年1月31日)	76,194.02	8,453	P - a c c	2,694.22	298,897
第23会計年度末 (2014年1月31日)	88,626.96	9,832	P - a c c	2,941.65	326,347
第24会計年度末 (2015年1月31日)	109,110.27	12,105	P - a c c	3,174.82	352,215
第25会計年度末 (2016年1月31日)	124,535.28	13,816	P - a c c	2,986.89	331,366
2015年2月末日	116,023.62	12,872	P - a c c	3,294.06	365,443
3月末日	124,884.38	13,855	P - a c c	3,279.64	363,843
4月末日	124,499.29	13,812	P - a c c	3,304.95	366,651
5月末日	124,707.61	13,835	P - a c c	3,325.28	368,907
6月末日	123,189.18	13,667	P - a c c	3,252.61	360,845
7月末日	125,313.33	13,902	P - a c c	3,288.16	364,788
8月末日	118,030.70	13,094	P - a c c	3,111.56	345,196
9月末日	115,331.70	12,795	P - a c c	3,025.51	335,650
10月末日	122,911.23	13,636	P - a c c	3,197.78	354,762
11月末日	121,456.94	13,474	P - a c c	3,199.49	354,951
12月末日	117,513.26	13,037	P - a c c	3,122.56	346,417
2016年1月末日	124,535.28	13,816	P - a c c	2,986.89	331,366

(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16会計年度	P - a c c	9,652.809 (0)	82,445.351 (0)	193,283.491 (0)
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)

(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。

(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16会計年度	P - a c c	3,245.813 (0)	21,771.995 (0)	73,003.473 (0)
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)

(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、日本語はイーロド（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、平成28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=123.65円、1米ドル=110.94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、2016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、2016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、2016年5月27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 2016 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 2016, 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, 27 May 2016

ERNST & YOUNG
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

N. Faber

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilinhaber 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 2016, 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

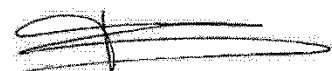
Nach unserer Beurteilung vermittelt der Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des UBS (Lux) Strategy Fund und seiner jeweiligen Subfonds per 31. Januar 2016 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, 27. Mai 2016

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
	2016年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	7,899,257,623.05	976,743,205
投資有価証券、未実現評価（損）益	574,085,239.12	70,985,640
投資有価証券合計（注1）	8,473,342,862.17	1,047,728,845
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	140,710,559.08	17,398,861
その他の流動資産（委託証拠金）	42,239,937.37	5,222,968
有価証券売却未収金（注1）	22,012,379.01	2,721,831
発行受益証券未収金	14,269,753.58	1,764,455
有価証券に係る未収利息	31,441,609.73	3,887,755
流動資産に係る未収利息	4,194.88	519
未収分配金	672,783.47	83,190
その他の未収金	13,971.39	1,728
金融先物に係る未実現（損）益（注1）	(6,465,053.95)	(799,404)
為替予約契約に係る未実現（損）益（注1）	(30,270,804.29)	(3,742,985)
スワップに係る未実現（損）益（注1）	43,613.42	5,393
資産合計	8,688,015,805.86	1,074,273,154
負債		
当座借越	(133,628.79)	(16,523)
当座借越に係る未払利息	(3,893.38)	(481)
有価証券購入未払金（注1）	(24,323,534.47)	(3,007,605)
買戻受益証券未払金	(14,899,853.55)	(1,842,367)
報酬引当金（注2）	(4,910,553.72)	(607,190)
年次税引当金（注3）	(190,214.05)	(23,520)
その他の手数料および報酬引当金（注2）	(190,115.99)	(23,508)
引当金合計	(5,290,883.76)	(654,218)
負債合計	(44,651,793.95)	(5,521,194)
期末現在純資産額	8,643,364,011.91	1,068,751,960

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2015年2月1日 至2016年1月31日	
収益		
流動資産に係る利息	136,002.16	16,817
有価証券に係る利息	85,241,026.04	10,540,053
分配金	32,537,242.61	4,023,230
スワップに係る受取利息 (注1)	11,190,407.76	1,383,694
貸付有価証券に係る収益 (注12)	2,632,630.00	325,525
その他の収益 (注4)	1,463,210.66	180,926
収益合計	133,200,519.23	16,470,244
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(2,259,691.97)	(279,411)
報酬 (注2)	(137,702,048.23)	(17,026,858)
年次税 (注3)	(2,466,062.84)	(304,929)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(1,053,051.93)	(130,210)
その他の手数料および報酬 (注2)	(572,112.42)	(70,742)
現金および当座借越に係る利息	(408,383.64)	(50,497)
費用合計	(144,461,351.03)	(17,862,646)
投資に係る純 (損) 益	(11,260,831.80)	(1,392,402)
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	90,016,811.89	11,130,579
金融先物に係る実現 (損) 益	12,943,197.58	1,600,426
為替予約契約に係る実現 (損) 益	(242,290,046.90)	(29,959,164)
スワップに係る実現 (損) 益	5,597,364.46	692,114
外国為替に係る実現 (損) 益	(26,205,495.50)	(3,240,310)
実現 (損) 益合計	(159,938,168.47)	(19,776,355)
当期実現純 (損) 益	(171,199,000.27)	(21,168,756)
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	(123,767,419.37)	(15,303,841)
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	(13,710,278.11)	(1,695,276)
為替予約契約に係る未実現評価 (損) 益	(18,316,571.35)	(2,264,844)
スワップに係る未実現評価 (損) 益	(15,186,677.24)	(1,877,833)
未実現評価 (損) 益の変動合計	(170,980,946.07)	(21,141,794)
運用の結果による純資産の純増 (減)	(342,179,946.34)	(42,310,550)

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (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	2016年1月31日	2015年1月31日	2014年1月31日
純資産額 (米ドル)		614,299,334.76	667,100,051.62	486,349,874.30
クラスK-1-a-c-c	LU0939686977			
発行済受益証券口数		7,2000	7,5000	1,4000
1口当たり純資産価格 (米ドル)		5,241,674.79	5,429,461.30	5,089,078.64
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		5,241,674.79	5,429,461.30	5,098,238.98
クラスP-a-c-c	LU0033043885			
発行済受益証券口数		172,254,3460	183,829,7130	148,049,6720
1口当たり純資産価格 (米ドル)		2,890.07	3,009.79	2,836.21
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		2,890.07	3,009.79	2,841.32
クラスP-d-i-s-t	LU0033041590			
発行済受益証券口数		52,283,4230	50,946,1820	43,202,3400
1口当たり純資産価格 (米ドル)		1,360.53	1,433.49	1,373.21
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		1,360.53	1,433.49	1,375.68
クラスQ-a-c-c ²	LU0941351925			
発行済受益証券口数		61,362,6390	564,0000	-
1口当たり純資産価格 (米ドル)		103.17	106.70	-
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		103.17	106.70	-
クラスQ-d-i-s-t ³	LU1240800539			
発行済受益証券口数		13,059,3780	-	-
1口当たり純資産価格 (米ドル)		97.14	-	-
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ¹		97.14	-	-

¹ 注記1を参照のこと。

² 初回純資産価格計算日：2014年2月3日

³ 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	2015年／2016年	2014年／2015年	2013年／2014年
クラスK-1-a-c-c	米ドル	-3.5%	6.6%	-
クラスP-a-c-c	米ドル	-4.0%	6.0%	3.3%
クラスP-d-i-s-t	米ドル	-4.0%	6.0%	3.3%
クラスQ-a-c-c	米ドル	-3.3%	-	-
クラスQ-d-i-s-t ¹	米ドル	-	-	-

¹ 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・ファンドーイールド (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	82.27
ユーロ	7.47
英ポンド	2.28
カナダ・ドル	1.97
豪ドル	1.87
日本円	0.61
スイス・フラン	0.25
スウェーデン・クローネ	0.08
香港ドル	0.07
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	0.01
イスラエル・シケル	0.01
合計	<u>96.97</u>

商品別分類 (対純資産割合 (%))

投資証券、オープン・エンド型	53.53
固定利付債券	12.87
固定利付米国中期国債	11.86
固定利付ノート	6.81
無記名株	6.37
固定利付ミディアム・ターム・ノート	5.00
記名株式	0.41
その他の株式	0.08
投資証券、クローズド・エンド型	0.01
優先株式	0.01
預託証券	0.01
参加証券	0.01
合計	<u>96.97</u>

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・ファンドーイールド (米ドル)

純資産計算書

	米ドル	千 円
資産	2016年1月31日現在	
投資有価証券、取得原価	598,643,932.04	66,413,558
投資有価証券、未実現評価 (損) 益	(2,948,381.52)	(327,093)
投資有価証券合計 (注1)	595,695,550.52	66,086,464
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	15,498,532.00	1,719,407
その他の流動資産 (委託証拠金)	2,082,048.02	230,982
発行受益証券未収金	829,284.12	92,001
有価証券に係る未収利息	1,683,463.20	186,763
流動資産に係る未収利息	146.45	16
未収分配金	32,318.31	3,585
その他の未収金	1,272.84	141
金融先物に係る未実現 (損) 益 (注1)	(153,750.04)	(17,057)
為替予約契約に係る未実現 (損) 益 (注1)	779,236.98	86,449
スワップに係る未実現 (損) 益 (注1)	1,156.64	128
資産合計	616,449,259.04	68,388,881
負債		
当座借越に係る未払利息	(1.02)	(0)
買戻受益証券未払金	(1,795,922.33)	(199,240)
報酬引当金 (注2)	(326,930.29)	(36,270)
年次税引当金 (注3)	(12,176.26)	(1,351)
その他の手数料および報酬引当金 (注2)	(14,894.38)	(1,652)
引当金合計	(354,000.93)	(39,273)
負債合計	(2,149,924.28)	(238,513)
期末現在純資産額	614,299,334.76	68,150,368

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2015年2月1日	至2016年1月31日
収益		
流動資産に係る利息	10,271.49	1,140
有価証券に係る利息	6,186,626.93	686,344
分配金	1,505,803.85	167,054
スワップに係る受取利息 (注1)	722,808.94	80,188
貸付有価証券に係る収益 (注12)	189,247.09	20,995
その他の収益 (注4)	54,520.55	6,049
収益合計	8,669,278.85	961,770
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(149,012.23)	(16,531)
報酬 (注2)	(9,373,239.67)	(1,039,867)
年次税 (注3)	(158,604.70)	(17,596)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(75,698.83)	(8,398)
その他の手数料および報酬 (注2)	(38,846.08)	(4,310)
現金および当座借越に係る利息	(8,377.81)	(929)
費用合計	(9,803,779.32)	(1,087,631)
投資に係る純 (損) 益	(1,134,500.47)	(125,861)
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	(4,229,234.61)	(469,191)
金融先物に係る実現 (損) 益	57,567.18	6,387
為替予約契約に係る実現 (損) 益	12,512,968.51	1,388,189
スワップに係る実現 (損) 益	289,144.94	32,078
外国為替に係る実現 (損) 益	969,808.40	107,591
実現 (損) 益合計	9,600,254.42	1,065,052
当期実現純 (損) 益	8,465,753.95	939,191
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	(28,095,006.06)	(3,116,860)
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	(752,601.71)	(83,494)
為替予約契約に係る未実現評価 (損) 益	(4,947,875.13)	(548,917)
スワップに係る未実現評価 (損) 益	(986,078.63)	(109,396)
未実現評価 (損) 益の変動合計	(34,781,561.53)	(3,858,666)
運用の結果による純資産の純増 (減)	(26,315,807.58)	(2,919,476)

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・ファンドーイールド (米ドル)

純資産変動計算書

	米ドル	千 円
	自2015年2月1日	至2016年1月31日
期首現在純資産額	667,100,051.62	74,008,080
受益証券発行	138,467,657.31	15,361,602
受益証券買戻し	(164,046,072.96)	(18,199,271)
受益証券発行 (買戻し) 純額合計	(25,578,415.65)	(2,837,669)
支払分配金	(906,493.63)	(100,566)
純投資 (損) 益	(1,134,500.47)	(125,861)
実現 (損) 益合計	9,600,254.42	1,065,052
未実現評価 (損) 益の変動合計	(34,781,561.53)	(3,858,666)
運用の結果による純資産の純増 (減)	(26,315,807.58)	(2,919,476)
期末現在純資産額	614,299,334.76	68,150,368

発行済受益証券口数の変動

	自2015年2月1日	至2016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		7.5000
発行受益証券口数		1.5000
買戻受益証券口数		(1.8000)
期末現在発行済受益証券口数		7.2000
クラス		P - a c c
期首現在発行済受益証券口数		183,829.7130
発行受益証券口数		34,060.3650
買戻受益証券口数		(45,635.7320)
期末現在発行済受益証券口数		172,254.3460
クラス		P - d i s t
期首現在発行済受益証券口数		50,946.1820
発行受益証券口数		13,941.5180
買戻受益証券口数		(12,604.2770)
期末現在発行済受益証券口数		52,283.4230
クラス		Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数		564.0000
発行受益証券口数		60,918.6390
買戻受益証券口数		(120.0000)
期末現在発行済受益証券口数		61,362.6390
クラス		Q - d i s t
期首現在発行済受益証券口数		0.0000
発行受益証券口数		13,059.3780
買戻受益証券口数		0.0000
期末現在発行済受益証券口数		13,059.3780

年間分配金

UBS (Lux) ストラテジー・ファンド ーイールド (米ドル) クラス P - d i s t	権利落ち日 2015年4月1日	支払日 2015年4月8日	通貨 米ドル	1口当たり金額 16.88	円 1,873
------------------------------------------------------	--------------------	------------------	-----------	------------------	------------

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・ファンドーイールド (米ドル)

2016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/為替予約契約/ 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	589.00	7 749.30	0.00
AUD	AMCOR LIMITED NPV	1 519.00	14 290.38	0.00
AUD	AMP LIMITED NPV (POST RECON)	1 914.00	7 270.27	0.00
AUD	APA GROUP NPV	3 345.00	20 064.41	0.01
AUD	ASX LTD NPV	212.00	6 350.73	0.00
AUD	AURIZON HOLDINGS NPV	3 049.00	7 958.26	0.00
AUD	AUST & NZ BANK GRP NPV	4 257.00	72 810.55	0.01
AUD	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	868.00	6 594.14	0.00
AUD	BHP BILLITON LTD NPV	4 869.00	52 866.74	0.01
AUD	BK OF QUEENSLAND NPV	1 338.00	12 388.82	0.00
AUD	BRAMBLES LTD NPV	1 927.00	15 170.90	0.00
AUD	CALTEX AUSTRALIA NPV	294.00	7 725.75	0.00
AUD	CIMIC GROUP LTD NPV	131.00	2 230.39	0.00
AUD	CMNWLTH BK OF AUST NPV	2 548.00	141 789.13	0.03
AUD	COCA-COLA AMATIL NPV	651.00	3 872.68	0.00
AUD	COCHLEAR LTD NPV	74.00	4 908.29	0.00
AUD	COMPUTERSHARE LTD NPV (POST REC)	571.00	4 200.53	0.00
AUD	CROWN RESORTS LTD NPV	661.00	5 736.94	0.00
AUD	CSL NPV	841.00	61 867.66	0.01
AUD	FORTESCUE METALS G NPV	1 274.00	1 559.01	0.00
AUD	ILUKA RESOURCES NPV	902.00	3 464.50	0.00
AUD	INCITEC PIVOT NPV	1 803.00	3 953.59	0.00
AUD	INSURANCE AUST GRP NPV	2 733.00	10 187.90	0.00
AUD	LEND LEASE GROUP NPV	845.00	7 764.26	0.00
AUD	MACQUARIE GP LTD NPV	596.00	30 176.74	0.01
AUD	NATL AUSTRALIA BK NPV	3 955.00	77 380.77	0.01
AUD	NEWCREST MINING NPV	565.00	5 147.53	0.00
AUD	ORICA LIMITED NPV	550.00	5 532.18	0.00
AUD	ORIGIN ENERGY NPV	3 346.00	9 703.85	0.00
AUD	QANTAS AIRWAYS NPV	1 838.00	5 044.42	0.00
AUD	QBE INS GROUP NPV	1 536.00	11 821.01	0.00
AUD	RAMSAY HEALTH CARE NPV	252.00	10 798.52	0.00
AUD	RIO TINTO LIMITED NPV	780.00	21 589.31	0.01
AUD	SANTOS LIMITED NPV	3 195.00	7 141.55	0.00
AUD	SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	8 430.00	25 938.88	0.01
AUD	SEEK LIMITED NPV	752.00	7 702.30	0.00
AUD	SONIC HEALTHCARE NPV	516.00	6 715.86	0.00
AUD	SOUTH32 LTD NPV	4 869.00	3 357.99	0.00
GBP	SOUTH32 LTD NPV	3 072.00	2 102.56	0.00
AUD	SUNCORP GROUP	1 571.00	12 901.58	0.00
AUD	SYDNEY AIRPORT NPV (STAPLED SECURITY)	304.00	1 414.93	0.00
AUD	TELSTRA CORP NPV	3 888.00	15 483.50	0.00
AUD	TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	1 879.00	14 327.81	0.00
AUD	WESFARMERS LTD NPV	1 631.00	48 651.02	0.01
AUD	WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	3 970.00	27 800.98	0.01
AUD	WESTPAC BKG CORP NPV	4 974.00	108 541.37	0.02
AUD	WOODSIDE PETROLEUM NPV	1 210.00	23 922.23	0.01
AUD	WOOLWORTHS LTD NPV	2 089.00	35 877.44	0.01
オーストラリア合計			1 001 849.46	0.17

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV(BR)	147.00	6 799.87	0.00
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	551.00	15 936.68	0.01
EUR OMV AG NPV(VAR)	186.00	4 760.83	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	179.00	4 694.97	0.00
オーストリア合計		32 192.35	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	267.00	10 789.25	0.00
EUR ANHEUSER-BUSCH INB NPV	1 239.00	155 315.46	0.03
EUR COLRUYT SA NPV	109.00	5 801.64	0.00
EUR DELHAIZE GROUP NPV	141.00	14 713.76	0.00
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	87.00	6 577.45	0.00
EUR KBC GROUP NV NPV	407.00	23 248.42	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	196.00	6 733.60	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	68.00	5 598.66	0.00
EUR UCB NPV	138.00	11 739.77	0.00
EUR UMICORE NPV	131.00	4 790.39	0.00
ベルギー合計		245 308.40	0.04
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USD0.01	147.00	9 929.85	0.00
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125	200.00	10 782.00	0.00
USD EVEREST RE GROUP COM USD0.01	100.00	17 894.00	0.01
USD MARVELL TECH GROUP COM USD0.002	500.00	4 425.00	0.00
USD PARTNERRE LTD COM USD1	100.00	14 040.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	100.00	11 265.00	0.00
バミューダ合計		68 335.85	0.01
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	542.00	15 991.36	0.00
CAD AGRUM INC COM NPV	202.00	17 558.10	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	384.00	16 639.77	0.00
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	300.00	6 988.10	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	783.00	10 477.09	0.00
CAD ATCO LTD CL 1 NON VTG	300.00	8 277.85	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	938.00	50 137.76	0.01
USD BANK MONTREAL QUE COM	50.00	2 676.00	0.00
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	1 809.00	73 774.03	0.01
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	1 188.00	11 759.70	0.00
CAD BCE INC COM NEW	301.00	12 069.95	0.00
CAD BLACKBERRY LTD NPV	400.00	2 839.58	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS' B' SUB-VTG NPV	1 500.00	1 044.59	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET MGMT INC CL A LTD VT SH	1 464.00	43 995.42	0.01
CAD CAE INC COM	460.00	4 782.23	0.00
CAD CAMECO CORP COM	910.00	10 999.54	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	200.00	23 933.20	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	1 553.00	33 096.09	0.01
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	1 242.00	67 031.37	0.01
CAD CANADIAN OIL SANDS COM NPV	1 023.00	6 826.06	0.00
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	152.00	12 329.58	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	403.00	10 346.70	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	574.00	37 215.68	0.01
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	1 115.00	13 675.54	0.00
CAD CGI GROUP INC 'A' SUB-VTG NPV	232.00	9 898.23	0.00
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	271.00	5 958.25	0.00
CAD CRESCENT POINT EN COM NPV	458.00	5 054.35	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	200.00	10 683.25	0.00
CAD ELDORADO GOLD CORP NEW COM	500.00	1 129.86	0.00
CAD EMPIRE LTD CL A	630.00	11 854.61	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
CAD	ENBRIDGE INC COM	1 197.00	41 389.96	0.01
CAD	ENCANA CORP COM NPV	1 332.00	5 821.14	0.00
CAD	FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG	37.00	18 964.98	0.01
CAD	FINNING INTL INC COM NEW	369.00	4 677.89	0.00
CAD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	1 284.00	2 764.63	0.00
CAD	FORTIS INC COM	201.00	5 814.68	0.00
CAD	FRANCO NEVADA CORP COM NPV	209.00	9 212.49	0.00
CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	400.00	10 050.81	0.00
CAD	GOLDCORP INC NEW COM	1 520.00	17 238.73	0.01
CAD	GREAT WEST LIFE CO INC COM	293.00	7 228.97	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	765.00	7 577.97	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	300.00	9 156.16	0.00
CAD	INDUSTRIAL ALLNCE INS FIN SRVC COM	100.00	2 955.41	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	140.00	8 356.72	0.00
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NO PAR	900.00	1 477.35	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	217.00	10 144.91	0.00
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	116.00	7 200.12	0.00
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	400.00	13 834.07	0.00
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	2 202.00	30 465.76	0.01
CAD	MEG ENERGY CORP COM NPV	482.00	1 989.99	0.00
CAD	METHANEX CORP COM	200.00	5 306.80	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	300.00	8 827.85	0.00
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	406.00	11 531.59	0.00
CAD	ONEX CORP SUB VTG	262.00	15 588.74	0.00
CAD	OPEN TEXT CORP COM	266.00	12 955.51	0.00
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	502.00	11 358.10	0.00
CAD	PEYTO EXPLORATION COM NPV	300.00	6 423.17	0.00
CAD	POTASH CORP SASK INC COM	1 289.00	20 920.78	0.01
CAD	POWER CORP CDA COM	438.00	9 247.10	0.00
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	296.00	6 800.27	0.00
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	160.00	5 372.80	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS' B' COM CAD1.62478	715.00	24 372.75	0.01
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	2 071.00	106 769.27	0.02
CAD	SAPUTO INC COM	400.00	9 777.94	0.00
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	561.00	9 667.26	0.00
CAD	SILVER WHEATON CORP COM	912.00	10 699.68	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	200.00	5 691.95	0.00
CAD	SUN LIFE FINL INC COM	901.00	25 725.48	0.01
CAD	SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	1 981.00	46 707.82	0.01
CAD	TECK RESOURCES LTD CLASS' B' SUB-VTG COM NPV	1 002.00	3 723.90	0.00
CAD	TORONTO-DOMINION COM NPV	2 676.00	101 069.04	0.02
CAD	TRANSCANADA CORP COM NPV	1 087.00	37 578.65	0.01
CAD	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV	432.00	39 600.64	0.01
CAD	VERMILION ENERGY I COM NPV	239.00	6 362.01	0.00
CAD	YAMANA GOLD INC COM	700.00	1 198.79	0.00
カナダ合計			1 298 644.47	0.22
デンマーク				
DKK	A. P. MOELLER-MAERSK SER' B' DKK1000	15.00	19 182.67	0.00
DKK	CARLSBERG SER' B' DKK20	228.00	19 107.86	0.00
DKK	COLOPLAST DKK1 B	150.00	12 233.84	0.00
DKK	DANSKE BANK A/S DKK10	1 292.00	34 600.20	0.01
DKK	DSV DKK1	325.00	12 586.54	0.00
DKK	NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER' B'	2 907.00	160 126.62	0.03
DKK	NOVOZYMES A/S SER' B' DKK2 (POST CONS)	229.00	9 496.22	0.00
DKK	PANDORA A/S DKK1	209.00	27 788.48	0.01
DKK	TDC A/S DKK1	1 120.00	4 775.98	0.00
デンマーク合計			299 898.41	0.05
フィンランド				
EUR	ELISA CORPORATION EURO.50	137.00	4 937.90	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	957.00	14 963.29	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	630.00	27 519.89	0.01
EUR METSO OYJ EUR1.70	137.00	2 816.58	0.00
EUR NOKIA OYJ EURO.06	3 709.00	26 487.93	0.01
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	153.00	5 165.28	0.00
EUR SAMPO OYJ SER' A' NPV	787.00	37 809.86	0.01
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER' R'	673.00	5 443.45	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	507.00	8 201.56	0.00
EUR WARTSILA OYJ ABP SER' B' EUR3.50	182.00	8 135.30	0.00
フィンランド合計		141 481.04	0.03
フランス			
EUR ACCOR EUR3	167.00	6 324.58	0.00
EUR ADP EUR3	118.00	13 323.61	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	521.00	53 680.09	0.01
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	875.00	54 743.61	0.01
EUR ALCATEL-LUCENT EURO.05	3 410.00	13 467.74	0.00
EUR ALSTOM EUR7.00	394.00	10 536.69	0.00
EUR ARKEMA EUR10	88.00	5 480.89	0.00
EUR ATOS SE EUR1	111.00	8 737.82	0.00
EUR AXA EUR2.29	2 458.00	60 560.89	0.01
EUR BNP PARIBAS EUR2	1 419.00	67 136.64	0.01
EUR BOUYGUES EUR1	151.00	5 892.65	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	295.00	5 605.24	0.00
EUR CAP GEMINI EUR8	154.00	14 010.73	0.00
EUR CARREFOUR EUR2.50	911.00	25 856.16	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	77.00	3 476.02	0.00
EUR CHRISTIAN DIOR EUR2	45.00	7 586.25	0.00
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	494.00	20 277.50	0.00
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	888.00	8 836.07	0.00
EUR DANONE EURO.25	905.00	62 133.75	0.01
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	152.00	11 708.73	0.00
EUR EDENRED EUR2	388.00	7 267.35	0.00
EUR EDF EURO.5	167.00	2 175.66	0.00
EUR ENGIE EUR1	1 822.00	28 971.12	0.01
EUR ESSILOR INTL EURO.18	303.00	37 490.92	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	156.00	5 024.33	0.00
EUR HERMES INTL NPV	17.00	5 767.71	0.00
EUR ILIAD NPV	38.00	9 500.29	0.00
EUR KERING EUR4	66.00	11 072.94	0.00
EUR KLEPIERRE EUR1.40	325.00	14 031.48	0.00
EUR L' OREAL EURO.20	318.00	54 211.68	0.01
EUR LEGRAND SA EUR4	494.00	27 111.50	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	345.00	55 324.13	0.01
EUR NATIXIS EUR1.6	1 625.00	7 938.87	0.00
EUR ORANGE EUR4	2 827.00	49 952.74	0.01
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	334.00	39 013.64	0.01
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	175.00	10 465.86	0.00
EUR RENAULT SA EUR3.81	327.00	27 574.00	0.01
EUR REXEL EUR5	615.00	7 256.85	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	441.00	28 468.80	0.01
EUR SANOFI EUR2	1 699.00	140 729.75	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	800.00	42 511.58	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	1 049.00	39 931.78	0.01
EUR SODEXO EUR4	91.00	8 877.74	0.00
EUR SUEZ ENVIRONNEMENT EUR4	336.00	6 207.94	0.00
EUR TECHNIP NPV	98.00	4 542.79	0.00
EUR THALES EUR3	147.00	11 161.33	0.00
EUR TOTAL EUR2.5	3 174.00	140 536.74	0.02
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	175.00	43 931.23	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR VALEO EUR3	120.00	15 510.10	0.00
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	370.00	8 885.96	0.00
EUR VINCI EUR2.50	690.00	46 603.68	0.01
EUR VIVENDI SA EUR5.50	1 793.00	38 860.52	0.01
EUR WENDEL EUR4	64.00	6 392.58	0.00
EUR ZODIAC AEROSPACE	380.00	7 923.42	0.00
フランス合計		1 450 602.67	0.24
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	516.00	42 802.18	0.01
EUR BEIERSDORF AG NPV	117.00	10 771.12	0.00
EUR COMMERZBANK AG NPV	915.00	7 392.90	0.00
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	165.00	34 386.47	0.01
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	420.00	37 115.83	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	477.00	31 453.44	0.01
EUR GEA GROUP AG NPV	208.00	8 693.20	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	157.00	11 482.31	0.00
EUR HENKEL AG & CO KGAA	100.00	9 181.20	0.00
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	66.00	5 239.03	0.00
EUR LANXESS AG NPV	129.00	5 275.60	0.00
EUR LINDE AG NPV	263.00	35 458.56	0.01
EUR MAN SE ORD NPV	122.00	12 309.94	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	160.00	13 864.09	0.00
EUR METRO AG ORD NPV	125.00	3 510.58	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	828.00	11 530.71	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	1 395.00	110 477.36	0.02
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	862.00	13 277.37	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	62.00	8 090.71	0.00
ドイツ合計		412 312.60	0.07
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	17 800.00	98 001.37	0.02
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	3 000.00	7 901.99	0.00
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	4 736.00	58 630.66	0.01
HKD CK PROPERTY LTD HKD1	4 736.00	25 344.75	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	3 500.00	29 275.91	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	4 000.00	12 386.21	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	1 700.00	28 068.12	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 219.00	6 578.31	0.00
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	1 437.00	31 443.64	0.01
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	8 978.00	15 711.51	0.00
HKD LI & FUNG HKD0.0125	6 000.00	3 422.91	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	367.00	14 643.30	0.00
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	7 319.00	5 924.53	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	3 000.00	27 252.23	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	4 721.00	5 993.11	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP HKD0.50	2 054.00	22 115.96	0.00
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	2 000.00	19 273.15	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2 500.00	14 246.07	0.00
HKD WHARF (HLDGS) HKD1	2 000.00	9 251.11	0.00
HKD WHEELOK & COMPANY HKD0.50	2 000.00	7 593.62	0.00
香港合計		443 058.46	0.08
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	922.00	97 307.88	0.02
EUR CRH ORD EURO.32(DUBLIN LISTING)	639.00	16 787.92	0.00
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	677.00	34 195.27	0.01
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	900.00	15 192.14	0.00
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	468.00	24 087.96	0.01
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	356.00	16 774.72	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	400.00	11 620.00	0.00
GBP SHIRE ORD GBP0.05	794.00	44 037.90	0.01
USD XL GROUP PLC USD0.01	300.00	10 878.00	0.00
アイルランド合計		270 881.79	0.05
イスラエル			
ILS BANK HAPOALIM B.M. ILS1	2 062.00	9 513.35	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	2 295.00	7 536.57	0.00
ILS ICL-ISRAEL CHEM ILS1	1 534.00	6 138.87	0.00
ILS TEVA PHARMA IND ILS0.1 (POST CONS)	633.00	38 325.81	0.01
イスラエル合計		61 514.60	0.01
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	1 283.00	19 144.24	0.00
EUR ATLANTIA SPA EUR1	909.00	23 684.69	0.01
EUR BCA MPS NPV	1 683.00	1 207.38	0.00
EUR ENEL EUR1	10 231.00	41 713.47	0.01
EUR ENEL GREEN POWER S EURO.2	5 198.00	10 124.09	0.00
EUR ENI SPA EUR1	3 513.00	50 480.49	0.01
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	49.00	1 940.55	0.00
EUR FINMECCANICA SPA EUR4.40	817.00	9 662.50	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	17 722.00	50 203.01	0.01
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	178.00	11 084.41	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	646.00	5 148.17	0.00
EUR PRYSMIAN SPA EURO.10	349.00	7 125.98	0.00
EUR SAIPEM EUR1	232.00	143.22	0.00
EUR SNAM EUR1	1 540.00	8 606.73	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	6 634.00	7 336.25	0.00
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 570.00	8 381.97	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV	6 524.00	25 046.37	0.01
EUR UNIONE DI BANCHE I EUR2.50	987.00	4 594.46	0.00
イタリア合計		285 627.98	0.05
日本			
JPY イオン	600.00	7 914.75	0.00
JPY イオンフィナンシャルサービス	300.00	6 779.83	0.00
JPY イオンモール	220.00	3 310.95	0.00
JPY アイシン精機	300.00	12 513.94	0.00
JPY 味の素	1 000.00	23 429.56	0.01
JPY 旭硝子	1 000.00	6 005.04	0.00
JPY アサヒグループホールディングス	500.00	15 846.86	0.00
JPY 旭化成	3 000.00	19 174.82	0.00
JPY アステラス製薬	4 000.00	54 516.17	0.01
JPY バンダイナムコホールディングス	400.00	8 986.91	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	2 762.98	0.00
JPY 横浜銀行	1 000.00	5 246.77	0.00
JPY ブリヂストン	1 100.00	39 397.02	0.01
JPY ブラザー工業	400.00	3 961.51	0.00
JPY キヤノン	1 700.00	46 928.51	0.01
JPY カシオ計算機	500.00	9 532.07	0.00
JPY 東海旅客鉄道	200.00	36 517.57	0.01
JPY 千葉銀行	2 000.00	12 175.28	0.00
JPY 中部電力	500.00	6 333.37	0.00
JPY 中外製薬	400.00	12 076.16	0.00
JPY 中国電力	600.00	7 904.84	0.00
JPY クレディセゾン	200.00	3 685.62	0.00
JPY 大日本印刷	1 000.00	9 201.67	0.00
JPY 第一生命保険	900.00	12 143.48	0.00
JPY ダイハツ工業	500.00	7 681.82	0.00
JPY 第一三共	1 400.00	28 696.16	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
JPY	ダイキン工業	200.00	13 232.56	0.00
JPY	大東建託	100.00	12 580.02	0.00
JPY	大和ハウス工業	1 000.00	27 753.69	0.01
JPY	大和証券グループ本社	2 000.00	12 398.30	0.00
JPY	デンソー	800.00	34 097.39	0.01
JPY	電通	200.00	10 424.15	0.00
JPY	東日本旅客鉄道	600.00	54 466.61	0.01
JPY	エーザイ	300.00	17 816.88	0.00
JPY	ファナック	300.00	39 177.30	0.01
JPY	ファーストリテイリング	100.00	31 743.28	0.01
JPY	富士フイルムホールディングス	700.00	26 585.72	0.01
JPY	富士重工業	700.00	28 077.48	0.01
JPY	富士通	2 000.00	8 215.42	0.00
JPY	阪急阪神ホールディングス	3 000.00	18 461.16	0.00
JPY	日野自動車	1 000.00	11 134.51	0.00
JPY	ヒロセ電機	105.00	11 708.59	0.00
JPY	久光製薬	100.00	4 435.63	0.00
JPY	日立化成	300.00	5 166.65	0.00
JPY	日立建機	200.00	2 861.27	0.00
JPY	日立製作所	7 000.00	33 905.75	0.01
JPY	北陸電力	200.00	2 793.54	0.00
JPY	本田技研工業	2 600.00	71 751.54	0.01
JPY	HOYA	900.00	34 196.51	0.01
JPY	ヒューリック	600.00	5 084.88	0.00
JPY	IHI	3 000.00	6 294.14	0.00
JPY	国際石油開発帝石	1 100.00	9 572.13	0.00
JPY	三越伊勢丹	800.00	9 997.93	0.00
JPY	いすゞ自動車	500.00	4 964.28	0.00
JPY	伊藤忠商事	1 300.00	15 006.40	0.00
JPY	J. フロント リテイリング	1 000.00	13 587.74	0.00
JPY	日本取引所グループ	800.00	11 141.12	0.00
JPY	ジャパンリアルエステイト投資法人	2.00	10 539.79	0.00
JPY	日本リテールファンド投資法人	4.00	8 415.31	0.00
JPY	日本たばこ産業	1 900.00	73 149.96	0.01
JPY	ジェイ エフ イー ホールディングス	1 000.00	13 265.60	0.00
JPY	JSR	300.00	4 282.00	0.00
JPY	ジェイテクト	500.00	7 875.93	0.00
JPY	J Xホールディングス	3 600.00	13 559.66	0.00
JPY	関西電力	1 800.00	19 261.55	0.00
JPY	関西ペイント	1 000.00	13 736.42	0.00
JPY	花王	700.00	36 976.00	0.01
JPY	KDDI	2 700.00	67 084.62	0.01
JPY	京浜急行電鉄	1 000.00	8 185.68	0.00
JPY	京王電鉄	1 000.00	8 763.89	0.00
JPY	キーエンス	100.00	46 190.06	0.01
JPY	麒麟ホールディングス	1 000.00	13 996.61	0.00
JPY	コマツ	1 700.00	24 861.44	0.01
JPY	コナミホールディングス	200.00	4 569.44	0.00
JPY	コニカミノルタ	500.00	4 134.14	0.00
JPY	クボタ	2 000.00	28 893.57	0.01
JPY	クラレ	800.00	9 515.55	0.00
JPY	京セラ	400.00	16 394.50	0.00
JPY	九州電力	600.00	6 378.39	0.00
JPY	ローソン	100.00	7 797.46	0.00
JPY	LIXILグループ	300.00	6 244.58	0.00
JPY	マキタ	100.00	5 525.96	0.00
JPY	丸紅	2 000.00	9 426.34	0.00
JPY	マツダ	1 000.00	17 746.67	0.00
JPY	メディカルホールディングス	400.00	6 393.26	0.00
JPY	明治ホールディングス	400.00	33 007.06	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
JPY	三菱ケミカルホールディングス	2 000.00	10 941.23	0.00
JPY	三菱商事	2 500.00	39 348.70	0.01
JPY	三菱電機	3 000.00	27 245.69	0.01
JPY	三菱地所	2 000.00	39 111.22	0.01
JPY	三菱重工業	5 000.00	19 270.64	0.00
JPY	三菱自動車工業	800.00	6 356.92	0.00
JPY	田辺三菱製薬	600.00	9 713.79	0.00
JPY	三菱UFJフィナンシャル・グループ	16 900.00	85 068.85	0.02
JPY	三菱UFJリース	2 400.00	11 716.02	0.00
JPY	三井物産	1 900.00	21 273.29	0.01
JPY	三井不動産	1 000.00	23 152.85	0.01
JPY	商船三井	1 000.00	1 949.37	0.00
JPY	みずほフィナンシャルグループ	29 000.00	49 297.48	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	26 638.58	0.01
JPY	村田製作所	200.00	22 624.21	0.01
JPY	日本碍子	1 000.00	20 427.04	0.00
JPY	日本特殊陶業	1 000.00	23 128.07	0.01
JPY	日本電産	400.00	26 769.09	0.01
JPY	ニコン	500.00	7 272.95	0.00
JPY	任天堂	200.00	27 514.15	0.01
JPY	日本通運	3 000.00	13 827.28	0.00
JPY	新日鐵住金	620.00	10 887.71	0.00
JPY	日本電信電話	1 400.00	58 143.97	0.01
JPY	日産自動車	4 200.00	40 936.69	0.01
JPY	日清製粉グループ本社	603.00	9 607.95	0.00
JPY	ニトリホールディングス	100.00	7 970.92	0.00
JPY	日東電工	200.00	11 268.33	0.00
JPY	NOK	200.00	4 068.89	0.00
JPY	野村ホールディングス	5 100.00	27 381.99	0.01
JPY	野村不動産ホールディングス	200.00	3 459.30	0.00
JPY	日本精工	1 000.00	10 159.83	0.00
JPY	エス・ティ・ティ・データ	400.00	18 998.06	0.00
JPY	NTTドコモ	2 700.00	56 357.33	0.01
JPY	NTT都市開発	400.00	3 859.08	0.00
JPY	大林組	2 000.00	17 808.62	0.00
JPY	小田急電鉄	1 000.00	10 481.97	0.00
JPY	オリンパス	200.00	7 665.30	0.00
JPY	オムロン	200.00	5 096.44	0.00
JPY	小野薬品工業	100.00	15 834.47	0.00
JPY	オリエンタルランド	400.00	25 186.47	0.01
JPY	オリックス	2 300.00	32 040.23	0.01
JPY	大塚ホールディングス	600.00	19 898.40	0.00
JPY	パナソニック	3 300.00	30 365.51	0.01
JPY	楽天	800.00	8 117.95	0.00
JPY	りそなホールディングス	3 100.00	14 019.33	0.00
JPY	リコー	1 000.00	9 532.07	0.00
JPY	ローム	200.00	8 904.31	0.00
JPY	三協	100.00	3 774.84	0.00
JPY	参天製薬	1 000.00	15 702.31	0.00
JPY	SBIホールディングス	170.00	1 668.19	0.00
JPY	セコム	500.00	34 341.06	0.01
JPY	セガサミーホールディングス	200.00	1 860.16	0.00
JPY	積水化学工業	1 000.00	12 010.08	0.00
JPY	積水ハウス	1 000.00	15 479.29	0.00
JPY	セブン&アイ・ホールディングス	1 300.00	57 040.43	0.01
JPY	四国電力	300.00	4 291.91	0.00
JPY	シマノ	100.00	15 694.05	0.00
JPY	信越化学工業	700.00	35 160.45	0.01
JPY	塩野義製薬	400.00	17 184.16	0.00
JPY	資生堂	500.00	9 251.23	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
JPY 静岡銀行	1 000.00	8 573.91	0.00
JPY 昭和シェル石油	500.00	4 022.63	0.00
JPY SMC	100.00	22 070.79	0.01
JPY ソフトバンク	1 400.00	60 884.65	0.01
JPY 損保ジャパン日本興亜	750.00	21 800.27	0.01
JPY ソニー	1 800.00	37 512.08	0.01
JPY ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 249.49	0.00
JPY スタンレー電気	400.00	8 649.90	0.00
JPY 住友商事	2 300.00	22 569.69	0.01
JPY 住友電気工業	700.00	9 040.19	0.00
JPY 住友金属鉱山	1 000.00	10 382.85	0.00
JPY 三井住友フィナンシャルグループ	2 000.00	65 749.80	0.01
JPY 三井住友トラスト・ホールディングス	3 000.00	9 411.47	0.00
JPY 住友不動産	1 000.00	27 571.97	0.01
JPY 住友ゴム工業	300.00	3 749.23	0.00
JPY サントリー食品インターナショナル	300.00	13 678.60	0.00
JPY スズキ	800.00	24 158.92	0.01
JPY シスメックス	200.00	12 621.32	0.00
JPY T&Dホールディングス	1 500.00	16 819.48	0.00
JPY 武田薬品工業	1 300.00	61 990.67	0.01
JPY TDK	200.00	10 754.55	0.00
JPY テルモ	400.00	12 489.16	0.00
JPY THK	300.00	4 698.30	0.00
JPY 東武鉄道	3 000.00	14 471.56	0.00
JPY 東宝	300.00	7 731.38	0.00
JPY 東北電力	400.00	4 949.41	0.00
JPY 東京海上ホールディングス	1 200.00	42 106.31	0.01
JPY 東京電力	800.00	3 964.81	0.00
JPY 東京エレクトロン	200.00	12 347.09	0.00
JPY 東京ガス	3 000.00	13 619.13	0.00
JPY 東京建物	500.00	5 294.68	0.00
JPY 東京急行電鉄	1 000.00	7 690.08	0.00
JPY 東急不動産ホールディングス	900.00	5 805.97	0.00
JPY 凸版印刷	1 000.00	8 590.43	0.00
JPY 東レ	3 000.00	25 213.73	0.01
JPY 東芝	3 000.00	4 931.24	0.00
JPY TOTO	500.00	15 941.85	0.00
JPY 東洋製罐グループホールディングス	300.00	5 332.67	0.00
JPY 豊田自動織機	200.00	9 829.43	0.00
JPY トヨタ自動車	3 800.00	225 994.30	0.04
JPY 豊田通商	500.00	11 204.72	0.00
JPY トレンドマイクロ	400.00	16 586.13	0.00
JPY ユニ・チャーム	600.00	11 545.04	0.00
JPY ユー・エス・エス	500.00	7 545.53	0.00
JPY 西日本旅客鉄道	300.00	19 179.78	0.00
JPY ヤフー	1 700.00	6 389.13	0.00
JPY ヤクルト本社	200.00	9 052.99	0.00
JPY ヤマダ電機	1 000.00	4 799.07	0.00
JPY ヤマハ	300.00	7 015.24	0.00
JPY ヤマハ発動機	400.00	7 840.42	0.00
JPY ヤマトホールディングス	500.00	10 810.31	0.00
JPY 安川電機	1 000.00	10 886.72	0.00
JPY 横河電機	500.00	5 497.05	0.00
日本合計		3 736 300.49	0.61
ジャージー島			
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	123.00	8 666.20	0.00
ジャージー島合計		8 666.20	0.00
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG' S'	4 400.00	15 151.26	0.01
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	2 000.00	2 145.74	0.00
マカオ合計		17 297.00	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	3 756.00	21 137.81	0.00
EUR AHOLD(KON) NV EURO.01	1 610.00	36 279.24	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	410.00	26 205.84	0.01
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	561.00	51 124.07	0.01
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	755.00	4 685.20	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	494.00	3 423.68	0.00
EUR GEMALTO EUR1	75.00	4 492.67	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	136.00	10 396.77	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	450.00	38 963.54	0.01
EUR KON KPN NV EURO.24	5 572.00	21 457.86	0.00
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.80	198.00	7 777.13	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	176.00	8 478.42	0.00
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	1 690.00	44 793.14	0.01
EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	158.00	8 570.42	0.00
EUR RELX NV EURO.07	1 536.00	25 537.07	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	3 566.00	76 937.82	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	5 923.00	127 538.95	0.02
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	200.00	7 340.00	0.00
EUR TNT EXPRESS NV EURO.08	375.00	3 192.59	0.00
EUR VOPAK(KON) EURO.50	79.00	3 423.98	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	320.00	10 851.66	0.00
オランダ合計		542 607.86	0.09
ニュージーランド			
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	3 098.00	6 734.80	0.00
ニュージーランド合計		6 734.80	0.00
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	951.00	11 354.05	0.00
NOK GJENSIDIGE FORSIKR NOK2	692.00	10 917.99	0.00
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	2 055.00	6 752.95	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	873.00	7 011.89	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	1 633.00	22 153.41	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	1 304.00	21 036.96	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	176.00	6 594.21	0.00
ノルウェー合計		85 821.46	0.02
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	467.00	5 513.01	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	438.00	6 085.36	0.01
ポルトガル合計		11 598.37	0.01
シンガポール			
USD AVAGO TECH LTD NPV	438.00	58 564.98	0.01
SGD CAPITALAND SGD1	6 000.00	12 941.76	0.00
SGD CITY DEVELOPMENTS SGDO.50	1 000.00	4 890.04	0.00
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	2 218.00	21 910.41	0.00
USD FLEXTRONICS INTL USD0.01	900.00	9 432.00	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	3 100.00	10 933.75	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	4 259.00	23 699.35	0.01
SGD SEMBCORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)	2 000.00	3 527.01	0.00
SGD SEMBCORP MARINE SGDO.10	2 000.00	2 185.06	0.00
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 000.00	7 749.60	0.00
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	1 000.00	4 974.36	0.00
SGD SINGAPORE PRESS HD SGDO.20	3 000.00	7 503.69	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV (POST RE-ORG)	11 000.00	27 127.10	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	2 226.00	28 292.24	0.01
シンガポール合計		223 731.35	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
スペイン				
EUR	ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	446.00	6 613.95	0.00
EUR	ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	189.00	4 767.07	0.00
EUR	AMADEUS IT HLDGS EURO.01	388.00	15 750.13	0.00
EUR	BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)	1 596.00	4 281.12	0.00
EUR	BANKIA S.A. EUR1	5 792.00	5 728.25	0.00
EUR	BCO DE SABADELL EURO.125	10 368.00	18 667.91	0.01
EUR	CAIXABANK SA EUR1	3 813.00	11 469.88	0.00
EUR	DISTRIBUIDORA INTL EURO.01	403.00	2 157.22	0.00
EUR	ENAGAS SA EUR1.50	275.00	7 944.95	0.00
EUR	FERROVIAL SA EURO.2	734.00	15 991.71	0.01
EUR	GAS NATURAL SDG EUR1	408.00	7 953.21	0.00
EUR	GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	434.00	8 995.37	0.00
EUR	IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	8 626.00	60 184.11	0.01
EUR	INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	1 570.00	51 278.85	0.01
EUR	INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	1 543.00	11 810.77	0.00
EUR	RED ELECTRICA CORPORACION EUR2	136.00	10 947.14	0.00
EUR	REPSOL SA EUR1	1 654.00	16 987.94	0.01
EUR	TELEFONICA SA EUR1	7 094.00	74 288.93	0.01
スペイン合計			335 818.51	0.06
スウェーデン				
SEK	ALFA LAVAL AB NPV	373.00	6 394.32	0.00
SEK	ASSA ABLOY SER' B' NPV (POST SPLIT)	1 953.00	41 155.59	0.01
SEK	ATLAS COPCO AB SER' A' NPV (POST SPLIT)	576.00	12 279.12	0.00
SEK	ATLAS COPCO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	329.00	6 683.63	0.00
USD	AUTOLIV INC COM	157.00	16 136.46	0.00
SEK	BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	607.00	8 388.33	0.00
SEK	ELECTROLUX AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	335.00	7 266.51	0.00
SEK	ERICSSON SER' B' NPV	4 717.00	41 476.84	0.01
SEK	GETINGE AB SER' B' NPV	273.00	5 988.52	0.00
SEK	HENNES & MAURITZ SER' B' NPV	1 368.00	44 573.93	0.01
SEK	HEXAGON AB SER' B' NPV	306.00	10 134.64	0.00
SEK	INVESTOR AB SER' B' NPV	920.00	30 652.54	0.01
SEK	KINNEVIK INV AB SER' B' NPV	240.00	6 157.47	0.00
SEK	LUNDIN PETROLEUM A NPV	405.00	5 790.47	0.00
SEK	NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	3 968.00	39 749.64	0.01
SEK	SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	1 773.00	14 732.01	0.00
SEK	SECURITAS SER' B' NPV	1 274.00	18 705.25	0.00
SEK	SKAND ENSKILDA BKN SER' A' NPV	2 279.00	21 873.21	0.00
SEK	SKANSKA AB SER' B' NPV	454.00	8 720.03	0.00
SEK	SKF AB SER' B' NPV	827.00	12 556.97	0.00
SEK	SVENSKA CELLULOZA SER' B' NPV	1 011.00	29 817.31	0.01
SEK	SVENSKA HANDELSBKN SER' A' NPV (P/S)	1 818.00	22 748.98	0.01
SEK	SWEDBANK AB SER' A' NPV	1 474.00	30 786.58	0.01
SEK	SWEDISH MATCH NPV	250.00	8 868.86	0.00
SEK	TELE2 AB SHS	347.00	2 871.11	0.00
SEK	TELIASONERA AB NPV	2 951.00	13 879.24	0.00
SEK	VOLVO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	1 652.00	14 940.33	0.00
スウェーデン合計			483 327.89	0.08
スイス				
GBP	GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	15 283.00	19 398.31	0.01
CHF	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR) (POST SUBD)	54.00	3 127.80	0.00
CHF	SIKA AG CHF0.60 (BR)	3.00	10 707.07	0.00
EUR	STMICROELECTRONICS EUR1.04	608.00	3 957.85	0.00
CHF	SWATCH GROUP CHF2.25(BR)	27.00	9 180.50	0.00
CHF	SWISS RE AG CHF0.10	537.00	49 682.92	0.01
USD	WEATHERFORD INTL. COM USD0.001	1 449.00	9 766.26	0.00
GBP	WOLSELEY ORD GBP0.108030303 (POST CON)	286.00	14 049.08	0.00
スイス合計			119 869.79	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
イギリス			
GBP	3I GROUP ORD GBPO.738636	1 212.00	7 598.96 0.00
GBP	ABERDEEN ASSET MGT ORD GBPO.10	1 305.00	4 563.07 0.00
GBP	ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001	258.00	6 492.36 0.00
GBP	AGGREKO ORD GBPO.048329113924	474.00	5 735.31 0.00
GBP	AMEC FOSTER WHEELER ORD GBPO.50	791.00	4 623.90 0.00
GBP	ANGLO AMERICAN USDO.54945	1 954.00	7 690.21 0.00
GBP	ANTOFAGASTA ORD GBPO.05	1 002.00	5 403.92 0.00
USD	AON PLC COM USDO.01 CL A	278.00	24 416.74 0.00
GBP	ARM HLDGS ORD GBPO.0005	1 323.00	18 635.39 0.00
GBP	ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568	399.00	17 828.42 0.00
GBP	ASTRAZENECA ORD USDO.25	1 777.00	113 115.28 0.02
GBP	AVIVA ORD GBPO.25	5 643.00	38 486.09 0.01
GBP	BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	4 641.00	33 969.61 0.01
GBP	BARCLAYS ORD GBPO.25	22 051.00	58 179.58 0.01
GBP	BG GROUP ORD GBPO.10	4 814.00	72 008.21 0.01
GBP	BHP BILLITON PLC USDO.50	3 072.00	29 475.03 0.00
GBP	BP ORD USDO.25	27 097.00	144 561.92 0.02
GBP	BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	2 814.00	155 554.95 0.03
GBP	BRITISH LAND CO PLC REIT	1 342.00	14 086.84 0.00
GBP	BT GROUP ORD GBPO.05	11 697.00	80 447.25 0.01
GBP	BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	406.00	6 882.14 0.00
GBP	CAPITA PLC ORD GBPO.02066666	672.00	11 200.48 0.00
GBP	CARNIVAL PLC ORD USD1.66	179.00	8 836.12 0.00
GBP	CENTRICA ORD GBPO.061728395	8 139.00	23 644.51 0.00
GBP	COBHAM ORD GBPO.025	1 693.00	6 099.86 0.00
GBP	COMPASS GROUP ORD GBPO.10625	2 355.00	40 187.03 0.01
GBP	CRODA INTL ORD GBPO.10	215.00	8 697.96 0.00
USD	DELPHI AUTOMOTIVE COM USDO.01	523.00	33 963.62 0.01
GBP	DIAGEO ORD GBX28.935185	3 744.00	100 083.23 0.02
GBP	EASYJET ORD GBPO.27285714(POST CONS	498.00	10 935.27 0.00
GBP	ENSCO PLC COM USDO.10 'A'	300.00	2 934.00 0.00
GBP	G4S ORD GBPO.25	1 687.00	5 427.35 0.00
GBP	GKN ORD GBPO.50	3 554.00	14 055.28 0.00
GBP	GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	7 085.00	144 620.54 0.02
GBP	HAMMERSON PLC REIT	1 496.00	12 382.31 0.00
GBP	HARGREAVES LANSLOW ORD GBPO.004 (WI)	536.00	10 363.11 0.00
GBP	HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)	26 448.00	184 693.66 0.03
GBP	ICAP ORD GBPO.10	726.00	4 978.20 0.00
GBP	IMI ORD GBPO.2857	308.00	3 514.84 0.00
GBP	IMPERIAL TOBACCO ORD GBPO.10	1 426.00	76 582.49 0.01
GBP	INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.1580547	295.00	9 611.97 0.00
GBP	INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	211.00	8 470.29 0.00
GBP	INTU PROPERTIES PLC GBPO.50	1 170.00	4 962.34 0.00
GBP	INVESTEC ORD GBPO.0002	1 252.00	7 883.50 0.00
GBP	ITV ORD GBPO.10	8 108.00	30 685.19 0.00
GBP	JOHNSON MATTHEY GBP1.101698	211.00	7 377.83 0.00
GBP	KINGFISHER ORD GBPO.157142857	4 730.00	21 879.70 0.00
GBP	LAND SECURITIES GROUP PLC REIT	857.00	13 311.42 0.00
GBP	LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	9 450.00	32 640.75 0.01
USD	LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 C	1 114.00	37 107.34 0.01
GBP	LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBPO.25	72 332.00	67 163.89 0.01
GBP	LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	568.00	19 933.22 0.00
GBP	MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	1 801.00	10 834.56 0.00
GBP	MORRISON(W) SUPRMKT ORD GBPO.10	5 339.00	13 215.54 0.00
GBP	NATIONAL GRID ORD GBPO.11395	5 094.00	71 232.32 0.01
GBP	NEXT ORD GBPO.10	178.00	17 485.14 0.00
GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBPO.114285714(POST CON	3 938.00	9 479.54 0.00
GBP	PEARSON ORD GBPO.25	1 406.00	15 735.90 0.00
GBP	PERSIMMON ORD GBPO.10	640.00	18 483.62 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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
GBP	PETROFAC ORD USD0.02	692.00	7 769.38	0.00
GBP	PRUDENTIAL ORD GBP0.05	3 307.00	64 149.15	0.01
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10	943.00	83 388.82	0.01
GBP	RELX PLC GBP0.1444	2 040.00	35 593.00	0.01
GBP	REXAM NEW ORD GBP0.8035714	1 013.00	8 621.64	0.00
GBP	RIO TINTO ORD GBP0.10	1 828.00	44 444.33	0.01
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20	2 484.00	19 555.72	0.00
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	3 770.00	13 513.75	0.00
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	1 064.00	6 284.66	0.00
GBP	SABMILLER ORD USD0.10	1 415.00	83 950.21	0.01
GBP	SAGE GROUP GBP0.01051948	1 490.00	13 125.24	0.00
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBP0.28571428	1 622.00	5 639.28	0.00
GBP	SCHRODERS VTG SHS GBP1	210.00	8 114.39	0.00
GBP	SEGRO PLC ORD GBP0.10	1 656.00	10 309.91	0.00
GBP	SEVERN TRENT ORD GBP0.9789	286.00	8 880.58	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBP0.50	1 945.00	29 852.19	0.01
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	1 452.00	23 933.27	0.00
GBP	SSE PLC ORD GBP0.50	839.00	17 256.76	0.00
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	4 731.00	31 608.45	0.01
GBP	STANDARD LIFE ORD GBP0.1222222	3 603.00	18 577.97	0.00
GBP	TATE & LYLE ORD GBP0.25	708.00	6 281.88	0.00
GBP	TESCO ORD GBP0.05	12 025.00	29 577.64	0.00
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBP0.10	303.00	7 843.95	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBP0.031111	1 857.00	81 263.67	0.01
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05	770.00	10 447.32	0.00
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	37 580.00	119 354.89	0.02
GBP	WEIR GROUP ORD GBP0.125	231.00	2 834.38	0.00
GBP	WHITBREAD ORD GBP0.76797385	223.00	12 653.02	0.00
GBP	WILLIAM HILL ORD GBP0.10	1 286.00	7 096.10	0.00
USD	WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000115	72.00	8 241.84	0.00
GBP	WPP PLC ORD GBP0.10	1 762.00	37 915.85	0.01
イギリス合計			2 828 528.34	0.37
アメリカ合衆国				
USD	3M CO COM	914.00	138 014.00	0.02
USD	ABBOTT LABS COM	2 254.00	85 313.90	0.01
USD	ABBVIE INC COM USD0.01	2 253.00	123 689.70	0.02
USD	ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	600.00	20 892.00	0.00
USD	ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	719.00	64 084.47	0.01
USD	ADT CORP COM USD0.01	494.00	14 612.52	0.00
USD	ADVANCE AUTO PARTS INC COM	100.00	15 205.00	0.00
USD	AES CORP COM	1 573.00	14 943.50	0.00
USD	AETNA INC COM USD0.01	591.00	60 187.44	0.01
USD	AFLAC INC COM USD0.10	646.00	37 442.16	0.01
USD	AGCO CORP COM USD0.01	100.00	4 877.00	0.00
USD	AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	598.00	22 514.70	0.00
USD	AIR PRODS & CHEMS INC COM	325.00	41 180.75	0.01
USD	AIRGAS INC COM USD0.01	140.00	19 600.00	0.00
USD	AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	200.00	9 124.00	0.00
USD	ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	5 264.00	0.00
USD	ALCOA INC COM USD1	1 967.00	14 339.43	0.00
USD	ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	272.00	39 692.96	0.01
USD	ALLERGAN PLC COM USD0.0001	488.00	138 801.84	0.02
USD	ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	56.00	11 188.24	0.00
USD	ALLIANT ENERGY CORP COM	100.00	6 534.00	0.00
USD	ALLSTATE CORP COM	728.00	44 116.80	0.01
USD	ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	393.00	291 979.35	0.05
USD	ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	392.00	298 449.20	0.05
USD	ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	2 877.00	175 813.47	0.03
USD	AMAZON COM INC COM USD0.01	510.00	299 370.00	0.05

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	781.00	47 617.57	0.01
USD AMER EXPRESS CO COM USD0.20	1 385.00	74 097.50	0.01
USD AMER INTL GRP COM USD2.50	1 960.00	110 700.80	0.02
USD AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	609.00	57 453.06	0.01
USD AMEREN CORP COM	595.00	26 727.40	0.01
USD AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	210.00	13 631.10	0.00
USD AMERIPRISE FINL INC COM	325.00	29 461.25	0.01
USD AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	300.00	26 868.00	0.01
USD AMETEK INC COM USD0.01	506.00	23 807.30	0.00
USD AMGEN INC COM USD0.0001	1 084.00	165 559.32	0.03
USD AMPHENOL CORP NEW CL A	400.00	19 828.00	0.00
USD ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	691.00	27 011.19	0.01
USD ANALOG DEVICES INC COM	382.00	20 574.52	0.00
USD ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	1 866.00	17 727.00	0.00
USD ANSYS INC COM	200.00	17 638.00	0.00
USD ANTHEM INC COM USD0.01	454.00	59 242.46	0.01
USD APACHE CORP COM USD0.625	537.00	22 843.98	0.00
USD APPLE INC COM NPV	8 486.00	826 027.24	0.14
USD APPLIED MATLS INC COM	1 677.00	29 599.05	0.01
USD ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	966.00	34 148.10	0.01
USD ARROW ELECTRS INC COM	100.00	5 160.00	0.00
USD ASHLAND INC COM USD1.00	100.00	9 476.00	0.00
USD ASSURANT INC COM	100.00	8 131.00	0.00
USD AT&T INC COM USD1	9 068.00	326 992.08	0.05
USD AUTODESK INC COM USD0.01	465.00	21 771.30	0.00
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC COM	655.00	54 423.95	0.01
USD AUTOZONE INC COM USD0.01	21.00	16 115.19	0.00
USD AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	218.00	37 384.82	0.01
USD AVERY DENNISON CORP COM	227.00	13 822.03	0.00
USD AVNET INC COM	100.00	3 992.00	0.00
USD BAKER HUGHES INC COM USD1	726.00	31 588.26	0.01
USD BALL CORP COM	200.00	13 366.00	0.00
USD BARD(CR)INC COM USD0.25	100.00	18 327.00	0.00
USD BAXALTA INC.COM USD1 'WI'	815.00	32 608.15	0.01
USD BAXTER INTL INC COM USD1	815.00	29 829.00	0.01
USD BB&T CORP COM USD5	961.00	31 386.26	0.01
USD BE AEROSPACE COM USD0.01	200.00	8 090.00	0.00
USD BECTON DICKINSON COM USD1	319.00	46 373.03	0.01
USD BED BATH & BEYOND INC COM	407.00	17 570.19	0.00
USD BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	5 015.00	0.00
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1 563.00	202 830.51	0.03
USD BEST BUY CO INC COM USD0.10	200.00	5 586.00	0.00
USD BIOGEN INC COM STK USD0.0005	318.00	86 833.08	0.02
USD BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	300.00	22 206.00	0.00
USD BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	15 022.00	212 411.08	0.04
USD BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	1 605.00	58 133.10	0.01
USD BLACKROCK INC COM STK USD0.01	163.00	51 224.38	0.01
USD BLOCK(H&R)INC COM NPV	675.00	22 983.75	0.00
USD BOEING CO COM USD5	1 018.00	122 292.34	0.02
USD BORG WARNER INC COM	448.00	13 153.28	0.00
USD BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	227.00	26 379.67	0.01
USD BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	2 400.00	42 072.00	0.01
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO COM	2 326.00	144 584.16	0.02
USD BROADCOM CORP CL A COM USD0.0001	618.00	33 786.06	0.01
USD BROWN FORMAN CORP CL B	172.00	16 828.48	0.00
USD BUNGE LIMITED COM USD0.01	208.00	12 898.08	0.00
USD CA INC COM USD0.10	709.00	20 369.57	0.00
USD CABLEVISION SYS CORP CL A NY CABLVS	538.00	17 167.58	0.00
USD CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	737.00	15 292.75	0.00
USD CALPINE CORP COM STK USD0.001	400.00	6 124.00	0.00
USD CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	200.00	11 282.00	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	850.00	55 777.00	0.01
USD	CARDINAL HEALTH INC COM	559.00	45 485.83	0.01
USD	CARMAX INC COM USD0.50	447.00	19 748.46	0.00
USD	CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRE STOCK)	641.00	30 851.33	0.01
USD	CATERPILLAR INC DEL COM	937.00	58 318.88	0.01
USD	CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	377.00	10 544.69	0.00
USD	CBS CORP NEW CL B	860.00	40 850.00	0.01
USD	CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	200.00	12 734.00	0.00
USD	CELGENE CORP COM USD0.01	1 144.00	114 766.08	0.02
USD	CENTERPOINT ENERGY INC COM	411.00	7 344.57	0.00
USD	CENTURYLINK INC COM	1 058.00	26 894.36	0.01
USD	CERNER CORP COM	515.00	29 875.15	0.01
USD	CF INDS HLDGS INC COM	315.00	9 450.00	0.00
USD	CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	246.00	15 933.42	0.00
USD	CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	100.00	17 136.00	0.00
USD	CHENIERE ENERGY INC COM NEW	200.00	6 010.00	0.00
USD	CHESAPEAKE ENERGY CORP COM	897.00	3 040.83	0.00
USD	CHEVRON CORP COM USD0.75	2 721.00	235 284.87	0.04
USD	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	23.00	10 418.31	0.00
USD	CHURCH & DWIGHT INC COM	139.00	11 676.00	0.00
USD	CIGNA CORP COM USD0.25	403.00	53 840.80	0.01
USD	CIMAREX ENERGY CO COM	100.00	9 300.00	0.00
USD	CINCINNATI FINL CORP COM	405.00	23 340.15	0.00
USD	CINTAS CORP COM	100.00	8 592.00	0.00
USD	CISCO SYSTEMS COM USD0.001	7 614.00	181 137.06	0.03
USD	CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	437.00	12 825.95	0.00
USD	CITIGROUP INC COM USD0.01	4 342.00	184 882.36	0.03
USD	CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	200.00	14 092.00	0.00
USD	CLOROX CO DEL COM	254.00	32 778.70	0.01
USD	CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS' A'	436.00	39 174.60	0.01
USD	CMS ENERGY CORP COM	300.00	11 664.00	0.00
USD	COACH INC COM USD0.01	473.00	17 524.65	0.00
USD	COCA-COLA CO COM USD0.25	5 618.00	241 124.56	0.04
USD	COCA-COLA ENTERPR COM USD1.00	300.00	13 926.00	0.00
USD	COGNIZANT TECHNOLO COM CL' A' USD0.01	876.00	55 459.56	0.01
USD	COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	1 323.00	89 342.19	0.02
USD	COLUMBIA PIPE GRP COM NPV 'WI'	400.00	7 420.00	0.00
USD	COMCAST CORP COM CLS' A' USD0.01	3 928.00	218 828.88	0.04
USD	COMERICA INC COM	307.00	10 530.10	0.00
USD	CONAGRA FOODS INC COM	808.00	33 645.12	0.01
USD	CONCHO RES INC COM STK USD0.001	94.00	8 942.22	0.00
USD	CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	1 605.00	62 723.40	0.01
USD	CONSOLIDATED EDISON INC COM	558.00	38 719.62	0.01
USD	CONSTELLATION BRDS CLASS' A' COM USD0.01	200.00	30 496.00	0.01
USD	CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	146.00	3 082.06	0.00
USD	CORNING INC COM USD0.50	1 991.00	37 052.51	0.01
USD	COSTCO WHSL CORP NEW COM	579.00	87 498.48	0.02
USD	CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	503.00	43 358.60	0.01
USD	CROWN HOLDINGS INC COM USD5	242.00	11 102.96	0.00
USD	CSX CORP COM	1 412.00	32 504.24	0.01
USD	CUMMINS INC COM	169.00	15 191.41	0.00
USD	CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	1 740.00	168 066.60	0.03
USD	D R HORTON INC COM	839.00	23 080.89	0.00
USD	DANAHER CORP COM USD0.01	843.00	73 045.95	0.01
USD	DARDEN RESTAURANTS INC COM	100.00	6 306.00	0.00
USD	DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	200.00	13 424.00	0.00
USD	DEERE & CO COM USD1	560.00	43 125.60	0.01
USD	DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	352.00	15 590.08	0.00
USD	DENTSPLY INTL INC NEW COM	391.00	23 025.99	0.00
USD	DEVON ENERGY CORP NEW COM	608.00	16 963.20	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	DICKS SPORTING GOODS INC COM	200.00	7 816.00	0.00
USD	DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	156.00	12 492.48	0.00
USD	DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	811.00	37 135.69	0.01
USD	DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	150.00	4 138.50	0.00
USD	DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	450.00	12 244.50	0.00
USD	DISH NETWORK CORPO CLASS' A' COM USD0.01	444.00	21 431.88	0.00
USD	DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	315.00	23 643.90	0.00
USD	DOLLAR TREE INC	324.00	26 347.68	0.01
USD	DOMINION RES(VIR) COM STK NPV	854.00	61 633.18	0.01
USD	DOVER CORP COM	200.00	11 690.00	0.00
USD	DOW CHEMICAL CO COM USD2.50	1 703.00	71 526.00	0.01
USD	DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	200.00	18 768.00	0.00
USD	DTE ENERGY CO COM	230.00	19 552.30	0.00
USD	DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30	1 300.00	68 588.00	0.01
USD	DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	1 038.00	78 161.40	0.01
USD	DUKE REALTY CORP COM USD0.01	537.00	10 809.81	0.00
USD	DUN & BRADSTREET CORP DEL NEW COM	134.00	13 188.28	0.00
USD	EASTMAN CHEM CO COM	200.00	12 242.00	0.00
USD	EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	2 866.00	0.00
USD	EBAY INC COM USD0.001	1 713.00	40 186.98	0.01
USD	ECOLAB INC COM	354.00	38 185.98	0.01
USD	EDGEWELL PERSONAL COM USD0.01	92.00	6 808.92	0.00
USD	EDISON INTL COM	382.00	23 607.60	0.00
USD	EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	224.00	17 519.04	0.00
USD	ELECTRONIC ARTS INC COM	300.00	19 363.50	0.00
USD	ELI LILLY AND CO COM NPV	1 435.00	113 508.50	0.02
USD	EMC CORP(MASS) COM USD0.01	2 931.00	72 600.87	0.01
USD	EMERSON ELEC CO COM	1 030.00	47 359.40	0.01
USD	ENERGEN CORP COM USD0.01	100.00	3 527.00	0.00
USD	ENTERGY CORP NEW COM	232.00	16 374.56	0.00
USD	EOG RESOURCES INC COM USD0.01	694.00	49 287.88	0.01
USD	EQT CORPORATION	247.00	15 249.78	0.00
USD	EQUIFAX INC COM	100.00	10 580.00	0.00
USD	EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	104.00	32 299.28	0.01
USD	EQUITY RESIDENTIAL-SBI	606.00	46 716.54	0.01
USD	ESTEE LAUDER COS CLASS' A' COM USD0.01	200.00	17 050.00	0.00
USD	EVERSOURCE ENERGY COM USD5	407.00	21 896.60	0.00
USD	EXELON CORP COM NPV	1 267.00	37 465.19	0.01
USD	EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)	100.00	10 104.00	0.00
USD	EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	200.00	9 024.00	0.00
USD	EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	1 192.00	85 669.04	0.01
USD	EXXON MOBIL CORP COM NPV	6 202.00	482 825.70	0.08
USD	F M C CORP COM NEW	200.00	7 144.00	0.00
USD	F5 NETWORK INC COM STK NPV	97.00	9 096.66	0.00
USD	FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL 'A'	2 479.00	278 168.59	0.05
USD	FASTENAL CO COM	376.00	15 250.56	0.00
USD	FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	81.00	12 217.23	0.00
USD	FEDEX CORP COM USD0.10	421.00	55 942.48	0.01
USD	FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	325.00	10 523.50	0.00
USD	FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	300.00	17 919.00	0.00
USD	FIFTH THIRD BANCORP COM	1 141.00	18 027.80	0.00
USD	FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	200.00	13 600.00	0.00
USD	FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	757.00	25 026.42	0.01
USD	FISERV INC COM USD0.01	437.00	41 322.72	0.01
USD	FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	100.00	12 284.00	0.00
USD	FLIR SYS INC COM	303.00	8 859.72	0.00
USD	FLOWSERVE CORP COM	300.00	11 592.00	0.00
USD	FLUOR CORP NEW COM	216.00	9 696.24	0.00
USD	FMC TECHNOLOGIES INC COM	470.00	11 820.50	0.00
USD	FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	4 974.00	59 389.56	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	FRANKLIN RES INC COM	714.00	24 747.24	0.00
USD	FREEMPORT-MCMOR C&G COM STK USD0.10	1 447.00	6 656.20	0.00
USD	FRONTIER COMMUNICA COM USD0.25	848.00	3 858.40	0.00
USD	GAMESTOP CORP COM USD0.001 CLASS 'A'	100.00	2 621.00	0.00
USD	GAP INC DEL COM	432.00	10 679.04	0.00
USD	GEN DYNAMICS CORP COM USD1	311.00	41 602.47	0.01
USD	GEN ELEC CO COM USD0.06	14 361.00	417 905.10	0.07
USD	GEN GROWTH PPTYS COM USD0.01 NEW	1 144.00	32 077.76	0.01
USD	GENERAL MLS INC COM	973.00	54 984.23	0.01
USD	GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	1 346.00	39 895.44	0.01
USD	GENUINE PARTS CO COM STK USD1	262.00	22 576.54	0.00
USD	GILEAD SCIENCES COM USD0.001	2 204.00	182 932.00	0.03
USD	GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	601.00	97 097.56	0.02
USD	GRAINGER W W INC COM	53.00	10 424.57	0.00
USD	HALLIBURTON COM STK USD2.50	1 205.00	38 306.95	0.01
USD	HARLEY DAVIDSON INC COM	408.00	16 320.00	0.00
USD	HARRIS CORP COM STK USD1	100.00	8 697.00	0.00
USD	HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	556.00	22 340.08	0.00
USD	HASBRO INC COM	100.00	7 428.00	0.00
USD	HCA HLDGS INC COM USD0.01	543.00	37 781.94	0.01
USD	HCP INC COM USD1	850.00	30 549.00	0.01
USD	HELMERICH & PAYNE INC COM	255.00	12 954.00	0.00
USD	HERSHEY CO COM	191.00	16 829.01	0.00
USD	HERTZ GLOBAL HOLDI COM STK USD0.01	423.00	3 840.84	0.00
USD	HESS CORPORATION COM USD1	479.00	20 357.50	0.00
USD	HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01	2 736.00	37 647.36	0.01
USD	HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01	199.00	6 959.03	0.00
USD	HOLOGIC INC COM USD0.01	200.00	6 788.00	0.00
USD	HOME DEPOT INC COM USD0.05	2 032.00	255 544.32	0.04
USD	HONEYWELL INTL INC COM	1 073.00	110 733.60	0.02
USD	HORMEL FOODS CORP COM	200.00	16 082.00	0.00
USD	HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01	535.00	7 409.75	0.00
USD	HP INC COM USD0.01	2 736.00	26 566.56	0.01
USD	HUMANA INC COM USD0.166	247.00	40 209.13	0.01
USD	HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	7 270.00	0.00
USD	ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	418.00	37 649.26	0.01
USD	ILLUMINA INC COM USD0.01	196.00	30 958.20	0.01
USD	INTEL CORP COM USD0.001	6 941.00	215 309.82	0.04
USD	INTERCONTINENTAL E COM USD0.01	134.00	35 349.20	0.01
USD	INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	157.00	18 362.72	0.00
USD	INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10	600.00	13 464.00	0.00
USD	INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20	1 485.00	185 313.15	0.03
USD	INTL PAPER CO COM	784.00	26 820.64	0.01
USD	INTUIT COM	347.00	33 141.97	0.01
USD	INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001	50.00	27 042.50	0.01
USD	INVESCO LTD COM STK USD0.20	568.00	17 000.24	0.00
USD	IRON MTN INC NEW COM NPV	115.00	3 167.10	0.00
USD	JACOBS ENG GROUP COM USD1	312.00	12 239.76	0.00
USD	JOHNSON & JOHNSON COM USD1	3 943.00	411 806.92	0.07
USD	JOHNSON CONTROLS COM STK USD0.01388	950.00	34 076.50	0.01
USD	JP MORGAN CHASE & COM USD1	5 362.00	319 039.00	0.05
USD	JUNIPER NETWORKS INC COM	881.00	20 791.60	0.00
USD	KANSAS CITY STHN I COM USD0.01	100.00	7 088.00	0.00
USD	KELLOGG CO COM USD0.25	292.00	21 444.48	0.00
USD	KEURIG GREEN MTN I COM USD0.1	128.00	11 424.00	0.00
USD	KEYCORP NEW COM	700.00	7 812.00	0.00
USD	KIMBERLY CLARK CORP COM	536.00	68 833.12	0.01
USD	KIMCO REALTY COM USD0.01	400.00	10 876.00	0.00
USD	KINDER MORGAN INC USD0.01	1 512.00	24 872.40	0.00
USD	KLA-TENCOR CORP COM USD0.001	100.00	6 699.00	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD KOHLS CORPORATION COM USD0.01	261.00	12 984.75	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USD0.01	876.00	68 380.56	0.01
USD KROGER CO COM USD1	1 774.00	68 848.94	0.01
USD L BRANDS INC COM USD0.50	454.00	43 652.10	0.01
USD LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1	100.00	11 235.00	0.00
USD LAM RESEARCH CORP COM USD0.001	360.00	25 844.40	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	573.00	25 842.30	0.01
USD LEGG MASON INC COM	100.00	3 062.00	0.00
USD LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01	100.00	4 151.00	0.00
USD LENNAR CORP COM CL' A' USD0.10	300.00	12 645.00	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	687.00	11 376.72	0.00
USD LEVEL 3 COMMUNICAT COM USD0.01(POST REV SPLIT)	316.00	15 423.96	0.00
USD LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A	446.00	15 346.86	0.00
USD LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	985.00	25 669.10	0.01
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01	100.00	3 662.00	0.00
USD LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C WHEN ISSU	200.00	7 118.00	0.00
USD LINCOLN NATL CORP COM NPV	479.00	18 901.34	0.00
USD LINEAR TECHNOLOGY COM USD0.001	498.00	21 279.54	0.00
USD LINKEDIN CORP COM USD0.0001	100.00	19 791.00	0.00
USD LKQ CORP COM	300.00	8 220.00	0.00
USD LOCKHEED MARTIN CORP COM	378.00	79 758.00	0.01
USD LOEWS CORP COM	377.00	13 952.77	0.00
USD LOWE' S COS INC COM USD0.50	1 505.00	107 848.30	0.02
USD LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	586.00	45 690.42	0.01
USD M & T BANK CORP COM USD0.50	132.00	14 543.76	0.00
USD MACERICH CO COM USD0.01	149.00	11 617.53	0.00
USD MACY' S INC COM STK USD0.01	592.00	23 922.72	0.00
USD MARATHON OIL CORP COM USD1	1 109.00	10 790.57	0.00
USD MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	972.00	40 619.88	0.01
USD MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	485.00	29 720.80	0.01
USD MARSH & MCLENNAN COM USD1	879.00	46 877.07	0.01
USD MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01	128.00	16 074.24	0.00
USD MASCO CORP COM	922.00	24 331.58	0.00
USD MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	1 452.00	129 271.56	0.02
USD MATTEL INC COM USD1	610.00	16 829.90	0.00
USD MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	287.00	9 585.80	0.00
USD MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	300.00	26 391.00	0.01
USD MCDONALD' S CORP COM USD0.01	1 437.00	177 871.86	0.03
USD MCGRAW HILL FINANCIAL INC COM	382.00	32 477.64	0.01
USD MCKESSON CORP COM USD0.01	329.00	52 962.42	0.01
USD MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01	222.00	16 092.78	0.00
USD MEDTRONIC PLC USD0.0001	2 142.00	162 620.64	0.03
USD MERCK & CO INC COM USD0.50	4 130.00	209 267.10	0.03
USD METLIFE INC COM USD0.01	1 284.00	57 330.60	0.01
USD MGM RESORTS INTL COM	415.00	8 333.20	0.00
USD MICROCHIP TECHNLY COM USD0.001	200.00	8 962.00	0.00
USD MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	1 482.00	16 346.46	0.00
USD MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	11 190.00	616 457.10	0.10
USD MOHAWK INDS COM USD0.01	94.00	15 642.54	0.00
USD MOLSON COORS BREWI COM CLS' B' COM NON-V USD0.01	353.00	31 939.44	0.01
USD MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	2 346.00	101 112.60	0.02
USD MONSANTO COM STK USD0.01	752.00	68 131.20	0.01
USD MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)	200.00	27 006.00	0.01
USD MOODYS CORP COM USD0.01	200.00	17 828.00	0.00
USD MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	2 067.00	53 493.96	0.01
USD MOSAIC CO COM USD0.01	585.00	14 098.50	0.00
USD MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	443.00	29 579.11	0.01
USD MURPHY OIL CORP COM	238.00	4 667.18	0.00
USD MYLAN NV EURO.01	601.00	31 666.69	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD NASDAQ INC COM STK USD0.01	100.00	6 200.00	0.00
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	615.00	20 012.10	0.00
USD NAVIENT CORP COM USD0.01	500.00	4 780.00	0.00
USD NETAPP INC COM USD0.001	677.00	14 846.61	0.00
USD NETFLIX INC COM USD0.001	574.00	52 716.16	0.01
USD NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	1 095.00	16 950.60	0.00
USD NEWELL RUBBERMAID INC COM	631.00	24 470.18	0.00
USD NEWMONT MINING CORP COM	946.00	18 882.16	0.00
USD NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL' A'	325.00	4 215.25	0.00
USD NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	409.00	45 689.39	0.01
USD NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	575.00	27 692.00	0.01
USD NIKE INC CLASS' B' COM NPV	2 020.00	125 260.20	0.02
USD NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	347.00	11 232.39	0.00
USD NORDSTROM INC COM NPV	329.00	16 153.90	0.00
USD NORFOLK SOUTHERN CORP COM	474.00	33 417.00	0.01
USD NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	256.00	15 892.48	0.00
USD NORTHROP GRUMMAN COM USD1	200.00	37 012.00	0.01
USD NRG ENERGY INC COM NEW	698.00	7 426.72	0.00
USD NUANCE COMMUNICATI COM USD0.001	494.00	8 709.22	0.00
USD NUCOR CORP COM	379.00	14 807.53	0.00
USD NVIDIA CORP COM USD0.001	1 258.00	36 846.82	0.01
USD OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	1 125.00	77 433.75	0.01
USD OCEANEERING INTL INC COM	100.00	3 385.00	0.00
USD OGE ENERGY CORP COM USD0.01	200.00	5 246.00	0.00
USD OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	333.00	24 425.55	0.00
USD ONEOK INC	209.00	5 206.19	0.00
USD ORACLE CORP COM USD0.01	4 916.00	178 499.96	0.03
USD OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	198.00	51 658.20	0.01
USD PACCAR INC COM STK USD1	401.00	19 677.07	0.00
USD PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	216.00	20 986.56	0.00
USD PATTERSON COMPANIES INC COM	100.00	4 246.00	0.00
USD PAYCHEX INC COM	409.00	19 574.74	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	1 713.00	61 907.82	0.01
USD PEOPLE' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	576.00	8 277.12	0.00
USD PEPCO HOLDINGS COM USD0.01	300.00	8 004.00	0.00
USD PEPSICO INC CAP USD0.016666	2 201.00	218 559.30	0.04
USD PERRIGO CO LTD COM EURO.001	137.00	19 807.46	0.00
USD PFIZER INC COM USD0.05	9 174.00	279 715.26	0.05
USD PG&E CORP COM	537.00	29 486.67	0.01
USD PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	2 315.00	208 373.15	0.03
USD PHILLIPS 66 COM USD0.01	795.00	63 719.25	0.01
USD PINNACLE WEST CAP CORP COM	100.00	6 631.00	0.00
USD PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	177.00	21 939.15	0.00
USD PLUM CREEK TIMBER COMPANY INC REIT	458.00	18 553.58	0.00
USD PNC FINL SVCS GROUP INC COM	744.00	64 467.60	0.01
USD POLARIS INDS INC COM	100.00	7 384.00	0.00
USD PPG INDS INC COM	346.00	32 911.52	0.01
USD PPL CORP COM	1 086.00	38 075.16	0.01
USD PRAXAIR INC COM USD0.01	402.00	40 200.00	0.01
USD PRECISION CASTPART COM NPV	173.00	40 646.35	0.01
USD PRICELINE.COM INC COM USD0.008	69.00	73 482.93	0.01
USD PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	504.00	19 152.00	0.00
USD PROCTER & GAMBLE COM NPV	3 865.00	315 731.85	0.05
USD PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	1 038.00	32 437.50	0.01
USD PROLOGIS INC COM USD0.01	855.00	33 746.85	0.01
USD PRUDENTIAL FINL INC COM	630.00	44 150.40	0.01
USD PUBLIC STORAGE COM USD0.10	200.00	50 712.00	0.01
USD PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	889.00	36 715.70	0.01
USD PULTE GROUP INC USD0.01	537.00	9 000.12	0.00
USD PVH CORP COM USD1	100.00	7 338.00	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	QUALCOMM INC COM USD0.0001	2 492.00	112 987.28	0.02
USD	QUANTA SVCS INC COM	272.00	5 086.40	0.00
USD	QUEST DIAGNOSTICS INC COM	246.00	16 154.82	0.00
USD	RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	100.00	11 250.00	0.00
USD	RANGE RES CORP COM USD0.01	206.00	6 089.36	0.00
USD	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	200.00	8 762.00	0.00
USD	RAYTHEON CO COM NEW	336.00	43 088.64	0.01
USD	REALOGY HLDGS CORP COM USD0.01	200.00	6 560.00	0.00
USD	REALTY INCOME CORP	223.00	12 441.17	0.00
USD	RED HAT INC COM	204.00	14 290.20	0.00
USD	REGENCY CENTERS COM USD0.01	318.00	23 020.02	0.00
USD	REGENERON PHARMACEUTICALS COM	70.00	29 406.30	0.01
USD	REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	900.00	7 308.00	0.00
USD	REPUBLIC SERVICES COM USD0.01	695.00	30 371.50	0.01
USD	RESMED INC COM USD0.004	200.00	11 340.00	0.00
USD	REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001	1 516.00	75 724.20	0.01
USD	ROBERT HALF INTL INC COM	100.00	4 377.00	0.00
USD	ROCKWELL AUTOMATION INC COM	218.00	20 834.26	0.00
USD	ROCKWELL COLLINS INC COM	299.00	24 183.12	0.00
USD	ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01	198.00	34 782.66	0.01
USD	ROSS STORES INC COM USD0.01	400.00	22 504.00	0.00
USD	ROYAL CARIBBEAN COM USD0.01	383.00	31 390.68	0.01
USD	SALESFORCE.COM INC COM USD0.001	806.00	54 856.36	0.01
USD	SANDISK CORP COM USD0.001	444.00	31 390.80	0.01
USD	SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01	100.00	9 928.00	0.00
USD	SCANA CORP NEW COM	100.00	6 295.00	0.00
USD	SCHEIN HENRY INC COM	100.00	15 144.00	0.00
USD	SCHLUMBERGER COM USD0.01	1 858.00	134 277.66	0.02
USD	SCHWAB CHARLES CORP NEW COM	1 600.00	40 848.00	0.01
USD	SCRIPPS NETWORKS I COM USD0.01 CL A	105.00	6 401.85	0.00
USD	SEALED AIR CORP NEW COM	200.00	8 106.00	0.00
USD	SEI INVESTMENT COM USD0.01	269.00	10 555.56	0.00
USD	SEMPRA ENERGY COM	372.00	35 247.00	0.01
USD	SERVICENOW INC COM USD0.001	200.00	12 442.00	0.00
USD	SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	100.00	25 567.00	0.01
USD	SIMON PROP GROUP COM USD0.0001	444.00	82 708.32	0.01
USD	SMUCKER(JM)CO COM NPV	132.00	16 938.24	0.00
USD	SOUTHERN CO COM	1 290.00	63 106.80	0.01
USD	SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	679.00	25 543.98	0.01
USD	SPECTRA ENERGY COR COM USD0.001	929.00	25 501.05	0.01
USD	SPRINT CORPORATION COM USD0.01	668.00	2 017.36	0.00
USD	ST JUDE MED INC COM	353.00	18 659.58	0.00
USD	STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	272.00	25 660.48	0.01
USD	STAPLES INC COM STK USD0.0006	1 387.00	12 372.04	0.00
USD	STARBUCKS CORP COM USD0.001	2 168.00	131 749.36	0.02
USD	STARWOOD HTLS WRLD COM STK USD0.01	226.00	14 066.24	0.00
USD	STATE STREET CORP COM STK USD1	645.00	35 945.85	0.01
USD	STERICYCLE INC COM	100.00	12 035.00	0.00
USD	STHWESTN ENERGY CO COM USD0.01	432.00	3 840.48	0.00
USD	STRYKER CORP COM USD0.10	495.00	49 079.25	0.01
USD	SUNTRUST BKS INC COM	905.00	33 104.90	0.01
USD	SYMANTEC CORP COM	1 174.00	23 292.16	0.00
USD	SYNOPSIS INC COM USD0.01	200.00	8 580.00	0.00
USD	SYSCO CORP COM	959.00	38 177.79	0.01
USD	T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20	486.00	34 481.70	0.01
USD	T-MOBILE US INC COM USD0.0001	400.00	16 060.00	0.00
USD	TARGET CORP COM STK USD0.0833	907.00	65 684.94	0.01
USD	TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01	409.00	11 280.22	0.00
USD	TERADATA CORP COM STK USD0.01 'WI'	207.00	5 038.38	0.00
USD	TESLA MOTORS INC COM USD0.001	100.00	19 120.00	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	TESORO CORP COM	200.00	17 450.00	0.00
USD	TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	1 557.00	82 412.01	0.01
USD	THERMO FISHER SCIE COM USD1	501.00	66 162.06	0.01
CAD	THOMSON-REUTERS CO COM NPV	674.00	25 096.89	0.01
USD	TIFFANY & CO NEW COM	261.00	16 662.24	0.00
USD	TIME WARNER CABLE USDO.01	423.00	76 990.23	0.01
USD	TIME WARNER INC COM USDO.01	1 391.00	97 982.04	0.02
USD	TJX COS INC COM USD1	1 032.00	73 519.68	0.01
USD	TOLL BROS INC COM USDO.01	475.00	13 119.50	0.00
USD	TORCHMARK CORP COM	225.00	12 226.50	0.00
USD	TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USDO.10	213.00	8 554.08	0.00
USD	TRACTOR SUPPLY CO COM	200.00	17 662.00	0.00
USD	TRAVELERS CO INC COM NPV	516.00	55 232.64	0.01
USD	TRIMBLE NAVIGATION LTD COM	300.00	5 787.00	0.00
USD	TRIPADVISOR INC COM USDO.001	100.00	6 676.00	0.00
USD	TWENTY-FIRST CENTU COM USDO.01 CL' A'	2 121.00	57 203.37	0.01
USD	TWENTY-FIRST CENTU COM USDO.01 CL' B'	500.00	13 550.00	0.00
USD	TYCO INTL PLC EUR1.00	885.00	30 435.15	0.01
USD	TYSON FOODS INC CL A	291.00	15 527.76	0.00
USD	UDR INC	351.00	12 492.09	0.00
USD	ULTA SALON COM STK USDO.0158	100.00	18 117.00	0.00
USD	UNDER ARMOUR INC COM STK USDO.000333 CL A	200.00	17 086.00	0.00
USD	UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	1 280.00	92 160.00	0.02
USD	UNITED CONTINENTAL COM USDO.01	289.00	13 952.92	0.00
USD	UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	1 033.00	96 275.60	0.02
USD	UNITEDHEALTH GRP COM USDO.01	1 475.00	169 861.00	0.03
USD	UNIVERSAL HEALTH S CLASS' B' COM USDO.01	200.00	22 528.00	0.00
USD	UNUM GROUP COM USDO.10	615.00	17 613.60	0.00
USD	US BANCORP COM USDO.01	2 530.00	101 351.80	0.02
USD	UTD TECHNOLOGIES COM USD1	1 248.00	109 437.12	0.02
USD	VALERO ENERGY CORP NEW COM	903.00	61 286.61	0.01
USD	VANTIV INC COM USDO.00001 A	500.00	23 525.00	0.00
USD	VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	100.00	7 713.00	0.00
USD	VENTAS INC COM USDO.25	550.00	30 426.00	0.01
USD	VEREIT INC COM USDO.001	1 092.00	8 419.32	0.00
USD	VERISIGN INC COM	200.00	15 120.00	0.00
USD	VERISK ANALYTICS I CL A USDO.001	142.00	10 366.00	0.00
USD	VERIZON COMMUN COM USDO.10	5 888.00	294 223.36	0.05
USD	VERTEX PHARMACEUTI COM USDO.01	367.00	33 305.25	0.01
USD	VF CORP COM NPV	400.00	25 040.00	0.01
USD	VIACOM INC NEW CL' B' NON-VTG USDO.001	600.00	27 384.00	0.01
USD	VISA INC COM STK USDO.0001	2 892.00	215 425.08	0.04
USD	VMWARE INC COM STK USDO.01 CLASS 'A'	110.00	5 032.50	0.00
USD	VULCAN MATLS CO COM	324.00	28 576.80	0.01
USD	WAL-MART STORES IN COM USDO.10	2 302.00	152 760.72	0.03
USD	WALGREENS BOOTS AL COM USDO.01	1 278.00	101 882.16	0.02
USD	WALT DISNEY CO.DISNEY COM USDO.01	2 447.00	234 471.54	0.04
USD	WASTE MGMT INC DEL COM	816.00	43 207.20	0.01
USD	WATERS CORP COM	100.00	12 121.00	0.00
USD	WEC ENERGY GROUP COM USDO.01	712.00	39 323.76	0.01
USD	WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	7 091.00	356 180.93	0.06
USD	WELLTOWER INC COM USD1	533.00	33 163.26	0.01
USD	WESTERN DIGITAL CORP COM	200.00	9 596.00	0.00
USD	WESTERN UN CO COM	1 348.00	24 048.32	0.00
USD	WESTROCK CO COM USDO.01	434.00	15 311.52	0.00
USD	WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	1 075.00	27 530.75	0.01
USD	WHIRLPOOL CORP COM	100.00	13 439.00	0.00
USD	WHITING PETROLEUM COM USDO.001	128.00	940.80	0.00
USD	WHOLE FOODS MKT INC COM	337.00	9 877.47	0.00
USD	WILLIAMS COS INC COM USD1	1 021.00	19 705.30	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	6 301.00	0.00
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	286.00	18 561.40	0.00
USD WYNN RESORTS LTD COM	100.00	6 734.00	0.00
USD XCEL ENERGY INC COM	894.00	34 168.68	0.01
USD XEROX CORP COM	1 200.00	11 700.00	0.00
USD XILINX INC COM USD0.01	485.00	24 380.95	0.00
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	496.00	17 831.20	0.00
USD YAHOO INC COM STK USD0.001	1 457.00	42 996.07	0.01
USD YUM BRANDS INC COM	646.00	46 751.02	0.01
USD ZIMMER HLDGS INC COM USD0.01	198.00	19 653.48	0.00
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	920.00	39 606.00	0.01
アメリカ合衆国合計		24 725 231.46	4.03
無記名株合計		39 137 241.60	6.37
参加証書			
スイス			
CHF LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10	3.00	17 523.06	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10 (POST-SUBD)	89.00	13 584.74	0.00
スイス合計		31 107.80	0.01
参加証書合計		31 107.80	0.01
その他の株式			
オランダ			
EUR ING GROEP NV CVA EURO.24	5 666.00	64 956.84	0.01
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	2 554.00	113 001.79	0.02
オランダ合計		177 958.63	0.03
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	1 014.00	261 157.08	0.04
スイス合計		261 157.08	0.04
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	270.00	20 601.00	0.01
アメリカ合衆国合計		20 601.00	0.01
その他の株式合計		459 716.71	0.08
優先株式			
ドイツ			
EUR FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV	284.00	11 577.61	0.00
EUR HENKEL AG&CO.KGAA NON-VTG PRF NPV	322.00	34 065.03	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	141.00	6 375.86	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	184.00	21 283.49	0.00
ドイツ合計		73 301.99	0.01
優先株式合計		73 301.99	0.01
記名株式			
フランス			
EUR LAGARDERE SCA EUR6.10 (REGD)	250.00	7 084.72	0.00
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2 (REGD)	292.00	26 559.48	0.01
フランス合計		33 644.20	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	358.00	36 792.77	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV (REGD) (VINKULIERT)	662.00	106 480.54	0.02
EUR BASF SE NPV	1 390.00	91 897.42	0.02
EUR BAYER AG NPV (REGD)	1 194.00	133 589.46	0.02
EUR BRENTAG AG	159.00	7 734.33	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV (REGD)	1 360.00	94 417.09	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV (REGD)	2 013.00	35 721.93	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV (REGD)	351.00	29 856.04	0.00
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	223.00	3 249.07	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV (REGD)	1 540.00	37 209.75	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV (REGD)	4 400.00	76 247.74	0.01
EUR E.ON SE NPV	2 861.00	29 177.40	0.00
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV (REGD)	96.00	10 034.50	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	2 202.00	29 259.24	0.00
EUR K&S AG NPV	133.00	2 793.34	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV (REGD)	300.00	57 408.16	0.01
EUR OSRAM LICHT AG NPV	54.00	2 398.58	0.00
EUR PROSIEBENSAT1 MED. NPV	294.00	14 603.42	0.00
EUR SIEMENS AG NPV (REGD)	1 183.00	112 876.14	0.02
GBP TUI AG NPV (REGD)	372.00	6 258.31	0.00
EUR UNITED INTERNET AG NPV (REGD)	215.00	11 042.30	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	654.00	19 821.58	0.00
ドイツ合計		948 869.11	0.15
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV	1 312.00	4 938.96	0.00
EUR TENARIS S. A. USD1	961.00	9 857.78	0.00
ルクセンブルグ合計		14 796.74	0.00
オランダ			
USD CHICAGO BRIDGE & I EURO.01 (REG)	200.00	7 764.00	0.00
EUR QIAGEN NV COM EURO.01	565.00	12 789.61	0.00
オランダ合計		20 553.61	0.00
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	2 139.00	7 445.76	0.00
ポルトガル合計		7 445.76	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50 (REGD)	19 590.00	83 411.61	0.02
EUR BBVA (BILB-VIZ-ARG) EURO.49	9 604.00	61 271.28	0.01
EUR MAPFRE SA EURO.10	3 639.00	8 107.48	0.00
スペイン合計		152 790.37	0.03
スイス			
CHF ABB LTD CHF1.03 (REGD)	3 386.00	58 060.82	0.01
CHF ACTELION CHF0.50 (REGD)	119.00	15 574.00	0.00
CHF ADECCO SA CHF1 (REGD)	291.00	17 749.96	0.00
CHF ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)	124.00	5 651.49	0.00
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	660.32	74 662.72	0.01
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04 (REGD)	2 552.00	44 830.92	0.01
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	3 518.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10 (REGD)	83.00	29 306.98	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	17.00	31 639.10	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	483.00	20 387.21	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1 (REGD) (POST-SUBD)	57.00	7 509.88	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	383.00	16 042.90	0.00
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	321.00	13 532.29	0.00
CHF LONZA GROUP AG CHF1 (REGD)	70.00	10 677.79	0.00
CHF NESTLE SA CHF0.10 (REGD)	4 609.00	338 258.72	0.06
CHF NOVARTIS AG CHF0.50 (REGD)	3 265.00	250 136.63	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	35.00	12 578.69	0.00
CHF RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	754.00	48 750.79	0.01
CHF SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1 (REGD) (POST-SUBD)	89.00	13 680.28	0.00
CHF SGS LTD CHF1 (REGD)	7.00	13 547.06	0.00
CHF SONOVA HOLDING AG	96.00	11 486.46	0.00
CHF SULZER AG CHF0.01	57.00	5 187.38	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF0.45 (REGD)	68.00	4 502.81	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1 (REGD)	41.00	10 387.55	0.00
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	187.00	14 928.61	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1 (REGD)	34.00	16 839.90	0.00
CHF SYNGENTA CHF0.1 (REGD)	157.00	57 596.55	0.01
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	699.00	39 954.84	0.01
CHF TRANSOCEAN LTD COM CHF15	191.00	1 944.21	0.00
USD TRANSOCEAN LTD COM CHF15	198.00	2 063.16	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	5 173.00	84 967.15	0.02
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	219.00	48 260.58	0.01
スイス合計		1 324 215.43	0.22
アメリカ合衆国			
USD CAMERON INTL CORP COM USD0.01	430.00	28 233.80	0.00
アメリカ合衆国合計		28 233.80	0.00
記名株式合計		2 530 549.02	0.41
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUF5 EURO.5	850.00	9 613.95	0.00
アイルランド合計		9 613.95	0.00
イスラエル			
USD TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)	641.00	39 408.68	0.01
イスラエル合計		39 408.68	0.01
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	81.00	3 559.30	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	317.00	8 254.54	0.00
ルクセンブルグ合計		11 813.84	0.00
預託証券合計		60 836.47	0.01
投資証券、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	193.00	3 393.01	0.00
カナダ合計		3 393.01	0.00
フランス			
EUR ICADE	152.00	10 772.89	0.00
フランス合計		10 772.89	0.00
日本			
JPY 日本ビルファンド投資法人	2.00	10 275.48	0.00
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	6.00	8 152.65	0.00
日本合計		18 428.13	0.00
シンガポール			
SGD CAPITALAND MALL TRUST	5 000.00	6 990.80	0.00
シンガポール合計		6 990.80	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/為替予約契約/ 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 AMERICAN CAPITAL A COM STK USD0.01	400.00	6 828.00	0.00
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	232.00	6 802.24	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	92.00	8 888.12	0.00
USD VORNADO REALTY TRUST-SBI	263.00	23 264.98	0.01
アメリカ合衆国合計		45 783.34	0.01
投資証券、クローズド・エンド型合計		85 368.17	0.01
新株引受権			
イタリア			
EUR SAIPEM SPA RIGHTS 11.02.16	232.00	728.00	0.00
イタリア合計		728.00	0.00
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES (STOCK DIVIDEND) OPTION RIGHTS 29.01.16	189.00	83.85	0.00
EUR IBERDROLA SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 26.01.16	8 600.00	1 191.12	0.00
スペイン合計		1 274.97	0.00
新株引受権合計		2 002.97	0.00
固定利付ノート			
豪ドル			
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 4.00000% 13-20.04.23	970 000.00	748 059.55	0.12
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 10-21.04.16	610 000.00	435 112.28	0.07
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.50000% 13-17.11.17	830 000.00	601 971.75	0.10
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 09-15.06.20	430 000.00	351 603.45	0.06
豪ドル合計		2 136 747.03	0.35
英ポンド			
GBP EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.00000% 98-07.12.28	460 000.00	925 650.69	0.15
英ポンド合計		925 650.69	0.15
米ドル			
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.00000% 12-23.10.22	2 150 000.00	2 145 592.50	0.35
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 10-14.07.20	1 200 000.00	1 308 000.00	0.21
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 13-15.03.18	2 800 000.00	2 794 064.00	0.45
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 16-15.03.21	1 600 000.00	1 629 392.00	0.27
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO-144A 0.96400% 15-15.04.16	6 061 000.00	6 063 806.24	0.99
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 13-15.03.18	2 000 000.00	1 997 368.00	0.32
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 14-15.10.19	2 900 000.00	2 958 342.20	0.48
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 12-12.09.17	2 200 000.00	2 198 816.40	0.36
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	650 000.00	655 404.10	0.11
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 2.50000% 15-28.04.20	3 550 000.00	3 524 014.00	0.57
USD TELEFONICA EMISIONES SA 3.99200% 11-16.02.16	250 000.00	250 253.50	0.04
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	2 650 000.00	2 768 796.85	0.45
米ドル合計		28 293 849.79	4.60
固定利付ノート合計		31 356 247.51	5.10
固定利付メディアム・ターム・ノート			
豪ドル			
AUD HYPOTHEKENBANK FRANKFURT AG 6.00000% 06-30.11.16	200 000.00	143 938.65	0.02
豪ドル合計		143 938.65	0.02
カナダ・ドル			
CAD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 4.45000% 06-26.10.18	340 000.00	262 176.30	0.04
カナダ・ドル合計		262 176.30	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
英ポンド			
GBP GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 6.25000% 02-15.12.17	110 000.00	170 259.15	0.03
GBP KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.00000% 00-07.12.28	400 000.00	819 609.30	0.13
英ポンド合計		989 868.45	0.16
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.50000% 06-27.06.16	1 700 000.00	1 733 221.40	0.28
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.50000% 11-16.05.16	2 000 000.00	2 009 620.00	0.33
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 12-12.09.19	3 000 000.00	2 993 388.00	0.49
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 1.00000% 12-24.10.17	4 500 000.00	4 498 245.00	0.73
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.37500% 12-21.06.17	3 000 000.00	3 011 760.00	0.49
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.00000% 14-30.09.19	2 900 000.00	2 933 408.00	0.48
USD SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 0.62500% 14-19.09.16	3 000 000.00	2 999 580.00	0.49
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	1 170 000.00	1 179 088.56	0.19
米ドル合計		21 358 310.96	3.48
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		22 754 294.36	3.70
固定利付債券			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17	2 070 000.00	1 514 144.21	0.25
AUD AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27	3 700 000.00	3 132 075.77	0.51
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 11-21.07.22	500 000.00	421 856.46	0.07
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23	1 050 000.00	809 339.26	0.13
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.750000% 04-15.11.16	260 000.00	189 102.81	0.03
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 03-17.10.22	810 000.00	693 583.13	0.11
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 7.000000% 01-15.10.19	410 000.00	337 975.93	0.06
豪ドル合計		7 098 077.57	1.16
カナダ・ドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.09.17	700 000.00	505 815.07	0.08
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.06.23	3 610 000.00	2 655 578.75	0.43
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 08-01.06.19	1 990 000.00	1 567 242.78	0.26
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21	2 350 000.00	1 891 825.12	0.31
CAD CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 01-01.06.33	3 100 000.00	3 465 681.24	0.56
CAD EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.12500% 14-04.02.19	560 000.00	411 859.16	0.07
カナダ・ドル合計		10 498 002.12	1.71
ユーロ			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 2.00000% 13-15.08.23	2 000 000.00	2 496 181.15	0.41
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 6.50000% 97-04.07.27	1 000 000.00	1 817 546.44	0.30
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 5.62500% 98-04.01.28	1 100 000.00	1 902 336.96	0.31
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37	1 100 000.00	1 882 398.99	0.31
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 07-04.01.18	3 000 000.00	3 527 555.50	0.57
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 08-04.07.40	1 400 000.00	2 760 093.14	0.45
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19	3 200 000.00	3 931 044.36	0.64
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 09-04.01.20	3 600 000.00	4 456 509.49	0.72
ユーロ合計		22 773 666.03	3.71
英ポンド			
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.75000% 07-07.12.30	1 140 000.00	2 203 446.83	0.36
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19	400 000.00	636 452.58	0.10
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.75000% 11-07.09.21	1 090 000.00	1 775 152.04	0.29
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 10-07.12.40	1 600 000.00	3 095 961.36	0.50
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 2.75000% 14-07.09.24	860 000.00	1 344 950.78	0.22
英ポンド合計		9 055 963.59	1.47

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	1 800 000.00	2 405 088.00	0.39
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 12-04.10.17	4 000 000.00	4 036 280.00	0.66
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	1 000 000.00	1 038 570.00	0.17
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	2 550 000.00	2 538 481.65	0.41
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 1.00000% 13-15.06.18	2 000 000.00	1 994 862.00	0.32
USD FMS WERTMANAGEMENT 1.00000% 12-21.11.17	400 000.00	399 984.80	0.07
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	2 650 000.00	2 919 703.75	0.48
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 1.75000% 13-04.09.18	500 000.00	505 956.00	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	2 500 000.00	2 589 240.00	0.42
USD ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	2 150 000.00	2 692 531.00	0.44
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 5.12500% 06-14.03.16	2 830 000.00	2 842 848.20	0.46
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.65000% 12-27.09.19	250 000.00	249 763.25	0.04
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.10000% 12-25.10.17	450 000.00	449 742.15	0.07
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 2.75000% 12-17.05.17	950 000.00	961 732.50	0.16
米ドル合計		25 624 783.30	4.17
固定利付債券合計		75 050 492.61	12.22
固定利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30	4 000 000.00	5 992 656.00	0.97
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	2 000 000.00	2 809 922.00	0.46
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38	2 000 000.00	2 637 110.00	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 11-15.05.41	5 400 000.00	7 129 474.20	1.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.62500% 06-15.11.16	2 000 000.00	2 062 656.00	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 08-15.02.18	1 500 000.00	1 580 742.00	0.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 08-15.05.18	10 600 000.00	11 329 163.40	1.84
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 09-15.02.19	7 500 000.00	7 890 817.50	1.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20	10 700 000.00	11 711 899.00	1.91
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.09.18	5 600 000.00	5 665 844.80	0.92
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 12-31.12.17	6 000 000.00	5 994 846.00	0.98
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	8 000 000.00	8 022 496.00	1.31
米ドル合計		72 827 626.90	11.86
固定利付米国中期国債合計		72 827 626.90	11.86
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		244 368 786.11	39.78
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			
固定利付ノート			
豪ドル			
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 6.00000% 11-01.02.18	850 000.00	648 313.16	0.10
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25	600 000.00	486 051.31	0.08
豪ドル合計		1 134 364.47	0.18
米ドル			
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 2.37500% 11-08.09.16	500 000.00	501 244.00	0.08
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S 2.75000% 12-27.03.18	500 000.00	506 215.00	0.08
USD BANK OF NEW YORK MELLON CO 1.30000% 12-25.01.18	4 500 000.00	4 490 307.00	0.73
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	1 500 000.00	1 526 910.00	0.25
USD HEINEKEN NV-REG-S 1.40000% 12-01.10.17	450 000.00	449 665.20	0.08
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 2.00000% 12-20.06.17	350 000.00	353 479.00	0.06
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.25000% 12-05.10.17	1 550 000.00	1 544 979.55	0.25
米ドル合計		9 372 799.75	1.53
固定利付ノート合計		10 507 164.22	1.71

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付メディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.50000% 13-16.01.18	3 000 000.00	3 003 372.00	0.49
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.37500% 13-10.01.18	5 000 000.00	5 007 785.00	0.81
米ドル合計		8 011 157.00	1.30
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		8 011 157.00	1.30
固定利付債券			
米ドル			
USD NATIONAL BANK OF CANADA 2.10000% 15-14.12.18	750 000.00	753 301.50	0.12
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.25000% 12-15.12.17	1 200 000.00	1 194 024.00	0.20
米ドル合計		1 947 325.50	0.32
固定利付債券合計		1 947 325.50	0.32
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		20 465 646.72	3.33
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			
無記名株			
カナダ			
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	419.00	12 058.62	0.00
カナダ合計		12 058.62	0.00
無記名株合計		12 058.62	0.00
株式に係るストリップ			
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV STRIP	832.00	0.90	0.00
ベルギー合計		0.90	0.00
株式に係るストリップ合計		0.90	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場で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		12 059.52	0.00
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付債券			
米ドル			
USD UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD-REG-S 2.95000% 15-24.09.20	2 000 000.00	1 992 214.00	0.33
米ドル合計		1 992 214.00	0.33
固定利付債券合計		1 992 214.00	0.33
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 992 214.00	0.33

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
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			
投資証書、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	152 235.00	20 222 897.40	3.29
アイルランド合計		20 222 897.40	3.29
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	162 048.00	18 388 329.31	2.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-ACC	2 471.00	25 346 554.31	4.13
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	7 124.00	88 740 034.76	14.45
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	2 213.00	31 447 061.95	5.12
USD UBS (LUX) BOND SICAV - EMERGING ECONOMIES CORP (USD)-I-X-DIS	129 381.00	12 643 111.32	2.06
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	1 845.00	18 877 154.40	3.07
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD)-U-X-ACC	297.00	4 996 897.29	0.81
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	406.00	6 260 601.20	1.02
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	3 103.00	49 921 963.87	8.13
USD UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV 2 - GLOBAL QUANTITATIVE I-X-AC	35.30	50 405 606.01	8.20
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	155.00	1 606 632.35	0.26
ルクセンブルグ合計		308 633 946.77	50.24
投資証書、オープン・エンド型合計		328 856 844.17	53.53
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			
		328 856 844.17	53.53
投資有価証券合計		595 695 550.52	96.97
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			
EUR EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.03.16	328.00	-659 427.24	-0.10
USD S&P500 EMINI FUTURE 18.03.16	-55.00	325 367.50	0.05
GBP FTSE 100 INDEX FUTURE 18.03.16	62.00	292 198.28	0.05
JPY NIKKEI 225 (SGX) INDEX FUTURE 10.03.16	-18.00	-111 888.58	-0.02
指数に係る金融先物合計		-153 750.04	-0.02
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-153 750.04	-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.IG.25 DEC20 CDI REC 1.00000% 15-20.12.20	3 500 000.00	1 156.64	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		1 156.64	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引さ れていない派生商品合計		1 156.64	0.00
派生商品合計		-152 593.40	-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／為替予約契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
為替予約契約					
為替予約契約（購入／売却）					
USD	7 589 055.70	JPY	892 605 000.00	14.4.2016	202 764.24 0.03
USD	6 677 518.29	AUD	9 703 833.41	14.4.2016	-163 093.36 -0.03
NOK	26 758 930.84	USD	3 020 649.82	14.4.2016	43 207.60 0.01
USD	155 757.66	ZAR	2 630 000.00	14.4.2016	-7 324.59 0.00
USD	10 668 169.05	GBP	7 450 000.00	14.4.2016	98 551.21 0.02
USD	479 300.47	SGD	690 000.00	14.4.2016	-4 748.03 0.00
USD	966 406.83	SEK	8 241 790.00	14.4.2016	2 951.06 0.00
USD	372 928.27	DKK	2 550 000.00	14.4.2016	2 382.39 0.00
USD	34 918 152.12	EUR	32 038 000.00	14.4.2016	182 746.47 0.03
USD	1 161 068.79	HKD	9 070 000.00	14.4.2016	-4 320.72 0.00
USD	1 295 681.49	CHF	1 300 000.00	14.4.2016	22 951.02 0.00
USD	303 632.21	MXN	5 560 000.00	14.4.2016	-856.93 0.00
USD	7 912 262.73	CAD	11 479 000.00	14.4.2016	-245 300.44 -0.04
USD	4 546 906.79	JPY	530 840 000.00	14.4.2016	154 214.66 0.02
USD	6 732 930.24	AUD	9 586 111.80	25.2.2016	-40 207.52 -0.01
USD	966 878.66	SEK	8 240 000.00	25.2.2016	5 272.59 0.00
USD	12 042 485.22	JPY	1 423 435 000.00	25.2.2016	280 035.56 0.05
USD	159 728.72	ZAR	2 630 000.00	25.2.2016	-4 947.32 0.00
NOK	27 334 797.95	USD	3 136 891.94	25.2.2016	-5 713.76 0.00
USD	1 163 873.97	HKD	9 070 000.00	25.2.2016	-1 599.86 0.00
USD	482 861.23	SGD	690 000.00	25.2.2016	-1 737.83 0.00
USD	34 904 878.89	EUR	32 086 408.75	25.2.2016	166 530.19 0.03
USD	371 834.11	DKK	2 550 000.00	25.2.2016	1 868.77 0.00
USD	12 091 764.10	GBP	8 450 000.00	25.2.2016	105 164.51 0.02
USD	2 189 035.34	CHF	2 221 719.83	25.2.2016	18 772.45 0.00
USD	7 227 141.05	CAD	10 196 000.00	25.2.2016	-18 189.16 0.00
USD	304 208.61	MXN	5 560 000.00	25.2.2016	-1 334.37 0.00
ZAR	4 850 000.00	USD	300 293.40	25.2.2016	3 386.74 0.00
ZAR	4 850 000.00	USD	297 496.95	14.4.2016	3 244.07 0.00
EUR	1 060 000.00	USD	1 156 946.54	14.4.2016	-7 700.96 0.00
EUR	1 060 000.00	USD	1 155 340.64	25.2.2016	-7 731.70 0.00
為替予約契約（購入／売却）合計					779 236.98 0.13
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					17 580 580.02 2.86
その他の資産および負債					396 560.64 0.06
純資産合計					614 299 334.76 100.00

* 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。

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	2016年1月31日	2015年1月31日	2014年1月31日
純資産額 (米ドル)		124,535,278.13	109,110,267.35	88,626,955.40
クラスF-a c c ¹	LU1317082466			
発行済受益証券口数		240,2770	—	—
1口当たり純資産価格 (米ドル)		100.74	—	—
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ²		100.74	—	—
クラスP-a c c	LU0033040865			
発行済受益証券口数		40,872,1420	34,321,3510	30,128,3100
1口当たり純資産価格 (米ドル)		2,986.89	3,174.82	2,941.65
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ²		2,986.89	3,174.82	2,946.06
クラスQ-a c c ³	LU0941351685			
発行済受益証券口数		23,548,2680	1,344,0000	—
1口当たり純資産価格 (米ドル)		103.21	108.73	—
1口当たり発行および買戻価格 (米ドル) ²		103.21	108.73	—

¹ 初回純資産価格計算日：2016年1月14日

² 注記1を参照のこと。

³ 初回純資産価格計算日：2014年2月3日

パフォーマンス

	通貨	2015年／2016年	2014年／2015年	2013年／2014年
クラスF-a c c ¹	米ドル	—	—	—
クラスP-a c c	米ドル	-5.9%	7.6%	9.5%
クラスQ-a c c	米ドル	-5.1%	—	—

¹ 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	82.44
ユーロ	6.46
英ポンド	1.99
日本円	1.44
カナダ・ドル	1.32
豪ドル	1.21
スイス・フラン	0.59
スウェーデン・クローネ	0.18
香港ドル	0.18
デンマーク・クローネ	0.13
シンガポールドル	0.06
イスラエル・シケル	0.04
ノルウェー・クローネ	0.04
合計	<u>96.08</u>

商品別分類 (対純資産割合 (%))

投資証券、オープン・エンド型	63.66
無記名株	15.33
固定利付債券	6.44
固定利付米国中期国債	4.13
固定利付ノート	3.23
固定利付メディアム・ターム・ノート	2.07
記名株式	0.99
その他の株式	0.17
優先株式	0.02
投資証券、クローズド・エンド型	0.02
預託証券	0.01
参加証券	0.01
合計	<u>96.08</u>

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
	2016年1月31日現在	
資産		
投資有価証券、取得原価	118,373,883.21	13,132,399
投資有価証券、未実現評価(損)益	1,276,701.06	141,637
投資有価証券合計(注1)	119,650,584.27	13,274,036
現金預金、要求払預金および貯蓄預金	4,527,880.58	502,323
その他の流動資産(委託証拠金)	426,995.42	47,371
発行受益証券未収金	221,261.76	24,547
有価証券に係る未収利息	160,800.94	17,839
流動資産に係る未収利息	41.62	5
未収分配金	14,214.34	1,577
その他の未収金	181.21	20
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	(77,899.35)	(8,642)
為替予約契約に係る未実現(損)益(注1)	283,114.97	31,409
スワップに係る未実現(損)益(注1)	231.33	26
資産合計	125,207,407.09	13,890,510
負債		
当座借越に係る未払利息	(20.67)	(2)
買戻受益証券未払金	(583,365.60)	(64,719)
報酬引当金(注2)	(83,653.74)	(9,281)
年次税引当金(注3)	(2,156.60)	(239)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(2,932.35)	(325)
引当金合計	(88,742.69)	(9,845)
負債合計	(672,128.96)	(74,566)
期末現在純資産額	124,535,278.13	13,815,944

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2015年2月1日	至2016年1月31日
収益		
流動資産に係る利息	3,382.78	375
有価証券に係る利息	539,940.60	59,901
分配金	373,723.25	41,461
スワップに係る受取利息 (注1)	121,044.44	13,429
貸付有価証券に係る収益 (注12)	25,069.33	2,781
その他の収益 (注4)	71,895.71	7,976
収益合計	1,135,056.11	125,923
費用		
スワップに係る支払利息 (注1)	(26,046.09)	(2,890)
報酬 (注2)	(2,173,341.81)	(241,111)
年次税 (注3)	(25,841.87)	(2,867)
貸付有価証券に係るコスト (注12)	(10,027.73)	(1,112)
その他の手数料および報酬 (注2)	(7,579.19)	(841)
現金および当座借越に係る利息	(1,796.11)	(199)
費用合計	(2,244,632.80)	(249,020)
投資に係る純 (損) 益	(1,109,576.69)	(123,096)
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	43,523.13	4,828
金融先物に係る実現 (損) 益	143,310.50	15,899
為替予約契約に係る実現 (損) 益	2,402,418.53	266,524
スワップに係る実現 (損) 益	37,840.44	4,198
外国為替に係る実現 (損) 益	167,233.23	18,553
実現 (損) 益合計	2,794,325.83	310,003
当期実現純 (損) 益	1,684,749.14	186,906
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	(7,968,958.95)	(884,076)
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	(158,928.93)	(17,632)
為替予約契約に係る未実現評価 (損) 益	(730,587.70)	(81,051)
スワップに係る未実現評価 (損) 益	(158,486.04)	(17,582)
未実現評価 (損) 益の変動合計	(9,016,961.62)	(1,000,342)
運用の結果による純資産の純増 (減)	(7,332,212.48)	(813,436)

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2015年2月1日 至2016年1月31日	
期首現在純資産額	109,110,267.35	12,104,693
受益証券発行	54,596,673.55	6,056,955
受益証券買戻し	(31,839,450.29)	(3,532,269)
受益証券発行 (買戻し) 純額合計	22,757,223.26	2,524,686
純投資 (損) 益	(1,109,576.69)	(123,096)
実現 (損) 益合計	2,794,325.83	310,003
未実現評価 (損) 益の変動合計	(9,016,961.62)	(1,000,342)
運用の結果による純資産の純増 (減)	(7,332,212.48)	(813,436)
期末現在純資産額	124,535,278.13	13,815,944

発行済受益証券口数の変動

自2015年2月1日 至2016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	0.0000
発行受益証券口数	240.2770
買戻受益証券口数	0.0000
期末現在発行済受益証券口数	240.2770
クラス	P - a c c
期首現在発行済受益証券口数	34,321.3510
発行受益証券口数	16,514.3350
買戻受益証券口数	(9,963.5440)
期末現在発行済受益証券口数	40,872.1420
クラス	Q - a c c
期首現在発行済受益証券口数	1,344.0000
発行受益証券口数	22,791.2680
買戻受益証券口数	(587.0000)
期末現在発行済受益証券口数	23,548.2680

注記は、財務書類と不可分のものである。

U B S (Lux) ストラテジー・ファンドーグロース (米ドル)

2016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/為替予約契約/ 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	5 578.45	0.01
AUD	AMCOR LIMITED NPV	1 173.00	11 035.30	0.01
AUD	AMP LIMITED NPV(POST RECON)	807.00	3 065.36	0.00
AUD	APA GROUP NPV	1 080.00	6 478.19	0.01
AUD	ARISTOCRAT LEISURE NPV	925.00	6 706.56	0.01
AUD	ASX LTD NPV	153.00	4 583.31	0.00
AUD	AUST & NZ BANK GRP NPV	2 202.00	37 662.40	0.03
AUD	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV	415.00	3 152.73	0.00
AUD	BHP BILLITON LTD NPV	2 095.00	22 747.14	0.02
AUD	BK OF QUEENSLAND NPV	648.00	5 999.97	0.01
AUD	BRAMBLES LTD NPV	1 289.00	10 148.05	0.01
AUD	CALTEX AUSTRALIA NPV	211.00	5 544.67	0.00
AUD	CHALLENGER LIMITED NPV	1 099.00	6 172.38	0.01
AUD	CIMIC GROUP LTD NPV	94.00	1 600.44	0.00
AUD	CMNWLTH BK OF AUST NPV	1 235.00	68 724.32	0.06
AUD	COCA-COLA AMATIL NPV	396.00	2 355.73	0.00
AUD	COCHLEAR LTD NPV	82.00	5 438.91	0.00
AUD	COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)	413.00	3 038.21	0.00
AUD	CROWN RESORTS LTD NPV	368.00	3 193.94	0.00
AUD	CSL NPV	341.00	25 085.46	0.02
AUD	DEXUS PROPERTY GP NPV (STAPLED)	1 245.00	6 481.59	0.01
AUD	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV	67.00	1 852.10	0.00
AUD	FORTESCUE METALS G NPV	916.00	1 120.92	0.00
AUD	GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)	1 456.00	6 261.80	0.02
AUD	INCITEC PIVOT NPV	1 297.00	2 844.04	0.00
AUD	LEND LEASE GROUP NPV	435.00	3 996.99	0.00
AUD	MACQUARIE GP LTD NPV	202.00	10 227.69	0.01
AUD	NATL AUSTRALIA BK NPV	2 011.00	39 345.82	0.03
AUD	NEWCREST MINING NPV	406.00	3 698.93	0.00
AUD	ORICA LIMITED NPV	256.00	2 574.98	0.00
AUD	ORIGIN ENERGY NPV	1 036.00	3 004.54	0.00
AUD	QANTAS AIRWAYS NPV	1 322.00	3 628.25	0.00
AUD	QBE INS GROUP NPV	773.00	5 948.98	0.01
AUD	RAMSAY HEALTH CARE NPV	107.00	4 585.09	0.00
AUD	REA GROUP LIMITED NPV	182.00	6 797.35	0.01
AUD	RIO TINTO LIMITED NPV	389.00	10 766.98	0.01
AUD	SANTOS LIMITED NPV	934.00	2 087.70	0.00
AUD	SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT	3 990.00	12 277.12	0.01
AUD	SEEK LIMITED NPV	272.00	2 785.94	0.00
AUD	SONIC HEALTHCARE NPV	283.00	3 683.31	0.00
AUD	SOUTH32 LTD NPV	2 095.00	1 444.85	0.00
GBP	SOUTH32 LTD NPV	1 100.00	752.87	0.00
AUD	SUNCORP GROUP	943.00	7 744.23	0.01
AUD	SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)	129.00	600.41	0.00
AUD	TELSTRA CORP NPV	2 795.00	11 130.75	0.01
AUD	TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV	1 239.00	9 447.66	0.01
AUD	TREASURY WINE ESTA NPV	1 122.00	7 190.44	0.01
AUD	WESFARMERS LTD NPV	918.00	27 382.98	0.02
AUD	WESTFIELD CORP NPV STAPLED UNITS	1 240.00	8 683.43	0.01
AUD	WESTPAC BKG CORP NPV	2 463.00	53 746.96	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
AUD WOODSIDE PETROLEUM NPV	718.00	14 195.17	0.01
AUD WOOLWORTHS LTD NPV	943.00	16 195.51	0.01
オーストラリア合計		530 796.90	0.43
オーストリア			
EUR ANDRITZ AG NPV (BR)	72.00	3 330.55	0.01
EUR ERSTE GROUP BK AG NPV	108.00	3 123.71	0.00
EUR OMV AG NPV (VAR)	77.00	1 970.89	0.00
EUR VOESTALPINE AG NPV	96.00	2 517.97	0.00
オーストリア合計		10 943.12	0.01
ベルギー			
EUR AGEAS NPV (POST SPLIT)	279.00	11 274.16	0.01
EUR ANHEUSER-BUSCH INB NPV	554.00	69 446.94	0.06
EUR COLRUYT SA NPV	78.00	4 151.63	0.00
EUR DELHAIZE GROUP NPV	61.00	6 365.53	0.01
EUR GPE BRUXELLES LAM NPV	63.00	4 762.98	0.01
EUR KBC GROUP NV NPV	241.00	13 766.26	0.01
EUR PROXIMUS SA NPV	98.00	3 366.80	0.00
EUR SOLVAY SA NPV	35.00	2 881.66	0.00
EUR TELENET GRP HLDG NPV	70.00	3 630.39	0.00
EUR UCB NPV	130.00	11 059.20	0.01
EUR UMICORE NPV	98.00	3 583.65	0.00
ベルギー合計		134 289.20	0.11
バミューダ			
USD ARCH CAPITAL GROUP COM USDO.01	100.00	6 755.00	0.01
USD AXIS CAPITAL HLDGS COM USDO.0125	100.00	5 391.00	0.00
USD MARVELL TECH GROUP COM USDO.002	300.00	2 655.00	0.00
USD RENAISSANCE RE HLG COM USD1	52.00	5 857.80	0.01
USD SIGNET JEWELERS LT ORD USDO.18	100.00	11 600.00	0.01
バミューダ合計		32 258.80	0.03
カナダ			
CAD AGNICO EAGLE MINES LTD COM	103.00	3 038.95	0.00
CAD AGRUM INC COM NPV	99.00	8 605.21	0.01
CAD ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VTG SH	341.00	14 776.46	0.01
CAD ALTAGAS LTD COM NPV	100.00	2 329.37	0.00
CAD ARC RESOURCES COM NPV	164.00	2 194.44	0.00
CAD BANK MONTREAL QUE COM	481.00	25 710.30	0.02
CAD BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM	936.00	38 171.64	0.03
CAD BARRICK GOLD CORP COM NPV	572.00	5 662.08	0.01
CAD BCE INC COM NEW	215.00	8 621.39	0.01
CAD BLACKBERRY LTD NPV	300.00	2 129.69	0.00
CAD BOMBARDIER INC CLASS' B' SUB-VTG NPV	1 100.00	766.03	0.00
CAD BROOKFIELD ASSET MGMT INC CL A LTD VT SH	664.00	19 954.21	0.02
CAD CAE INC COM	322.00	3 347.56	0.00
CAD CAMECO CORP COM	187.00	2 260.34	0.00
CAD CAN PACIFIC RYS COM NPV	112.00	13 402.59	0.01
CAD CANADIAN NAT RES LTD COM	782.00	16 665.25	0.01
CAD CANADIAN NATL RY CO COM	562.00	30 331.43	0.03
CAD CANADIAN OIL SANDS COM NPV	200.00	1 334.52	0.00
CAD CANADIAN TIRE LTD CL A	46.00	3 731.32	0.00
CAD CANADIAN UTILS LTD CL A	119.00	3 055.23	0.00
CAD CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM	265.00	17 181.45	0.01
CAD CENOVUS ENERGY INC COM NPV	415.00	5 090.00	0.01
CAD CGI GROUP INC 'A' SUB-VTG NPV	233.00	9 940.89	0.01
CAD CI FINANCIAL CORP COM NPV	139.00	3 056.07	0.00
CAD CRESCENT POINT EN COM NPV	195.00	2 151.96	0.00
CAD DOLLARAMA INC COM NPV	100.00	5 341.63	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
CAD	ELDORADO GOLD CORP NEW COM	400.00	903.89	0.00
CAD	ELEMENT FINL CORP COM NPV	600.00	6 297.39	0.01
CAD	ENBRIDGE INC COM	525.00	18 153.49	0.02
CAD	ENCANA CORP COM NPV	411.00	1 796.16	0.00
CAD	FINNING INTL INC COM NEW	156.00	1 977.64	0.00
CAD	FIRST QUANTUM MINERALS LTD COM	321.00	691.16	0.00
CAD	FORTIS INC COM	315.00	9 112.56	0.01
CAD	FRANCO NEVADA CORP COM NPV	93.00	4 099.34	0.00
CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC COM	200.00	5 025.40	0.01
CAD	GOLDCORP INC NEW COM	701.00	7 950.23	0.01
CAD	GREAT WEST LIFE CO INC COM	167.00	4 120.26	0.00
CAD	HUSKY ENERGY INC COM	204.00	2 020.79	0.00
CAD	IGM FINANCIAL INC COM	72.00	1 837.29	0.00
CAD	IMPERIAL OIL LTD COM NEW	321.00	9 797.09	0.01
CAD	INDUSTRIAL ALLNCE INS FIN SRVC COM	111.00	3 280.50	0.00
CAD	INTACT FINL CORP COM NPV	68.00	4 058.98	0.00
CAD	INTER PIPELINE LTD COM NPV	200.00	3 226.15	0.00
CAD	KEYERA CORPORATION COM NPV	200.00	5 457.45	0.01
CAD	KINROSS GOLD CORP COM NO PAR	666.00	1 093.24	0.00
CAD	LOBLAW COS LTD COM	143.00	6 685.36	0.01
USD	LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01	89.00	5 524.23	0.00
CAD	MAGNA INTL INC COM NPV	375.00	12 969.44	0.01
CAD	MANULIFE FINL CORP COM	1 306.00	18 069.16	0.02
CAD	MEG ENERGY CORP COM NPV	149.00	615.16	0.00
CAD	METHANEX CORP COM	100.00	2 653.40	0.00
CAD	METRO INC CL A SUB	135.00	3 972.54	0.00
CAD	NATL BK OF CANADA COM NPV	194.00	5 510.17	0.01
CAD	OPEN TEXT CORP COM	100.00	4 870.49	0.00
CAD	PEMBINA PIPELINE C COM NPV	218.00	4 932.40	0.01
CAD	PEYTO EXPLORATION COM NPV	100.00	2 141.06	0.00
CAD	POTASH CORP SASK INC COM	794.00	12 886.81	0.01
CAD	POWER CORP CDA COM	366.00	7 727.03	0.01
CAD	POWER FINANCIAL CORP COM	195.00	4 479.91	0.00
CAD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	200.00	6 723.75	0.01
USD	RESTAURANT BRANDS COM NPV	50.00	1 679.00	0.00
CAD	ROGERS COMMS INC CLASS' B' COM CAD1.62478	351.00	11 964.80	0.01
CAD	ROYAL BK OF CANADA COM NPV	1 056.00	54 441.50	0.04
CAD	SAPUTO INC COM	200.00	4 888.97	0.00
CAD	SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV	266.00	4 583.76	0.00
CAD	SILVER WHEATON CORP COM	191.00	2 240.83	0.00
CAD	SNC-LAVALIN GROUP INC COM	100.00	2 845.98	0.00
CAD	SUN LIFE FINL INC COM	521.00	14 875.67	0.01
CAD	SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'	903.00	21 290.84	0.02
CAD	TECK RESOURCES LTD CLASS' B' SUB-VTG COM NPV	382.00	1 419.69	0.00
CAD	TORONTO-DOMINION COM NPV	1 309.00	49 439.23	0.04
CAD	TOURMALINE OIL CP COM NPV	97.00	1 925.18	0.00
CAD	TRANSCANADA CORP COM NPV	521.00	18 011.48	0.02
CAD	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC COM NPV	183.00	16 775.27	0.01
CAD	YAMANA GOLD INC COM	500.00	856.28	0.00
カナダ合計			646 748.41	0.52
デンマーク				
DKK	A. P. MOELLER-MAERSK SER' B' DKK1000	5.00	6 394.22	0.01
DKK	A. P. MOLLER-MAERSK 'A' DKK1000	3.00	3 775.64	0.00
DKK	CARLSBERG SER' B' DKK20	71.00	5 950.25	0.00
DKK	CHR. HANSEN HLDG DKK10	106.00	6 459.73	0.01
DKK	COLOPLAST DKK1 B	61.00	4 975.10	0.00
DKK	DANSKE BANK A/S DKK10	625.00	16 737.71	0.01
DKK	DSV DKK1	127.00	4 918.43	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
DKK ISS A/S DKK1	208.00	7 328.56	0.01
DKK NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER' B'	1 355.00	74 637.62	0.06
DKK NOVOZYMES A/S SER' B' DKK2 (POST CONS)	236.00	9 786.50	0.01
DKK PANDORA A/S DKK1	74.00	9 838.98	0.01
DKK TDC A/S DKK1	457.00	1 948.77	0.00
DKK VESTAS WIND SYSTEM DKK1	155.00	10 066.12	0.01
DKK WILLIAM DEMANT HOL DKK1.00	51.00	4 473.78	0.00
デンマーク合計		167 291.41	0.13
フィンランド			
EUR ELISA CORPORATION EURO.50	163.00	5 875.02	0.00
EUR FORTUM OYJ EUR3.40	187.00	2 923.86	0.00
EUR KONE CORPORATION NPV ORD 'B'	295.00	12 886.30	0.01
EUR NOKIA OYJ EURO.06	3 715.00	26 530.78	0.02
EUR NOKIAN RENKAAT OYJ NPV	91.00	3 072.16	0.00
EUR SAMPO OYJ SER' A' NPV	390.00	18 736.78	0.02
EUR STORA ENSO OYJ NPV SER' R'	649.00	5 249.33	0.00
EUR UPM-KYMMENE CORP NPV	365.00	5 904.48	0.01
EUR WARTSILA OYJ ABP SER' B' EUR3.50	130.00	5 810.93	0.01
フィンランド合計		86 989.64	0.07
フランス			
EUR ACCOR EUR3	120.00	4 544.61	0.00
EUR AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)	233.00	24 006.64	0.02
EUR AIRBUS GROUP NV EUR1	368.00	23 023.60	0.02
EUR ALCATEL-LUCENT EURO.05	1 661.00	6 560.09	0.01
EUR ALSTOM EUR7.00	96.00	2 567.32	0.00
EUR ARKEMA EUR10	46.00	2 865.01	0.00
EUR ATOS SE EUR1	47.00	3 699.80	0.00
EUR AXA EUR2.29	1 160.00	28 580.40	0.02
EUR BNP PARIBAS EUR2	737.00	34 869.42	0.03
EUR BOUYGUES EUR1	135.00	5 268.26	0.00
EUR BUREAU VERITAS EURO.12	142.00	2 698.11	0.00
EUR CAP GEMINI EUR8	149.00	13 555.84	0.01
EUR CARREFOUR EUR2.50	321.00	9 110.68	0.01
EUR CASINO GUICH-PERR EUR1.53	37.00	1 670.30	0.00
EUR CHRISTIAN DIOR EUR2	36.00	6 069.00	0.01
EUR CIE DE ST-GOBAIN EUR4	379.00	15 557.03	0.01
EUR CREDIT AGRICOLE SA EUR3	490.00	4 875.76	0.00
EUR DANONE EURO.25	419.00	28 766.89	0.02
EUR DASSAULT SYSTEMES EURO.50	70.00	5 392.18	0.00
EUR EDENRED EUR2	169.00	3 165.42	0.00
EUR EDF EURO.5	121.00	1 576.37	0.00
EUR ENGIE EUR1	712.00	11 321.32	0.01
EUR ESSILOR INTL EURO.18	134.00	16 580.14	0.01
EUR EUTELSAT COMMUNICA EUR1	111.00	3 575.01	0.00
EUR GPE EUROTUNNEL SE EURO.40	386.00	4 423.14	0.00
EUR HERMES INTL NPV	23.00	7 803.37	0.01
EUR ILIAD NPV	25.00	6 250.19	0.01
EUR INGENICO GROUP EUR1	54.00	6 357.26	0.01
EUR KERING EUR4	69.00	11 576.26	0.01
EUR KLEPIERRE EUR1.40	239.00	10 318.54	0.01
EUR L' OREAL EURO.20	134.00	22 843.91	0.02
EUR LEGRAND SA EUR4	148.00	8 122.47	0.01
EUR LVMH MOET HENNESSY EURO.30	197.00	31 590.88	0.03
EUR NATIXIS EUR1.6	590.00	2 882.42	0.00
EUR ORANGE EUR4	1 156.00	20 426.38	0.02
EUR PERNOD RICARD EUR1.55	117.00	13 666.45	0.01
EUR PEUGEOT SA EUR1	414.00	6 119.25	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR PUBLICIS GROUPE SA EURO.40	112.00	6 698.15	0.01
EUR RENAULT SA EUR3.81	116.00	9 781.60	0.01
EUR REXEL EUR5	171.00	2 017.76	0.00
EUR SAFRAN EURO.20	234.00	15 105.89	0.01
EUR SANOFI EUR2	769.00	63 696.98	0.05
EUR SCHNEIDER ELECTRIC EUR8	405.00	21 521.49	0.02
EUR SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)	184.00	6 396.00	0.01
EUR SOC GENERALE EUR1.25	489.00	18 614.53	0.01
EUR SODEXO EUR4	51.00	4 975.44	0.00
EUR SUEZ ENVIRONNEMENT EUR4	241.00	4 452.72	0.00
EUR TECHNIP NPV	71.00	3 291.21	0.00
EUR THALES EUR3	105.00	7 972.38	0.01
EUR TOTAL EUR2.5	1 476.00	65 353.57	0.05
EUR UNIBAIL-RODAMCO EUR5	84.00	21 086.99	0.02
EUR VALEO EUR3	80.00	10 340.07	0.01
EUR VEOLIA ENVIRONNEME EUR5	253.00	6 076.08	0.01
EUR VINCI EUR2.50	323.00	21 815.92	0.02
EUR VIVENDI SA EUR5.50	770.00	16 688.57	0.01
EUR ZODIAC AEROSPACE	214.00	4 462.14	0.00
フランス合計		722 627.21	0.58
ドイツ			
EUR BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1	218.00	18 083.09	0.02
EUR BEIERSDORF AG NPV	59.00	5 431.59	0.01
EUR COMMERZBANK AG NPV	863.00	6 972.75	0.01
EUR CONTINENTAL AG ORD NPV	68.00	14 171.39	0.01
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)	116.00	3 043.18	0.00
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (ASD VONOVIA 26.01.16)	116.00	2 899.46	0.00
EUR FRAPORT AG NPV	52.00	3 139.11	0.00
EUR FRESENIUS MED CARE NPV	139.00	12 283.57	0.01
EUR FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV	310.00	20 441.44	0.02
EUR GEA GROUP AG NPV	87.00	3 636.10	0.00
EUR HEIDELBERGCEMENT NPV	148.00	10 824.09	0.01
EUR HENKEL AG & CO KGAA	43.00	3 947.91	0.00
EUR HUGO BOSS AG NPV (REGD)	56.00	4 445.23	0.00
EUR LANXESS AG NPV	68.00	2 780.93	0.00
EUR LINDE AG NPV	144.00	19 414.57	0.02
EUR MAN SE ORD NPV	34.00	3 430.64	0.00
EUR MERCK KGAA NPV	70.00	6 065.54	0.01
EUR METRO AG ORD NPV	90.00	2 527.61	0.00
EUR RWE AG (NEU) NPV	255.00	3 551.13	0.00
EUR SAP AG ORD NPV	700.00	55 436.67	0.04
EUR SYMRISE AG NPV (BR)	109.00	7 012.92	0.01
EUR THYSSENKRUPP AG NPV	463.00	7 131.59	0.01
EUR VOLKSWAGEN AG ORD NPV	27.00	3 523.37	0.00
ドイツ合計		220 193.88	0.18
香港			
HKD AIA GROUP LTD NPV	7 400.00	40 742.14	0.03
HKD ASM PACIFIC TECH HKD0.10	700.00	5 045.71	0.00
HKD BOC HONG KONG HLDG HKD5	2 500.00	6 584.99	0.01
HKD CHEUNG KONG INFSTR HKD1	1 000.00	9 353.90	0.01
HKD CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0	1 684.00	20 847.56	0.02
HKD CK PROPERTY LTD HKD1	1 684.00	9 011.94	0.01
HKD CLP HOLDINGS HKD5	1 000.00	8 364.55	0.01
HKD GALAXY ENTERTAINME HKD0.10	1 000.00	3 096.55	0.00
HKD HANG LUNG PROP HKD1	3 000.00	5 496.70	0.00
HKD HANG SENG BANK HKD5	500.00	8 255.33	0.01
HKD HENDERSON LAND DEV HKD2	1 108.00	5 979.30	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
HKD HONG KONG EXCHANGE HKD1	823.00	18 008.43	0.01
USD HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)	1 000.00	6 270.00	0.01
HKD HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25	4 764.00	8 337.01	0.01
HKD LI & FUNG HKD0.0125	2 000.00	1 140.97	0.00
USD MICHAEL KORS HOLDI COM NPV	85.00	3 391.50	0.00
HKD MTR CORP HKD1	1 500.00	6 764.87	0.01
HKD NEW WORLD DEVEL CO HKD1	4 875.00	3 946.18	0.00
HKD POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1	1 500.00	13 626.11	0.01
HKD SINO LAND CO HKD1	2 526.00	3 206.65	0.00
HKD SJM HOLDINGS LTD. HKD1.00	2 000.00	1 308.00	0.00
HKD SUN HUNG KAI PROP HKD0.50	1 047.00	11 273.33	0.01
HKD SWIRE PACIFIC 'A' HKD0.60	500.00	4 818.29	0.00
HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2 000.00	11 396.85	0.01
HKD WHARF (HLDGS) HKD1	1 000.00	4 625.55	0.00
香港合計		220 892.41	0.18
アイルランド			
USD ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'	435.00	45 909.90	0.04
USD ALKERMES PLC COM USD0.01	100.00	3 201.00	0.00
EUR BK OF IRELAND ORD STK EURO.1	17 655.00	5 807.49	0.00
EUR CRH ORD EURO.32(DUBLIN LISTING)	459.00	12 058.93	0.01
USD EATON CORP PLC COM USD0.01	371.00	18 739.21	0.02
GBP EXPERIAN ORD USD0.10	682.00	11 512.26	0.01
USD INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1	184.00	9 470.48	0.01
USD MALLINCKRODT PLC USD0.20	100.00	5 809.00	0.00
USD PENTAIR PLC COM USD0.01	88.00	4 146.56	0.00
USD SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001	181.00	5 258.05	0.00
GBP SHIRE ORD GBPO.05	407.00	22 573.58	0.02
USD XL GROUP PLC USD0.01	200.00	7 252.00	0.01
アイルランド合計		151 738.46	0.12
イスラエル			
ILS BANK HAPOLIM B.M. ILS1	799.00	3 686.31	0.00
ILS BEZEQ ISRAEL TELCM ILS1	2 427.00	5 203.54	0.00
ILS BK LEUMI LE ISRAEL ILS1	1 087.00	3 569.61	0.00
USD CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01	79.00	6 225.99	0.01
USD MOBILEYE NV EURO.01	200.00	5 426.00	0.01
ILS TEVA PHARMA IND ILS0.1 (POST CONS)	628.00	38 023.08	0.03
イスラエル合計		62 134.53	0.05
イタリア			
EUR ASSIC GENERALI SPA EUR1	606.00	9 042.41	0.01
EUR ATLANTIA SPA EUR1	240.00	6 253.38	0.01
EUR BANCO POPOLARE NPV (POST REVERSE SPLIT)	447.00	4 120.92	0.00
EUR ENEL EUR1	4 640.00	18 918.04	0.02
EUR ENI SPA EUR1	1 481.00	21 281.41	0.02
EUR EXOR SPA NV EUR1	78.00	2 526.09	0.00
EUR FERRARI NV EURO.01(NEW)	60.00	2 376.18	0.00
EUR FINMECCANICA SPA EUR4.40	384.00	4 541.49	0.00
EUR INTESA SANPAOLO	9 021.00	25 554.75	0.02
EUR LUXOTTICA GROUP EURO.06	61.00	3 798.59	0.00
EUR MEDIOBANCA SPA EURO.5	395.00	3 147.88	0.00
EUR SAIPEM EUR1	167.00	103.09	0.00
EUR SNAM EUR1	1 899.00	10 613.11	0.01
EUR TELECOM ITALIA SPA EURO.55	8 925.00	9 869.76	0.01
EUR TERNA SPA ORD EURO.22	1 129.00	6 027.55	0.00
EUR UNICREDIT SPA NPV	3 169.00	12 166.15	0.01
EUR UNIONE DI BANCHE I EUR2.50	730.00	3 398.13	0.00
イタリア合計		143 738.93	0.11

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
日本			
JPY イオン	800.00	10 553.01	0.01
JPY イオンフィナンシャルサービス	100.00	2 259.94	0.00
JPY イオンモール	220.00	3 310.95	0.00
JPY アイシン精機	100.00	4 171.31	0.00
JPY 味の素	1 000.00	23 429.56	0.02
JPY ANAホールディングス	2 000.00	5 798.54	0.01
JPY アサヒグループホールディングス	200.00	6 338.74	0.01
JPY 旭化成	1 000.00	6 391.61	0.01
JPY アステラス製薬	1 400.00	19 080.66	0.02
JPY バンダイナムコホールディングス	100.00	2 246.73	0.00
JPY ベネッセホールディングス	100.00	2 762.98	0.00
JPY 横浜銀行	1 000.00	5 246.77	0.01
JPY ブリヂストン	400.00	14 326.19	0.01
JPY ブラザー工業	300.00	2 971.13	0.00
JPY キヤノン	800.00	22 084.00	0.02
JPY カシオ計算機	400.00	7 625.66	0.01
JPY 東海旅客鉄道	100.00	18 258.79	0.02
JPY 中部電力	400.00	5 066.70	0.00
JPY 中外製薬	100.00	3 019.04	0.00
JPY 中国電力	300.00	3 952.42	0.00
JPY クレディセゾン	200.00	3 685.62	0.00
JPY 第一生命保険	900.00	12 143.48	0.01
JPY 株式会社ダイセル	600.00	8 668.07	0.01
JPY ダイハツ工業	200.00	3 072.73	0.00
JPY 第一三共	400.00	8 198.90	0.01
JPY ダイキン工業	200.00	13 232.56	0.01
JPY 大東建託	100.00	12 580.02	0.01
JPY 大和ハウス工業	600.00	16 652.21	0.01
JPY 大和証券グループ本社	1 000.00	6 199.15	0.01
JPY デンソー	300.00	12 786.52	0.01
JPY 電通	100.00	5 212.08	0.00
JPY 東日本旅客鉄道	300.00	27 233.30	0.02
JPY エーザイ	200.00	11 877.92	0.01
JPY ファミリーマート	100.00	4 625.61	0.00
JPY ファナック	100.00	13 059.10	0.01
JPY 富士フイルムホールディングス	300.00	11 393.88	0.01
JPY 富士重工業	500.00	20 055.34	0.02
JPY 富士通	1 000.00	4 107.71	0.00
JPY 日野自動車	300.00	3 340.35	0.00
JPY 久光製薬	100.00	4 435.63	0.00
JPY 日立建機	200.00	2 861.27	0.00
JPY 日立製作所	3 000.00	14 531.04	0.01
JPY 北陸電力	200.00	2 793.54	0.00
JPY 本田技研工業	1 200.00	33 116.09	0.03
JPY HOYA	300.00	11 398.84	0.01
JPY 国際石油開発帝石	1 100.00	9 572.13	0.01
JPY 三越伊勢丹	400.00	4 998.97	0.00
JPY いすゞ自動車	500.00	4 964.28	0.00
JPY 伊藤忠商事	1 200.00	13 852.06	0.01
JPY J. フロント リテイリング	500.00	6 793.87	0.01
JPY 日本取引所グループ	400.00	5 570.56	0.00
JPY ゆうちょ銀行	500.00	6 079.38	0.01
JPY 日本郵便	400.00	5 269.90	0.00
JPY 日本リテールファンド投資法人	2.00	4 207.66	0.00
JPY 日本たばこ産業	800.00	30 799.98	0.03
JPY ジェイ エフ イー ホールディングス	300.00	3 979.68	0.00
JPY JSR	100.00	1 427.33	0.00
JPY ジェイテクト	400.00	6 300.75	0.01
JPY J Xホールディングス	2 400.00	9 039.77	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
JPY	カカクコム	200.00	3 812.82	0.00
JPY	関西電力	400.00	4 280.35	0.00
JPY	関西ペイント	400.00	5 494.57	0.00
JPY	花王	400.00	21 129.15	0.02
JPY	KDDI	1 200.00	29 815.39	0.02
JPY	キリンホールディングス	1 000.00	13 996.61	0.01
JPY	コマツ	500.00	7 312.19	0.01
JPY	コニカミノルタ	500.00	4 134.14	0.00
JPY	クボタ	1 000.00	14 446.78	0.01
JPY	クラレ	400.00	4 757.77	0.00
JPY	栗田工業	200.00	4 204.35	0.00
JPY	京セラ	200.00	8 197.25	0.01
JPY	九州電力	300.00	3 189.20	0.00
JPY	ローソン	100.00	7 797.46	0.01
JPY	LIXILグループ	200.00	4 163.05	0.00
JPY	エムスリー	300.00	6 760.00	0.01
JPY	マキタ	100.00	5 525.96	0.00
JPY	丸紅	1 000.00	4 713.17	0.00
JPY	マツダ	600.00	10 648.00	0.01
JPY	日本マクドナルドホールディングス	200.00	3 935.08	0.00
JPY	メディアパルホールディングス	300.00	4 794.94	0.00
JPY	明治ホールディングス	200.00	16 503.53	0.01
JPY	三菱ケミカルホールディングス	1 200.00	6 564.74	0.01
JPY	三菱商事	800.00	12 591.58	0.01
JPY	三菱電機	1 000.00	9 081.90	0.01
JPY	三菱地所	1 000.00	19 555.61	0.02
JPY	三菱重工業	2 000.00	7 708.26	0.01
JPY	三菱自動車工業	400.00	3 178.46	0.00
JPY	田辺三菱製薬	300.00	4 856.90	0.00
JPY	三菱UFJフィナンシャル・グループ	9 000.00	45 302.94	0.04
JPY	三井物産	1 500.00	16 794.70	0.01
JPY	三井不動産	1 000.00	23 152.85	0.02
JPY	商船三井	1 000.00	1 949.37	0.00
JPY	みずほフィナンシャルグループ	14 500.00	24 648.74	0.02
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	10 655.43	0.01
JPY	村田製作所	100.00	11 312.11	0.01
JPY	日本電産	200.00	13 384.55	0.01
JPY	ニコン	200.00	2 909.18	0.00
JPY	任天堂	100.00	13 757.07	0.01
JPY	新日鐵住金	447.00	7 849.68	0.01
JPY	日本電信電話	600.00	24 918.85	0.02
JPY	日産自動車	1 700.00	16 569.61	0.01
JPY	日清製粉グループ本社	400.00	6 373.44	0.01
JPY	日東電工	100.00	5 634.16	0.00
JPY	NOK	200.00	4 068.89	0.00
JPY	野村ホールディングス	2 600.00	13 959.44	0.01
JPY	野村不動産	5.00	6 112.42	0.01
JPY	野村不動産ホールディングス	100.00	1 729.65	0.00
JPY	日本精工	500.00	5 079.92	0.00
JPY	NTTドコモ	1 100.00	22 960.39	0.02
JPY	NTT都市開発	300.00	2 894.31	0.00
JPY	大林組	700.00	6 233.02	0.01
JPY	小田急電鉄	1 000.00	10 481.97	0.01
JPY	オリンパス	100.00	3 832.65	0.00
JPY	オムロン	100.00	2 548.22	0.00
JPY	小野薬品工業	100.00	15 834.47	0.01
JPY	オリエンタルランド	200.00	12 593.24	0.01
JPY	オリックス	1 200.00	16 716.64	0.01
JPY	大阪ガス	2 000.00	7 490.19	0.01
JPY	大塚ホールディングス	400.00	13 265.60	0.01
JPY	パナソニック	1 800.00	16 563.00	0.01
JPY	パーク24	200.00	5 525.96	0.00
JPY	楽天	700.00	7 103.21	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
JPY	りそなホールディングス	2 000.00	9 044.73	0.01
JPY	リコー	400.00	3 812.83	0.00
JPY	三協	100.00	3 774.83	0.00
JPY	参天製薬	500.00	7 851.15	0.01
JPY	SBIホールディングス	150.00	1 471.94	0.00
JPY	セコム	200.00	13 736.42	0.01
JPY	セガサミーホールディングス	100.00	930.08	0.00
JPY	積水化学工業	500.00	6 005.04	0.01
JPY	積水ハウス	300.00	4 643.79	0.00
JPY	セブン&アイ・ホールディングス	500.00	21 938.63	0.02
JPY	シマノ	100.00	15 694.05	0.01
JPY	シミズ	1 000.00	7 657.04	0.01
JPY	信越化学工業	300.00	15 068.76	0.01
JPY	塩野義製薬	200.00	8 592.08	0.01
JPY	資生堂	300.00	5 550.74	0.00
JPY	昭和シェル石油	300.00	2 413.58	0.00
JPY	ソフトバンク	700.00	30 442.32	0.02
JPY	損保ジャパン日本興亜	275.00	7 993.43	0.01
JPY	ソニー	900.00	18 756.04	0.02
JPY	ソニーフィナンシャルホールディングス	200.00	3 249.49	0.00
JPY	スタンレー電気	200.00	4 324.95	0.00
JPY	住友商事	700.00	6 869.04	0.01
JPY	住友電気工業	500.00	6 457.28	0.01
JPY	住友金属鉱山	1 000.00	10 382.85	0.01
JPY	三井住友フィナンシャルグループ	1 000.00	32 874.90	0.03
JPY	三井住友トラスト・ホールディングス	3 000.00	9 411.47	0.01
JPY	住友ゴム工業	100.00	1 249.74	0.00
JPY	スルガ銀行	300.00	5 347.54	0.00
JPY	スズキ	200.00	6 039.73	0.01
JPY	シスメックス	100.00	6 310.66	0.01
JPY	T&Dホールディングス	300.00	3 363.90	0.00
JPY	大成建設	1 000.00	6 153.72	0.01
JPY	武田薬品工業	500.00	23 842.56	0.02
JPY	TDK	100.00	5 377.28	0.00
JPY	テルモ	200.00	6 244.58	0.02
JPY	東宝	200.00	5 154.26	0.00
JPY	東北電力	300.00	3 712.06	0.00
JPY	東京海上ホールディングス	600.00	21 053.15	0.02
JPY	東京電力	700.00	3 469.21	0.00
JPY	東京エレクトロン	100.00	6 173.54	0.01
JPY	東京ガス	2 000.00	9 079.42	0.01
JPY	東京急行電鉄	1 000.00	7 690.08	0.01
JPY	東急不動産ホールディングス	500.00	3 225.54	0.00
JPY	凸版印刷	1 000.00	8 590.43	0.01
JPY	東レ	1 000.00	8 404.58	0.01
JPY	東芝	2 000.00	3 287.49	0.00
JPY	東洋製罐グループホールディングス	200.00	3 555.12	0.00
JPY	豊田自動織機	100.00	4 914.72	0.00
JPY	トヨタ自動車	1 900.00	112 997.15	0.09
JPY	豊田通商	200.00	4 481.89	0.00
JPY	ユニ・チャーム	300.00	5 772.52	0.01
JPY	ユー・エス・エス	300.00	4 527.32	0.00
JPY	西日本旅客鉄道	100.00	6 393.26	0.01
JPY	ヤフー	700.00	2 630.82	0.00
JPY	ヤクルト本社	100.00	4 526.49	0.00
JPY	ヤマハ	300.00	7 015.24	0.01
JPY	ヤマハ発動機	100.00	1 960.10	0.00
JPY	ヤマトホールディングス	300.00	6 486.19	0.01
JPY	安川電機	500.00	5 443.36	0.01
JPY	横河電機	300.00	3 298.23	0.00
日本合計			1 779 086.43	1.43

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
ジャージー島			
GBP RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05	62.00	4 368.33	0.00
ジャージー島合計		4 368.33	0.00
マカオ			
HKD SANDS CHINA LTD USD0.01 REG' S'	1 200.00	4 132.16	0.00
HKD WYNN MACAU LTD HKD0.10	1 200.00	1 287.45	0.00
マカオ合計		5 419.61	0.00
オランダ			
EUR AEGON NV EURO.12	1 598.00	8 993.13	0.01
USD AERCAP HOLDINGS NV	200.00	6 142.00	0.00
EUR AHOLD(KON)NV EURO.01	654.00	14 737.03	0.01
EUR AKZO NOBEL NV EUR2	148.00	9 459.67	0.01
EUR ALTICE NV EURO.01 (COMMON SHARES A)	186.00	2 664.70	0.00
EUR ALTICE NV EURO.25 (COMMON SHARES B)	62.00	914.06	0.00
EUR ASML HOLDING NV EURO.09	225.00	20 504.31	0.02
EUR CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01	233.00	1 445.90	0.00
EUR FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01	606.00	4 199.90	0.00
EUR GEMALTO EUR1	37.00	2 216.38	0.00
EUR HEINEKEN HOLDING EUR1.6	69.00	5 274.83	0.00
EUR HEINEKEN NV EUR1.60	151.00	13 074.43	0.01
EUR KON KPN NV EURO.24	1 721.00	6 627.60	0.01
EUR KONINKLIJKE BOSKAL EURO.80	162.00	6 363.10	0.00
EUR KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5	194.00	9 345.54	0.01
EUR KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20	737.00	19 534.05	0.02
EUR NN GROUP N.V. EURO.12	252.00	8 496.60	0.01
USD NXP SEMICONDUCTORS EURO.20	97.00	7 253.66	0.01
EUR RANDSTAD HLDGS NV EURO.10	83.00	4 502.18	0.00
EUR RELX NV EURO.07	699.00	11 621.37	0.01
GBP ROYAL DUTCH SHELL 'B' SHS EURO.07 (UK LIST)	1 463.00	31 564.79	0.03
GBP ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A' SHS EURO.07	2 628.00	56 588.28	0.05
USD SENSATA TECHNOLOGI COM EURO.01	100.00	3 670.00	0.00
EUR TNT EXPRESS NV EURO.08	270.00	2 298.66	0.00
EUR VOPAK(KON) EURO.50	70.00	3 033.91	0.00
EUR WOLTERS KLUWER EURO.12	144.00	4 883.25	0.00
オランダ合計		265 409.33	0.21
ニュージーランド			
NZD SPARK NEW ZEALAND NPV	2 227.00	4 841.32	0.00
ニュージーランド合計		4 841.32	0.00
ノルウェー			
NOK DNB ASA NOK10	928.00	11 079.45	0.01
NOK NORSK HYDRO ASA NOK3.6666	854.00	2 806.34	0.00
NOK ORKLA ASA NOK1.25	590.00	4 738.85	0.00
NOK STATOIL ASA NOK2.50	823.00	11 164.88	0.01
NOK TELENOR ASA ORD NOK6	748.00	12 067.21	0.01
NOK YARA INTERNATIONAL NOK1.7	147.00	5 507.67	0.01
ノルウェー合計		47 364.40	0.04
ポルトガル			
EUR GALP ENERGIA EUR1-B	262.00	3 092.95	0.00
EUR JERONIMO MARTINS EUR5	457.00	6 349.34	0.01
ポルトガル合計		9 442.29	0.01
シンガポール			
USD AVAGO TECH LTD NPV	157.00	20 992.47	0.02
SGD CITY DEVELOPMENTS SGD0.50	900.00	4 401.04	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
SGD DBS GROUP HLDGS SGD1	1 600.00	15 805.52	0.01
USD FLEXTRONICS INTL USD0.01	600.00	6 288.00	0.01
SGD JARDINE CYCLE & CA SGD1	222.00	5 816.33	0.00
SGD KEPPEL CORP NPV	1 000.00	3 527.01	0.00
SGD OVERSEA-CHINESE BK NPV	1 942.00	10 806.32	0.01
SGD SINGAPORE AIRLINES NPV	1 000.00	7 749.60	0.01
SGD SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01	1 000.00	4 974.36	0.00
SGD SINGAPORE TELECOMM NPV(POST RE-ORG)	5 000.00	12 330.50	0.01
SGD UTD O/S BANK SGD1	1 026.00	13 040.36	0.01
シンガポール合計		105 731.51	0.08
スペイン			
EUR ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A	630.00	9 342.58	0.01
EUR ACS ACTIVIDADES CO EURO.5	136.00	3 430.27	0.00
EUR AENA SA EUR10	56.00	6 195.82	0.01
EUR AMADEUS IT HLDGS EURO.01	326.00	13 233.35	0.01
EUR BANCO POPULAR ESPA EURO.5 (POST CONS)	2 011.00	5 394.31	0.00
EUR BANKIA S.A. EUR1	2 457.00	2 429.96	0.00
EUR BCO DE SABADELL EURO.125	2 309.00	4 157.43	0.00
EUR CAIXABANK SA EUR1	2 932.00	8 819.75	0.01
EUR DISTRIBUIDORA INTL EURO.01	309.00	1 654.04	0.00
EUR ENAGAS SA EUR1.50	198.00	5 720.37	0.00
EUR ENDESA SA EUR1.2	321.00	6 170.47	0.01
EUR FERROVIAL SA EURO.2	227.00	4 945.67	0.00
EUR GAS NATURAL SDG EUR1	298.00	5 808.95	0.01
EUR GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD	132.00	2 735.92	0.00
EUR IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)	3 619.00	25 249.97	0.02
EUR INDITEX EURO.03 (POST SUBD)	777.00	25 378.13	0.02
EUR INTL CONS AIRLINE ORD EURO.50	584.00	4 470.19	0.00
EUR RED ELECTRICA CORPORACION EUR2	79.00	6 359.00	0.01
EUR REPSOL SA EUR1	894.00	9 182.11	0.01
EUR TELEFONICA SA EUR1	3 123.00	32 704.30	0.03
スペイン合計		183 382.59	0.15
スウェーデン			
SEK ALFA LAVAL AB NPV	261.00	4 474.31	0.00
SEK ASSA ABLOY SER' B' NPV (POST SPLIT)	770.00	16 226.22	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' A' NPV (POST SPLIT)	634.00	13 515.55	0.01
SEK ATLAS COPCO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	163.00	3 311.34	0.00
USD AUTOLIV INC COM	47.00	4 830.66	0.01
SEK BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)	207.00	2 860.60	0.00
SEK ELECTROLUX AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	123.00	2 668.00	0.00
SEK ERICSSON SER' B' NPV	2 259.00	19 863.51	0.02
SEK GETINGE AB SER' B' NPV	196.00	4 299.45	0.00
SEK HENNES & MAURITZ SER' B' NPV	620.00	20 201.63	0.02
SEK HEXAGON AB SER' B' NPV	125.00	4 139.97	0.00
SEK INVESTOR AB SER' B' NPV	381.00	12 694.15	0.01
SEK KINNEVIK INV AB SER' B' NPV	106.00	2 719.55	0.00
SEK LUNDIN PETROLEUM A NPV	212.00	3 031.06	0.00
SEK NORDEA BANK AB ORD NPV(SEK QUOTE)	2 017.00	20 205.40	0.02
SEK SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)	637.00	5 292.89	0.01
SEK SKAND ENSKILDA BKN SER' A' NPV	910.00	8 733.93	0.01
SEK SKANSKA AB SER' B' NPV	310.00	5 954.20	0.01
SEK SKF AB SER' B' NPV	158.00	2 399.03	0.00
SEK SVENSKA CELLULOSA SER' B' NPV	401.00	11 826.65	0.01
SEK SVENSKA HANDELSBKN SER' A' NPV (P/S)	858.00	10 736.32	0.01
SEK SWEDBANK AB SER' A' NPV	676.00	14 119.22	0.01
SEK SWEDISH MATCH NPV	136.00	4 824.66	0.00
SEK TELE2 AB SHS	250.00	2 068.53	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
SEK TELIASONERA AB NPV	2 576.00	12 115.53	0.01
SEK VOLVO AB SER' B' NPV (POST SPLIT)	1 472.00	13 312.45	0.01
スウェーデン合計		226 424.81	0.18
スイス			
GBP GLENCORE XSTRATA ORD USD0.01	7 230.00	9 176.84	0.01
CHF PARGESA HLDGS SA CHF20(BR) (POST SUBD)	39.00	2 258.97	0.00
CHF SIKA AG CHF0.60 (BR)	2.00	7 138.05	0.01
EUR STMICROELECTRONICS EUR1.04	468.00	3 046.50	0.00
CHF SWATCH GROUP CHF2.25 (BR)	19.00	6 460.35	0.00
CHF SWISS RE AG CHF0.10	242.00	22 389.69	0.02
USD WEATHERFORD INTL.COM USD0.001	400.00	2 696.00	0.00
GBP WOLSELEY ORD GBPO.108030303 (POST CON)	230.00	11 298.21	0.01
スイス合計		64 464.61	0.05
イギリス			
GBP 3I GROUP ORD GBPO.738636	872.00	5 467.24	0.01
GBP ABERDEEN ASSET MGT ORD GBPO.10	606.00	2 118.94	0.00
GBP ANGLO AMERICAN USD0.54945	675.00	2 656.55	0.00
USD AON PLC COM USD0.01 CL A	222.00	19 498.26	0.02
GBP ARM HLDGS ORD GBPO.0005	1 089.00	15 339.33	0.01
GBP ASHTEAD GROUP ORD GBPO.10	438.00	5 585.51	0.00
GBP ASSOC BRIT FOODS ORD GBPO.0568	287.00	12 823.95	0.01
GBP ASTRAZENECA ORD USD0.25	879.00	55 952.92	0.05
GBP AVIVA ORD GBPO.25	2 063.00	14 069.96	0.01
GBP BAE SYSTEMS ORD GBPO.025	1 870.00	13 687.39	0.01
GBP BARCLAYS ORD GBPO.25	12 210.00	32 214.99	0.03
GBP BARRATT DEVEL ORD GBPO.10	709.00	6 029.28	0.01
GBP BG GROUP ORD GBPO.10	2 617.00	39 145.31	0.03
GBP BHP BILLITON PLC USD0.50	1 800.00	17 270.52	0.01
GBP BP ORD USD0.25	12 912.00	68 885.24	0.06
GBP BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25	1 195.00	66 058.34	0.05
GBP BRITISH LAND CO PLC REIT	730.00	7 662.74	0.01
GBP BT GROUP ORD GBPO.05	5 247.00	36 086.75	0.03
GBP BUNZL ORD GBPO.32142857	163.00	4 319.11	0.00
GBP BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005	175.00	2 966.44	0.00
GBP CAPITA PLC ORD GBPO.02066666	484.00	8 067.01	0.01
GBP CARNIVAL PLC ORD USD1.66	99.00	4 887.02	0.00
GBP CENTRICA ORD GBPO.061728395	2 534.00	7 361.49	0.01
GBP COBHAM ORD GBPO.025	1 217.00	4 384.84	0.00
GBP COMPASS GROUP ORD GBPO.10625	1 052.00	17 951.91	0.02
GBP CRODA INTL ORD GBPO.10	103.00	4 166.93	0.00
USD DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01	200.00	12 988.00	0.01
GBP DIAGEO ORD GBX28.935185	1 780.00	47 582.31	0.04
GBP DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909	1 323.00	7 030.03	0.01
GBP DIXONS CARPHONE ORD GBPO.001	1 116.00	7 498.89	0.01
USD ENSCO PLC COM USD0.10 'A'	112.00	1 095.36	0.00
GBP G4S ORD GBPO.25	982.00	3 159.25	0.00
GBP GKN ORD GBPO.50	787.00	3 112.42	0.00
GBP GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25	3 313.00	67 625.67	0.05
GBP HAMMERSON PLC REIT	660.00	5 462.79	0.00
GBP HSBC HLDGS ORD USD0.50(UK REG)	13 386.00	93 478.13	0.08
GBP ICAP ORD GBPO.10	522.00	3 579.37	0.00
GBP IMPERIAL TOBACCO ORD GBPO.10	681.00	36 572.70	0.03
GBP INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.1580547	124.00	4 040.29	0.00
GBP INTERTEK GROUP ORD GBPO.01	84.00	3 372.06	0.00
GBP INTU PROPERTIES PLC GBPO.50	1 353.00	5 738.50	0.01
GBP INVESTEC ORD GBPO.0002	541.00	3 406.53	0.00
GBP ITV ORD GBPO.10	2 633.00	9 964.74	0.01
GBP JOHNSON MATTHEY GBP1.101698	152.00	5 314.84	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
GBP	KINGFISHER ORD GBPO.157142857	2 352.00	10 879.71	0.01
GBP	LAND SECURITIES GROUP PLC REIT	614.00	9 537.00	0.01
GBP	LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025	2 799.00	9 667.89	0.01
USD	LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 C	533.00	17 754.23	0.01
GBP	LLOYDS BANKING GROUP PLC ORD GBPO.25	40 630.00	37 726.99	0.03
GBP	LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604	200.00	7 018.74	0.01
GBP	MARKS & SPENCER GP ORD GBPO.25	1 771.00	10 654.08	0.01
GBP	MEGGITT ORD GBPO.05	519.00	2 675.36	0.00
GBP	MONDI ORD EURO.20	344.00	5 543.27	0.00
GBP	MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10	699.00	1 730.23	0.00
GBP	NATIONAL GRID ORD GBPO.11395	2 270.00	31 742.71	0.03
GBP	NEXT ORD GBPO.10	52.00	5 108.02	0.00
GBP	OLD MUTUAL PLC ORD GBPO.114285714(POST CON	1 948.00	4 689.22	0.00
GBP	PEARSON ORD GBPO.25	514.00	5 752.67	0.01
GBP	PERSIMMON ORD GBPO.10	215.00	6 209.34	0.01
GBP	PROVIDENT FINL ORD GBX20.727272	134.00	5 584.52	0.00
GBP	PRUDENTIAL ORD GBPO.05	1 837.00	35 634.11	0.03
GBP	RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10	469.00	41 473.34	0.03
GBP	RELX PLC GBPO.1444	823.00	14 359.33	0.01
GBP	REXAM NEW ORD GBPO.8035714	472.00	4 017.19	0.00
GBP	RIO TINTO ORD GBPO.10	1 031.00	25 066.80	0.02
GBP	ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20	1 073.00	8 447.38	0.01
GBP	ROYAL BK SCOT GRP ORD GBP1 (POST CONS)	2 678.00	9 599.43	0.01
GBP	ROYAL MAIL PLC ORD GBPO.01 (WI)	1 040.00	6 774.30	0.01
GBP	RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00	581.00	3 431.75	0.00
GBP	SABMILLER ORD USD0.10	662.00	39 275.64	0.03
GBP	SAGE GROUP GBPO.01051948	1 072.00	9 443.12	0.01
GBP	SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428	700.00	2 433.72	0.00
GBP	SCHRODERS VTG SHS GBP1	142.00	5 486.87	0.00
GBP	SEVERN TRENT ORD GBPO.9789	142.00	4 409.24	0.00
GBP	SKY PLC ORD GBPO.50	716.00	10 989.29	0.01
GBP	SMITH & NEPHEW ORD USD0.20	656.00	10 812.83	0.01
GBP	SMITHS GROUP ORD GBPO.375	486.00	6 504.40	0.01
GBP	SSE PLC ORD GBPO.50	602.00	12 382.09	0.01
GBP	STANDARD CHARTERED ORD USD0.50	2 185.00	14 598.28	0.01
GBP	STANDARD LIFE ORD GBPO.1222222	2 018.00	10 405.31	0.01
GBP	TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01	2 200.00	6 004.23	0.01
GBP	TESCO ORD GBPO.05	4 551.00	11 193.99	0.01
GBP	TRAVIS PERKINS ORD GBPO.10	139.00	3 598.38	0.00
GBP	UNILEVER PLC ORD GBPO.031111	810.00	35 446.19	0.03
GBP	UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05	554.00	7 516.65	0.01
GBP	VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)	17 462.00	55 459.69	0.04
GBP	WEIR GROUP ORD GBPO.125	118.00	1 447.86	0.00
GBP	WHITBREAD ORD GBPO.76797385	174.00	9 872.76	0.01
GBP	WILLIAM HILL ORD GBPO.10	748.00	4 127.44	0.00
USD	WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000115	135.00	15 453.45	0.01
GBP	WPP PLC ORD GBPO.10	757.00	16 289.61	0.01
イギリス合計			1 409 908.50	1.13
アメリカ合衆国				
USD	3M CO COM	430.00	64 930.00	0.05
USD	ABBOTT LABS COM	932.00	35 276.20	0.03
USD	ABBVIE INC COM USD0.01	1 161.00	63 738.90	0.05
USD	ACTIVISION BLIZZAR COM STK USD0.000001	340.00	11 838.80	0.01
USD	ADOBE SYSTEMS INC COM USD0.0001	346.00	30 838.98	0.03
USD	ADT CORP COM USD0.01	150.00	4 437.00	0.00
USD	ADVANCE AUTO PARTS INC COM	42.00	6 386.10	0.01
USD	AES CORP COM	400.00	3 800.00	0.00
USD	AETNA INC COM USD0.01	244.00	24 848.96	0.02
USD	AFLAC INC COM USD0.10	314.00	18 199.44	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	AGCO CORP COM USD0.01	30.00	1 463.10	0.00
USD	AGILENT TECHNOLOGIES INC COM	188.00	7 078.20	0.01
USD	AGL RESOURCES INC COM USD5	100.00	6 356.00	0.01
USD	AIR PRODS & CHEMS INC COM	147.00	18 626.37	0.02
USD	AIRGAS INC COM USD0.01	65.00	9 100.00	0.01
USD	AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM	100.00	4 562.00	0.00
USD	ALBEMARLE CORP COM USD0.01	100.00	5 264.00	0.00
USD	ALCOA INC COM USD1	1 453.00	10 592.37	0.01
USD	ALEXION PHARMACEUT COM USD0.0001	155.00	22 619.15	0.02
USD	ALLERGAN PLC COM USD0.0001	223.00	63 427.89	0.05
USD	ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01	16.00	3 196.64	0.00
USD	ALLIANT ENERGY CORP COM	78.00	5 096.52	0.00
USD	ALLSTATE CORP COM	325.00	19 695.00	0.02
USD	ALLY FINANCIAL INC COM USD0.01	300.00	4 755.00	0.00
USD	ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C	208.00	154 533.60	0.12
USD	ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL A	195.00	148 463.25	0.12
USD	ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333	1 338.00	81 765.18	0.07
USD	AMAZON COM INC COM USD0.01	269.00	157 903.00	0.13
USD	AMER ELEC PWR INC COM USD6.50	348.00	21 217.56	0.02
USD	AMER EXPRESS CO COM USD0.20	587.00	31 404.50	0.03
USD	AMER INTL GRP COM USD2.50	937.00	52 921.76	0.04
USD	AMER TOWER CORP COM NEW USD0.01	328.00	30 943.52	0.03
USD	AMEREN CORP COM	267.00	11 993.64	0.01
USD	AMERICAN AIRLINES COM USD1	100.00	3 899.00	0.00
USD	AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01	101.00	6 555.91	0.01
USD	AMERIPRISE FINL INC COM	92.00	8 339.80	0.01
USD	AMERISOURCEBERGEN COM STK USD0.01	152.00	13 613.12	0.01
USD	AMETEK INC COM USD0.01	232.00	10 915.60	0.01
USD	AMGEN INC COM USD0.0001	523.00	79 877.79	0.06
USD	AMPHENOL CORP NEW CL A	200.00	9 914.00	0.01
USD	ANADARKO PETROLEUM COM USD0.10	411.00	16 065.99	0.01
USD	ANALOG DEVICES INC COM	192.00	10 341.12	0.01
USD	ANNALY CAPITAL MAN COM USD0.01	500.00	4 750.00	0.00
USD	ANSYS INC COM	78.00	6 878.82	0.01
USD	ANTERO RES CORP USD0.01	200.00	5 434.00	0.00
USD	ANTHEM INC COM USD0.01	126.00	16 441.74	0.01
USD	APACHE CORP COM USD0.625	347.00	14 761.38	0.01
USD	APPLE INC COM NPV	3 892.00	378 847.28	0.30
USD	APPLIED MATLS INC COM	971.00	17 138.15	0.01
USD	ARAMARK COM USD0.01	200.00	6 390.00	0.01
USD	ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM	448.00	15 836.80	0.01
USD	ARROW ELECTRS INC COM	113.00	5 830.80	0.01
USD	ASHLAND INC COM USD1.00	44.00	4 169.44	0.00
USD	ASSURANT INC COM	63.00	5 122.53	0.00
USD	AT&T INC COM USD1	4 136.00	149 144.16	0.12
USD	AUTODESK INC COM USD0.01	212.00	9 925.84	0.01
USD	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC COM	347.00	28 832.23	0.02
USD	AUTONATION INC COM	107.00	4 627.75	0.00
USD	AUTOZONE INC COM USD0.01	10.00	7 673.90	0.01
USD	AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01	59.00	10 117.91	0.01
USD	AVERY DENNISON CORP COM	81.00	4 932.09	0.00
USD	AVNET INC COM	95.00	3 792.40	0.00
USD	AXALTA COATING SYS COM USD1.00	200.00	4 762.00	0.00
USD	BAKER HUGHES INC COM USD1	386.00	16 794.86	0.01
USD	BALL CORP COM	90.00	6 014.70	0.01
USD	BARD(CR)INC COM USD0.25	63.00	11 546.01	0.01
USD	BAXALTA INC.COM USD1 'WI'	494.00	19 764.94	0.02
USD	BAXTER INTL INC COM USD1	469.00	17 165.40	0.01
USD	BB&T CORP COM USD5	595.00	19 432.70	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	BE AEROSPACE COM USD0.01	100.00	4 045.00	0.00
USD	BECTON DICKINSON COM USD1	119.00	17 299.03	0.01
USD	BED BATH & BEYOND INC COM	100.00	4 317.00	0.00
USD	BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20	100.00	5 015.00	0.00
USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	815.00	105 762.55	0.09
USD	BEST BUY CO INC COM USD0.10	306.00	8 546.58	0.01
USD	BIOGEN INC COM STK USD0.0005	162.00	44 235.72	0.04
USD	BIOMARIN PHARMA COM USD0.001	100.00	7 402.00	0.01
USD	BK OF AMERICA CORP COM USD0.01	7 006.00	99 064.84	0.08
USD	BK OF NY MELLON CP COM STK USD0.01	800.00	28 976.00	0.02
USD	BLACKROCK INC COM STK USD0.01	51.00	16 027.26	0.01
USD	BLOCK(H&R)INC COM NPV	200.00	6 810.00	0.01
USD	BOEING CO COM USD5	445.00	53 457.85	0.04
USD	BORG WARNER INC COM	104.00	3 053.44	0.00
USD	BOSTON PPTYS INC COM USD0.01	117.00	13 596.57	0.01
USD	BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01	1 000.00	17 530.00	0.01
USD	BRISTOL MYERS SQUIBB CO COM	1 137.00	70 675.92	0.06
USD	BRIXMOR PROPERTY G COM USD0.01	263.00	7 001.06	0.01
USD	BROADCOM CORP CL A COM USD0.0001	362.00	19 790.54	0.02
USD	BROWN FORMAN CORP CL B	70.00	6 848.80	0.01
USD	BUNGE LIMITED COM USD0.01	131.00	8 123.31	0.01
USD	CA INC COM USD0.10	182.00	5 228.86	0.00
USD	CABLEVISION SYS CORP CL A NY CABLVS	387.00	12 349.17	0.01
USD	CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10	204.00	4 233.00	0.00
USD	CALPINE CORP COM STK USD0.001	200.00	3 062.00	0.00
USD	CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375	204.00	11 507.64	0.01
USD	CAPITAL ONE FINL COM USD0.01	409.00	26 838.58	0.02
USD	CARDINAL HEALTH INC COM	246.00	20 017.02	0.02
USD	CARMAX INC COM USD0.50	100.00	4 418.00	0.00
USD	CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)	314.00	15 112.82	0.01
USD	CATERPILLAR INC DEL COM	435.00	27 074.40	0.02
USD	CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01	302.00	8 446.94	0.01
USD	CBS CORP NEW CL B	333.00	15 817.50	0.01
USD	CDK GLOBAL INC COM USD0.01	100.00	4 405.00	0.00
USD	CDW CORP COM USD0.01	200.00	7 690.00	0.01
USD	CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001	100.00	6 367.00	0.01
USD	CELGENE CORP COM USD0.01	526.00	52 768.32	0.04
USD	CENTENE CORP DEL COM	100.00	6 206.00	0.00
USD	CENTERPOINT ENERGY INC COM	178.00	3 180.86	0.00
USD	CENTURYLINK INC COM	310.00	7 880.20	0.01
USD	CERNER CORP COM	198.00	11 485.98	0.01
USD	CF INDS HLDGS INC COM	100.00	3 000.00	0.00
USD	CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1	100.00	6 477.00	0.01
USD	CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'	35.00	5 997.60	0.01
USD	CHENIERE ENERGY INC COM NEW	100.00	3 005.00	0.00
USD	CHESAPEAKE ENERGY CORP COM	300.00	1 017.00	0.00
USD	CHEVRON CORP COM USD0.75	1 295.00	111 978.65	0.09
USD	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A	24.00	10 871.28	0.01
USD	CHURCH & DWIGHT INC COM	65.00	5 460.00	0.00
USD	CIGNA CORP COM USD0.25	155.00	20 708.00	0.02
USD	CIMAREX ENERGY CO COM	36.00	3 348.00	0.00
USD	CINCINNATI FINL CORP COM	100.00	5 763.00	0.01
USD	CINTAS CORP COM	100.00	8 592.00	0.01
USD	CISCO SYSTEMS COM USD0.001	3 379.00	80 386.41	0.06
USD	CIT GROUP INC COM NEW USD0.01	100.00	2 935.00	0.00
USD	CITIGROUP INC COM USD0.01	2 057.00	87 587.06	0.07
USD	CITIZENS FINL GP COM USD0.01	400.00	8 500.00	0.01
USD	CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001	100.00	7 046.00	0.01
USD	CLOROX CO DEL COM	100.00	12 905.00	0.01
USD	CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'	232.00	20 845.20	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	CMS ENERGY CORP COM	184.00	7 153.92	0.01
USD	COACH INC COM USD0.01	187.00	6 928.35	0.01
USD	COCA-COLA CO COM USD0.25	2 788.00	119 660.96	0.10
USD	COCA-COLA ENTERPR COM USD1.00	196.00	9 098.32	0.01
USD	COGNIZANT TECHNOLO COM CL' A' USD0.01	401.00	25 387.31	0.02
USD	COLGATE-PALMOLIVE COM USD1	569.00	38 424.57	0.03
USD	COLUMBIA PIPE GRP COM NPV 'WI'	305.00	5 657.75	0.00
USD	COMCAST CORP COM CLS' A' USD0.01	1 714.00	95 486.94	0.08
USD	COMERICA INC COM	85.00	2 915.50	0.00
USD	CONAGRA FOODS INC COM	361.00	15 032.04	0.01
USD	CONCHO RES INC COM STK USD0.001	42.00	3 995.46	0.00
USD	CONOCOPHILLIPS COM USD0.01	929.00	36 305.32	0.03
USD	CONSOLIDATED EDISON INC COM	250.00	17 347.50	0.01
USD	CONSTELLATION BRDS CLASS' A' COM USD0.01	124.00	18 907.52	0.02
USD	CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01	144.00	3 039.84	0.00
USD	CORNING INC COM USD0.50	1 012.00	18 833.32	0.02
USD	COSTCO WHSL CORP NEW COM	285.00	43 069.20	0.03
USD	CROWN CASTLE INTL COM USD0.01	257.00	22 153.40	0.02
USD	CROWN HOLDINGS INC COM USD5	100.00	4 588.00	0.00
USD	CSX CORP COM	827.00	19 037.54	0.02
USD	CUMMINS INC COM	95.00	8 539.55	0.01
USD	CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01	768.00	74 181.12	0.06
USD	D R HORTON INC COM	344.00	9 463.44	0.01
USD	DANAHER CORP COM USD0.01	400.00	34 660.00	0.03
USD	DARDEN RESTAURANTS INC COM	132.00	8 323.92	0.01
USD	DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	100.00	6 712.00	0.01
USD	DEERE & CO COM USD1	214.00	16 480.14	0.01
USD	DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001	107.00	4 739.03	0.00
USD	DENTSPLY INTL INC NEW COM	100.00	5 889.00	0.01
USD	DEVON ENERGY CORP NEW COM	286.00	7 979.40	0.01
USD	DICKS SPORTING GOODS INC COM	100.00	3 908.00	0.00
USD	DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01	81.00	6 486.48	0.01
USD	DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01	294.00	13 462.26	0.01
USD	DISCOVERY COMMUNIC COM CL A USD0.01	55.00	1 517.45	0.00
USD	DISCOVERY COMMUNIC COM CL C USD0.01	155.00	4 217.55	0.00
USD	DISH NETWORK CORPO CLASS' A' COM USD0.01	199.00	9 605.73	0.01
USD	DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875	232.00	17 413.92	0.01
USD	DOLLAR TREE INC	194.00	15 776.08	0.01
USD	DOMINION RES(VIR) COM STK NPV	427.00	30 816.59	0.03
USD	DOVER CORP COM	100.00	5 845.00	0.01
USD	DOW CHEMICAL CO COM USD2.50	773.00	32 466.00	0.03
USD	DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01	162.00	15 202.08	0.01
USD	DTE ENERGY CO COM	110.00	9 351.10	0.01
USD	DU PONT DE NEMOURS COM USD0.30	571.00	30 125.96	0.02
USD	DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)	463.00	34 863.90	0.03
USD	DUKE REALTY CORP COM USD0.01	280.00	5 636.40	0.00
USD	E TRADE FINANCIAL COM USD0.01	200.00	4 712.00	0.00
USD	EASTMAN CHEM CO COM	67.00	4 101.07	0.00
USD	EATON VANCE CORP COM NON VTG	100.00	2 866.00	0.00
USD	EBAY INC COM USD0.001	721.00	16 914.66	0.01
USD	ECOLAB INC COM	141.00	15 209.67	0.01
USD	EDGEWELL PERSONAL COM USD0.01	44.00	3 256.44	0.00
USD	EDISON INTL COM	283.00	17 489.40	0.01
USD	EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM	184.00	14 390.64	0.01
USD	ELECTRONIC ARTS INC COM	200.00	12 909.00	0.01
USD	ELI LILLY AND CO COM NPV	690.00	54 579.00	0.04
USD	EMC CORP(MASS) COM USD0.01	1 309.00	32 423.93	0.03
USD	EMERSON ELEC CO COM	505.00	23 219.90	0.02
USD	ENDO INTERNATIONAL COM USD0.0001	127.00	7 044.69	0.01
USD	ENERGEN CORP COM USD0.01	24.00	846.48	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	ENTERGY CORP NEW COM	118.00	8 328.44	0.01
USD	ENVISION HEALTHCAR COM USD0.01	300.00	6 630.00	0.01
USD	EOG RESOURCES INC COM USD0.01	435.00	30 893.70	0.03
USD	EQT CORPORATION	100.00	6 174.00	0.00
USD	EQUIFAX INC COM	59.00	6 242.20	0.01
USD	EQUINIX INC COM USD0.001 NEW	43.00	13 354.51	0.01
USD	EQUITY RESIDENTIAL-SBI	272.00	20 968.48	0.02
USD	ESTEE LAUDER COS CLASS' A' COM USD0.01	148.00	12 617.00	0.01
USD	EVERSOURCE ENERGY COM USD5	193.00	10 383.40	0.01
USD	EXELON CORP COM NPV	569.00	16 825.33	0.01
USD	EXPEDIA INC COM USD0.001 (POST-SPLIT)	50.00	5 052.00	0.00
USD	EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01	100.00	4 512.00	0.00
USD	EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01	471.00	33 850.77	0.03
USD	EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01	95.00	8 615.55	0.01
USD	EXXON MOBIL CORP COM NPV	2 864.00	222 962.40	0.18
USD	F M C CORP COM NEW	56.00	2 000.32	0.00
USD	F5 NETWORK INC COM STK NPV	43.00	4 032.54	0.00
USD	FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL 'A'	1 466.00	164 499.86	0.13
USD	FASTENAL CO COM	277.00	11 235.12	0.01
USD	FEDERAL REALTY INVT TR SH BEN INT NEW	42.00	6 334.86	0.01
USD	FEDEX CORP COM USD0.10	209.00	27 771.92	0.02
USD	FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001	200.00	6 476.00	0.01
USD	FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01	175.00	10 452.75	0.01
USD	FIFTH THIRD BANCORP COM	640.00	10 112.00	0.01
USD	FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01	100.00	6 800.00	0.01
USD	FIRSTENERGY CORP COM USD0.10	225.00	7 438.50	0.01
USD	FISERV INC COM USD0.01	200.00	18 912.00	0.02
USD	FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001	64.00	7 861.76	0.01
USD	FLIR SYS INC COM	100.00	2 924.00	0.00
USD	FLOWERVE CORP COM	66.00	2 550.24	0.00
USD	FLUOR CORP NEW COM	100.00	4 489.00	0.00
USD	FMC TECHNOLOGIES INC COM	112.00	2 816.80	0.00
USD	FOOT LOCKER INC COM USD0.01	111.00	7 499.16	0.01
USD	FORD MOTOR CO COM STK USD0.01	2 411.00	28 787.34	0.02
USD	FORTINET INC COM USD0.001	200.00	5 628.00	0.00
USD	FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI	139.00	6 754.01	0.01
USD	FRANKLIN RES INC COM	308.00	10 675.28	0.01
USD	FREEMPORT-MCMOR C&G COM STK USD0.10	583.00	2 681.80	0.00
USD	FRONTIER COMMUNICA COM USD0.25	536.00	2 438.80	0.00
USD	GALLAGHER ARTHUR J & CO COM	164.00	6 172.96	0.01
USD	GAMESTOP CORP COM USD0.001 CLASS 'A'	100.00	2 621.00	0.00
USD	GAP INC DEL COM	104.00	2 570.88	0.00
USD	GEN DYNAMICS CORP COM USD1	184.00	24 613.68	0.02
USD	GEN ELEC CO COM USD0.06	6 403.00	186 327.30	0.15
USD	GEN GROWTH PPTYS COM USD0.01 NEW	443.00	12 421.72	0.01
USD	GENERAL MLS INC COM	453.00	25 599.03	0.02
USD	GENERAL MOTORS CO COM USD0.01	988.00	29 284.32	0.02
USD	GENUINE PARTS CO COM STK USD1	100.00	8 617.00	0.01
USD	GILEAD SCIENCES COM USD0.001	993.00	82 419.00	0.07
USD	GLOBAL PAYMENTS COM NPV	100.00	5 895.00	0.01
USD	GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01	262.00	42 328.72	0.03
USD	GOODYEAR TIRE&RUBR COM NPV	200.00	5 682.00	0.00
USD	GRAINGER W W INC COM	16.00	3 147.04	0.00
USD	HALLIBURTON COM STK USD2.50	622.00	19 773.38	0.02
USD	HANESBRANDS INC COM	400.00	12 228.00	0.01
USD	HARLEY DAVIDSON INC COM	100.00	4 000.00	0.00
USD	HARMAN INTL INDS INC COM	72.00	5 356.08	0.00
USD	HARRIS CORP COM STK USD1	60.00	5 218.20	0.00
USD	HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01	356.00	14 304.08	0.01
USD	HASBRO INC COM	105.00	7 799.40	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD HCA HLDGS INC COM USDO.01	219.00	15 238.02	0.01
USD HCP INC COM USD1	314.00	11 285.16	0.01
USD HELMERICH & PAYNE INC COM	100.00	5 080.00	0.00
USD HERSHEY CO COM	130.00	11 454.30	0.01
USD HERTZ GLOBAL HOLDI COM STK USDO.01	287.00	2 605.96	0.00
USD HESS CORPORATION COM USD1	153.00	6 502.50	0.01
USD HEWLETT PACKARD EN COM USDO.01	1 477.00	20 323.52	0.02
USD HILTON WORLDWIDE H COM USDO.01	400.00	7 124.00	0.01
USD HOLLYFRONTIER CORP COM USDO.01	88.00	3 077.36	0.00
USD HOLOGIC INC COM USDO.01	195.00	6 618.30	0.01
USD HOME DEPOT INC COM USDO.05	860.00	108 153.60	0.09
USD HONEYWELL INTL INC COM	506.00	52 219.20	0.04
USD HORMEL FOODS CORP COM	98.00	7 880.18	0.01
USD HOST HOTELS & RESO COM STK USDO.01	376.00	5 207.60	0.00
USD HP INC COM USDO.01	977.00	9 486.67	0.01
USD HUMANA INC COM USDO.166	80.00	13 023.20	0.01
USD HUNT J B TRANS SVCS INC COM	100.00	7 270.00	0.01
USD IHS INC COM USDO.01 CLASS 'A'	57.00	5 963.34	0.01
USD ILLINOIS TOOL WKS COM NPV	261.00	23 508.27	0.02
USD ILLUMINA INC COM USDO.01	81.00	12 793.95	0.01
USD IMS HEALTH HOLDING COM USDO.01	300.00	6 936.00	0.01
USD INCYTE CORPORATION COM USDO.001	100.00	7 056.00	0.01
USD INTEL CORP COM USDO.001	3 181.00	98 674.62	0.08
USD INTERCONTINENTAL E COM USDO.01	76.00	20 048.80	0.02
USD INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM	100.00	11 696.00	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP COM USDO.10	400.00	8 976.00	0.01
USD INTL BUSINESS MCHN COM USDO.20	636.00	79 366.44	0.06
USD INTL PAPER CO COM	215.00	7 355.15	0.01
USD INTUIT COM	184.00	17 573.84	0.01
USD INTUITIVE SURGICAL COM USDO.001	13.00	7 031.05	0.01
USD INVESCO LTD COM STK USDO.20	374.00	11 193.82	0.01
USD IONIS PHARMACEUTIC COM USDO.001	100.00	3 893.00	0.00
USD IRON MTN INC NEW COM NPV	115.00	3 167.10	0.00
USD JACOBS ENG GROUP COM USD1	100.00	3 923.00	0.00
USD JARDEN CORP COM	100.00	5 305.00	0.00
USD JOHNSON & JOHNSON COM USD1	1 876.00	195 929.44	0.16
USD JOHNSON CONTROLS COM STK USDO.01388	396.00	14 204.52	0.01
USD JP MORGAN CHASE & COM USD1	2 512.00	149 464.00	0.12
USD JUNIPER NETWORKS INC COM	200.00	4 720.00	0.00
USD KANSAS CITY STHN I COM USDO.01	48.00	3 402.24	0.00
USD KELLOGG CO COM USDO.25	170.00	12 484.80	0.01
USD KEURIG GREEN MTN I COM USDO.1	143.00	12 762.75	0.01
USD KEYCORP NEW COM	400.00	4 464.00	0.00
USD KIMBERLY CLARK CORP COM	253.00	32 490.26	0.03
USD KIMCO REALTY COM USDO.01	300.00	8 157.00	0.01
USD KINDER MORGAN INC USDO.01	1 497.00	24 625.65	0.02
USD KLA-TENCOR CORP COM USDO.001	103.00	6 899.97	0.01
USD KOHLS CORPORATION COM USDO.01	100.00	4 975.00	0.00
USD KRAFT HEINZ CO COM USDO.01	359.00	28 023.54	0.02
USD KROGER CO COM USD1	560.00	21 733.60	0.02
USD L BRANDS INC COM USDO.50	174.00	16 730.10	0.01
USD LAB CORP AMER HLDG COM USDO.1	46.00	5 168.10	0.00
USD LAM RESEARCH CORP COM USDO.001	82.00	5 886.78	0.01
USD LAS VEGAS SANDS CORP COM	227.00	10 237.70	0.01
USD LEAR CORP COM USDO.01	100.00	10 383.00	0.01
USD LEGG MASON INC COM	93.00	2 847.66	0.00
USD LEGGETT & PLATT IN COM USDO.01	100.00	4 151.00	0.00
USD LENNAR CORP COM CL' A' USDO.10	112.00	4 720.80	0.00
USD LEUCADIA NATL CORP COM	100.00	1 656.00	0.00
USD LEVEL 3 COMMUNICAT COM USDO.01(POST REV SPLIT)	200.00	9 762.00	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/為替予約契約/ 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	120.00	4 129.20	0.00
USD	LIBERTY INTERACTIVE CORP COM SER A	300.00	7 818.00	0.01
USD	LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01	169.00	6 188.78	0.01
USD	LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C WHEN ISSU	200.00	7 118.00	0.01
USD	LINCOLN NATL CORP COM NPV	187.00	7 379.02	0.01
USD	LINEAR TECHNOLOGY COM USD0.001	251.00	10 725.23	0.01
USD	LINKEDIN CORP COM USD0.0001	80.00	15 832.80	0.01
USD	LKQ CORP COM	200.00	5 480.00	0.00
USD	LOCKHEED MARTIN CORP COM	150.00	31 650.00	0.03
USD	LOEWS CORP COM	202.00	7 476.02	0.01
USD	LOWE' S COS INC COM USD0.50	659.00	47 223.94	0.04
USD	LYONDELLBASELL IND COM USD0.01	238.00	18 556.86	0.01
USD	M & T BANK CORP COM USD0.50	46.00	5 068.28	0.00
USD	MACERICH CO COM USD0.01	100.00	7 797.00	0.01
USD	MACY' S INC COM STK USD0.01	196.00	7 920.36	0.01
USD	MANPOWER GROUP COM USD0.01	37.00	2 824.95	0.00
USD	MARATHON OIL CORP COM USD1	571.00	5 555.83	0.00
USD	MARATHON PETROLEUM COM USD0.01	312.00	13 038.48	0.01
USD	MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'	206.00	12 623.68	0.01
USD	MARSH & MCLENNAN COM USD1	343.00	18 292.19	0.01
USD	MASCO CORP COM	200.00	5 278.00	0.00
USD	MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'	688.00	61 252.64	0.05
USD	MATTEL INC COM USD1	228.00	6 290.52	0.01
USD	MAXIM INTEGRATED COM USD0.001	291.00	9 719.40	0.01
USD	MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV	100.00	8 797.00	0.01
USD	MCDONALD' S CORP COM USD0.01	641.00	79 342.98	0.06
USD	MCGRAW HILL FINANCIAL INC COM	140.00	11 902.80	0.01
USD	MCKESSON CORP COM USD0.01	125.00	20 122.50	0.02
USD	MEAD JOHNSON NUTRI COM USD0.01	126.00	9 133.74	0.01
USD	MEDIVATION INC COM USD0.01	200.00	6 540.00	0.01
USD	MEDNAX INC COM USD0.01	100.00	6 946.00	0.01
USD	MEDTRONIC PLC USD0.0001	998.00	75 768.16	0.06
USD	MERCK & CO INC COM USD0.50	1 918.00	97 185.06	0.08
USD	METLIFE INC COM USD0.01	677.00	30 228.05	0.02
USD	MGM RESORTS INTL COM	166.00	3 333.28	0.00
USD	MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001	100.00	4 481.00	0.00
USD	MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10	1 051.00	11 592.53	0.01
USD	MICROSOFT CORP COM USD0.0000125	5 186.00	285 696.74	0.23
USD	MOHAWK INDS COM USD0.01	29.00	4 825.89	0.00
USD	MOLSON COORS BREWI COM CLS' B' COM NON-V USD0.01	110.00	9 952.80	0.01
USD	MONDELEZ INTL INC COM USD0.01	1 189.00	51 245.90	0.04
USD	MONSANTO COM STK USD0.01	340.00	30 804.00	0.02
USD	MONSTER BEV CORP USD0.005 (NEW)	50.00	6 751.50	0.01
USD	MOODYS CORP COM USD0.01	168.00	14 975.52	0.01
USD	MORGAN STANLEY COM STK USD0.01	1 034.00	26 759.92	0.02
USD	MOSAIC CO COM USD0.01	251.00	6 049.10	0.00
USD	MOTOROLA SOLUTIONS INCCOM USD0.01	199.00	13 287.23	0.01
USD	MURPHY OIL CORP COM	100.00	1 961.00	0.00
USD	MYLAN NV EURO.01	300.00	15 807.00	0.01
USD	NASDAQ INC COM STK USD0.01	100.00	6 200.00	0.00
USD	NATIONAL OILWELL VARCO INC COM	250.00	8 135.00	0.01
USD	NAVIENT CORP COM USD0.01	303.00	2 896.68	0.00
USD	NETAPP INC COM USD0.001	219.00	4 802.67	0.00
USD	NETFLIX INC COM USD0.001	275.00	25 256.00	0.02
USD	NEW YORK CMNTY BANCORP INC COM	501.00	7 755.48	0.01
USD	NEWELL RUBBERMAID INC COM	200.00	7 756.00	0.01
USD	NEWMONT MINING CORP COM	605.00	12 075.80	0.01
USD	NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL' A'	123.00	1 595.31	0.00
USD	NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01	308.00	34 406.68	0.03
USD	NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07	274.00	13 195.84	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	NIKE INC CLASS' B' COM NPV	906.00	56 181.06	0.05
USD	NOBLE ENERGY INC COM USD0.01	339.00	10 973.43	0.01
USD	NORDSTROM INC COM NPV	100.00	4 910.00	0.00
USD	NORFOLK SOUTHERN CORP COM	170.00	11 985.00	0.01
USD	NORTHERN TRUST CP COM USD1.666	100.00	6 208.00	0.00
USD	NORTHROP GRUMMAN COM USD1	94.00	17 395.64	0.01
USD	NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001	100.00	4 537.00	0.00
USD	NRG ENERGY INC COM NEW	237.00	2 521.68	0.00
USD	NUANCE COMMUNICATI COM USD0.001	329.00	5 800.27	0.00
USD	NUCOR CORP COM	203.00	7 931.21	0.01
USD	NVIDIA CORP COM USD0.001	300.00	8 787.00	0.01
USD	OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20	547.00	37 650.01	0.03
USD	OCEANEERING INTL INC COM	100.00	3 385.00	0.00
USD	OGE ENERGY CORP COM USD0.01	100.00	2 623.00	0.00
USD	OMNICOM GROUP INC COM USD0.15	177.00	12 982.95	0.01
USD	ONEOK INC	82.00	2 042.62	0.00
USD	ORACLE CORP COM USD0.01	2 379.00	86 381.49	0.07
USD	OREILLY AUTO NEW COM USD0.01	70.00	18 263.00	0.01
USD	PACCAR INC COM STK USD1	215.00	10 550.05	0.01
USD	PACKAGING CORP AMER COM	100.00	5 083.00	0.00
USD	PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50	100.00	9 716.00	0.01
USD	PATTERSON COMPANIES INC COM	102.00	4 330.92	0.00
USD	PAYCHEX INC COM	204.00	9 763.44	0.01
USD	PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001	721.00	26 056.94	0.02
USD	PEOPLE' S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01	414.00	5 949.18	0.00
USD	PEPCO HOLDINGS COM USD0.01	200.00	5 336.00	0.00
USD	PEPSICO INC CAP USD0.016666	954.00	94 732.20	0.08
USD	PERRIGO CO LTD COM EURO.001	120.00	17 349.60	0.01
USD	PFIZER INC COM USD0.05	4 174.00	127 265.26	0.10
USD	PG&E CORP COM	343.00	18 834.13	0.02
USD	PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'	1 048.00	94 330.48	0.08
USD	PHILLIPS 66 COM USD0.01	345.00	27 651.75	0.02
USD	PINNACLE WEST CAP CORP COM	139.00	9 217.09	0.01
USD	PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01	75.00	9 296.25	0.01
USD	PLUM CREEK TIMBER COMPANY INC REIT	100.00	4 051.00	0.00
USD	PNC FINL SVCS GROUP INC COM	351.00	30 414.15	0.02
USD	PPG INDS INC COM	183.00	17 406.96	0.01
USD	PPL CORP COM	485.00	17 004.10	0.01
USD	PRAXAIR INC COM USD0.01	189.00	18 900.00	0.02
USD	PRECISION CASTPART COM NPV	93.00	21 850.35	0.02
USD	PRICELINE.COM INC COM USD0.008	32.00	34 079.04	0.03
USD	PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01	195.00	7 410.00	0.01
USD	PROCTER & GAMBLE COM NPV	1 854.00	151 453.26	0.12
USD	PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1	502.00	15 687.50	0.01
USD	PROLOGIS INC COM USD0.01	421.00	16 616.87	0.01
USD	PRUDENTIAL FINL INC COM	336.00	23 546.88	0.02
USD	PUBLIC STORAGE COM USD0.10	63.00	15 974.28	0.01
USD	PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM	393.00	16 230.90	0.01
USD	PULTE GROUP INC USD0.01	160.00	2 681.60	0.00
USD	PVH CORP COM USD1	34.00	2 494.92	0.00
USD	QORVO INC COM USD 0.0001	100.00	3 960.00	0.00
USD	QUALCOMM INC COM USD0.0001	1 112.00	50 418.08	0.04
USD	QUANTA SVCS INC COM	132.00	2 468.40	0.00
USD	QUEST DIAGNOSTICS INC COM	114.00	7 486.38	0.01
USD	QUINTILES TRANSNTL COM USD0.01	100.00	6 083.00	0.00
USD	RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01	27.00	3 037.50	0.00
USD	RANGE RES CORP COM USD0.01	100.00	2 956.00	0.00
USD	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM	100.00	4 381.00	0.00
USD	RAYTHEON CO COM NEW	136.00	17 440.64	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	REALOGY HLDGS CORP COM USDO.01	100.00	3 280.00	0.00
USD	REALTY INCOME CORP	244.00	13 612.76	0.01
USD	RED HAT INC COM	100.00	7 005.00	0.01
USD	REGENCY CENTERS COM USDO.01	103.00	7 456.17	0.01
USD	REGENERON PHARMACEUTICALS COM	46.00	19 324.14	0.02
USD	REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM	500.00	4 060.00	0.00
USD	REPUBLIC SERVICES COM USDO.01	200.00	8 740.00	0.01
USD	RESMED INC COM USDO.004	100.00	5 670.00	0.00
USD	REYNOLDS AMERICAN COM USDO.0001	607.00	30 319.65	0.02
USD	RITE AID CORP COM	800.00	6 232.00	0.01
USD	ROBERT HALF INTL INC COM	100.00	4 377.00	0.00
USD	ROCKWELL AUTOMATION INC COM	124.00	11 850.68	0.01
USD	ROCKWELL COLLINS INC COM	100.00	8 088.00	0.01
USD	ROPER TECHNOLOGIES COM USDO.01	100.00	17 567.00	0.01
USD	ROSS STORES INC COM USDO.01	296.00	16 652.96	0.01
USD	ROYAL CARIBBEAN COM USDO.01	86.00	7 048.56	0.01
USD	SABRE CORP COM USDO.01	200.00	5 122.00	0.00
USD	SALESFORCE.COM INC COM USDO.001	434.00	29 538.04	0.02
USD	SANDISK CORP COM USDO.001	183.00	12 938.10	0.01
USD	SBA COMMUNICATIONS COM USDO.01	54.00	5 361.12	0.00
USD	SCANA CORP NEW COM	100.00	6 295.00	0.01
USD	SCHEIN HENRY INC COM	100.00	15 144.00	0.01
USD	SCHLUMBERGER COM USDO.01	929.00	67 138.83	0.05
USD	SCHWAB CHARLES CORP NEW COM	789.00	20 143.17	0.02
USD	SCRIPPS NETWORKS I COM USDO.01 CL A	57.00	3 475.29	0.00
USD	SEALED AIR CORP NEW COM	128.00	5 187.84	0.00
USD	SEI INVESTMENT COM USDO.01	120.00	4 708.80	0.00
USD	SEMPRA ENERGY COM	170.00	16 107.50	0.01
USD	SERVICENOW INC COM USDO.001	100.00	6 221.00	0.00
USD	SHERWIN-WILLIAMS COM USD1	64.00	16 362.88	0.01
USD	SIMON PROP GROUP COM USDO.0001	190.00	35 393.20	0.03
USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC COM	100.00	6 892.00	0.01
USD	SMUCKER(JM)CO COM NPV	94.00	12 062.08	0.01
USD	SOUTHERN CO COM	635.00	31 064.20	0.02
USD	SOUTHWEST AIRLINES COM USD1	100.00	3 762.00	0.00
USD	SPECTRA ENERGY COR COM USDO.001	603.00	16 552.35	0.01
USD	SPLUNK INC COM USDO.001	100.00	4 629.00	0.00
USD	SPRINT CORPORATION COM USDO.01	307.00	927.14	0.00
USD	ST JUDE MED INC COM	220.00	11 629.20	0.01
USD	STANLEY BLACK & DE COM USD2.50	126.00	11 886.84	0.01
USD	STAPLES INC COM STK USDO.0006	300.00	2 676.00	0.00
USD	STARBUCKS CORP COM USDO.001	998.00	60 648.46	0.05
USD	STARWOOD HTLS WRLD COM STK USDO.01	100.00	6 224.00	0.00
USD	STATE STREET CORP COM STK USD1	292.00	16 273.16	0.01
USD	STERICYCLE INC COM	61.00	7 341.35	0.01
USD	STHWESTN ENERGY CO COM USDO.01	194.00	1 724.66	0.00
USD	STRYKER CORP COM USDO.10	241.00	23 895.15	0.02
USD	SUNTRUST BKS INC COM	311.00	11 376.38	0.01
USD	SYMANTEC CORP COM	436.00	8 650.24	0.01
USD	SYNCHRONY FINANCIA COM USDO.001	600.00	17 052.00	0.01
USD	SYNOPSIS INC COM USDO.01	200.00	8 580.00	0.01
USD	SYSCO CORP COM	448.00	17 834.88	0.01
USD	T ROWE PRICE GROUP COM USDO.20	186.00	13 196.70	0.01
USD	T-MOBILE US INC COM USDO.0001	255.00	10 238.25	0.01
USD	TARGET CORP COM STK USDO.0833	423.00	30 633.66	0.02
USD	TD AMERITRADE HLDG COM USDO.01	300.00	8 274.00	0.01
USD	TEGNA INC COM USD1	300.00	7 203.00	0.01
USD	TERADATA CORP COM STK USDO.01 'WI'	100.00	2 434.00	0.00
USD	TESLA MOTORS INC COM USDO.001	58.00	11 089.60	0.01
USD	TESORO CORP COM	80.00	6 980.00	0.01
USD	TEXAS INSTRUMENTS COM USD1	734.00	38 850.62	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
USD	THERMO FISHER SCIE COM USD1	276.00	36 448.56	0.03
CAD	THOMSON-REUTERS CO COM NPV	231.00	8 601.46	0.01
USD	TIFFANY & CO NEW COM	129.00	8 235.36	0.01
USD	TIME WARNER CABLE USDO.01	171.00	31 123.71	0.02
USD	TIME WARNER INC COM USDO.01	589.00	41 489.16	0.03
USD	TJX COS INC COM USD1	429.00	30 561.96	0.02
USD	TOLL BROS INC COM USDO.01	115.00	3 176.30	0.00
USD	TORCHMARK CORP COM	82.00	4 455.88	0.00
USD	TOTAL SYSTEM SVCS COM STK USDO.10	132.00	5 301.12	0.00
USD	TRACTOR SUPPLY CO COM	100.00	8 831.00	0.01
USD	TRAVELERS CO INC COM NPV	223.00	23 869.92	0.02
USD	TRIMBLE NAVIGATION LTD COM	100.00	1 929.00	0.00
USD	TRIPADVISOR INC COM USDO.001	51.00	3 404.76	0.00
USD	TWENTY-FIRST CENTU COM USDO.01 CL' A'	763.00	20 578.11	0.02
USD	TWENTY-FIRST CENTU COM USDO.01 CL' B'	370.00	10 027.00	0.01
USD	TWITTER INC COM USDO.000005	500.00	8 400.00	0.01
USD	TYCO INTL PLC EUR1.00	386.00	13 274.54	0.01
USD	TYSON FOODS INC CL A	252.00	13 446.72	0.01
USD	UDR INC	175.00	6 228.25	0.01
USD	UNDER ARMOUR INC COM STK USDO.000333 CL A	200.00	17 086.00	0.01
USD	UNION PACIFIC CORP COM USD2.50	619.00	44 568.00	0.04
USD	UNITED CONTINENTAL COM USDO.01	115.00	5 552.20	0.00
USD	UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	435.00	40 542.00	0.03
USD	UNITED RENTALS INC COM	100.00	4 791.00	0.00
USD	UNITEDHEALTH GRP COM USDO.01	644.00	74 163.04	0.06
USD	UNIVERSAL HEALTH S CLASS' B' COM USDO.01	100.00	11 264.00	0.01
USD	UNUM GROUP COM USDO.10	309.00	8 849.76	0.01
USD	US BANCORP COM USDO.01	1 187.00	47 551.22	0.04
USD	UTD TECHNOLOGIES COM USD1	588.00	51 561.72	0.04
USD	VALERO ENERGY CORP NEW COM	361.00	24 501.07	0.02
USD	VANTIV INC COM USDO.00001 A	100.00	4 705.00	0.00
USD	VARIAN MEDICAL SYS COM USD1	44.00	3 393.72	0.00
USD	VENTAS INC COM USDO.25	262.00	14 493.84	0.01
USD	VEREIT INC COM USDO.001	218.00	1 680.78	0.00
USD	VERISIGN INC COM	100.00	7 560.00	0.01
USD	VERISK ANALYTICS I CL A USDO.001	100.00	7 300.00	0.01
USD	VERIZON COMMUN COM USDO.10	2 752.00	137 517.44	0.11
USD	VERTEX PHARMACEUTI COM USDO.01	156.00	14 157.00	0.01
USD	VF CORP COM NPV	220.00	13 772.00	0.01
USD	VIACOM INC NEW CL' B' NON-VTG USDO.001	210.00	9 584.40	0.01
USD	VISA INC COM STK USDO.0001	1 335.00	99 444.15	0.08
USD	VMWARE INC COM STK USDO.01 CLASS 'A'	43.00	1 967.25	0.00
USD	VOYA FINL INC COM USDO.01	200.00	6 116.00	0.00
USD	VULCAN MATLS CO COM	71.00	6 262.20	0.01
USD	WABTEC CORP COM	100.00	6 395.00	0.01
USD	WAL-MART STORES IN COM USDO.10	1 101.00	73 062.36	0.06
USD	WALGREENS BOOTS AL COM USDO.01	558.00	44 483.76	0.04
USD	WALT DISNEY CO.DISNEY COM USDO.01	1 105.00	105 881.10	0.09
USD	WASTE MGMT INC DEL COM	335.00	17 738.25	0.01
USD	WATERS CORP COM	40.00	4 848.40	0.00
USD	WEC ENERGY GROUP COM USDO.01	235.00	12 979.05	0.01
USD	WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3	3 306.00	166 060.38	0.13
USD	WELLTOWER INC COM USD1	303.00	18 852.66	0.02
USD	WESTERN DIGITAL CORP COM	219.00	10 507.62	0.01
USD	WESTERN UN CO COM	523.00	9 330.32	0.01
USD	WESTROCK CO COM USDO.01	178.00	6 279.84	0.01
USD	WEYERHAEUSER CO COM USD1.25	488.00	12 497.68	0.01
USD	WHIRLPOOL CORP COM	29.00	3 897.31	0.00
USD	WHITEWAVE FOODS CO COM USDO.01 CL' A'	200.00	7 550.00	0.01
USD	WHITING PETROLEUM COM USDO.001	69.00	507.15	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD WHOLE FOODS MKT INC COM	205.00	6 008.55	0.00
USD WILLIAMS COS INC COM USD1	438.00	8 453.40	0.01
USD WORKDAY INC COM USD0.001	100.00	6 301.00	0.01
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP COM	132.00	8 566.80	0.01
USD WYNN RESORTS LTD COM	82.00	5 521.88	0.00
USD XCEL ENERGY INC COM	305.00	11 657.10	0.01
USD XEROX CORP COM	700.00	6 825.00	0.01
USD XILINX INC COM USD0.01	178.00	8 948.06	0.01
USD XYLEM INC COM USD0.01 WI	100.00	3 595.00	0.00
USD YAHOO INC COM STK USD0.001	697.00	20 568.47	0.02
USD YUM BRANDS INC COM	298.00	21 566.26	0.02
USD ZIMMER HLDGS INC COM USD0.01	99.00	9 826.74	0.01
USD ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'	407.00	17 521.35	0.01
アメリカ合衆国合計		11 893 368.48	9.53
無記名株合計		19 129 855.11	15.33
参加証書			
スイス			
CHF SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10 (POST-SUBD)	41.00	6 258.14	0.01
スイス合計		6 258.14	0.01
参加証書合計		6 258.14	0.01
その他の株式			
オランダ			
EUR ING GROEP NV CVA EURO.24	2 945.00	33 762.43	0.03
EUR UNILEVER NV CVA EURO.16	1 188.00	52 563.09	0.04
オランダ合計		86 325.52	0.07
スイス			
CHF ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV	471.00	121 306.69	0.10
スイス合計		121 306.69	0.10
アメリカ合衆国			
USD CAMDEN PROP TST SBI USD0.01	69.00	5 264.70	0.00
アメリカ合衆国合計		5 264.70	0.00
その他の株式合計		212 896.91	0.17
優先株式			
ドイツ			
EUR HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV	114.00	12 060.29	0.01
EUR PORSCHE AUTO HL SE NON VTG PRF NPV	63.00	2 848.79	0.00
EUR VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV	148.00	17 119.33	0.01
ドイツ合計		32 028.41	0.02
優先株式合計		32 028.41	0.02
記名株式			
フランス			
EUR MICHELIN (CGDE) EUR2 (REGD)	112.00	10 187.20	0.01
フランス合計		10 187.20	0.01
ドイツ			
EUR ADIDAS AG NPV (REGD)	126.00	12 949.41	0.01
EUR ALLIANZ SE NPV (REGD) (VINKULIERT)	325.00	52 275.19	0.04
EUR BASF SE NPV	674.00	44 560.33	0.04
EUR BAYER AG NPV (REGD)	575.00	64 333.28	0.05

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR BRENNTAG AG	72.00	3 502.34	0.00
EUR DAIMLER AG ORD NPV (REGD)	696.00	48 319.33	0.04
EUR DEUTSCHE BANK AG NPV (REGD)	913.00	16 201.75	0.01
EUR DEUTSCHE BOERSE AG NPV (REGD)	121.00	10 292.25	0.01
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD) (VINK)	203.00	2 957.68	0.00
EUR DEUTSCHE POST AG NPV (REGD)	735.00	17 759.20	0.01
EUR DEUTSCHE TELEKOM NPV (REGD)	2 311.00	40 047.40	0.03
EUR E. ON SE NPV	1 533.00	15 634.04	0.01
EUR HANNOVER RUECKVERS ORD NPV (REGD)	26.00	2 717.68	0.00
EUR INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)	1 043.00	13 858.94	0.01
EUR K&S AG NPV	95.00	1 995.25	0.00
EUR MUENCHENER RUECKVE NPV (REGD)	117.00	22 389.18	0.02
EUR OSRAM LICHT AG NPV	26.00	1 154.87	0.00
EUR PROSIEBENSAT1 MED. NPV	215.00	10 679.38	0.01
EUR SIEMENS AG NPV (REGD)	574.00	54 768.31	0.04
GBP TUI AG NPV (REGD)	341.00	5 736.78	0.01
EUR UNITED INTERNET AG NPV (REGD)	97.00	4 981.88	0.00
EUR VONOVIA SE NPV	287.00	8 698.46	0.01
ドイツ合計		455 812.93	0.35
イスラエル			
ILS MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01	237.00	2 645.22	0.00
イスラエル合計		2 645.22	0.00
ルクセンブルグ			
EUR ARCELORMITTAL NPV	606.00	2 281.25	0.00
EUR TENARIS S. A. USD1	198.00	2 031.05	0.00
ルクセンブルグ合計		4 312.30	0.00
オランダ			
USD CHICAGO BRIDGE & I EURO.01 (REG)	100.00	3 882.00	0.00
EUR QIAGEN NV COM EURO.01	278.00	6 292.94	0.01
オランダ合計		10 174.94	0.01
ポルトガル			
EUR EDP ENERGIAS PORTU EUR1 (REGD)	1 538.00	5 353.71	0.00
ポルトガル合計		5 353.71	0.00
スペイン			
EUR BANCO SANTANDER SA EURO.50 (REGD)	10 374.00	44 171.11	0.04
EUR BANKINTER SA EURO.3 (REGD)	926.00	6 422.68	0.01
EUR BBVA (BILB-VIZ-ARG) EURO.49	4 108.00	26 208.08	0.02
スペイン合計		76 801.87	0.07
スイス			
CHF ABB LTD CHF1.03 (REGD)	1 475.00	25 292.29	0.02
CHF ACTELION CHF0.50 (REGD)	96.00	12 563.90	0.01
CHF ADECCO SA CHF1 (REGD)	91.00	5 550.68	0.00
CHF ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)	50.00	2 278.83	0.00
CHF BALOISE-HLDGS CHF0.1 (REGD)	50.00	6 099.64	0.01
USD CHUBB LIMITED ORD CHF24.15	298.68	33 772.09	0.03
CHF CREDIT SUISSE GRP CHF0.04 (REGD)	1 279.00	22 468.16	0.02
CHF DUFY AG CHF5 (REGD)	57.00	6 152.54	0.01
CHF GALENICA AG CHF0.10 (REGD)	4.00	5 562.88	0.00
USD GARMIN LTD COM CHF10.00	100.00	3 518.00	0.00
CHF GEBERIT CHF0.10 (REGD)	38.00	13 417.65	0.01
CHF GIVAUDAN AG CHF10	6.00	11 166.74	0.01
CHF JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)	155.00	6 542.48	0.01
CHF KUEHNE&NAGEL INTL CHF1 (REGD) (POST-SUBD)	41.00	5 401.84	0.00
CHF LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	150.00	6 283.12	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
EUR LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)	160.00	6 745.07	0.01
CHF LONZA GROUP AG CHF1 (REGD)	50.00	7 626.99	0.01
CHF NESTLE SA CHF0.10 (REGD)	2 145.00	157 423.51	0.13
CHF NOVARTIS AG CHF0.50 (REGD)	1 556.00	119 207.53	0.10
CHF PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)	18.00	6 469.04	0.01
CHF RICHEMONT (CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'	345.00	22 306.40	0.02
CHF SGS LTD CHF1 (REGD)	3.00	5 805.88	0.01
CHF SONOVA HOLDING AG	51.00	6 102.18	0.01
CHF SWATCH GROUP CHF0.45 (REGD)	49.00	3 244.67	0.00
CHF SWISS LIFE HLDG CHF5.1 (REGD)	29.00	7 347.29	0.01
CHF SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)	54.00	4 310.94	0.00
CHF SWISSCOM AG CHF1 (REGD)	15.00	7 429.37	0.01
CHF SYNGENTA CHF0.1 (REGD)	68.00	24 946.27	0.02
USD TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57	283.00	16 176.28	0.01
USD TRANSOCEAN LTD COM CHF15	177.00	1 844.34	0.00
CHF UBS GROUP CHF0.10 (REGD)	2 550.00	41 884.06	0.03
CHF ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10	110.00	24 240.47	0.02
スイス合計		629 181.13	0.54
アメリカ合衆国			
USD CAMERON INTL CORP COM USD0.01	103.00	6 762.98	0.01
アメリカ合衆国合計		6 762.98	0.01
記名株式合計		1 201 232.28	0.99
預託証券			
アイルランド			
AUD JAMES HARDIE ID PLC CUPS EURO.5	330.00	3 732.47	0.00
アイルランド合計		3 732.47	0.00
ルクセンブルグ			
SEK MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50	58.00	2 548.63	0.00
EUR SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV	228.00	5 937.01	0.01
ルクセンブルグ合計		8 485.64	0.01
預託証券合計		12 218.11	0.01
投資証券、クローズド・エンド型			
カナダ			
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	139.00	2 443.67	0.00
カナダ合計		2 443.67	0.00
日本			
JPY ユナイテッド・アーバン投資法人	5.00	6 793.87	0.01
日本合計		6 793.87	0.01
アメリカ合衆国			
USD AMERICAN CAPITAL A COM STK USD0.01	200.00	3 414.00	0.00
USD LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001	119.00	3 489.08	0.00
USD SL GREEN REALTY CORPORATION	45.00	4 347.45	0.00
USD VORNADO REALTY TRUST-SBI	111.00	9 819.06	0.01
アメリカ合衆国合計		21 069.59	0.01
投資証券、クローズド・エンド型合計		30 307.13	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
新株引受権			
イタリア			
EUR SAIPEM SPA RIGHTS 11.02.16	167.00	524.04	0.00
イタリア合計		524.04	0.00
スペイン			
EUR ACS ACTIVIDADES (STOCK DIVIDEND) OPTION RIGHTS 29.01.16	136.00	60.34	0.00
EUR IBERDROLA SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 26.01.16	3 600.00	498.61	0.00
スペイン合計		558.95	0.00
新株引受権合計		1 082.99	0.00
固定利付ノート			
豪ドル			
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 4.00000% 13-20.04.23	80 000.00	61 695.64	0.05
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 10-21.04.16	50 000.00	35 664.94	0.03
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.50000% 13-17.11.17	60 000.00	43 516.03	0.04
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 09-15.06.20	30 000.00	24 530.48	0.02
豪ドル合計		165 407.09	0.14
英ポンド			
GBP EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.00000% 98-07.12.28	30 000.00	60 368.52	0.05
英ポンド合計		60 368.52	0.05
米ドル			
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 10-14.07.20	100 000.00	109 000.00	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 13-15.03.18	500 000.00	498 940.00	0.40
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO-144A 0.96400% 15-15.04.16	457 000.00	457 211.59	0.37
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 13-15.03.18	150 000.00	149 802.60	0.12
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 14-15.10.19	250 000.00	255 029.50	0.21
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.50000% 08-16.07.18	750 000.00	810 948.00	0.65
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 12-12.09.17	200 000.00	199 892.40	0.16
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.40000% 12-21.09.22	50 000.00	50 415.70	0.04
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 2.50000% 15-28.04.20	300 000.00	297 804.00	0.24
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	200 000.00	208 965.80	0.17
米ドル合計		3 038 009.59	2.45
固定利付ノート合計		3 263 785.20	2.64
固定利付メディアム・ターム・ノート			
カナダ・ドル			
CAD CAISSE D' AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 4.45000% 06-26.10.18	30 000.00	23 133.21	0.02
カナダ・ドル合計		23 133.21	0.02
英ポンド			
GBP GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 6.25000% 02-15.12.17	10 000.00	15 478.10	0.01
GBP KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.00000% 00-07.12.28	50 000.00	102 451.16	0.08
英ポンド合計		117 929.26	0.09
米ドル			
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.50000% 06-27.06.16	200 000.00	203 908.40	0.16
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.50000% 11-16.05.16	500 000.00	502 405.00	0.40
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 1.00000% 12-24.10.17	350 000.00	349 863.50	0.28
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.37500% 12-21.06.17	200 000.00	200 784.00	0.16
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.00000% 14-30.09.19	200 000.00	202 304.00	0.16

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
USD SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 0.62500% 14-19.09.16	250 000.00	249 965.00	0.20
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.50000% 15-14.12.20	145 000.00	146 126.36	0.12
米ドル合計		1 855 356.26	1.48
固定利付メディアム・ターム・ノート合計		1 996 418.73	1.59
固定利付債券			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA 4.25000% 11-21.07.17	200 000.00	146 294.13	0.12
AUD AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27	460 000.00	389 393.20	0.31
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 11-21.07.22	40 000.00	33 748.51	0.03
AUD QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23	80 000.00	61 663.94	0.05
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.750000% 04-15.11.16	20 000.00	14 546.37	0.01
AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 03-17.10.22	60 000.00	51 376.53	0.04
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 7.000000% 01-15.10.19	30 000.00	24 729.95	0.02
豪ドル合計		721 752.63	0.58
カナダ・ドル			
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.09.17	50 000.00	36 129.65	0.03
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 12-01.06.23	440 000.00	323 671.64	0.26
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.75000% 08-01.06.19	130 000.00	102 382.69	0.08
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.25000% 10-01.06.21	200 000.00	161 006.40	0.13
CAD CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 01-01.06.33	280 000.00	313 029.27	0.25
CAD EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.12500% 14-04.02.19	40 000.00	29 418.51	0.02
カナダ・ドル合計		965 638.16	0.77
ユーロ			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 2.00000% 13-15.08.23	300 000.00	374 427.17	0.30
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 6.50000% 97-04.07.27	200 000.00	363 509.29	0.29
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37	100 000.00	171 127.18	0.14
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 07-04.01.18	200 000.00	235 170.36	0.19
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 08-04.07.40	90 000.00	177 434.56	0.14
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19	250 000.00	307 112.84	0.25
EUR GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 09-04.01.20	250 000.00	309 479.82	0.25
ユーロ合計		1 938 261.22	1.56
英ポンド			
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.75000% 07-07.12.30	200 000.00	386 569.62	0.31
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19	20 000.00	31 822.63	0.03
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.75000% 11-07.09.21	80 000.00	130 286.39	0.11
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 10-07.12.40	90 000.00	174 147.83	0.14
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 2.75000% 14-07.09.24	50 000.00	78 194.81	0.06
英ポンド合計		801 021.28	0.65
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23	500 000.00	668 080.00	0.54
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPEMENT-REG-S 1.62500% 12-04.10.17	950 000.00	958 616.50	0.77
USD BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21	100 000.00	103 857.00	0.08
USD BANK OF NOVA SCOTIA 1.85000% 15-14.04.20	250 000.00	248 870.75	0.20
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 1.00000% 13-15.06.18	500 000.00	498 715.50	0.40
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 10-14.02.20	200 000.00	220 355.00	0.18
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 1.75000% 13-04.09.18	50 000.00	50 595.60	0.04
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT 2.50000% 15-29.07.25	200 000.00	207 139.20	0.17
USD ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23	300 000.00	375 702.00	0.30
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.10000% 12-25.10.17	50 000.00	49 971.35	0.04
米ドル合計		3 381 902.90	2.72
固定利付債券合計		7 808 576.19	6.28

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
固定利付米国中期国債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30	100 000.00	149 816.40	0.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	170 000.00	238 843.37	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38	180 000.00	237 339.90	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 11-15.05.41	400 000.00	528 109.20	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 08-15.05.18	850 000.00	908 470.65	0.73
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 09-15.02.19	600 000.00	631 265.40	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 10-15.02.20	850 000.00	930 384.50	0.75
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.09.18	550 000.00	556 466.90	0.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 13-15.05.23	950 000.00	952 671.40	0.77
米ドル合計		5 133 367.72	4.13
固定利付米国中期国債合計		5 133 367.72	4.13
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		38 828 026.92	31.19
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			
固定利付ノート			
豪ドル			
AUD NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 6.00000% 11-01.02.18	70 000.00	53 390.50	0.04
AUD WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25	40 000.00	32 403.42	0.03
豪ドル合計		85 793.92	0.07
米ドル			
USD BANK OF NEW YORK MELLON CO 1.30000% 12-25.01.18	350 000.00	349 246.10	0.28
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	100 000.00	101 794.00	0.08
USD HEINEKEN NV-REG-S 1.40000% 12-01.10.17	50 000.00	49 962.80	0.04
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.25000% 12-05.10.17	150 000.00	149 514.15	0.12
米ドル合計		650 517.05	0.52
固定利付ノート合計		736 310.97	0.59
固定利付ミディアム・ターム・ノート			
米ドル			
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.50000% 13-16.01.18	200 000.00	200 224.80	0.16
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.37500% 13-10.01.18	400 000.00	400 622.80	0.32
米ドル合計		600 847.60	0.48
固定利付ミディアム・ターム・ノート合計		600 847.60	0.48
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		1 337 158.57	1.07
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場で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			
無記名株			
カナダ			
CAD TELUS CORPORATION COM NPV	119.00	3 424.76	0.00
カナダ合計		3 424.76	0.00
無記名株合計		3 424.76	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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)
株式に係るストリップ			
ベルギー			
EUR ANHEUSER-BUSCH INBEV STRIP	1 080.00	1.17	0.00
ベルギー合計		1.17	0.00
株式に係るストリップ合計			
		1.17	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場で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			
		3 425.93	0.00
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
固定利付債券			
米ドル			
USD UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD-REG-S 2.95000% 15-24.09.20	200 000.00	199 221.40	0.16
米ドル合計		199 221.40	0.16
固定利付債券合計			
		199 221.40	0.16
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		199 221.40	0.16
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			
投資証券、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) INVESTOR SELECTION PLC - GLOB EMER MKT OPP-I-X USD	66 954.00	8 894 169.36	7.14
アイルランド合計		8 894 169.36	7.14
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	32 864.00	3 729 228.71	2.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV-SHORT TERM USD CORPORATES (USD) U-X-ACC	120.00	1 230 913.20	0.99
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD CORPORATES U-X-ACC	185.00	2 304 450.65	1.85
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	437.00	6 209 835.55	4.99
USD UBS (LUX) EMERGING ECONOMIES FUND-GLOBAL BONDS (USD)-U-X ACC	367.00	3 754 967.84	3.02
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA GRWTH (USD)-U-X-ACC	46.00	1 059 117.34	0.85
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - EM GROWTH (USD)-U-X-ACC	132.00	2 220 843.24	1.78
USD UBS (LUX) EQUITY SICAV - USA ENHANCED (USD) U-X-ACC	259.00	3 993 831.80	3.21
USD UBS (LUX) INST FUND-KEY SEL. GLOBAL EQUITY FA-USD	1 353.00	21 767 456.37	17.48
USD UBS (LUX) KEY SELECTION SICAV 2 - GLOBAL QUANTITATIVE I-X-ACC	15.09	21 547 325.63	17.30
USD UBS (LUX) MONEY MARKET FUND - USD U-X-ACC	248.00	2 570 611.76	2.06
ルクセンブルグ合計		70 388 582.09	56.52
投資証券、オープン・エンド型合計			
		79 282 751.45	63.66
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			
		79 282 751.45	63.66
投資有価証券合計			
		119 650 584.27	96.08

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/為替予約契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 割合 (%)	
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				
EUR	EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.03.16	73.00	-87 133.16	-0.07
USD	S&P500 EMINI FUTURE 18.03.16	5.00	13 896.42	0.01
GBP	FTSE 100 INDEX FUTURE 18.03.16	1.00	4 712.88	0.01
JPY	NIKKEI 225 (SGX) INDEX FUTURE 10.03.16	-2.00	-9 375.49	-0.01
指数に係る金融先物合計			-77 899.35	-0.06
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計			-77 899.35	-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				
クレジット・デフォルト・スワップ*				
USD	CME/CDX.NA.IG.25 DEC20 CDI REC 1.00000% 15-20.12.20	700 000.00	231.33	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計			231.33	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品合計			231.33	0.00
派生商品合計			-77 668.02	-0.06

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／為替予約契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 割合 (%)
為替予約契約						
為替予約契約（購入／売却）						
USD	3 047 253.21	JPY	358 410 000.00	14. 4. 2016	81 416.45	0.07
USD	1 125 830.13	AUD	1 636 067.11	14. 4. 2016	-27 497.56	-0.02
USD	410 631.37	CHF	412 000.00	14. 4. 2016	7 273.71	0.01
NOK	4 520 395.18	USD	510 279.39	14. 4. 2016	7 299.07	0.01
USD	483 885.34	HKD	3 780 000.00	14. 4. 2016	-1 800.70	0.00
ZAR	1 110 000.00	USD	65 738.02	14. 4. 2016	3 091.37	0.00
USD	3 121 692.42	GBP	2 180 000.00	14. 4. 2016	28 837.80	0.02
USD	361 959.80	DKK	2 475 000.00	14. 4. 2016	2 312.32	0.00
USD	232 703.85	SGD	335 000.00	14. 4. 2016	-2 305.20	0.00
USD	403 012.00	SEK	3 437 000.00	14. 4. 2016	1 230.65	0.00
USD	7 715 387.94	EUR	7 079 000.00	14. 4. 2016	40 378.99	0.03
USD	115 773.43	MXN	2 120 000.00	14. 4. 2016	-326.74	0.00
USD	1 531 583.57	CAD	2 222 000.00	14. 4. 2016	-47 483.02	-0.04
USD	913 766.89	JPY	106 680 000.00	14. 4. 2016	30 991.67	0.02
USD	72 024.13	JPY	8 500 000.00	14. 4. 2016	1 686.77	0.00
ZAR	1 110 000.00	USD	67 414.02	25. 2. 2016	2 088.03	0.00
USD	227 434.64	SGD	325 000.00	25. 2. 2016	-818.54	0.00
USD	2 947 814.68	GBP	2 060 000.00	25. 2. 2016	25 637.74	0.02
USD	1 028 207.22	AUD	1 463 925.66	25. 2. 2016	-6 140.22	0.00
USD	402 474.97	SEK	3 430 000.00	25. 2. 2016	2 194.77	0.00
USD	805 363.90	CHF	817 388.79	25. 2. 2016	6 906.54	0.01
USD	4 006 646.30	JPY	473 590 000.00	25. 2. 2016	93 170.42	0.07
USD	483 129.60	HKD	3 765 000.00	25. 2. 2016	-664.11	0.00
USD	360 897.81	DKK	2 475 000.00	25. 2. 2016	1 813.80	0.00
NOK	4 987 208.34	USD	572 323.00	25. 2. 2016	-1 042.47	0.00
USD	7 752 785.49	EUR	7 126 770.01	25. 2. 2016	36 988.32	0.03
USD	1 424 021.81	CAD	2 009 000.00	25. 2. 2016	-3 583.96	0.00
USD	115 993.21	MXN	2 120 000.00	25. 2. 2016	-508.79	0.00
USD	185 765.11	CAD	260 000.00	25. 2. 2016	1 007.77	0.00
USD	178 622.85	CAD	250 000.00	14. 4. 2016	960.09	0.00
為替予約契約（購入／売却）合計					283 114.97	0.23
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					4 954 876.00	3.98
その他の資産および負債					-275 629.09	-0.23
純資産合計					124 535 278.13	100.00

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

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

2016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グローバル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) 為替予約契約の評価

未決済の為替予約契約に係る未実現（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2016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2016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 = 1.108723 スイス・フラン

1 ユーロ = 1.082050 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・バック証券の所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%

U B S (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%

ファンドは、上記の報酬から、ファンド資産の管理事務代行、ポートフォリオ管理および保管業務ならびに以下を含む販売業務に関連して生じる一切の費用を負担する。

- ・ ルクセンブルグ内外でのファンドの承認および監督に係る年間手数料および費用
- ・ 監督官庁によるその他の請求額
- ・ 約款、目論見書、年次報告書および半期報告書の印刷費
- ・ ファンドを販売している国への主要な投資家向け資料 (K I I D) または類似書類の作成
- ・ 投資家に対する価格および通知の公告
- ・ ルクセンブルグ内外でのファンドの上場および受益証券の販売に関連して発生する手数料
- ・ ファンド資産の安全保管、支払の取扱および2010年12月17日法 (改訂済) に基づき要求されるその他の業務に係る保管受託銀行の手数料および費用
- ・ 投資家に対する分配金支払のためのその他の費用および手数料
- ・ 監査報酬

2015年4月1日以降、上記の各規定は以下に置き換わる。

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、2016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・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0.23%)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

サブ・ファンドは、関連取引に関しサブ・ファンドが支出する平均的な報酬 (仲介手数料、証券取引所報酬/手数料等) を、純資産価額ベースで、投資家に対して請求することができる。かかる収益はサブ・ファンドにとって有利となり、運用計算書において「その他の収益」として計上される。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

2016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)	16,029,723.76米ドル	6,623,225.38米ドル
－グロース (米ドル)	2,959,540.90米ドル	146,161.15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	3,500,000.00米ドル
－グロース (米ドル)	－米ドル	700,000.00米ドル

注7. ソフト・コミッション・アレンジメント

2015年2月1日から2016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 (S FAMA) 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	0.95%
－イールド (米ドル) クラスP-a c c 受益証券	1.49%
－イールド (米ドル) クラスP-d i s t 受益証券	1.48%
－イールド (米ドル) クラスQ-a c c 受益証券	0.89%
－イールド (米ドル) クラスQ-d i s t 受益証券	0.94%
－グロース (米ドル) クラスF-a c c 受益証券	0.61%
－グロース (米ドル) クラスP-a c c 受益証券	1.87%
－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。

2016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。

U B S (Lux) ストラテジー・ファンド	取引費用
－イーールド (米ドル)	27,135.42米ドル
－グロース (米ドル)	10,573.19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、為替予約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

U B S グローバル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
BE0005582532	ANHEUSER-BUSCH INBEV STRIP
IE00B06H8J93	IRISH BK RESOL CP COM EURO.16
PTBES0AM0007	BCO ESPIRITO SANTO EUR
BE0005628020	ENGINE VVPR STRIP
AT0000A0GYT7	IMMOEAST AG RIGHTS PRP

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／保管人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、OTC取引の枠組みにおいて債務の履行をファンドが強いら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*

サブ・ファンド 取引相手方	時価	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	1,156.64米ドル	ー米ドル
ユービーエス・エイ・ジー	779,236.98米ドル	ー米ドル
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	231.33米ドル	ー米ドル
ユービーエス・エイ・ジー	283,114.97米ドル	ー米ドル

*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

	2016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		2016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・ 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)	112,516,848.87米ドル	118,258,327.13米ドル	45.55	54.45	0.00
ーグロース (米ドル)	11,956,127.47米ドル	12,566,221.40米ドル	45.55	54.45	0.00

(3) 投資有価証券明細表等

「(2) 損益計算書」の「2016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

該当事項はありません。